

# Halbjahresbericht (ungeprüft)

Franklin Templeton  
Global Funds Plc  
Ein Dachfonds mit getrennter  
Haftung zwischen den Teilfonds  
Für das Halbjahr zum 31. August 2023



# Inhaltsverzeichnis

Allgemeine Informationen	3
Brief an die Anteilsinhaber	16
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	17
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Core Bond Fund	18
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	28
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	45
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	48
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US High Yield Fund	53
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Global High Yield Fund	57
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	60
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	62
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>	66
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Global Credit Fund <sup>^</sup>	71
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	75
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>	83
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>	92
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund <sup>^</sup>	96
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund <sup>^</sup>	104
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund	107
Anlagenportfolio – Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	113
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	118
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	120
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund <sup>^</sup>	124
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global High Yield Fund <sup>^</sup>	127
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	129
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	132
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>	136
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup>	138
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund <sup>^</sup>	140
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Value Fund	142
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	144
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	146
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	148
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	150
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	152
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Global Growth Fund <sup>^</sup>	154
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup>	155
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	157
Anlagenportfolio – FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	159
Anlagenportfolio – FTGF Royce US Smaller Companies Fund	163
Anlagenportfolio – FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund <sup>^</sup>	165
Anlagenportfolio – Franklin MV European Equity Growth and Income Fund <sup>^</sup>	166
Anlagenportfolio – Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund <sup>^</sup>	167
Anlagenportfolio – Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund <sup>^</sup>	168
Anlagenportfolio – FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	169
Anlagenportfolio – FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	170
Anlagenportfolio – FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup>	171
Anlagenportfolio – FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>^</sup>	172
Anlagenportfolio – FTGF Martin Currie Improving Society Fund <sup>^</sup>	173
Anlagenportfolio – Franklin Responsible Income 2028 Fund <sup>^</sup>	174
Bilanz – Franklin Templeton Global Funds Plc	176
Gesamtergebnisrechnung – Franklin Templeton Global Funds Plc	196
Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – Franklin Templeton Global Funds Plc	206
Erläuterungen zum Abschluss – Franklin Templeton Global Funds Plc	232
Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (TER) – Franklin Templeton Global Funds Plc	251
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	258
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Western Asset US Core Bond Fund	258
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	258
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	259
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	259
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Western Asset US High Yield Fund	260
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Western Asset Global High Yield Fund	260
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	261
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	261
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>	262
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Western Asset Global Credit Fund <sup>^</sup>	262
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	262
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>	263
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>	263
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund <sup>^</sup>	264
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund <sup>^</sup>	264
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund	264
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	265
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	265
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	266
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund <sup>^</sup>	266
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Brandywine Global High Yield Fund <sup>^</sup>	266

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Inhaltsverzeichnis – (Fortsetzung)

Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	267
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	267
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>	268
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund <sup>^</sup>	268
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup>	269
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund <sup>^</sup>	269
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund <sup>^</sup>	270
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF ClearBridge Value Fund	270
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	271
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	271
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	272
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	272
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	273
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF ClearBridge Global Growth Fund <sup>^</sup>	273
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup>	274
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	274
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	275
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Royce US Smaller Companies Fund	275
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund <sup>^</sup>	275
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund <sup>^</sup>	276
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	276
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	277
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	277
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup>	277
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>^</sup>	278
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – FTGF Martin Currie Improving Society Fund <sup>^</sup>	278
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen – Franklin Responsible Income 2028 Fund <sup>^</sup>	278
Anhang: Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFTR)	280

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.



# Allgemeine Informationen

## Verwaltungsrat

Joseph Carrier (USA)  
 Fionnuala Doris (Irland) (unabhängig)  
 William Jackson (Vereinigtes Königreich)<sup>1</sup>  
 Joseph Keane (Irland) (unabhängig)  
 Joseph LaRocque (USA)  
 Jaspal Saggar (Vereinigtes Königreich)  
 Jane Trust (USA)  
 Craig Tyle (USA)<sup>2</sup>

<sup>1</sup> Zurückgetreten am 17. Juli 2023

<sup>2</sup> Bestellt am 27. Juli 2023

## Geschäftssitz

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

## Secretary

Bradwell Limited  
 Ten Earlsfort Terrace, Dublin 2  
 Irland

## Hauptvertriebs- und Hauptinformationsstelle

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

## Weitere Vertriebs- und Informationsstellen

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

Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc.  
 8F, No. 87  
 Sec. 4, Zhong Xiao E. Rd., 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 Anteilinhaber aus dem Vereinigten Königreich)

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

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

## Schweizer Vertreter

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

## Schweizer Zahlstelle

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

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

## Irischer Rechtsberater

Arthur Cox LLP  
 Ten Earlsfort Terrace, Dublin 2  
 Irland

## Verwahrstelle

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

## Unabhängige Wirtschaftsprüfer

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

## Verwaltungsstelle

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

## Verwalter und Promoter

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

## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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



## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund*	1. Oktober 2003	<b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund <sup>^*</sup>	3. April 2012	<b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global High Yield Fund <sup>^*</sup>	30. November 2012	<b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund*	25. Juni 2010	<b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund <sup>^*b</sup>	10. Mai 2012 (Handel eingestellt am 25. Februar 2021)	<b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund*	3. Juni 2013	<b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^*</sup>	30. Juni 2014	<b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund <sup>^*b</sup>	6. April 2017 (Handel eingestellt am 24. März 2023)	<b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund <sup>^*b</sup>	30. Oktober 2017 (Handel eingestellt am 29. Januar 2020)	<b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^*</sup>	16. August 2018	<b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund <sup>^*</sup>	1. Dezember 2022	<b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund <sup>^*b</sup>	31. Dezember 2015 (Handel eingestellt am 24. März 2023)	<b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA

## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Brandywine Global – EM Macro Bond Fund**^A		<b>Anlageverwalter:</b> Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF ClearBridge Value Fund**	23. März 1998	<b>Anlageverwalter:</b> ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge Growth Fund^**b	25. Februar 2004 (Handel eingestellt am 15. Februar 2019)	<b>Anlageverwalter:</b> ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^**b	1. September 2006 (Handel eingestellt am 22. November 2019)	<b>Anlageverwalter:</b> ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund**	20. April 2007	<b>Anlageverwalter:</b> ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund**	20. April 2007	<b>Anlageverwalter:</b> ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund**	20. April 2007	<b>Anlageverwalter:</b> ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund**	3. Juni 2013	<b>Anlageverwalter:</b> ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund**	30. September 2015	<b>Anlageverwalter:</b> ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge Global Growth Fund**^A	29. Juni 2018	<b>Anlageverwalter:</b> ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund**^A	22. September 2023	<b>Anlageverwalter:</b> ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund**^A	9. Dezember 2016	<b>Anlageverwalter:</b> ClearBridge Investments (North America) Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund**^Ab	31. März 2017 (Handel eingestellt am 17. November 2022)	<b>Anlageverwalter:</b> ClearBridge Investments (North America) Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund**	30. April 2021	<b>Anlageverwalter:</b> ClearBridge Investments (North America) Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien

## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund**	8. November 2002	<b>Anlageverwalter:</b> Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 USA
FTGF Royce US Smaller Companies Fund**	1. März 2004	<b>Anlageverwalter:</b> Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 USA
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^**	1. Dezember 2021	<b>Anlageverwalter:</b> Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 USA
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^*** <sup>b</sup>	30. August 2002 (Handel eingestellt am 11. Juli 2022)	<b>Anlageverwalter:</b> Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^*** <sup>b</sup>	25. Februar 2004 (Handel eingestellt am 17. Juli 2023)	<b>Anlageverwalter:</b> Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund^*** <sup>b</sup>	20. April 2007 (Handel eingestellt am 25. Februar 2015)	
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^*** <sup>b</sup>	28. April 2008 (Handel eingestellt am 14. April 2021)	<b>Anlageverwalter:</b> Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^*** <sup>b</sup>	29. Dezember 2010 (Handel eingestellt am 27. April 2022)	<b>Anlageverwalter:</b> Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
Legg Mason QS US Large Cap Fund^***		<b>Anlageverwalter:</b> Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund** <sup>^b</sup>	11. März 2016 (Handel eingestellt am 20. April 2023)	<b>Anlageverwalter:</b> Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland <b>Unteranlageverwalter:</b> Templeton Asset Management Ltd. 7 Temasek Boulevard, #38-03 Suntec Tower One Singapore 038987
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund** <sup>^b</sup>	11. März 2016 (Handel eingestellt am 21. August 2019)	<b>Anlageverwalter:</b> Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland <b>Unteranlageverwalter:</b> Templeton Asset Management Ltd. 7 Temasek Boulevard, #38-03 Suntec Tower One Singapore 038987
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund** <sup>^b</sup>	11. März 2016 (Handel eingestellt am 1. Juni 2021)	<b>Anlageverwalter:</b> Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund** <sup>^b</sup>	11. März 2016 (Handel eingestellt am 31. Juli 2017)	

## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
<b>Legg Mason Martin Currie Greater China Fund**<sup>ab</sup></b>	11. März 2016 (Handel eingestellt am 15. November 2019)	<b>Anlageverwalter:</b> Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
<b>FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund**<sup>a</sup></b>	28. Juni 2016	<b>Anlageverwalter:</b> Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
<b>FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund**</b>	28. Juni 2016	<b>Anlageverwalter:</b> Franklin Templeton Australia Limited Level 47 120 Collins Street, Melbourne VIC 3000 Australien
<b>FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund**<sup>a</sup></b>	24. November 2017	<b>Anlageverwalter:</b> Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
<b>FTGF Martin Currie European Select Absolute Alpha Fund**<sup>1a</sup></b>		<b>Anlageverwalter:</b> Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
<b>FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund**<sup>a</sup></b>	9. November 2018	<b>Anlageverwalter:</b> Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
<b>FTGF Martin Currie Improving Society Fund**<sup>a</sup></b>	20. Juni 2023	<b>Anlageverwalter:</b> Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
<b>FTGF Multi-Asset Infrastructure Income Fund**<sup>1a</sup></b>		<b>Anlageverwalter:</b> 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
<b>Legg Mason US Equity Fund<sup>ab</sup></b>	8. Januar 2008 (Handel eingestellt am 24. August 2010, am 13. April 2012 neu aufgelegt und Handel eingestellt am 30. August 2013)	
<b>Legg Mason Japan Equity Fund<sup>ab</sup></b>	2. Oktober 2008 (Handel eingestellt am 30. November 2010)	
<b>Franklin Responsible Income 2028 Fund*<sup>a</sup></b>	23. Januar 2023	<b>Anlageverwalter:</b> Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street London EC4N 6HL Vereinigtes Königreich
<b>Franklin Responsible Series 2 Fund**<sup>1a</sup></b>		<b>Anlageverwalter:</b> Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street London EC4N 6HL Vereinigtes Königreich

## Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Franklin Responsible Series 3 Fund <sup>†^</sup>		<b>Anlageverwalter:</b> Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street London EC4N 6HL Vereinigtes Königreich

<sup>†</sup> Zum Ende des Berichtszeitraums haben diese Fonds nicht mit dem Handel begonnen.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

<sup>μ</sup> 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).

<sup>p</sup> Bis zum Widerruf der Genehmigung durch die Zentralbank.

## 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](http://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](http://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 Halbjahresbericht für Franklin Templeton Global Funds Plc (die „Gesellschaft“) für den Sechsmontatszeitraum zum 31. August 2023 vorlegen zu können. In diesem Bericht heben wir die Haupttreiber der Entwicklung der Anleihe- und Aktienmärkte während des Berichtszeitraums hervor.

### Bericht über die Weltwirtschaft

Die globale Wirtschaft stand zahlreichen Herausforderungen gegenüber, erwies sich im Berichtszeitraum jedoch als widerstandsfähig. Aufgrund diverser Negativfaktoren dürften sich das Wachstum abschwächen. In seinem *World Economic Outlook Update* von Juli 2023 prognostizierte der Internationale Währungsfonds („IWF“) einen Rückgang des globalen Bruttoinlandsprodukts („BIP“) von 3,5 % im Jahr 2022 auf 3,0 % im nächsten Jahr. Der IWF erklärte: „Die globale Erholung nach der COVID-19-Pandemie und dem Einmarsch Russlands in die Ukraine verlangsamt sich und die branchen- und regionenspezifischen Unterschiede werden ausgeprägter ... Die Prognose für 2023 ist etwas besser als im World Economic Outlook von April 2023, aber gemessen an historischen Standards ist sie weiterhin schwach. Der Anstieg der Leitzinsen zur Bekämpfung der Inflation belastet weiterhin die Wirtschaftstätigkeit ... Die Inflation lässt in den meisten Ländern nach, bleibt aber hoch, mit branchenspezifischen Unterschieden und divergierenden Inflationszahlen.“ Der IWF prognostiziert, dass das BIP 2023 in den USA um 1,8 % wachsen wird (2022: 2,1 %), um 0,9 % in der Eurozone (2022: 3,5 %), 0,4 % im Vereinigten Königreich (2022: 4,1 %) und 1,4 % in Japan (2022: 1,1 %).

### Marktüberblick – Rentenmärkte<sup>i</sup>

Der globale Anleihenmarkt tendierte im Berichtszeitraum allgemein höher. In den USA stiegen die Renditen von US-Staatsanleihen, weil die Inflation hoch blieb. Vor diesem Hintergrund hob die US-Notenbank Fed den Leitzins auf zehn aufeinanderfolgenden Sitzungen von März 2022 bis Mai 2023 an. Im Juni 2023 legte die Fed eine Pause ein und im Juli erhöhte sie den Leitzins dann auf den höchsten Stand seit 22 Jahren. Die Renditen der zehnjährigen US-Staatsanleihen lagen zu Beginn des Berichtszeitraums bei 3,92 % und am Ende bei 4,09 %. Auch in den meisten anderen Industrieländern außerhalb der USA stiegen die Renditen. In diesem Kontext verzeichneten US-Staatsanleihen und Investment-Grade<sup>ii</sup>-Unternehmensanleihen<sup>iii</sup> positive Renditen. US-Unternehmensanleihen mit niedrigerem Rating und auf US-Dollar lautende Schwellenländer-Staatsanleihen entwickelten sich ebenfalls positiv.

### Marktüberblick – Globale Aktien<sup>iv</sup>

Globale Aktien erlebten volatile Phasen, verzeichneten im Berichtszeitraum aber positive Renditen. Die Anlegerstimmung wurde durch die Resilienz der globalen Wirtschaft, die oftmals unerwartet guten Unternehmensgewinne und die nachlassende Inflation getragen. In dem Halbjahr zum 31. August 2023 rentierte der S&P 500 Index mit 14,50 %. Außerhalb der USA legten Industrieländeraktien, gemessen am MSCI EAFE Index (net), um 4,75 % zu, während Schwellenländeraktien, gemessen am MSCI Emerging Markets Index (net), eine Rendite von 3,62 % verbuchten.

i Rentenwerte – Anleihen.

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

Wir danken Ihnen für Ihr anhaltendes Vertrauen.

Mit freundlichen Grüßen

Franklin Templeton International Services S.à r.l

September 2023

*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 beziehen sich auf den 31. August 2023, sofern nicht anders angegeben.

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 von BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company, One Dockland Central, Guild Street, IFSC, Dublin 1, Irland, [www.franklinresources.com](http://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 richtet sich nicht an Personen und ist für keine Verwendung bestimmt, sollte dies gegen lokale Gesetze oder Bestimmungen verstoßen. Franklin Templeton ist nicht verantwortlich und haftet nicht, wenn dieses Dokument weiterverteilt wird.

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

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

# FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert				
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 75,66 % (28. Februar 2023: 71,90 %)</b>									
<b>USA – 75,66 % (28. Februar 2023: 71,90 %)</b>									
15.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,340 %, fällig 20.09.2023 *	15.000	1,61						
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,320 %, fällig 14.11.2023 *	10.000	1,08						
3.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,325 %, fällig 30.11.2023 *	2.999	0,32						
2.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Serie 0000, 5,360 %, fällig 13.12.2023 *	2.000	0,21						
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,360 %, fällig 27.12.2023 *	10.001	1,08						
15.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Serie 000, 5,330 %, fällig 08.01.2024 *	15.000	1,61						
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Serie 0000, 5,380 %, fällig 29.01.2024 *	10.000	1,08						
15.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,345 %, fällig 20.02.2024 *	14.999	1,61						
25.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,450 %, fällig 20.03.2024 *	25.001	2,69						
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Serie 000, 5,380 %, fällig 06.05.2024 *	10.000	1,08						
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Serie 0001, 5,380 %, fällig 24.05.2024 *	9.997	1,08						
10.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 01.09.2023	10.000	1,08						
10.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 06.09.2023	9.993	1,07						
15.862	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 15.09.2023	15.830	1,70						
15.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 29.09.2023	14.942	1,61						
10.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 07.10.2023	9.923	1,07						
5.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 17.01.2023	4.901	0,53						
10.000	Federal Home Loan Banks, Serie 0000, 5,360 %, fällig 05.09.2023 *	10.000	1,08						
10.000	Federal Home Loan Banks, 5,420 %, fällig 06.09.2023 *	10.000	1,08						
4.500	Federal Home Loan Banks, 5,360 %, fällig 20.09.2023 *	4.500	0,48						
10.000	Federal Home Loan Banks, 5,420 %, fällig 20.09.2023 *	10.000	1,08						
26.200	Federal Home Loan Banks, Serie 0002, 5,330 %, fällig 25.09.2023 *	26.200	2,82						
10.000	Federal Home Loan Banks, Serie 0000, 5,340 %, fällig 23.10.2023 *	10.000	1,08						
10.000	Federal Home Loan Banks, 5,335 %, fällig 16.11.2023 *	10.000	1,08						
10.000	Federal Home Loan Banks, Serie 0000, 5,355 %, fällig 24.11.2023 *	10.000	1,08						
5.000	Federal Home Loan Banks, 5,370 %, fällig 27.11.2023 *	5.000	0,54						
10.000	Federal Home Loan Banks, Serie 0000, 5,390 %, fällig 01.12.2023 *	10.000	1,08						
5.000	Federal Home Loan Banks, 5,380 %, fällig 24.01.2024 *	4.999	0,54						
10.000	Federal Home Loan Banks, Serie 0001, 5,340 %, fällig 01.02.2024 *	10.000	1,08						
10.000	Federal Home Loan Banks, Serie 0000, 5,340 %, fällig 16.02.2024 *	10.000	1,08						
20.000	Federal Home Loan Banks, 5,420 %, fällig 14.03.2024 *	20.007	2,15						
4.000	Federal Home Loan Banks, 5,360 %, fällig 03.05.2023 *	4.000	0,43						
15.000	Federal Home Loan Banks, Serie 0000, 5,365 %, fällig 10.05.2024 *	15.000	1,61						
10.000	Federal Home Loan Banks, 5,365 %, fällig 24.05.2024 *	10.000	1,08						
10.000	Federal Home Loan Banks, Serie 0001, 5,420 %, fällig 28.05.2024 *	10.000	1,08						
10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 05.09.2023	9.994	1,07						
15.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 07.09.2023	14.987	1,61						
15.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 12.09.2023	14.976	1,61						
15.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 19.09.2023	14.960	1,61						
15.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 21.09.2023	14.956	1,61						
15.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 26.09.2023	14.945	1,61						
10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 28.09.2023	9.961	1,07						
20.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 13.10.2023	19.906	2,14						
10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 05.10.2023	9.950	1,07						
20.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 12.10.2023	19.883	2,14						
10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 19.10.2023	9.930	1,07						
10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 24.10.2023	9.923	1,07						
15.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 26.10.2023	14.879	1,60						
10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 31.10.2023	9.913	1,07						
10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 07.11.2023	9.902	1,07						
10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 09.11.2023	9.899	1,06						
15.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 16.11.2023	14.832	1,60						
10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 21.11.2023	9.881	1,06						
20.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 24.11.2023	19.756	2,13						
10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 30.11.2023	9.867	1,06						
10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 12.12.2023	9.850	1,06						
				15.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 19.12.2023	14.759	1,59		
				10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 01.02.2024	9.824	1,06		
				10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 18.01.2024	9.797	1,05		
				15.000	Variabel verzinsliche United States Treasury Note, 5,448 %, fällig 31.10.2023 *	14.999	1,61		
						702.821	75,66		
				<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 702.821 USD)</b>		702.821	75,66		
				<b>Reverse-Repo-Geschäfte – 26,65 % (28. Februar 2023: 29,37 %)</b>					
				<b>USA – 26,65 % (28. Februar 2023: 29,37 %)</b>					
				50.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse-Repo-Geschäft zum Rückkauf zu 50.007.319 USD (besichert durch US-Staatsanleihen und Schuldverschreibungen im Gesamtwert von 51.007.467 USD), 5,270 %, fällig 01.09.2023	50.000	5,39		
				55.000	HSBC Bank (USA), Reverse-Repo-Geschäft zum Rückkauf zu 55.008.021 USD (besichert durch US-Staatsanleihen und -Schuldverschreibungen im Gesamtwert von 56.108.220 USD), 5,250 %, fällig 01.09.2023	55.000	5,92		
				80.000	JP Morgan Securities LLC, Reverse-Repo-Geschäft zum Rückkauf zu 80.011.733 USD (besichert durch US-Staatsanleihen und Schuldverschreibungen im Gesamtwert von 81.611.971 USD), 5,280 %, fällig 01.09.2023	80.000	8,61		
				50.000	Royal Bank of Canada, Reverse-Repo-Geschäft zum Rückkauf zu 50.007.278 USD (besichert durch US-Staatsanleihen und Schuldverschreibungen im Gesamtwert von 51.000.021 USD), 5,240 %, fällig 01.09.2023	50.000	5,38		
				12.520	TD Securities (USA) LLC, Reverse-Repo-Geschäft zum Rückkauf zu 12.521.843 USD (besichert durch US-Staatsanleihen und Schuldverschreibungen im Gesamtwert von 12.770.400 USD), 5,300 %, fällig 01.09.2023	12.520	1,35		
						247.520	26,65		
				<b>Summe Reverse-Repo-Geschäfte (Anschaffungskosten 247.520 USD)</b>		247.520	26,65		
				<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		950.341	102,31		
				<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		950.341	102,31		
				<b>Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten</b>		-21.422	-2,31		
				<b>Gesamtvermögen</b>		928.919\$	100,00		
				– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
				* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.					
				<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>			<b>% des Gesamtvermögens</b>		
				Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden			73,79		
				Geldmarktinstrumente			25,99		
				Sonstige Vermögenswerte			0,22		
				<b>Gesamtvermögen</b>			100,00		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Western Asset US Core Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventar	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventar		
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere – 7,01 % (28. Februar 2023: 9,59 %)</b>							
100	AB BSL CLO 4 Ltd, Serie 2023 4A, Klasse A, 144A, 6,957 %, fällig 20.04.2036 *	101	490	Trinitas CLO XVI Ltd, Serie 2021 16A, Klasse A1, 144A, 6,768 %, fällig 20.07.2034 *	483	0,24	
500	Apidos CLO XXXVII, Serie 2021 37A, Klasse A, 144A, 6,737 %, fällig 22.10.2034 *	497	660	Voya CLO 2016-3 Ltd, Serie 2016 3A, Klasse A1R, 144A, 6,762 %, fällig 18.10.2031 *	659	0,32	
260	Applebee's Funding LLC. IHOP Funding LLC, Serie 2023 1A, Klasse A2, 144A, 7,824 %, fällig 05.03.2053	259	<b>Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 14.468 USD)</b>			14.266	7,01
415	Argent Securities Inc Asset-Backed Pass-Through-Zertifikate Serie 2003-W7, Serie 2003 W3, Klasse M1, 3,972 %, fällig 25.09.2033 *	373	<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 41,38 % (28. Februar 2023: 36,20 %)</b>				
320	Barings Private Credit Corp CLO 2023-1 Ltd, Serie 2023 1A, Klasse A1, 144A, 7,807 %, fällig 15.07.2031 *	320	510	AREIT 2022-CRE7 LLC, Serie 2022 CRE7, Klasse A, 144A, 7,556 %, fällig 17.06.2039 *	510	0,25	
471	Benefit Street Partners CLO VIII Ltd, Serie 2015 8A, Klasse A1AR, 144A, 6,688 %, fällig 20.01.2031 *	470	24	Banc of America Mortgage 2003-C Trust, Serie 2003 C, Klasse B1, 4,746 %, fällig 25.04.2033 *	5	–	
140	Birch Grove CLO 6 Ltd, Serie 2023 6A, Klasse A1, 144A, 7,489 %, fällig 20.07.2035 *	141	110	BANK 2018-BNK10, Serie 2018 BN10, Klasse A5, 3,688 %, fällig 15.02.2061	102	0,05	
734	Brazos Higher Education Authority Inc, Serie 2011 2, Klasse A3, 6,316 %, fällig 27.10.2036 *	726	130	Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, Serie 2018 B1, Klasse A5, 3,666 %, fällig 15.01.2051 *	119	0,06	
630	Canyon CLO 2020-1 Ltd, Serie 2020 1A, Klasse AR, 144A, 6,750 %, fällig 15.07.2034 *	622	10.116	Benchmark 2018-B5 Mortgage Trust, Serie 2018 B5, Klasse XA, 0,614 %, fällig 15.07.2051 *	177	0,09	
270	Cayuga Park CLO Ltd, Serie 2020 1A, Klasse AR, 144A, 6,690 %, fällig 17.07.2034 *	268	879	BHMS 2018-ATLS, Serie 2018 ATLS, Klasse A, 144A, 6,857 %, fällig 15.07.2035 *	864	0,42	
435	CBAM 2017-1 Ltd, Serie 2017 1A, Klasse A1, 144A, 6,838 %, fällig 20.07.2030 *	435	100	CD 2017-CD3 Mortgage Trust, Serie 2017 CD3, Klasse A4, 3,631 %, fällig 10.02.2050	91	0,04	
71	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, Serie 2001 HE22, Klasse A1, 5,892 %, fällig 25.02.2032 *	69	130	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, Serie 2014 GC23, Klasse B, 4,175 %, fällig 10.07.2047 *	122	0,06	
31	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2007-13, Serie 2007 13, Klasse 2A2, 6,229 %, fällig 25.10.2047 *	28	3.786	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C3, Serie 2016 C3, Klasse XA, 1,121 %, fällig 15.11.2049 *	93	0,05	
140	CWABS Inc Asset-Backed Certificates Trust 2004-5, Serie 2004 5, Klasse 2A, 5,929 %, fällig 25.10.2034 *	134	220	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-C4, Serie 2017 C4, Klasse A3, 3,209 %, fällig 10.12.2050	202	0,10	
26	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-F, Series 2006 F, Klasse 2A1A, 5,565 %, fällig 15.07.2036 *	24	10	COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, Serie 2013 CR12, Klasse AM, 4,300 %, fällig 10.10.2046	9	–	
144	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-I, Serie 2006 I, Klasse 2A, 5,565 %, fällig 15.01.2037 *	130	123	Comm 2014-UBS2 Mortgage Trust, Serie 2014 UBS2, Klasse XA, 1,195 %, fällig 10.03.2047 *	–	–	
473	DB Master Finance LLC, Serie 2017 1A, Klasse A2II, 144A, 4,030 %, fällig 20.11.2047	436	38	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust, Serie 2015 LC19, Class ASB, 3,040 %, fällig 02.10.2048	38	0,02	
155	EFS Volunteer No 2 LLC, Serie 2012 1, Klasse A2, 144A, 6,752 %, fällig 25.03.2036 *	155	200	COMM 2015-PC1 Mortgage Trust, Serie 2015 PC1, Klasse A5, 3,902 %, fällig 10.07.2050	192	0,09	
420	Golub Capital Partners Clo 57M Ltd, Serie 2021 57A, Klasse A1, 144A, 7,103 %, fällig 25.10.2034 *	413	340	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, Serie 2022 R04, Klasse 1M2, 144A, 8,388 %, fällig 25.03.2042 *	345	0,17	
150	Golub Capital Partners CLO 668 Ltd, Serie 2023 66A, Klasse A, 144A, 6,926 %, fällig 25.04.2036 *	150	430	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R06, Serie 2023 R06, Klasse 1M2, 144A, 7,988 %, fällig 25.07.2043 *	433	0,21	
400	Goodleap Sustainable Home Solutions Trust 2023-3, Serie 2023 3C, Klasse A, 144A, 6,500 %, fällig 20.07.2055	400	100	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, Serie 2015 C1, Klasse AS, 3,791 %, fällig 15.04.2050 *	92	0,04	
250	Greenwood Park CLO Ltd, Serie 2018 1A, Klasse A2, 144A, 6,580 %, fällig 15.04.2031 *	249	340	CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Klasse A2, 144A, 3,953 %, fällig 15.09.2037	297	0,15	
320	Greywolf CLO V Ltd, Serie 2015 1A, Klasse A1R, 144A, 6,773 %, fällig 27.01.2031 *	320	420	CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Klasse B, 144A, 4,185 %, fällig 15.09.2037	342	0,17	
708	Home Equity Asset Trust 2006-4, Serie 2006 4, Klasse 2A4, 5,989 %, fällig 25.08.2036 *	686	353	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Klasse A2, 144A, 3,500 %, fällig 25.02.2048 *	311	0,15	
485	Jack in the Box Funding LLC, Serie 2022 1A, Klasse A2I, 144A, 3,445 %, fällig 26.02.2052	438	979	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Klasse B2, 144A, 3,586 %, fällig 25.02.2048 *	858	0,42	
323	Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, Serie 2021 1GS, Klasse A, 144A, 2,290 %, fällig 20.01.2048	239	200	Fannie Mae 5-Jahres-Pool, 4,830 %, fällig 01.09.2028 ∞	198	0,10	
589	Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1, Serie 2004 1, Klasse M1, 6,179 %, fällig 25.02.2034 *	566	200	Fannie Mae 5-Jahres-Pool, 4,880 %, fällig 01.09.2028 ∞	201	0,10	
245	Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-4, Serie 2004 4, Klasse M1, 6,329 %, fällig 25.10.2034 *	235	100	Fannie Mae 5-Jahres-Pool, 5,340 %, fällig 01.09.2028 ∞	102	0,05	
430	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2004-WMC5, Series 2004 WMC5, Klasse M1, 6,359 %, fällig 25.07.2035 *	415	300	Fannie Mae 5-Jahres-Pool, 5,000 %, fällig 01.10.2028 ∞	301	0,15	
443	MKS CLO 2017-2 Ltd, Serie 2017 2A, Klasse A, 144A, 6,778 %, fällig 20.01.2031 *	442	134	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2014 C03, Klasse 1M2, 8,402 %, fällig 25.07.2024 *	137	0,07	
405	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2004-NC8, Serie 2004 NC8, Klasse M1, 6,344 %, fällig 25.09.2034 *	390	1	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2014 C04, Klasse 2M2, 10,402 %, fällig 25.11.2024 *	1	–	
59	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2005-NC2, Serie 2005 NC2, Klasse M4, 6,344 %, fällig 25.03.2035 *	59	1	Fannie Mae Interest Strip 390, Klasse C3, 6,000 %, fällig 25.07.2038	–	–	
369	Mosaik Solar Loan Trust 2021-3, Serie 2021 3A, Klasse B, 144A, 1,920 %, fällig 20.06.2052	264	4	Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 41, 6,000 %, fällig 25.01.2038	1	–	
337	Navient Student Loan Trust 2017-3, Serie 2017 3A, Klasse A3, 144A, 6,452 %, fällig 26.07.2066 *	332	8	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C13, 3,500 %, fällig 25.11.2041	1	–	
350	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 Ltd, Serie 2018 29A, Klasse A1, 144A, 6,712 %, fällig 19.10.2031 *	349	8	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C18, 4,000 %, fällig 25.04.2042	1	–	
93	NovaStar Mortgage Funding Trust Series 2003-3, Series 2003 3, Klasse A1, 6,139 %, fällig 25.12.2033 *	90	5	Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C2, 3,000 %, fällig 25.04.2027	–	–	
730	Ocean Trails Clo X, Serie 2020 10A, Klasse AR, 144A, 6,790 %, fällig 15.10.2034 *	720	1.600	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,000 % ±	1.274	0,63	
240	Ocean Trails Clo XI, Serie 2021 11A, Klasse A, 144A, 6,808 %, fällig 20.07.2034 *	237	2.400	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 % ±	1.989	0,98	
59	SBA Small Business Investment Cos, Serie 2018 10B, Klasse 1, 3,548 %, fällig 10.09.2028	55	2.600	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 % ±	2.241	1,10	
75	SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A, Serie 2007 A, Klasse A4A, 5,792 %, fällig 16.12.2041 *	73	2.500	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,500 % ±	2.235	1,10	
324	SLM Private Education Loan Trust 2010-C, Serie 2010 C, Klasse A5, 144A, 10,175 %, fällig 15.10.2041 *	343	900	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,000 % ±	831	0,41	
146	SMB Private Education Loan Trust 2020-A, Serie 2020 A, Klasse A2A, 144A, 2,230 %, fällig 15.09.2037	135	600	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 % ±	569	0,28	
371	Stonepeak 2021-1 ABS, Serie 2021 1A, Klasse AA, 144A, 2,301 %, fällig 28.02.2033	336	600	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 % ±	582	0,29	
			2.400	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,500 % ±	2.370	1,16	
			100	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 6,000 % ±	100	0,05	
			1	Fannie Mae Pool „888795“, 5,500 %, fällig 01.11.2036	1	–	
			33	Fannie Mae Pool „890604“, 4,500 %, fällig 01.10.2044	32	0,02	
			20	Fannie Mae Pool „AB9594“, 4,000 %, fällig 01.06.2043	19	0,01	
			197	Fannie Mae Pool „AH4536“, 4,000 %, fällig 01.02.2041	187	0,09	
			8	Fannie Mae Pool „AL4324“, 6,500 %, fällig 01.05.2040	8	–	
			66	Fannie Mae Pool „AL9397“, 3,000 %, fällig 01.10.2046	58	0,03	
			50	Fannie Mae Pool „AL9546“, 3,500 %, fällig 01.11.2046	46	0,02	
			37	Fannie Mae Pool „AL9631“, 3,000 %, fällig 01.12.2046	33	0,02	
			20	Fannie Mae Pool „AM8674“, 2,810 %, fällig 01.04.2025	19	0,01	
			94	Fannie Mae Pool „AM8700“, 2,930 %, fällig 01.06.2030	84	0,04	
			247	Fannie Mae Pool „AN1187“, 2,930 %, fällig 01.07.2028	228	0,11	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



## FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)</b>					
57 Fannie Mae Pool „AN4927“, 3,450 %, fällig 01.03.2029	53	0,03	373 Fannie Mae Pool „CB3899“, 3,500 %, fällig 01.06.2052	334	0,16
58 Fannie Mae Pool „AN5386“, 3,250 %, fällig 01.05.2029	54	0,03	186 Fannie Mae Pool „CB5497“, 6,500 %, fällig 01.01.2053	191	0,09
44 Fannie Mae Pool „AO7501“, 4,000 %, fällig 01.06.2042	41	0,02	96 Fannie Mae Pool „CB5892“, 4,500 %, fällig 01.03.2053	91	0,04
23 Fannie Mae Pool „AP4781“, 3,000 %, fällig 01.09.2042	21	0,01	99 Fannie Mae Pool „CB6030“, 4,500 %, fällig 01.04.2053	94	0,05
18 Fannie Mae Pool „AR7399“, 3,000 %, fällig 01.06.2043	16	0,01	97 Fannie Mae Pool „CB6322“, 5,500 %, fällig 01.05.2053	96	0,05
40 Fannie Mae Pool „AS0038“, 3,000 %, fällig 01.07.2043	35	0,02	396 Fannie Mae Pool „CB6753“, 6,000 %, fällig 01.07.2053	398	0,20
211 Fannie Mae Pool „AS7313“, 3,500 %, fällig 01.06.2046	192	0,09	49 Fannie Mae Pool „FM0068“, 3,500 %, fällig 01.02.2040	45	0,02
90 Fannie Mae Pool „AS7738“, 3,000 %, fällig 01.08.2046	79	0,04	39 Fannie Mae Pool „FM0071“, 3,500 %, fällig 01.02.2040	36	0,02
57 Fannie Mae Pool „AS7844“, 3,000 %, fällig 01.09.2046	50	0,02	41 Fannie Mae Pool „FM1263“, 4,500 %, fällig 01.07.2049	40	0,02
21 Fannie Mae Pool „AS8740“, 3,500 %, fällig 01.02.2037	20	0,01	194 Fannie Mae Pool „FM1727“, 5,000 %, fällig 01.09.2049	191	0,09
38 Fannie Mae Pool „AS8745“, 3,000 %, fällig 01.02.2047	34	0,02	97 Fannie Mae Pool „FM2761“, 5,000 %, fällig 01.03.2050	95	0,05
43 Fannie Mae Pool „AS9588“, 4,000 %, fällig 01.05.2047	40	0,02	83 Fannie Mae Pool „FM3049“, 4,000 %, fällig 01.04.2044	79	0,04
17 Fannie Mae Pool „AT4281“, 4,000 %, fällig 01.06.2043	16	0,01	200 Fannie Mae Pool „FM3773“, 3,500 %, fällig 01.11.2048	182	0,09
25 Fannie Mae Pool „AU6735“, 3,000 %, fällig 01.10.2043	22	0,01	264 Fannie Mae Pool „FM4650“, 2,500 %, fällig 01.10.2040	229	0,11
41 Fannie Mae Pool „BC0884“, 3,000 %, fällig 01.05.2046	36	0,02	50 Fannie Mae Pool „FM5783“, 3,000 %, fällig 01.06.2038	46	0,02
65 Fannie Mae Pool „BC1509“, 3,000 %, fällig 01.08.2046	57	0,03	58 Fannie Mae Pool „FM5904“, 2,500 %, fällig 01.02.2051	49	0,02
90 Fannie Mae Pool „BC2817“, 3,000 %, fällig 01.09.2046	79	0,04	76 Fannie Mae Pool „FM6460“, 2,500 %, fällig 01.03.2051	64	0,03
36 Fannie Mae Pool „BD2455“, 3,000 %, fällig 01.01.2047	31	0,02	243 Fannie Mae Pool „FM7673“, 2,500 %, fällig 01.06.2051	203	0,10
39 Fannie Mae Pool „BD8104“, 3,000 %, fällig 01.10.2046	34	0,02	69 Fannie Mae Pool „FM7675“, 2,500 %, fällig 01.06.2051	58	0,03
190 Fannie Mae Pool „BFO104“, 4,000 %, fällig 01.02.2056	181	0,09	53 Fannie Mae Pool „FM7786“, 4,000 %, fällig 01.01.2049	50	0,02
210 Fannie Mae Pool „BFO133“, 4,000 %, fällig 01.08.2056	194	0,10	61 Fannie Mae Pool „FM7796“, 4,000 %, fällig 01.06.2048	57	0,03
45 Fannie Mae Pool „BFO163“, 5,000 %, fällig 01.11.2046	44	0,02	84 Fannie Mae Pool „FM7910“, 2,500 %, fällig 01.07.2051	71	0,03
84 Fannie Mae Pool „BFO183“, 4,000 %, fällig 01.01.2057	78	0,04	157 Fannie Mae Pool „FM8577“, 3,000 %, fällig 01.08.2051	138	0,07
179 Fannie Mae Pool „BFO191“, 4,000 %, fällig 01.06.2057	168	0,08	67 Fannie Mae Pool „FM8813“, 3,500 %, fällig 01.09.2051	60	0,03
37 Fannie Mae Pool „BFO301“, 4,500 %, fällig 01.08.2058	35	0,02	86 Fannie Mae Pool „FM9195“, 2,500 %, fällig 01.10.2051	72	0,04
193 Fannie Mae Pool „BFO646“, 2,500 %, fällig 01.06.2062	155	0,08	83 Fannie Mae Pool „FM9365“, 3,000 %, fällig 01.11.2051	73	0,04
38 Fannie Mae Pool „BL2454“, 3,160 %, fällig 01.05.2029	35	0,02	66 Fannie Mae Pool „FM9441“, 2,000 %, fällig 01.04.2051	69	0,03
145 Fannie Mae Pool „BM3473“, 3,500 %, fällig 01.11.2047	132	0,06	83 Fannie Mae Pool „FM9464“, 3,000 %, fällig 01.11.2051	72	0,04
14 Fannie Mae Pool „BM3904“, 5,000 %, fällig 01.05.2048	14	0,01	98 Fannie Mae Pool „FP0028“, 2,000 %, fällig 01.08.2040	82	0,04
409 Fannie Mae Pool „BM4579“, 3,000 %, fällig 01.04.2047	357	0,18	78 Fannie Mae Pool „FS0024“, 2,500 %, fällig 01.09.2051	66	0,03
36 Fannie Mae Pool „BM4751“, 3,500 %, fällig 01.03.2043	33	0,02	75 Fannie Mae Pool „FS0037“, 3,000 %, fällig 01.08.2051	66	0,03
580 Fannie Mae Pool „BN3898“, 4,500 %, fällig 01.12.2048	560	0,27	72 Fannie Mae Pool „FS0067“, 4,500 %, fällig 01.09.2051	68	0,03
74 Fannie Mae Pool „BQ1163“, 2,000 %, fällig 01.08.2050	59	0,03	86 Fannie Mae Pool „FS0240“, 3,000 %, fällig 01.01.2052	75	0,04
76 Fannie Mae Pool „BQ3331“, 2,000 %, fällig 01.08.2050	62	0,03	88 Fannie Mae Pool „FS0366“, 2,500 %, fällig 01.01.2052	75	0,04
74 Fannie Mae Pool „BQ4926“, 2,000 %, fällig 01.10.2050	59	0,03	176 Fannie Mae Pool „FS0424“, 2,500 %, fällig 01.01.2052	148	0,07
80 Fannie Mae Pool „BQ5876“, 2,500 %, fällig 01.11.2050	67	0,03	89 Fannie Mae Pool „FS0582“, 2,500 %, fällig 01.02.2052	75	0,04
75 Fannie Mae Pool „BR2641“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	61	0,03	88 Fannie Mae Pool „FS0584“, 2,000 %, fällig 01.02.2052	71	0,03
73 Fannie Mae Pool „BR2643“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	59	0,03	260 Fannie Mae Pool „FS0697“, 2,500 %, fällig 01.02.2042	223	0,11
71 Fannie Mae Pool „BR2644“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	57	0,03	331 Fannie Mae Pool „FS0735“, 3,000 %, fällig 01.01.2052	287	0,14
71 Fannie Mae Pool „BR3256“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	59	0,03	89 Fannie Mae Pool „FS0751“, 3,000 %, fällig 01.03.2052	77	0,04
76 Fannie Mae Pool „BR3257“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	62	0,03	91 Fannie Mae Pool „FS0957“, 3,000 %, fällig 01.03.2052	78	0,04
76 Fannie Mae Pool „BR3286“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	61	0,03	88 Fannie Mae Pool „FS1014“, 2,000 %, fällig 01.02.2052	71	0,03
76 Fannie Mae Pool „BR4052“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	61	0,03	534 Fannie Mae Pool „FS1074“, 3,000 %, fällig 01.03.2052	466	0,23
73 Fannie Mae Pool „BR4722“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	59	0,03	364 Fannie Mae Pool „FS1112“, 2,000 %, fällig 01.03.2052	295	0,14
80 Fannie Mae Pool „BR4753“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	65	0,03	87 Fannie Mae Pool „FS1118“, 3,500 %, fällig 01.03.2052	78	0,04
71 Fannie Mae Pool „BR4756“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	57	0,03	261 Fannie Mae Pool „FS1171“, 3,000 %, fällig 01.01.2052	226	0,11
80 Fannie Mae Pool „BR5566“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	64	0,03	88 Fannie Mae Pool „FS1289“, 3,000 %, fällig 01.03.2052	78	0,04
80 Fannie Mae Pool „BR5587“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	65	0,03	93 Fannie Mae Pool „FS2707“, 3,500 %, fällig 01.04.2052	83	0,04
81 Fannie Mae Pool „BR5633“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	66	0,03	161 Fannie Mae Pool „FS2740“, 3,500 %, fällig 01.06.2049	147	0,07
100 Fannie Mae Pool „BS7531“, 4,360 %, fällig 01.02.2033	96	0,05	286 Fannie Mae Pool „FS3162“, 2,500 %, fällig 01.04.2052	238	0,12
100 Fannie Mae Pool „BS7599“, 4,420 %, fällig 01.03.2033	97	0,05	190 Fannie Mae Pool „FS3339“, 3,500 %, fällig 01.06.2052	170	0,08
100 Fannie Mae Pool „BS7753“, 4,310 %, fällig 01.02.2030	97	0,05	97 Fannie Mae Pool „FS3672“, 5,500 %, fällig 01.02.2053	97	0,05
100 Fannie Mae Pool „BS8408“, 4,490 %, fällig 01.06.2028	98	0,05	95 Fannie Mae Pool „FS3836“, 4,500 %, fällig 01.01.2053	90	0,04
100 Fannie Mae Pool „BS8410“, 4,740 %, fällig 01.06.2030	98	0,05	98 Fannie Mae Pool „FS3941“, 5,000 %, fällig 01.02.2053	95	0,05
100 Fannie Mae Pool „BS8755“, 3,800 %, fällig 01.06.2030	94	0,05	93 Fannie Mae Pool „FS4000“, 6,000 %, fällig 01.07.2041	96	0,05
83 Fannie Mae Pool „BT0846“, 2,500 %, fällig 01.07.2051	69	0,03	99 Fannie Mae Pool „FS4136“, 5,000 %, fällig 01.04.2053	96	0,05
86 Fannie Mae Pool „BT3270“, 2,500 %, fällig 01.08.2051	72	0,03	291 Fannie Mae Pool „FS4269“, 2,000 %, fällig 01.10.2051	235	0,12
82 Fannie Mae Pool „BT3303“, 2,500 %, fällig 01.08.2051	69	0,03	389 Fannie Mae Pool „FS4524“, 5,000 %, fällig 01.05.2053	378	0,19
82 Fannie Mae Pool „BT5574“, 2,500 %, fällig 01.08.2051	68	0,03	98 Fannie Mae Pool „FS4533“, 2,500 %, fällig 01.03.2052	81	0,04
1.921 Fannie Mae Pool „BU1118“, 2,500 %, fällig 01.10.2051	1.601	0,79	1.078 Fannie Mae Pool „FS4654“, 2,000 %, fällig 01.07.2051	861	0,42
89 Fannie Mae Pool „BU1421“, 3,000 %, fällig 01.01.2052	77	0,04	99 Fannie Mae Pool „FS4805“, 5,500 %, fällig 01.05.2053	99	0,05
88 Fannie Mae Pool „BU2599“, 2,500 %, fällig 01.01.2052	74	0,04	99 Fannie Mae Pool „FS4933“, 6,000 %, fällig 01.06.2053	99	0,05
87 Fannie Mae Pool „BV3089“, 2,500 %, fällig 01.02.2052	73	0,04	196 Fannie Mae Pool „FS5059“, 3,500 %, fällig 01.11.2048	178	0,09
262 Fannie Mae Pool „BV4195“, 3,000 %, fällig 01.03.2052	228	0,11	28 Fannie Mae Pool „MA1217“, 4,000 %, fällig 01.10.2042	27	0,01
195 Fannie Mae Pool „BX9419“, 5,000 %, fällig 01.03.2053	189	0,09	15 Fannie Mae Pool „MA1253“, 4,000 %, fällig 01.11.2042	14	0,01
308 Fannie Mae Pool „CA1692“, 4,000 %, fällig 01.05.2048	290	0,14	21 Fannie Mae Pool „MA1591“, 4,500 %, fällig 01.09.2043	21	0,01
29 Fannie Mae Pool „CA2472“, 4,000 %, fällig 01.10.2048	27	0,01	40 Fannie Mae Pool „MA2110“, 3,500 %, fällig 01.12.2034	38	0,02
74 Fannie Mae Pool „CA7023“, 2,000 %, fällig 01.09.2050	60	0,03	28 Fannie Mae Pool „MA2138“, 3,500 %, fällig 01.01.2035	26	0,01
74 Fannie Mae Pool „CA7224“, 2,000 %, fällig 01.10.2050	59	0,03	54 Fannie Mae Pool „MA2320“, 3,000 %, fällig 01.07.2035	50	0,02
74 Fannie Mae Pool „CA7531“, 3,000 %, fällig 01.10.2050	65	0,03	87 Fannie Mae Pool „MA2523“, 3,000 %, fällig 01.02.2036	80	0,04
162 Fannie Mae Pool „CA8779“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	130	0,06	64 Fannie Mae Pool „MA2579“, 3,000 %, fällig 01.04.2036	59	0,03
165 Fannie Mae Pool „CA9220“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	132	0,06	156 Fannie Mae Pool „MA2672“, 3,000 %, fällig 01.07.2036	144	0,07
164 Fannie Mae Pool „CB0470“, 2,500 %, fällig 01.05.2041	142	0,07	103 Fannie Mae Pool „MA2707“, 3,000 %, fällig 01.08.2036	95	0,05
1.507 Fannie Mae Pool „CB1301“, 2,500 %, fällig 01.08.2051	1.257	0,62	23 Fannie Mae Pool „MA4031“, 4,500 %, fällig 01.05.2050	22	0,01
269 Fannie Mae Pool „CB2664“, 3,000 %, fällig 01.01.2052	233	0,11	218 Fannie Mae Pool „MA4158“, 2,000 %, fällig 01.10.2050	175	0,09
93 Fannie Mae Pool „CB3044“, 2,500 %, fällig 01.03.2052	78	0,04	60 Fannie Mae Pool „MA4177“, 2,500 %, fällig 01.11.2040	52	0,03
182 Fannie Mae Pool „CB3234“, 3,000 %, fällig 01.04.2052	158	0,08	83 Fannie Mae Pool „MA4236“, 1,500 %, fällig 01.01.2051	63	0,03
184 Fannie Mae Pool „CB3272“, 4,000 %, fällig 01.04.2052	171	0,08	164 Fannie Mae Pool „MA4364“, 2,000 %, fällig 01.06.2041	138	0,07
90 Fannie Mae Pool „CB3282“, 3,500 %, fällig 01.04.2052	81	0,04	1.180 Fannie Mae Pool „MA4422“, 2,000 %, fällig 01.09.2041	985	0,48
95 Fannie Mae Pool „CB3348“, 2,000 %, fällig 01.04.2052	75	0,04	423 Fannie Mae Pool „MA4446“, 2,000 %, fällig 01.10.2041	353	0,17
88 Fannie Mae Pool „CB3369“, 3,500 %, fällig 01.04.2052	79	0,04	259 Fannie Mae Pool „MA4474“, 2,000 %, fällig 01.11.2041	215	0,11
			182 Fannie Mae Pool „MA4587“, 2,500 %, fällig 01.04.2042	155	0,08
			91 Fannie Mae Pool „MA4607“, 2,500 %, fällig 01.05.2042	77	0,04

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US Core Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventar	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventar
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)</b>					
8 Fannie Mae REMICS, Serie 2001 81, Klasse GE, 6,000 %, fällig 25.01.2032	8	-	157 Freddie Mac Pool „RA3882“, 2,000 %, fällig 11.01.2050	127	0,06
17 Fannie Mae REMICS, Serie 2005 29, Klasse ZA, 5,500 %, fällig 25.04.2035	18	0,01	436 Freddie Mac Pool „RA3913“, 2,500 %, fällig 01.11.2050	367	0,18
4 Fannie Mae REMICS, Serie 2011 87, Klasse SG, 1,148 %, fällig 25.04.2040 *	-	-	237 Freddie Mac Pool „RA4703“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	191	0,09
11 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 101, Klasse AI, 3,000 %, fällig 25.06.2027	-	-	470 Freddie Mac Pool „RA5117“, 2,000 %, fällig 01.05.2051	378	0,19
133 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 118, Klasse VZ, 3,000 %, fällig 25.11.2042	119	0,06	86 Freddie Mac Pool „RA5373“, 2,000 %, fällig 01.06.2051	69	0,03
70 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 134, Klasse SK, 0,748 %, fällig 25.12.2042 *	7	-	174 Freddie Mac Pool „RA6135“, 2,500 %, fällig 01.10.2051	145	0,07
5 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 46, Klasse BA, 6,000 %, fällig 25.05.2042	6	-	86 Freddie Mac Pool „RA6562“, 2,500 %, fällig 01.01.2052	72	0,04
6 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 75, Klasse NS, 1,198 %, fällig 25.07.2042 *	1	-	365 Freddie Mac Pool „RA6694“, 2,000 %, fällig 01.01.2052	292	0,14
367 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 96, Klasse SB, 0,648 %, fällig 25.09.2042 *	25	0,01	272 Freddie Mac Pool „RA7185“, 4,000 %, fällig 01.04.2052	252	0,12
8 Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Klasse BC, 6,500 %, fällig 25.07.2042	9	-	449 Freddie Mac Pool „RA7186“, 4,000 %, fällig 01.04.2052	417	0,20
11 Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Klasse CB, 5,500 %, fällig 25.04.2042	11	0,01	371 Freddie Mac Pool „RA7928“, 4,500 %, fällig 01.09.2052	352	0,17
107 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 47, Klasse GZ, 2,000 %, fällig 25.07.2050	62	0,03	98 Freddie Mac Pool „RA8790“, 5,000 %, fällig 01.04.2053	96	0,05
78 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 56, Klasse DI, 2,500 %, fällig 25.08.2050	13	0,01	224 Freddie Mac Pool „RB5084“, 1,500 %, fällig 01.11.2040	181	0,09
153 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 57, Klasse TA, 2,000 %, fällig 25.04.2050	130	0,06	249 Freddie Mac Pool „RB5110“, 1,500 %, fällig 01.05.2041	200	0,10
76 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 74, Klasse EI, 2,500 %, fällig 25.10.2050	12	0,01	254 Freddie Mac Pool „RB5117“, 1,500 %, fällig 01.07.2041	204	0,10
527 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 89, Klasse DI, 2,500 %, fällig 25.12.2050	79	0,04	337 Freddie Mac Pool „RB5125“, 2,000 %, fällig 01.09.2041	282	0,14
439 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 97, Klasse AI, 2,000 %, fällig 25.01.2051	58	0,03	104 Freddie Mac Pool „RB5130“, 1,500 %, fällig 01.10.2041	84	0,04
713 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 3, Klasse QI, 2,500 %, fällig 25.02.2051	108	0,05	771 Freddie Mac Pool „RB5131“, 2,000 %, fällig 01.10.2041	643	0,32
75 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 65, Klasse JA, 2,000 %, fällig 25.01.2046	64	0,03	53 Freddie Mac Pool „RB5134“, 1,500 %, fällig 01.11.2041	42	0,02
48 Fannie Mae-Aces, Serie 2013 M6, Klasse 1AC, 3,454 %, fällig 25.02.2043 *	45	0,02	80 Freddie Mac Pool „RB5138“, 2,000 %, fällig 01.12.2041	72	0,04
400 Fannie Mae-Aces, Serie 2018 M15, Klasse 1A2, 3,700 %, fällig 25.01.2036	363	0,18	90 Freddie Mac Pool „RB5145“, 2,000 %, fällig 01.02.2042	74	0,04
165 Fannie Mae-Aces, Serie 2018 M9, Klasse APT2, 3,209 %, fällig 25.04.2028 *	154	0,08	184 Freddie Mac Pool „RB5166“, 3,000 %, fällig 01.07.2042	162	0,08
533 Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M36, Klasse X1, 1,541 %, fällig 25.09.2034 *	34	0,02	469 Freddie Mac Pool „SC0313“, 2,000 %, fällig 01.01.2042	390	0,19
9 Freddie Mac Gold Pool „G06409“, 6,000 %, fällig 01.11.2039	9	-	287 Freddie Mac Pool „SC0340“, 3,000 %, fällig 01.09.2042	253	0,12
4 Freddie Mac Gold Pool „G06669“, 6,500 %, fällig 01.09.2039	4	-	196 Freddie Mac Pool „SC0384“, 2,000 %, fällig 01.04.2042	165	0,08
153 Freddie Mac Gold Pool „G61637“, 3,000 %, fällig 01.09.2047	133	0,07	71 Freddie Mac Pool „SD0573“, 2,000 %, fällig 01.04.2051	58	0,03
20 Freddie Mac Gold Pool „Q17792“, 3,500 %, fällig 01.05.2043	19	0,01	88 Freddie Mac Pool „SD0615“, 4,500 %, fällig 01.01.2051	85	0,04
36 Freddie Mac Gold Pool „Q29184“, 4,000 %, fällig 01.10.2044	35	0,02	87 Freddie Mac Pool „SD0745“, 2,000 %, fällig 01.11.2051	71	0,03
38 Freddie Mac Gold Pool „Q45560“, 3,000 %, fällig 01.01.2047	33	0,02	88 Freddie Mac Pool „SD0849“, 2,500 %, fällig 01.01.2052	74	0,04
77 Freddie Mac Gold Pool „Q45737“, 3,000 %, fällig 01.01.2047	68	0,03	273 Freddie Mac Pool „SD0857“, 2,500 %, fällig 01.01.2052	228	0,11
43 Freddie Mac Gold Pool „Q45819“, 3,000 %, fällig 01.01.2047	37	0,02	946 Freddie Mac Pool „SD1218“, 4,000 %, fällig 01.07.2049	886	0,44
15 Freddie Mac Gold Pool „U90316“, 4,000 %, fällig 01.10.2042	14	0,01	188 Freddie Mac Pool „SD1549“, 3,500 %, fällig 01.04.2052	169	0,08
48 Freddie Mac Gold Pool „U99124“, 3,500 %, fällig 01.03.2045	44	0,02	96 Freddie Mac Pool „SD1807“, 4,500 %, fällig 01.07.2052	92	0,04
2.491 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K124, Klasse X1, 0,810 %, fällig 25.12.2030 *	102	0,05	190 Freddie Mac Pool „SD1936“, 3,500 %, fällig 01.06.2052	170	0,08
3.494 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K130, Klasse X1, 1,143 %, fällig 25.06.2031 *	218	0,11	98 Freddie Mac Pool „SD2245“, 5,500 %, fällig 01.12.2052	97	0,05
90 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate Q006, Klasse A2, 4,139 %, fällig 25.04.2028 *	82	0,04	93 Freddie Mac Pool „SD2284“, 6,000 %, fällig 01.12.2052	94	0,05
10.000 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate, Serie K 157, Klasse X1, 0,419 %, fällig 25.05.2033 *	234	0,11	97 Freddie Mac Pool „SD2394“, 4,500 %, fällig 01.11.2052	92	0,05
100 Freddie Mac Multifamily WI-Zertifikate Serie WI-K159 K159, Klasse A2, 4,500 %, fällig 25.11.2033	97	0,05	94 Freddie Mac Pool „SD2395“, 5,000 %, fällig 01.01.2053	92	0,04
71 Freddie Mac Non Gold Pool „84069“, 2,104 %, fällig 01.03.2047 *	67	0,03	98 Freddie Mac Pool „SD2443“, 4,500 %, fällig 01.10.2052	93	0,05
350 Freddie Mac Non Gold Pool „841076“, 3,008 %, fällig 01.11.2048 *	328	0,16	93 Freddie Mac Pool „SD2452“, 6,500 %, fällig 01.02.2053	95	0,05
112 Freddie Mac Non Gold Pool „841077“, 2,871 %, fällig 01.11.2047 *	106	0,05	97 Freddie Mac Pool „SD2591“, 5,000 %, fällig 01.03.2053	94	0,05
112 Freddie Mac Non Gold Pool „841081“, 3,099 %, fällig 01.02.2050 *	106	0,05	97 Freddie Mac Pool „SD2688“, 5,500 %, fällig 01.04.2053	96	0,05
370 Freddie Mac Pool „QB3535“, 2,000 %, fällig 01.09.2050	297	0,15	96 Freddie Mac Pool „SD2723“, 5,500 %, fällig 01.03.2053	96	0,05
75 Freddie Mac Pool „QB4985“, 2,000 %, fällig 01.11.2050	60	0,03	98 Freddie Mac Pool „SD2762“, 5,500 %, fällig 01.05.2053	97	0,05
74 Freddie Mac Pool „QB5092“, 2,500 %, fällig 01.11.2050	62	0,03	95 Freddie Mac Pool „SD2792“, 4,500 %, fällig 01.03.2047	92	0,05
76 Freddie Mac Pool „QB5093“, 2,500 %, fällig 01.11.2050	64	0,03	97 Freddie Mac Pool „SD2892“, 5,500 %, fällig 01.05.2053	96	0,05
69 Freddie Mac Pool „QB8604“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	56	0,03	196 Freddie Mac Pool „SD2919“, 5,500 %, fällig 01.04.2053	193	0,09
287 Freddie Mac Pool „QB9087“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	232	0,11	99 Freddie Mac Pool „SD2961“, 5,000 %, fällig 11.01.2052	96	0,05
76 Freddie Mac Pool „QB9482“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	61	0,03	477 Freddie Mac Pool „SD2981“, 6,500 %, fällig 01.05.2053	485	0,24
85 Freddie Mac Pool „QC3690“, 2,500 %, fällig 01.07.2051	71	0,03	388 Freddie Mac Pool „SD3171“, 5,500 %, fällig 01.06.2053	384	0,19
87 Freddie Mac Pool „QC4824“, 2,500 %, fällig 01.08.2051	73	0,04	200 Freddie Mac Pool „SD3382“, 5,000 %, fällig 01.06.2053	194	0,10
258 Freddie Mac Pool „QC5830“, 2,500 %, fällig 01.08.2051	217	0,11	299 Freddie Mac Pool „SD3400“, 4,500 %, fällig 01.10.2052	283	0,14
91 Freddie Mac Pool „QC9154“, 3,000 %, fällig 01.10.2051	80	0,04	47 Freddie Mac Pool „SD7509“, 3,000 %, fällig 01.11.2049	41	0,02
89 Freddie Mac Pool „QC9443“, 2,500 %, fällig 01.10.2051	74	0,04	140 Freddie Mac Pool „SD7525“, 2,500 %, fällig 01.10.2050	118	0,06
92 Freddie Mac Pool „QD5827“, 2,000 %, fällig 01.02.2052	74	0,04	149 Freddie Mac Pool „SD7534“, 2,500 %, fällig 01.02.2051	126	0,06
			566 Freddie Mac Pool „SD7548“, 2,500 %, fällig 11.01.2051	475	0,23
			193 Freddie Mac Pool „SD7560“, 4,000 %, fällig 01.02.2053	180	0,09
			620 Freddie Mac Pool „SD8121“, 2,000 %, fällig 01.01.2051	496	0,24
			281 Freddie Mac Pool „SD8209“, 1,500 %, fällig 01.03.2052	212	0,10
			93 Freddie Mac Pool „SD8214“, 3,500 %, fällig 01.05.2052	83	0,04
			100 Freddie Mac Pool „WN1227“, 4,650 %, fällig 01.01.2033	98	0,05
			300 Freddie Mac Pool „WN2371“, 4,600 %, fällig 01.02.2030	291	0,14
			100 Freddie Mac Pool „WN2372“, 4,600 %, fällig 01.02.2030	97	0,05
			45 Freddie Mac Pool „ZA2489“, 3,500 %, fällig 01.01.2038	42	0,02
			7 Freddie Mac Pool „Z17269“, 5,000 %, fällig 01.03.2038	7	-
			25 Freddie Mac Pool „ZN0538“, 3,500 %, fällig 01.11.2042	23	0,01
			15 Freddie Mac Pool „ZN1436“, 5,000 %, fällig 01.11.2048	15	0,01
			4 Freddie Mac Pool „ZS3059“, 5,500 %, fällig 01.12.2038	4	-
			7 Freddie Mac Pool „ZS3569“, 6,000 %, fällig 01.10.2036	7	-
			46 Freddie Mac Pool „ZT1257“, 3,000 %, fällig 01.01.2046	41	0,02
			4 Freddie Mac REMICS 3621, Klasse SB, 0,927 %, fällig 15.01.2040 *	-	-
			21 Freddie Mac REMICS 3947, Klasse SG, 0,647 %, fällig 15.10.2041 *	2	-
			12 Freddie Mac REMICS 4194, Klasse BI, 3,500 %, fällig 15.04.2043	2	-
			2 Freddie Mac REMICS 4298, Klasse PI, 4,000 %, fällig 15.04.2043	-	-
			28 Freddie Mac REMICS 4813, Klasse CJ, 3,000 %, fällig 15.08.2048	24	0,01
			66 Freddie Mac REMICS 5010, Klasse IK, 2,500 %, fällig 25.09.2050	10	-
			238 Freddie Mac REMICS 5010, Klasse JI, 2,500 %, fällig 25.09.2050	41	0,02

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## FTGF Western Asset US Core Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert		
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)</b>							
81	Freddie Mac REMICS 5013, Klasse IN, 2,500 %, fällig 25.09.2050	13	0,01	19	Ginnie Mae II Pool „MA5194“, 5,000 %, fällig 20.05.2048	19	0,01
167	Freddie Mac REMICS 5018, Klasse MI, 2,000 %, fällig 25.10.2050	22	0,01	78	Ginnie Mae II Pool „MA5265“, 4,500 %, fällig 20.06.2048	75	0,04
394	Freddie Mac REMICS 5038, Klasse PJ, 0,750 %, fällig 25.10.2050	277	0,14	37	Ginnie Mae II Pool „MA5331“, 4,500 %, fällig 20.07.2048	36	0,02
71	Freddie Mac REMICS 5040, Klasse IB, 2,500 %, fällig 25.11.2050	12	0,01	59	Ginnie Mae II Pool „MA5529“, 4,500 %, fällig 20.10.2048	57	0,03
337	Freddie Mac REMICS 5059, Klasse IB, 2,500 %, fällig 25.01.2051	53	0,03	16	Ginnie Mae II Pool „MA5597“, 5,000 %, fällig 20.11.2048	16	0,01
75	Freddie Mac REMICS 5069, Klasse MI, 2,500 %, fällig 25.02.2051	11	0,01	26	Ginnie Mae II Pool „MA5652“, 4,500 %, fällig 20.12.2048	25	0,01
426	Freddie Mac REMICS 5085, Klasse NI, 2,000 %, fällig 25.03.2051	50	0,02	48	Ginnie Mae II Pool „MA5653“, 5,000 %, fällig 20.12.2048	47	0,02
80	Freddie Mac REMICS 5092, Klasse AP, 2,000 %, fällig 25.04.2041	68	0,03	335	Ginnie Mae II Pool „MA5711“, 4,500 %, fällig 20.01.2049	324	0,16
176	Freddie Mac REMICS 5140, Klasse NI, 2,500 %, fällig 25.05.2049	25	0,01	15	Ginnie Mae II Pool „MA5712“, 5,000 %, fällig 20.01.2049	15	0,01
200	Freddie Mac REMICS 5224, Klasse HL, 4,000 %, fällig 25.04.2052	179	0,09	14	Ginnie Mae II Pool „MA5762“, 3,500 %, fällig 20.02.2049	13	0,01
420	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, Serie 2022 DNA3, Klasse M1B, 144A, 8,188 %, fällig 25.04.2042 *	428	0,21	42	Ginnie Mae II Pool „MA5763“, 4,000 %, fällig 20.02.2049	39	0,02
68	Strukturierte Pass-Through-Zertifikate von Freddie Mac, Serie T 56, Klasse 2AF, 5,802 %, fällig 25.05.2043 *	67	0,03	78	Ginnie Mae II Pool „MA5818“, 4,500 %, fällig 20.03.2049	75	0,04
16	Ginnie Mae I Pool „557522“, 7,000 %, fällig 15.07.2031	17	0,01	19	Ginnie Mae II Pool „MA5878“, 5,000 %, fällig 20.04.2049	19	0,01
10	Ginnie Mae I Pool „565347“, 7,000 %, fällig 15.08.2031	9	-	17	Ginnie Mae II Pool „MA6287“, 5,000 %, fällig 20.11.2049	17	0,01
3	Ginnie Mae I Pool „584344“, 7,000 %, fällig 15.04.2032	3	-	38	Ginnie Mae II Pool „MA6413“, 5,000 %, fällig 20.01.2050	38	0,02
62	Ginnie Mae I Pool „784571“, 3,500 %, fällig 15.06.2048	58	0,03	87	Ginnie Mae II Pool „MA6933“, 3,500 %, fällig 20.10.2050	80	0,04
35	Ginnie Mae I Pool „AA5649“, 3,000 %, fällig 15.09.2042	32	0,02	205	Ginnie Mae II Pool „MA7056“, 4,500 %, fällig 20.12.2050	198	0,10
52	Ginnie Mae I Pool „AB2892“, 3,000 %, fällig 15.09.2042	46	0,02	66	Ginnie Mae II Pool „MA7192“, 2,000 %, fällig 20.02.2051	54	0,03
115	Ginnie Mae I Pool „AB9108“, 3,000 %, fällig 15.10.2042	104	0,05	64	Ginnie Mae II Pool „MA7193“, 2,500 %, fällig 20.02.2051	54	0,03
7	Ginnie Mae II Pool „4837“, 6,000 %, fällig 20.10.2040	7	-	251	Ginnie Mae II Pool „MA7589“, 2,500 %, fällig 20.09.2051	214	0,11
6	Ginnie Mae II Pool „4923“, 4,500 %, fällig 20.01.2041	6	-	315	Ginnie Mae II Pool „MA7590“, 3,000 %, fällig 20.09.2051	278	0,14
4	Ginnie Mae II Pool „4961“, 6,000 %, fällig 20.02.2041	4	-	86	Ginnie Mae II Pool „MA7705“, 2,500 %, fällig 20.11.2051	73	0,04
15	Ginnie Mae II Pool „4978“, 4,500 %, fällig 20.03.2041	15	0,01	603	Ginnie Mae II Pool „MA7768“, 3,000 %, fällig 20.12.2051	532	0,26
8	Ginnie Mae II Pool „5240“, 6,000 %, fällig 20.11.2041	8	-	87	Ginnie Mae II Pool „MA7828“, 3,000 %, fällig 20.01.2052	77	0,04
13	Ginnie Mae II Pool „784106“, 3,500 %, fällig 20.01.2046	12	0,01	94	Ginnie Mae II Pool „MA8045“, 4,000 %, fällig 20.05.2052	88	0,04
445	Ginnie Mae II Pool „784577“, 4,000 %, fällig 20.07.2047	420	0,21	92	Ginnie Mae II Pool „MA8197“, 2,500 %, fällig 20.08.2052	78	0,04
11	Ginnie Mae II Pool „784825“, 3,500 %, fällig 20.10.2049	10	-	96	Ginnie Mae II Pool „MA8268“, 4,500 %, fällig 20.09.2052	92	0,04
121	Ginnie Mae II Pool „784905“, 3,000 %, fällig 20.01.2050	107	0,05	193	Ginnie Mae II Pool „MA8428“, 5,000 %, fällig 20.11.2052	188	0,09
24	Ginnie Mae II Pool „784985“, 3,500 %, fällig 20.09.2048	22	0,01	191	Ginnie Mae II Pool „MA8429“, 5,500 %, fällig 20.10.2052	190	0,09
25	Ginnie Mae II Pool „785359“, 2,000 %, fällig 20.03.2051	46	0,02	284	Ginnie Mae II Pool „MA8486“, 3,000 %, fällig 20.12.2052	251	0,12
85	Ginnie Mae II Pool „785360“, 2,000 %, fällig 20.03.2051	68	0,03	195	Ginnie Mae II Pool „MA8487“, 3,500 %, fällig 20.12.2052	177	0,09
330	Ginnie Mae II Pool „785558“, 2,500 %, fällig 20.07.2051	278	0,14	96	Ginnie Mae II Pool „MA8642“, 2,500 %, fällig 20.02.2053	82	0,04
169	Ginnie Mae II Pool „785565“, 2,500 %, fällig 20.06.2051	142	0,07	99	Ginnie Mae II Pool „MA8725“, 5,000 %, fällig 20.03.2053	96	0,05
166	Ginnie Mae II Pool „785568“, 2,500 %, fällig 20.08.2051	140	0,07	98	Ginnie Mae II Pool „MA8727“, 6,000 %, fällig 20.03.2053	99	0,05
172	Ginnie Mae II Pool „785657“, 2,500 %, fällig 20.10.2051	145	0,07	194	Ginnie Mae II Pool „MA8796“, 3,000 %, fällig 20.04.2053	171	0,08
84	Ginnie Mae II Pool „785663“, 2,500 %, fällig 20.10.2051	71	0,03	300	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,000 % ±	248	0,12
87	Ginnie Mae II Pool „785667“, 2,500 %, fällig 20.10.2051	73	0,04	1.000	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 % ±	851	0,42
176	Ginnie Mae II Pool „785762“, 2,500 %, fällig 20.11.2051	148	0,07	1.400	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,000 % ±	1.231	0,60
175	Ginnie Mae II Pool „785789“, 2,500 %, fällig 20.12.2051	148	0,07	2.000	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,500 % ±	1.090	0,54
344	Ginnie Mae II Pool „785791“, 2,500 %, fällig 20.12.2051	288	0,14	500	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 4,000 % ±	466	0,23
268	Ginnie Mae II Pool „785821“, 2,500 %, fällig 20.12.2051	226	0,11	900	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 4,500 % ±	858	0,42
89	Ginnie Mae II Pool „785944“, 3,000 %, fällig 20.02.2052	79	0,04	1.100	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 % ±	1.070	0,53
93	Ginnie Mae II Pool „786095“, 3,000 %, fällig 20.04.2052	80	0,04	800	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,500 % ±	792	0,39
95	Ginnie Mae II Pool „786108“, 3,500 %, fällig 20.03.2052	86	0,04	500	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 6,000 % ±	502	0,25
167	Ginnie Mae II Pool „786134“, 3,000 %, fällig 20.04.2052	145	0,07	100	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 6,500 % ±	101	0,05
97	Ginnie Mae II Pool „786474“, 5,000 %, fällig 20.01.2053	95	0,05	5	Government National Mortgage Association, Serie 2007 51, Klasse SG, 1,152 %, fällig 20.08.2037 *	-	-
772	Ginnie Mae II Pool „786583“, 3,000 %, fällig 20.03.2052	681	0,33	7	Government National Mortgage Association, Serie 2009 H01, Klasse FA, 6,578 %, fällig 20.11.2059 *	7	-
98	Ginnie Mae II Pool „786709“, 5,000 %, fällig 20.05.2053	96	0,05	1	Government National Mortgage Association, Serie 2010 85, Klasse HS, 1,222 %, fällig 20.01.2040 *	-	-
100	Ginnie Mae II Pool „786843“, 3,000 %, fällig 20.03.2052	87	0,04	15	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H26, Klasse LF, 5,605 %, fällig 20.08.2058 *	14	0,01
25	Ginnie Mae II Pool „BC4732“, 3,500 %, fällig 20.10.2047	23	0,01	25	Government National Mortgage Association, Serie 2011 H01, Klasse AF, 5,705 %, fällig 20.11.2060 *	24	0,01
29	Ginnie Mae II Pool „BM7534“, 3,500 %, fällig 20.02.2050	26	0,01	30	Government National Mortgage Association, Serie 2011 H09, Klasse AF, 5,755 %, fällig 20.03.2061 *	30	0,01
73	Ginnie Mae II Pool „BM9743“, 4,000 %, fällig 20.11.2049	68	0,03	78	Government National Mortgage Association, Serie 2012 112, Klasse IO, 0,116 %, fällig 16.02.2053 *	-	-
31	Ginnie Mae II Pool „BS1742“, 4,000 %, fällig 20.02.2050	30	0,01	39	Government National Mortgage Association, Serie 2012 27, Klasse IO, 0,238 %, fällig 16.04.2053 *	-	-
106	Ginnie Mae II Pool „BT0812“, 3,000 %, fällig 20.03.2050	91	0,04	17	Government National Mortgage Association, Serie 2012 34, Klasse SA, 0,622 %, fällig 20.03.2042 *	2	-
28	Ginnie Mae II Pool „MA1995“, 3,500 %, fällig 20.06.2044	26	0,01	20	Government National Mortgage Association, Serie 2012 44, Klasse IO, 0,029 %, fällig 16.03.2049 *	-	-
10	Ginnie Mae II Pool „MA2678“, 3,500 %, fällig 20.03.2045	9	-	12	Government National Mortgage Association, Serie 2012 H18, Klasse NA, 5,775 %, fällig 20.08.2062 *	11	0,01
104	Ginnie Mae II Pool „MA3521“, 3,500 %, fällig 20.03.2046	96	0,05	29	Government National Mortgage Association, Serie 2012 H27, Klasse AI, 1,744 %, fällig 20.10.2062 *	1	-
56	Ginnie Mae II Pool „MA3597“, 3,500 %, fällig 20.04.2046	51	0,02	13	Government National Mortgage Association, Serie 2012 H30, Klasse GA, 5,605 %, fällig 20.12.2062 *	13	0,01
14	Ginnie Mae II Pool „MA3663“, 3,500 %, fällig 20.05.2046	13	0,01	75	Government National Mortgage Association, Serie 2013 107, Klasse AD, 2,840 %, fällig 16.11.2047 *	67	0,03
43	Ginnie Mae II Pool „MA3736“, 3,500 %, fällig 20.06.2046	40	0,02	18	Government National Mortgage Association, Serie 2013 163, Klasse IO, 1,012 %, fällig 16.02.2046 *	-	-
14	Ginnie Mae II Pool „MA3803“, 3,500 %, fällig 20.07.2046	13	0,01	54	Government National Mortgage Association, Serie 2013 H08, Klasse BF, 5,655 %, fällig 20.03.2063 *	53	0,03
83	Ginnie Mae II Pool „MA3873“, 3,000 %, fällig 20.08.2046	74	0,04	38	Government National Mortgage Association, Serie 2014 105, Klasse IO, 0,125 %, fällig 16.06.2054 *	-	-
16	Ginnie Mae II Pool „MA3937“, 3,500 %, fällig 20.09.2046	15	0,01	8	Government National Mortgage Association, Serie 2014 17, Klasse AM, 3,537 %, fällig 16.06.2048 *	7	-
18	Ginnie Mae II Pool „MA4068“, 3,000 %, fällig 20.11.2046	16	0,01	10	Government National Mortgage Association, Serie 2014 47, Klasse IA, 0,148 %, fällig 16.02.2048 *	-	-
21	Ginnie Mae II Pool „MA4261“, 3,000 %, fällig 20.02.2047	18	0,01	49	Government National Mortgage Association, Serie 2014 50, Klasse IO, 0,628 %, fällig 16.09.2055 *	1	-
148	Ginnie Mae II Pool „MA4511“, 4,000 %, fällig 20.06.2047	140	0,07				
125	Ginnie Mae II Pool „MA4719“, 3,500 %, fällig 20.09.2047	115	0,06				
11	Ginnie Mae II Pool „MA4899“, 3,000 %, fällig 20.12.2047	10	-				
10	Ginnie Mae II Pool „MA5018“, 3,000 %, fällig 20.02.2048	9	-				
99	Ginnie Mae II Pool „MA5019“, 3,500 %, fällig 20.02.2048	91	0,04				
95	Ginnie Mae II Pool „MA5078“, 4,000 %, fällig 20.03.2048	90	0,04				

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US Core Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)</b>					
247			160		
Government National Mortgage Association, Serie 2014 92, Klasse IX, 0,101 %, fällig 16.05.2054 *	1	-	New Residential Mortgage Loan Trust 2015-2, Serie 2015 2A, Klasse A1, 144A, 3,750 %, fällig 25.08.2055 *	148	0,07
391			239		
Government National Mortgage Association, Serie 2014 H20, Klasse FA, 5,648 %, fällig 20.10.2064 *	388	0,19	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Serie 2016 3A, Klasse A1B, 144A, 3,250 %, fällig 25.09.2056 *	217	0,11
44			239		
Government National Mortgage Association, Serie 2015 167, Klasse OI, 4,000 %, fällig 16.04.2045	8	-	New Residential Mortgage Loan Trust 2017-2, Serie 2017 2A, Klasse B1, 144A, 4,500 %, fällig 25.03.2057 *	221	0,11
29			264		
Government National Mortgage Association, Serie 2015 36, Klasse MI, 5,500 %, fällig 20.03.2045	5	-	New Residential Mortgage Loan Trust 2018-3, Serie 2018 3A, Klasse A1, 144A, 4,500 %, fällig 25.05.2058 *	252	0,12
536			174		
Government National Mortgage Association, Serie 2015 5, Klasse IK, 0,277 %, fällig 16.11.2054 *	4	-	New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Serie 2021 NQ2R, Klasse A3, 144A, 1,353 %, fällig 25.10.2058 *	155	0,08
262			5		
Government National Mortgage Association, Serie 2016 128, Klasse IO, 0,736 %, fällig 16.09.2056 *	9	-	Thornburg Mortgage Securities Trust 2007-4, Serie 2007 4, Klasse 1A1, 3,827 %, fällig 25.09.2037 *	5	-
74			300		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 123, Klasse IL, 2,500 %, fällig 20.08.2050	10	-	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C15, Serie 2018 C15, Klasse C, 5,323 %, fällig 15.12.2051 *	243	0,12
153			289		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 123, Klasse NI, 2,500 %, fällig 20.08.2050	21	0,01	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, Serie 2016 C36, Klasse A3, 2,807 %, fällig 15.11.2059	266	0,13
74			150		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 127, Klasse IN, 2,500 %, fällig 20.08.2050	10	-	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, Serie 2016 C36, Klasse A4, 3,065 %, fällig 15.11.2059	137	0,07
78			1.379		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 129, Klasse IE, 2,500 %, fällig 20.09.2050	11	-	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2018-C36, Serie 2018 C36, Klasse XA, 1,301 %, fällig 15.11.2059 *	38	0,02
80			460		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Klasse IH, 2,500 %, fällig 20.10.2050	11	0,01	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C41, Serie 2017 C41, Klasse B, 4,188 %, fällig 15.11.2050 *	377	0,18
77			1.501		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Klasse VI, 2,500 %, fällig 20.10.2050	11	0,01	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C23, Serie 2014 C23, Klasse XA, 0,693 %, fällig 15.10.2057 *	5	-
313			2		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Klasse YI, 2,500 %, fällig 20.10.2050	42	0,02	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14, Serie 2014 LC14, Klasse ASB, 3,522 %, fällig 15.03.2047	2	-
4.383			<b>Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 88.667 USD)</b>		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 178, Klasse IO, 1,422 %, fällig 16.10.2060 *	399	0,20		84.186	41,38
3.216			<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 31,71 % (28. Februar 2023: 37,25 %)</b>		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 179, Klasse IO, 1,009 %, fällig 16.09.2062 *	229	0,11	<b>Australien – 0,03 % (28. Februar 2023: 0,05 %)</b>		
373			70 BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000 %, fällig 30.09.2043		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 181, Klasse WI, 2,000 %, fällig 20.12.2050	41	0,02		68	0,03
1.653			<b>Belgien – 0,39 % (28. Februar 2023: 0,45 %)</b>		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 195, Klasse IO, 0,926 %, fällig 16.12.2062 *	108	0,05	110 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,650 %, fällig 01.02.2026		
253			230 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,000 %, fällig 13.04.2028		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 47, Klasse MI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	43	0,02	60 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, fällig 01.06.2030		
71			300 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig 01.06.2040		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 47, Klasse NI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	12	0,01	15 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, fällig 15.04.2048		
176			100 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,439 %, fällig 06.10.2048		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 H04, Klasse FP, 5,169 %, fällig 20.06.2069 *	175	0,09	30 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, fällig 23.01.2049		
185				31	0,02
Government National Mortgage Association, Serie 2020 H09, Klasse FL, 4,850 %, fällig 20.05.2070 *	186	0,09		784	0,39
108			<b>Brasilien – 0,77 % (28. Februar 2023: 0,57 %)</b>		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 H09, Klasse NF, 6,468 %, fällig 20.04.2070 *	109	0,05	10 Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, fällig 17.03.2024		
64			50 Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig 05.06.2115		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 H13, Klasse FA, 4,989 %, fällig 20.07.2070 *	62	0,03	1.100 Suzano Austria GmbH, 6,000 %, fällig 15.01.2029		
5.902			20 Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 21.11.2036		
Government National Mortgage Association, Serie 2021 10, Klasse IO, 0,986 %, fällig 16.05.2063 *	408	0,20	390 Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 10.11.2039		
159				1.574	0,77
Government National Mortgage Association, Serie 2021 115, Klasse MI, 2,500 %, fällig 20.05.2051	17	0,01	<b>Kanada – 0,39 % (28. Februar 2023: 0,83 %)</b>		
436			130 Bank of Montreal, 1,850 %, fällig 01.05.2025		
Government National Mortgage Association, Serie 2021 188, Klasse PA, 2,000 %, fällig 20.10.2051	361	0,18	30 Bank of Montreal, 3,803 %, fällig 15.12.2032 *		
169			80 Bank of Nova Scotia/The, 3,450 %, fällig 11.04.2025		
Government National Mortgage Association, Serie 2021 2, Klasse AH, 1,500 %, fällig 16.06.2063	126	0,06	240 Bank of Nova Scotia/The, 1,300 %, fällig 11.06.2025		
88			70 Bank of Nova Scotia/The, 4,588 %, fällig 04.05.2037 *		
Government National Mortgage Association, Serie 2021 223, Klasse P, 2,000 %, fällig 20.06.2051	75	0,04	80 Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, fällig 30.05.2041		
4.990			40 Barrick PD Australia Finance Pty Ltd, 5,950 %, fällig 15.10.2039		
Government National Mortgage Association, Serie 2021 5, Klasse IO, 1,112 %, fällig 16.01.2061 *	367	0,18	60 Royal Bank of Canada, 1,150 %, fällig 10.06.2025		
200			110 Royal Bank of Canada, 3,875 %, fällig 04.05.2032		
Government National Mortgage Association, Serie 2022 3, Klasse B, 1,850 %, fällig 16.02.2061	101	0,05		785	0,39
874			<b>Chile – 0,32 % (28. Februar 2023: 0,28 %)</b>		
Government National Mortgage Association, Serie 2022 3, Klasse IO, 0,640 %, fällig 16.02.2061 *	44	0,02	710 Corp Nacional del Cobre de Chile, 3,625 %, fällig 01.08.2027		
100			<b>China – 0,37 % (28. Februar 2023: 0,45 %)</b>		
Government National Mortgage Association, Serie 2022 63, Klasse LM, 3,500 %, fällig 20.10.2050	83	0,04	120 NXP BV/NXP Funding LLC, NXP USA Inc, 2,700 %, fällig 01.05.2025		
300			670 Prosus NV, 144A, 4,027 %, fällig 03.08.2050		
Government National Mortgage Association, Serie 2023 92, Klasse AH, 2,000 %, fällig 16.06.2064	229	0,11	250 Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd, 4,375 %, fällig 10.04.2024		
570				760	0,37
GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-3PCK, Serie 2018 3PCK, Klasse B, 144A, 8,174 %, fällig 15.09.2031 *	555	0,27	<b>Kolumbien – 0,23 % (28. Februar 2023: 0,33 %)</b>		
466			650 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045		
GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Klasse A, 144A, 7,225 %, fällig 15.09.2031 *	387	0,19	<b>Dänemark – 0,29 % (28. Februar 2023: 0,30 %)</b>		
71			200 Danske Bank A/S, 144A, 3,875 %, fällig 12.09.2023		
HarborView Mortgage Loan Trust 2005-9, Serie 2005 9, Klasse 2A1B, 6,168 %, fällig 20.06.2035 *	64	0,03	398 Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, fällig 12.01.2024		
450				598	0,29
Independence Plaza Trust 2018-INDP, Serie 2018 INDP, Klasse A, 144A, 3,763 %, fällig 10.07.2035	423	0,21			
10					
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17, Serie 2013 C17, Klasse B, 5,039 %, fällig 15.01.2047 *	9	-			
120					
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23, Serie 2014 C23, Klasse AS, 4,202 %, fällig 15.09.2047 *	116	0,06			
430					
Mill City Mortgage Trust 2015-2, Serie 2015 2, Klasse M3, 144A, 3,705 %, fällig 25.09.2057 *	416	0,20			
100					
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C18, Serie 2014 C18, Klasse AS, 4,110 %, fällig 15.10.2047 *	96	0,05			
302					
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C30, Serie 2016 C30, Klasse A4, 2,600 %, fällig 15.09.2049	277	0,14			
217					
Morgan Stanley Capital I Trust 2017-ASHF, Serie 2017 ASHF, Klasse A, 144A, 6,333 %, fällig 15.11.2034 *	214	0,11			
550					
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Klasse A, 144A, 3,047 %, fällig 15.08.2036	483	0,24			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Western Asset US Core Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>Frankreich – 0,67 % (28. Februar 2023: 0,73 %)</b>					
400 BNP Paribas SA, 144A, 4,705 %, fällig 10.01.2025 *	398	0,20			
400 BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, fällig 09.06.2026 *	374	0,18			
200 BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, fällig 14.08.2028	189	0,09			
410 BNP Paribas SA, 144A, 5,125 %, fällig 13.01.2029 *	402	0,20			
	1.363	0,67			
<b>Indien – 0,09 % (28. Februar 2023: 0,14 %)</b>					
270 Reliance Industries Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 01.12.2052	184	0,09			
<b>Irland – 0,26 % (28. Februar 2023: 0,29 %)</b>					
230 AerCap Ireland Capital DAC. AerCap Global Aviation Trust, 2,450 %, fällig 29.10.2026	207	0,10			
360 AerCap Ireland Capital DAC. AerCap Global Aviation Trust, 3,000 %, fällig 29.10.2028	312	0,16			
	519	0,26			
<b>Japan – 0,19 % (28. Februar 2023: 0,15 %)</b>					
400 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3,837 %, fällig 17.04.2026 *	387	0,19			
<b>Kasachstan – 0,25 % (28. Februar 2023: 0,44 %)</b>					
560 KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, fällig 24.04.2030	510	0,25			
<b>Macau – 0,10 % (28. Februar 2023: 0,15 %)</b>					
200 Sands China Ltd, 5,375 %, fällig 08.08.2025	194	0,10			
<b>Mexiko – 0,60 % (28. Februar 2023: 0,62 %)</b>					
400 Comision Federal de Electricidad, 144A, 3,875 %, fällig 26.07.2033	312	0,15			
450 Orbia Advance Corp SAB de CV, 144A, 2,875 %, fällig 11.05.2031	358	0,18			
590 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	546	0,27			
	1.216	0,60			
<b>Niederlande – 0,60 % (28. Februar 2023: 0,65 %)</b>					
500 Cooperatieve Rabobank UA, 4,375 %, fällig 04.08.2025	485	0,24			
260 Cooperatieve Rabobank UA/NY, 3,375 %, fällig 21.05.2025	251	0,12			
180 Shell International Finance BV, 2,750 %, fällig 06.04.2030	159	0,08			
10 Shell International Finance BV, 4,550 %, fällig 12.08.2043	9	-			
260 Shell International Finance BV, 4,000 %, fällig 10.05.2046	214	0,11			
150 Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06.04.2050	107	0,05			
	1.225	0,60			
<b>Peru – 0,21 % (28. Februar 2023: 0,33 %)</b>					
400 Petroleos del Peru SA, 4,750 %, fällig 19.06.2032	297	0,15			
200 Petroleos del Peru SA, 144A, 5,625 %, fällig 19.06.2047	128	0,06			
	425	0,21			
<b>Südafrika – 0,23 % (28. Februar 2023: 0,21 %)</b>					
490 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig 10.04.2027	475	0,23			
<b>Spanien – 0,50 % (28. Februar 2023: 0,52 %)</b>					
800 Banco Santander SA, 2,746 %, fällig 28.05.2025	757	0,37			
300 Telefonica Emisiones SA, 5,213 %, fällig 08.03.2047	252	0,13			
	1.009	0,50			
<b>Schweiz – 1,02 % (28. Februar 2023: 1,25 %)</b>					
620 Credit Suisse AG, New York NY, 7,950 %, fällig 09.01.2025	632	0,31			
250 Credit Suisse AG, New York NY, 2,950 %, fällig 09.04.2025	238	0,12			
400 UBS Group AG, 144A, 3,126 %, fällig 13.08.2030 *	343	0,17			
500 UBS Group AG, 144A, 4,194 %, fällig 01.04.2031 *	451	0,22			
500 UBS Group AG, 144A, 3,091 %, fällig 14.05.2032 *	412	0,20			
	2.076	1,02			
<b>Taiwan – 0,23 % (28. Februar 2023: 0,36 %)</b>					
570 TSMC Arizona Corp, 2,500 %, fällig 25.10.2031	475	0,23			
<b>Vereinigte Arabische Emirate – 0,30 % (28. Februar 2023: 0,54 %)</b>					
650 DP World Ltd/Vereinigte Arabische Emirate, 144A, 5,625 %, fällig 25.09.2048	602	0,30			
<b>Vereinigtes Königreich – 1,11 % (28. Februar 2023: 1,57 %)</b>					
200 Barclays Plc, 4,972 %, fällig 16.05.2029 *	190	0,09			
400 HSBC Holdings Plc, 2,633 %, fällig 07.11.2025 *	384	0,19			
350 HSBC Holdings Plc, 4,300 %, fällig 08.03.2026	338	0,17			
600 HSBC Holdings Plc, 4,041 %, fällig 13.03.2028	564	0,28			
200 Lloyds Banking Group Plc, 4,650 %, fällig 24.03.2026	193	0,10			
400 NatWest Group Plc, 4,269 %, fällig 22.03.2025	396	0,19			
200 NatWest Group Plc, 4,892 %, fällig 18/05.2029	191	0,09			
	2.256	1,11			
<b>USA – 22,56 % (28. Februar 2023: 25,89 %)</b>					
10 3M Co, 2,375 %, fällig 26.08.2029	9	-	10 AbbVie Inc, 4,875 %, fällig 14.11.2048	9	-
140 3M Co, 3,700 %, fällig 15.04.2050	108	0,05	70 AbbVie Inc, 4,250 %, fällig 21.11.2049	59	0,03
10 Abbott Laboratories, 4,750 %, fällig 30.11.2036	10	0,01	280 Adobe Inc, 2,300 %, fällig 01.02.2030	243	0,12
130 Abbott Laboratories, 4,900 %, fällig 30.11.2046	127	0,06	10 Aetna Inc, 3,875 %, fällig 15.08.2047	8	-
90 AbbVie Inc, 3,800 %, fällig 15.03.2025	88	0,04	150 Air Lease Corp, 3,375 %, fällig 01.07.2025	143	0,07
20 AbbVie Inc, 3,600 %, fällig 14.05.2025	19	0,01	70 Air Lease Corp, 5,300 %, fällig 01.02.2028	69	0,03
90 AbbVie Inc, 2,950 %, fällig 21.11.2026	84	0,04	320 Alphabet Inc, 1,100 %, fällig 15.08.2030	257	0,13
1.080 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21.11.2029	974	0,48	70 Alphabet Inc, 1,900 %, fällig 15.08.2040	47	0,02
			40 Alphabet Inc, 2,050 %, fällig 15.08.2050	24	0,01
			450 Amazon.com Inc, 3,150 %, fällig 22.08.2027	423	0,21
			60 Amazon.com Inc, 3,450 %, fällig 13.04.2029	57	0,03
			50 Amazon.com Inc, 1,500 %, fällig 03.06.2030	41	0,02
			80 Amazon.com Inc, 2,100 %, fällig 12.05.2031	66	0,03
			250 Amazon.com Inc, 3,600 %, fällig 13.04.2032	230	0,11
			80 Amazon.com Inc, 4,950 %, fällig 05.12.2044	79	0,04
			610 Amazon.com Inc, 2,500 %, fällig 03.06.2050	389	0,19
			30 Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig 22.08.2057	26	0,01
			290 American Express Co, 2,500 %, fällig 30.07.2024	282	0,14
			300 American Express Co, 4,050 %, fällig 03.05.2029	285	0,14
			16 American International Group Inc, 2,500 %, fällig 30.06.2025	15	0,01
			20 American International Group Inc, 4,750 %, fällig 01.04.2048	18	0,01
			30 American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, fällig 15.01.2032	25	0,01
			11 Amgen Inc, 4,663 %, fällig 15.06.2051	9	0,01
			320 Apple Inc, 1,125 %, fällig 11.05.2025	299	0,15
			270 Applied Materials Inc, 1,750 %, fällig 01.06.2030	223	0,11
			70 AT&T Inc, 3,800 %, fällig 15.02.2027	67	0,03
			40 AT&T Inc, 2,250 %, fällig 01.02.2032	31	0,02
			50 AT&T Inc, 2,550 %, fällig 01.12.2033	38	0,02
			10 AT&T Inc, 5,350 %, fällig 01.09.2040	9	-
			10 AT&T Inc, 5,550 %, fällig 15.08.2041	9	0,01
			37 AT&T Inc, 4,350 %, fällig 15.06.2045	29	0,01
			28 AT&T Inc, 4,500 %, fällig 09.03.2048	22	0,01
			160 AT&T Inc, 3,500 %, fällig 15.09.2053	105	0,05
			76 AT&T Inc, 3,550 %, fällig 15.09.2055	50	0,02
			10 AT&T Inc, 3,800 %, fällig 01.12.2057	7	-
			63 AT&T Inc, 3,650 %, fällig 15.09.2059	41	0,02
			650 Bank of America Corp, 4,000 %, fällig 22.01.2025	634	0,31
			10 Bank of America Corp, 4,450 %, fällig 03.03.2026	10	0,01
			260 Bank of America Corp, 1,319 %, fällig 19.06.2026 *	239	0,12
			160 Bank of America Corp, 4,250 %, fällig 22.10.2026	154	0,08
			90 Bank of America Corp, 3,593 %, fällig 21.07.2028 *	84	0,04
			193 Bank of America Corp, 3,419 %, fällig 20.12.2028 *	177	0,09
			220 Bank of America Corp, 3,970 %, fällig 05.03.2029 *	206	0,10
			200 Bank of America Corp, 3,974 %, fällig 07.02.2030 *	184	0,09
			210 Bank of America Corp, 2,592 %, fällig 29.04.2031 *	175	0,09
			130 Bank of America Corp, 2,572 %, fällig 20.10.2032 *	104	0,05
			960 Bank of America Corp, 2,972 %, fällig 04.02.2033 *	790	0,39
			140 Bank of America Corp, 5,000 %, fällig 21.01.2044	133	0,07
			130 Bank of America Corp, 3,946 %, fällig 23.01.2049 *	102	0,05
			180 Bank of America Corp, 4,083 %, fällig 20.03.2051 *	145	0,07
			30 Bank of New York Mellon Corp/The, 1,600 %, fällig 24.04.2025	28	0,01
			113 Becton Dickinson & Co, 4,685 %, fällig 15.12.2044	100	0,05
			110 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2049	97	0,05
			480 Boston Properties LP, 3,400 %, fällig 21.06.2029	411	0,20
			110 BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, fällig 04.05.2026	105	0,05
			210 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06.04.2030	194	0,10
			160 BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, fällig 24.02.2050	107	0,05
			19 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029	18	0,01
			140 Bristol-Myers Squibb Co, 4,250 %, fällig 26.10.2049	118	0,06
			380 Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, fällig 15.11.2035	290	0,14
			540 Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, fällig 15.01.2035	448	0,22
			10 Carrier Global Corp, 3,577 %, fällig 05.04.2050	7	-
			240 Charles Schwab Corp/The, 5,875 %, fällig 24.08.2026	241	0,12
			50 Charles Schwab Corp/The, 6,136 %, fällig 24.08.2034 *	51	0,03
			180 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23.07.2025	177	0,09
			520 Charter Communications Operating LLC. Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	485	0,24
			80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, fällig 30.03.2029	76	0,04
			80 Charter Communications Operating LLC. Charter Communications Operating Capital, 4,400 %, fällig 01.04.2033	70	0,04
			90 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	76	0,04
			90 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, fällig 23.10.2045	83	0,04
			10 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.05.2047	8	-
			360 Charter Communications Operating LLC. Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, fällig 01.04.2048	304	0,15

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US Core Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, fällig 01.07.2049	31	0,02	70 Devon Energy Corp, 4,750 %, fällig 15.05.2042	58	0,03
150 Charter Communications Operating LLC. Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, fällig 01.03.2050	111	0,06	300 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	257	0,13
60 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,500 %, fällig 01.04.2063	47	0,02	260 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01.12.2029	235	0,12
150 Chevron Corp, 2,954 %, fällig 16.05.2026	143	0,07	30 Diamondback Energy Inc, 3,125 %, fällig 24.03.2031	26	0,01
30 Chevron USA Inc, 3,850 %, fällig 15.01.2028	29	0,01	70 Eaton Corp, 4,150 %, fällig 02.11.2042	61	0,03
200 Cigna Group/The, 4,125 %, fällig 15.11.2025	195	0,10	60 Elevance Health Inc, 4,100 %, fällig 15.05.2032	55	0,03
480 Cigna Group/The, 4,375 %, fällig 15.10.2028	463	0,23	340 Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, fällig 16.10.2028	325	0,16
20 Cigna Group/The, 4,900 %, fällig 15.12.2048	18	0,01	160 Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, fällig 31.01.2030	139	0,07
30 Cintas Corp Nr. 2, 3,700 %, fällig 01.04.2027	29	0,01	20 Enterprise Products Operating LLC, 7,550 %, fällig 15.04.2038	23	0,01
60 Cintas Corp Nr. 2, 4,000 %, fällig 01.05.2032	56	0,03	60 Enterprise Products Operating LLC, 5,700 %, fällig 15.02.2042	59	0,03
190 Citigroup Inc, 0,776 %, fällig 30.10.2024 *	188	0,09	20 Enterprise Products Operating LLC, 4,850 %, fällig 15.03.2044	18	0,01
300 Citigroup Inc, 4,400 %, fällig 10.06.2025	293	0,14	20 Enterprise Products Operating LLC, 4,800 %, fällig 01.02.2049	18	0,01
60 Citigroup Inc, 5,500 %, fällig 13.09.2025	60	0,03	270 Enterprise Products Operating LLC, 4,200 %, fällig 31.01.2050	216	0,11
90 Citigroup Inc, 3,106 %, fällig 08.04.2026 *	86	0,04	20 Enterprise Products Operating LLC, 3,700 %, fällig 31.01.2051	15	0,01
30 Citigroup Inc, 4,300 %, fällig 20.11.2026	29	0,01	10 Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, fällig 31.01.2060	7	-
220 Citigroup Inc, 4,450 %, fällig 29.09.2027	210	0,10	30 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15.02.2078 *	25	0,01
90 Citigroup Inc, 4,658 %, fällig 24.05.2028 *	88	0,04	130 EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	126	0,06
150 Citigroup Inc, 3,520 %, fällig 27.10.2028 *	139	0,07	350 EOG Resources Inc, 3,900 %, fällig 01.04.2035	310	0,15
200 Citigroup Inc, 3,980 %, fällig 20.03.2030 *	184	0,09	180 EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig 15.04.2050	170	0,08
220 Citigroup Inc, 4,412 %, fällig 31.03.2031 *	204	0,10	140 EQT Corp, 7,000 %, fällig 01.02.2030	147	0,07
280 Citigroup Inc, 2,572 %, fällig 03.06.2031 *	231	0,11	50 FirstEnergy Corp, Serie A, 1,600 %, fällig 15.01.2026	45	0,02
530 Citigroup Inc, 3,785 %, fällig 17.03.2033 *	461	0,23	180 FirstEnergy Corp, Serie B, 4,150 %, fällig 15.07.2027	170	0,08
170 Citigroup Inc, 4,910 %, fällig 24.05.2033 *	162	0,08	200 FirstEnergy Corp, Serie C, 5,100 %, fällig 15.07.2047	174	0,09
90 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	112	0,06	60 Freeport-McMoRan Inc, 5,400 %, fällig 14.11.2034	57	0,03
77 Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 30.07.2045	66	0,03	30 Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	27	0,01
10 Citigroup Inc, 4,750 %, fällig 18.05.2046	8	-	90 General Motors Co, 5,600 %, fällig 15.10.2032	87	0,04
110 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 01.06.2040	80	0,04	10 General Motors Co, 6,600 %, fällig 01.04.2036	10	0,01
30 Coca-Cola Co/The, 2,600 %, fällig 01.06.2050	20	0,01	10 General Motors Co, 5,150 %, fällig 01.04.2038	9	-
260 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,036 %, fällig 15.11.2033	263	0,13	30 General Motors Co, 6,250 %, fällig 02.10.2043	28	0,01
30 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,544 %, fällig 15.11.2053	31	0,02	10 General Motors Co, 5,950 %, fällig 01.04.2049	9	-
120 Comcast Corp, 3,300 %, fällig 01.04.2027	113	0,06	130 Gilead Sciences Inc, 3,650 %, fällig 01.03.2026	125	0,06
100 Comcast Corp, 4,150 %, fällig 15.10.2028	96	0,05	3 Goldman Sachs Capital II, 6,439 %, unbefristet *	2	-
80 Comcast Corp, 3,400 %, fällig 01.04.2030	73	0,04	150 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 01.04.2025	145	0,07
130 Comcast Corp, 4,250 %, fällig 15.10.2030	124	0,06	90 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250 %, fällig 21.10.2025	87	0,04
361 Comcast Corp, 7,050 %, fällig 15.03.2033	412	0,20	800 Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, fällig 12.02.2026 *	743	0,37
80 Comcast Corp, 3,900 %, fällig 01.03.2038	68	0,03	90 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 16.11.2026	85	0,04
10 Comcast Corp, 3,250 %, fällig 01.11.2039	8	-	40 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,615 %, fällig 15.03.2028 *	37	0,02
40 Comcast Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2040	33	0,02	180 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,814 %, fällig 23.04.2029 *	167	0,08
20 Comcast Corp, 4,000 %, fällig 15.08.2047	16	0,01	660 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223 %, fällig 01.05.2029 *	622	0,31
20 Comcast Corp, 3,969 %, fällig 01.11.2047	16	0,01	30 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, fällig 01.02.2041	32	0,02
20 Comcast Corp, 4,000 %, fällig 01.03.2048	16	0,01	260 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	239	0,12
10 Comcast Corp, 3,999 %, fällig 01.11.2049	8	-	10 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750 %, fällig 21.10.2045	9	-
90 Comcast Corp, 2,800 %, fällig 15.01.2051	57	0,03	50 Guardian Life Global Funding, 144A, 1,100 %, fällig 23.06.2025	46	0,02
291 Comcast Corp, 2,887 %, fällig 01.11.2051	187	0,09	4 Halliburton Co, 3,800 %, fällig 15.11.2025	4	-
54 Comcast Corp, 2,937 %, fällig 01.11.2056	34	0,02	30 Home Depot Inc/The, 2,500 %, fällig 15.04.2027	28	0,01
30 Comcast Corp, 4,950 %, fällig 15.10.2058	9	-	80 Home Depot Inc/The, 2,700 %, fällig 15.04.2030	70	0,03
20 ConocoPhillips Co, 6,950 %, fällig 15.04.2029	22	0,01	60 Home Depot Inc/The, 3,250 %, fällig 15.04.2032	53	0,03
90 Consolidated Edison Co of New York Inc, Serie 20A, 3,350 %, fällig 01.04.2030	81	0,04	240 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	189	0,09
30 Consolidated Edison Co of New York Inc, Serie 20B, 3,950 %, fällig 01.04.2050	24	0,01	20 Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig 15.06.2047	16	0,01
110 Constellation Brands Inc, 4,350 %, fällig 09.05.2027	107	0,05	60 Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	44	0,02
170 Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, fällig 15.01.2028	160	0,08	20 Humana Inc, 4,500 %, fällig 01.04.2025	20	0,01
210 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2031	201	0,10	110 Humana Inc, 3,950 %, fällig 15.03.2027	106	0,05
140 Costco Wholesale Corp, 1,750 %, fällig 20.04.2032	111	0,06	150 Humana Inc, 3,700 %, fällig 23.03.2029	139	0,07
170 Coterra Energy Inc, 3,900 %, fällig 15.05.2027	162	0,08	30 Humana Inc, 2,150 %, fällig 03.02.2032	24	0,01
600 Coterra Energy Inc, 4,375 %, fällig 15.03.2029	565	0,28	50 Intel Corp, 5,125 %, fällig 10.02.2030	50	0,02
40 CVS Health Corp, 3,625 %, fällig 01.04.2027	38	0,02	30 Intel Corp, 5,200 %, fällig 10.02.2033	30	0,02
70 CVS Health Corp, 4,300 %, fällig 25.03.2028	67	0,03	180 Intel Corp, 4,750 %, fällig 25.03.2050	158	0,08
220 CVS Health Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2030	200	0,10	20 Intel Corp, 3,050 %, fällig 12.08.2051	13	0,01
20 CVS Health Corp, 1,875 %, fällig 28.02.2031	16	0,01	210 Johnson & Johnson, 3,700 %, fällig 01.03.2046	175	0,09
90 CVS Health Corp, 2,125 %, fällig 15.09.2031	71	0,04	420 Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA, 1,750 %, fällig 15.09.2030	337	0,17
380 CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25.03.2038	341	0,17	230 JPMorgan Chase & Co, 4,023 %, fällig 05.12.2024 *	229	0,11
40 CVS Health Corp, 4,125 %, fällig 01.04.2040	33	0,02	360 JPMorgan Chase & Co, 0,563 %, fällig 16.02.2025 *	351	0,17
40 CVS Health Corp, 5,125 %, fällig 20.07.2045	36	0,02	520 JPMorgan Chase & Co, 2,083 %, fällig 22.04.2026 *	489	0,24
220 CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048	193	0,10	70 JPMorgan Chase & Co, 4,125 %, fällig 15.12.2026	67	0,03
3 CVS Pass-Through Trust, 5,880 %, fällig 01.10.2028	3	-	100 JPMorgan Chase & Co, 4,250 %, fällig 01.10.2027	97	0,05
140 Deere & Co, 3,750 %, fällig 15.04.2050	120	0,06	130 JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, fällig 23.07.2029 *	123	0,06
340 Delta Air Lines Inc. SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 20.10.2025	333	0,16	110 JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, fällig 05.12.2029 *	105	0,05
190 Delta Air Lines Inc. SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 20.10.2028	183	0,09	210 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	176	0,09
160 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15.12.2025	161	0,08	280 JPMorgan Chase & Co, 2,580 %, fällig 22.04.2032 *	229	0,11
18 Devon Energy Corp, 5,250 %, fällig 15.10.2027	18	0,01	115 JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, fällig 01.06.2045	106	0,05
30 Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig 15.01.2030	28	0,01	50 JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig 22.04.2051 *	34	0,02
40 Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15.07.2041	37	0,02	110 Kenvue Inc, 144A, 4,900 %, fällig 22.03.2033	109	0,05
			30 Kimberly-Clark Corp, 3,100 %, fällig 26.03.2030	27	0,01
			100 KLA Corp, 4,650 %, fällig 15.07.2032	98	0,05
			340 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08.08.2024	329	0,16
			20 Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, fällig 25.06.2025	19	0,01
			70 Lowe's Cos Inc, 1,700 %, fällig 15.09.2028	60	0,03
			90 Lowe's Cos Inc, 4,500 %, fällig 15.04.2030	87	0,04
			340 Mars Inc, 144A, 3,200 %, fällig 01.04.2030	307	0,15
			250 Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26.03.2050	208	0,10
			50 McDonald's Corp, 3,500 %, fällig 01.07.2027	48	0,02

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US Core Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
30 McDonald's Corp, 3,800 %, fällig 01.04.2028	29	0,01	320 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig 01.02.2026	335	0,16
60 McDonald's Corp, 2,125 %, fällig 01.03.2030	51	0,03	110 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,250 %, fällig 15.05.2030	97	0,05
80 McDonald's Corp, 3,600 %, fällig 01.07.2030	74	0,04	190 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,950 %, fällig 15.05.2050	142	0,07
220 McDonald's Corp, 4,875 %, fällig 09.12.2045	203	0,10	100 Truist Financial Corp, 6,047 %, fällig 08.06.2027 *	100	0,05
20 McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01.09.2049	15	0,01	130 Union Pacific Corp, 2,400 %, fällig 05.02.2030	112	0,06
60 McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	50	0,02	230 Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 05.02.2070	168	0,08
15 Medtronic Inc, 4,625 %, fällig 15.03.2045	14	0,01	30 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15.12.2028	29	0,01
130 Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig 24.06.2030	105	0,05	40 UnitedHealth Group Inc, 4,000 %, fällig 15.05.2029	38	0,02
305 MetLife Inc, 6,400 %, fällig 15.12.2036	302	0,15	100 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15.05.2030	83	0,04
110 Micron Technology Inc, 5,875 %, fällig 09.02.2033	109	0,05	20 UnitedHealth Group Inc, 2,300 %, fällig 15.05.2031	17	0,01
20 Microsoft Corp, 2,525 %, fällig 01.06.2050	13	0,01	50 UnitedHealth Group Inc, 4,200 %, fällig 15.05.2032	47	0,02
150 Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17.03.2052	106	0,05	270 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, fällig 15.05.2040	195	0,10
20 Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC, 144A, 4,100 %, fällig 15.05.2028	19	0,01	50 UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, fällig 15.03.2043	44	0,02
130 Mondelez International Inc, 1,500 %, fällig 04.05.2025	122	0,06	40 UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, fällig 15.06.2048	34	0,02
440 Morgan Stanley, Serie I, 0,864 %, fällig 21.10.2025 *	414	0,20	20 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15.12.2048	18	0,01
110 Morgan Stanley, 2,188 %, fällig 28.04.2026 *	104	0,05	50 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, fällig 15.08.2049	39	0,02
160 Morgan Stanley, 3,772 %, fällig 24.01.2029 *	148	0,07	60 UnitedHealth Group Inc, 2,900 %, fällig 15.05.2050	40	0,02
210 Morgan Stanley, 2,699 %, fällig 22.01.2031 *	177	0,09	60 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15.08.2059	46	0,02
570 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	507	0,25	20 UnitedHealth Group Inc, 3,125 %, fällig 15.05.2060	13	0,01
110 MPLX LP, 4,000 %, fällig 15.03.2028	103	0,05	10 US Bancorp, Serie mtn, 2,215 %, fällig 27.01.2028 *	9	-
100 MPLX LP, 4,500 %, fällig 15.04.2038	85	0,04	100 US Bancorp, 5,775 %, fällig 12.06.2029 *	100	0,05
40 MPLX LP, 5,200 %, fällig 01.03.2047	34	0,02	90 US Bancorp, 5,836 %, fällig 12.06.2034 *	90	0,04
60 MPLX LP, 5,200 %, fällig 01.12.2047	52	0,03	300 USAA Capital Corp, 144A, 2,125 %, fällig 01.05.2030	248	0,12
50 MPLX LP, 4,700 %, fällig 15.04.2048	40	0,02	40 Verizon Communications Inc, 2,625 %, fällig 15.08.2026	37	0,02
140 New York Life Global Funding, 144A, 0,950 %, fällig 24.06.2025	129	0,06	40 Verizon Communications Inc, 4,125 %, fällig 16.03.2027	39	0,02
140 NIKE Inc, 2,850 %, fällig 27.03.2030	125	0,06	100 Verizon Communications Inc, 2,100 %, fällig 22.03.2028	87	0,04
60 NIKE Inc, 3,250 %, fällig 27.03.2040	48	0,02	225 Verizon Communications Inc, 4,329 %, fällig 21.09.2028	216	0,11
10 NIKE Inc, 3,375 %, fällig 27.03.2050	8	-	100 Verizon Communications Inc, 3,875 %, fällig 08.02.2029	93	0,05
270 NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2040	225	0,11	100 Verizon Communications Inc, 3,150 %, fällig 22.03.2030	88	0,04
110 NVIDIA Corp, 3,700 %, fällig 01.04.2060	88	0,04	296 Verizon Communications Inc, 2,550 %, fällig 21.03.2031	244	0,12
50 ONEOK Inc, 5,550 %, fällig 01.11.2026	50	0,02	310 Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig 10.08.2033	287	0,14
60 ONEOK Inc, 5,800 %, fällig 01.11.2030	60	0,03	60 Verizon Communications Inc, 4,400 %, fällig 01.11.2034	54	0,03
140 ONEOK Inc, 6,050 %, fällig 01.09.2033	141	0,07	20 Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16.03.2037	20	0,01
180 ONEOK Inc, 6,625 %, fällig 01.09.2053	182	0,09	210 Verizon Communications Inc, 2,650 %, fällig 20.11.2040	140	0,07
210 Oracle Corp, 1,650 %, fällig 25.03.2026	191	0,09	30 Verizon Communications Inc, 3,400 %, fällig 22.03.2041	22	0,01
50 Oracle Corp, 4,650 %, fällig 06.05.2030	48	0,02	70 Verizon Communications Inc, 4,125 %, fällig 15.08.2046	56	0,03
340 Oracle Corp, 2,875 %, fällig 25.03.2031	287	0,14	70 Verizon Communications Inc, 4,862 %, fällig 21.08.2046	62	0,03
60 Otis Worldwide Corp, 2,056 %, fällig 05.04.2025	57	0,03	80 Verizon Communications Inc, 4,000 %, fällig 22.03.2050	61	0,03
50 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, fällig 01.08.2027	43	0,02	10 Verizon Communications Inc, 2,875 %, fällig 20.11.2050	6	-
150 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig 01.02.2031	117	0,06	30 Visa Inc, 3,150 %, fällig 14.12.2025	29	0,01
20 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig 01.08.2040	13	0,01	70 Visa Inc, 4,300 %, fällig 14.12.2045	63	0,03
30 Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, fällig 01.08.2050	19	0,01	50 Visa Inc, 3,650 %, fällig 15.09.2047	41	0,02
60 PayPal Holdings Inc, 4,400 %, fällig 01.06.2032	57	0,03	30 Walmart Inc, 1,800 %, fällig 22.09.2031	25	0,01
40 PepsiCo Inc, 1,625 %, fällig 01.05.2030	33	0,02	20 Walt Disney Co/The, 6,650 %, fällig 15.11.2037	23	0,01
40 PepsiCo Inc, 2,875 %, fällig 15.10.2049	28	0,01	60 Warnermedia Holdings Inc, 6,412 %, fällig 15.03.2026	60	0,03
250 Pfizer Inc, 2,625 %, fällig 01.04.2030	220	0,11	30 Warnermedia Holdings Inc, 3,755 %, fällig 15.03.2027	28	0,01
90 Pfizer Inc, 1,700 %, fällig 28.05.2030	74	0,04	60 Warnermedia Holdings Inc, 4,054 %, fällig 15.03.2029	55	0,03
230 Pfizer Inc, 2,550 %, fällig 28.05.2040	165	0,08	270 Warnermedia Holdings Inc, 4,279 %, fällig 15.03.2032	238	0,12
110 Pfizer Inc, 2,700 %, fällig 28.05.2050	75	0,04	20 Warnermedia Holdings Inc, 5,050 %, fällig 15.03.2042	16	0,01
30 Pioneer Natural Resources Co, 1,125 %, fällig 15.01.2026	27	0,01	60 Warnermedia Holdings Inc, 5,141 %, fällig 15.03.2052	48	0,02
100 Pioneer Natural Resources Co, 1,900 %, fällig 15.08.2030	81	0,04	61 Wells Fargo & Co, 4,480 %, fällig 16.01.2024	61	0,03
230 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, fällig 15.01.2031	187	0,09	90 Wells Fargo & Co, 2,188 %, fällig 30.04.2026 *	85	0,04
40 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,812 %, fällig 12.06.2026 *	40	0,02	50 Wells Fargo & Co, 4,100 %, fällig 03.06.2026	48	0,02
200 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,582 %, fällig 12.06.2029 *	198	0,10	30 Wells Fargo & Co, 3,000 %, fällig 23.10.2026	28	0,01
70 Principal Life Global Funding II, 144A, 1,250 %, fällig 23.06.2025	65	0,03	430 Wells Fargo & Co, 4,300 %, fällig 22.07.2027	412	0,20
90 Procter & Gamble Co/The, 3,000 %, fällig 25.03.2030	82	0,04	60 Wells Fargo & Co, 2,393 %, fällig 02.06.2028 *	53	0,03
460 Prologis LP, 1,250 %, fällig 15.10.2030	355	0,17	10 Wells Fargo & Co, 4,150 %, fällig 24.01.2029	9	-
130 Salesforce Inc, 3,700 %, fällig 11.04.2028	125	0,06	100 Wells Fargo & Co, 5,574 %, fällig 25.07.2029 *	100	0,05
140 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, fällig 01.03.2032	159	0,08	130 Wells Fargo & Co, 2,879 %, fällig 30.10.2030 *	111	0,06
180 Targa Resources Corp, 5,200 %, fällig 01.07.2027	178	0,09	120 Wells Fargo & Co, 4,478 %, fällig 04.04.2031 *	112	0,06
30 Targa Resources Corp, 4,950 %, fällig 15.04.2052	24	0,01	220 Wells Fargo & Co, 3,350 %, fällig 02.03.2033 *	185	0,09
2 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, fällig 16.12.2039	2	-	20 Wells Fargo & Co, 4,650 %, fällig 04.11.2044	17	0,01
230 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, fällig 01.03.2030	197	0,10	50 Wells Fargo & Co, 4,900 %, fällig 17.11.2045	43	0,02
240 Texas Instruments Inc, 2,250 %, fällig 04.09.2029	209	0,10	430 Wells Fargo & Co, 4,400 %, fällig 14.06.2046	341	0,17
70 Texas Instruments Inc, 1,750 %, fällig 04.05.2030	58	0,03	200 Wells Fargo & Co, 4,750 %, fällig 07.12.2046	166	0,08
70 Texas Instruments Inc, 4,150 %, fällig 15.05.2048	61	0,03	1.070 Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	967	0,48
170 The Vanguard Group Inc, 3,050 %, fällig 22.08.2050 †=	105	0,05	30 Wyeth LLC, 5,950 %, fällig 01.04.2037	32	0,02
30 Time Warner Cable LLC, 6,550 %, fällig 01.05.2037	29	0,01			
100 Time Warner Cable LLC, 5,875 %, fällig 15.11.2040	87	0,04			
100 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2025	97	0,05			
20 T-Mobile USA Inc, 3,750 %, fällig 15.04.2027	19	0,01			
380 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030	347	0,17			
80 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15.02.2031	66	0,03			
80 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15.11.2031	64	0,03			
110 T-Mobile USA Inc, 3,000 %, fällig 15.02.2041	78	0,04			
30 T-Mobile USA Inc, 3,300 %, fällig 15.02.2051	20	0,01			
				45.914	22,56
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 70.767 USD)</b>				<b>64.519</b>	<b>31,71</b>
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 26,05 % (28. Februar 2023: 21,89 %)</b>					
<b>Chile – 0,08 % (28. Februar 2023: 0,12 %)</b>					
			250 Chile, internationale Staatsanleihe, 3,100 %, fällig 22.01.2061	158	0,08
<b>Kolumbien – 0,33 % (28. Februar 2023: 0,48 %)</b>					
			220 Kolumbien, internationale Staatsanleihe, 3,125 %, fällig 15.04.2031	170	0,08
			260 Kolumbien, internationale Staatsanleihe, 3,250 %, fällig 22.04.2032	196	0,10
			400 Kolumbien, internationale Staatsanleihe, 5,625 %, fällig 26.02.2044	304	0,15
				670	0,33

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US Core Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert																																																																																																																																																																																																																																																																																										
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
<b>Indien – 0,20 % (28. Februar 2023: 0,14 %)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
430	Export-Import Bank of India, 3,375 %, fällig 05.08.2026	0,20	406	0,20																																																																																																																																																																																																																																																																																											
<b>Israel – 0,34 % (28. Februar 2023: 0,54 %)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
800	Israel, internationale Staatsanleihe, 2,750 %, fällig 03.07.2030	0,34	698	0,34																																																																																																																																																																																																																																																																																											
<b>Kasachstan – 0,09 % (28. Februar 2023: 0,14 %)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
200	Kasachstan, internationale Staatsanleihe, 4,875 %, fällig 14.10.2044	0,09	179	0,09																																																																																																																																																																																																																																																																																											
<b>Mexiko – 0,81 % (28. Februar 2023: 0,83 %)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
1.580	Mexiko, internationale Staatsanleihe, 4,750 %, fällig 08.03.2044	0,65	1.331	0,65																																																																																																																																																																																																																																																																																											
420	Mexiko, internationale Staatsanleihe, 4,400 %, fällig 12.02.2052	0,16	325	0,16																																																																																																																																																																																																																																																																																											
		0,81	1.656	0,81																																																																																																																																																																																																																																																																																											
<b>Panama – 0,23 % (28. Februar 2023: 0,20 %)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
640	Panama, internationale Staatsanleihe, 4,300 %, fällig 29.04.2053	0,23	463	0,23																																																																																																																																																																																																																																																																																											
<b>Peru – 0,22 % (28. Februar 2023: 0,13 %)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
40	Peru, internationale Staatsanleihe, 3,550 %, fällig 10.03.2051	0,01	29	0,01																																																																																																																																																																																																																																																																																											
640	Peru, internationale Staatsanleihe, 3,600 %, fällig 15.01.2072	0,21	422	0,21																																																																																																																																																																																																																																																																																											
		0,22	451	0,22																																																																																																																																																																																																																																																																																											
<b>South Korea – 0,24 % (28. Februar 2023: 0,20 %)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
510	Korea Housing Finance Corp, 144A, 4,625 %, fällig 24.02.2033	0,24	488	0,24																																																																																																																																																																																																																																																																																											
<b>USA – 23,00 % (28. Februar 2023: 18,58 %)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
440	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 12.12.2023	0,21	434	0,21																																																																																																																																																																																																																																																																																											
640	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 01.02.2024	0,31	629	0,31																																																																																																																																																																																																																																																																																											
640	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, fällig 29.01.2024	0,31	626	0,31																																																																																																																																																																																																																																																																																											
2.160	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 10.03.2023	1,06	2.150	1,06																																																																																																																																																																																																																																																																																											
1.400	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 12.12.2023	0,68	1.379	0,68																																																																																																																																																																																																																																																																																											
1.760	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 26.12.2023	0,85	1.730	0,85																																																																																																																																																																																																																																																																																											
1.470	United States Treasury, inflationsindexierte Anleihen, 1,125 %, fällig 15.01.2033 β	0,69	1.405	0,69																																																																																																																																																																																																																																																																																											
20	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 30.04.2024	0,01	19	0,01																																																																																																																																																																																																																																																																																											
340	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 28.02.2025	0,17	338	0,17																																																																																																																																																																																																																																																																																											
20	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.03.2026	0,01	20	0,01																																																																																																																																																																																																																																																																																											
70	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 31.03.2026	0,03	66	0,03																																																																																																																																																																																																																																																																																											
310	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.10.2027	0,15	307	0,15																																																																																																																																																																																																																																																																																											
1.700	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 31.12.2027	0,82	1.669	0,82																																																																																																																																																																																																																																																																																											
890	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 31.01.2028	0,42	861	0,42																																																																																																																																																																																																																																																																																											
10	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 29.02.2028	-	10	-																																																																																																																																																																																																																																																																																											
50	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.03.2028	0,02	49	0,02																																																																																																																																																																																																																																																																																											
1.870	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.05.2028	0,89	1.819	0,89																																																																																																																																																																																																																																																																																											
6.110	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.07.2028	2,99	6.075	2,99																																																																																																																																																																																																																																																																																											
280	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.03.2030	0,13	270	0,13																																																																																																																																																																																																																																																																																											
40	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 30.04.2030	0,02	38	0,02																																																																																																																																																																																																																																																																																											
1.140	United States Treasury Note/Bond, 3,750 %, fällig 31.05.2030	0,55	1.109	0,55																																																																																																																																																																																																																																																																																											
970	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 31.07.2030	0,47	959	0,47																																																																																																																																																																																																																																																																																											
3.340	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.08.2030	1,63	3.326	1,63																																																																																																																																																																																																																																																																																											
245	United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, fällig 15.05.2033	0,11	231	0,11																																																																																																																																																																																																																																																																																											
170	United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, fällig 15.05.2042	0,07	145	0,07																																																																																																																																																																																																																																																																																											
380	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.02.2043	0,17	354	0,17																																																																																																																																																																																																																																																																																											
1.990	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.05.2043	0,91	1.851	0,91																																																																																																																																																																																																																																																																																											
1.500	United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 15.08.2043	0,74	1.496	0,74																																																																																																																																																																																																																																																																																											
640	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2048	0,25	508	0,25																																																																																																																																																																																																																																																																																											
460	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2049	0,18	365	0,18																																																																																																																																																																																																																																																																																											
130	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2049	0,05	101	0,05																																																																																																																																																																																																																																																																																											
3.200	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2050	1,01	2.050	1,01																																																																																																																																																																																																																																																																																											
700	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.11.2050	0,20	405	0,20																																																																																																																																																																																																																																																																																											
280	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	0,09	189	0,09																																																																																																																																																																																																																																																																																											
1.590	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	0,61	1.235	0,61																																																																																																																																																																																																																																																																																											
3.450	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	1,35	2.750	1,35																																																																																																																																																																																																																																																																																											
60	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2052	0,03	58	0,03																																																																																																																																																																																																																																																																																											
2.315	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.02.2053	1,03	2.086	1,03																																																																																																																																																																																																																																																																																											
8.530	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.05.2053	3,78	7.695	3,78																																																																																																																																																																																																																																																																																											
		23,00	46.807	23,00																																																																																																																																																																																																																																																																																											
<b>Uruguay – 0,51 % (28. Februar 2023: 0,53 %)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
440	Uruguay, internationale Staatsanleihe, 4,375 %, fällig 23.01.2031	0,22	433	0,22																																																																																																																																																																																																																																																																																											
40	Uruguay, internationale Staatsanleihe, 5,750 %, fällig 28.10.2034	0,02	43	0,02																																																																																																																																																																																																																																																																																											
220	Uruguay, internationale Staatsanleihe, 7,625 %, fällig 21.03.2036	0,13	267	0,13																																																																																																																																																																																																																																																																																											
<table border="1"> <thead> <tr> <th>Nennwert (in Tsd.)</th> <th>Wert (in Tsd.)</th> <th>% vom Nettoinventarwert</th> <th>Nennwert (in Tsd.)</th> <th>Wert (in Tsd.)</th> <th>% vom Nettoinventarwert</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>300</td> <td>Uruguay, internationale Staatsanleihe, 5,100 %, fällig 18.06.2050</td> <td></td> <td>289</td> <td>0,14</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> <td>1.032</td> <td>0,51</td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="6"><b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 57.071 USD)</b></td> </tr> <tr> <td colspan="6"><b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 5,29 % (28. Februar 2023: 1,32 %)</b></td> </tr> <tr> <td>10.768</td> <td>Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)</td> <td>5,29</td> <td>10.768</td> <td>5,29</td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="6"><b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 10.768 USD)</b></td> </tr> <tr> <td colspan="6"><b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 241.741 USD)</b></td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> <td>226.747</td> <td>111,44</td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="6"><b>Kontrakte (in Tsd.)</b></td> </tr> <tr> <td colspan="6"><b>Erworbene Optionen – 0,16 % (28. Februar 2023: 0,05 %)</b></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Put 95,8750, fällig 15.12.2023 – Goldman Sachs</td> <td>0,01</td> <td>20</td> <td>0,01</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Put 96,00, fällig 15.12.2023 – Goldman Sachs</td> <td>0,03</td> <td>57</td> <td>0,03</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Oktober 2023, Put 97,00, fällig 13.10.2023 – Goldman Sachs</td> <td>0,04</td> <td>80</td> <td>0,04</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- CME 3-Monats-SOFR-Futures März 2024 Call 95,25, fällig 15.03.2024 – Goldman Sachs</td> <td>-</td> <td>8</td> <td>-</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- CME 3-Monats-SOFR-Futures September 2023 Call 96,00, fällig 15.09.2023 – Goldman Sachs</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- US-Anleihe mit 10 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 110,50, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs</td> <td>0,01</td> <td>13</td> <td>0,01</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- US-Anleihe mit 10 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Rufnummer 111,00, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs</td> <td>-</td> <td>9</td> <td>-</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- US-Anleihe mit 5 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 106,50, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs</td> <td>0,01</td> <td>18</td> <td>0,01</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- US-Anleihe mit 5 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 107,25, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs</td> <td>0,01</td> <td>14</td> <td>0,01</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- US-Anleihe Oktober 2023 Call 119,00, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs</td> <td>0,02</td> <td>39</td> <td>0,02</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- US-Anleihe Oktober 2023 Call 120,00, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs</td> <td>0,01</td> <td>15</td> <td>0,01</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- US-Anleihe Oktober 2023 Call 121,00, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs</td> <td>0,02</td> <td>36</td> <td>0,02</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- US-Anleihe Oktober 2023 Call 121,50, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs</td> <td>-</td> <td>13</td> <td>-</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- US-Anleihe Oktober 2023 Call 122,00, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs</td> <td>-</td> <td>5</td> <td>-</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td>0,16</td> <td>327</td> <td>0,16</td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="6"><b>Summe erworbene Optionen (Anschaffungskosten 233 USD)</b></td> </tr> <tr> <td colspan="6"><b>Credit Default Swaps – 0,17 % (28. Februar 2023: 0,23 %)</b></td> </tr> <tr> <td></td> <td>Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)</td> <td></td> <td>350</td> <td>0,17</td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="6"><b>Index Swaps – 0,48 % (28. Februar 2023: 1,66 %)</b></td> </tr> <tr> <td></td> <td>Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)</td> <td></td> <td>971</td> <td>0,48</td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="6"><b>Futures – 0,15 % (28. Februar 2023: 0,23 %)</b></td> </tr> <tr> <td></td> <td>Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)</td> <td></td> <td>310</td> <td>0,15</td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="6"><b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b></td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> <td>228.705</td> <td>112,40</td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="6"><b>Kontrakte (in Tsd.)</b></td> </tr> <tr> <td colspan="6"><b>geschriebene Optionen – -0,10 % (28. Februar 2023: -0,05 %)</b></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Put 95,25, fällig 15.12.2023 – Goldman Sachs</td> <td>-0,01</td> <td>-12</td> <td>-0,01</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Put 95,3750, fällig 15.12.2023 – Goldman Sachs</td> <td>-0,02</td> <td>-36</td> <td>-0,02</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Oktober 2023, Put 96,25, fällig 13.10.2023 – Goldman Sachs</td> <td>-0,02</td> <td>-34</td> <td>-0,02</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Oktober 2023, Put 96,50, fällig 13.10.2023 – Goldman Sachs</td> <td>-0,02</td> <td>-48</td> <td>-0,02</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- CME 3-Monats-SOFR-Futures März 2024 Call 96,1250, fällig 15.03.2024 – Goldman Sachs</td> <td>-0,01</td> <td>-8</td> <td>-0,01</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- CME 3-Monats-SOFR-Futures September 2023 Call 96,75, fällig 15.09.2023 – Goldman Sachs</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- US Anleihe, Laufzeit 10J, November 2023 Call 112,00, fällig 27.10.2023 – Goldman Sachs</td> <td>-0,01</td> <td>-14</td> <td>-0,01</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- US Anleihe, Laufzeit 10J, November 2023 Put 107,50, fällig 27.10.2023 – Goldman Sachs</td> <td>-</td> <td>-3</td> <td>-</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- US Anleihe, Laufzeit 10J, November 2023 Put 108,00, fällig 27.10.2023 – Goldman Sachs</td> <td>-</td> <td>-3</td> <td>-</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>- US Anleihe, Laufzeit 10J, Oktober 2023, Call 111,75, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs</td> <td>-</td> <td>-7</td> <td>-</td> <td></td> </tr> </tbody> </table>						Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	300	Uruguay, internationale Staatsanleihe, 5,100 %, fällig 18.06.2050		289	0,14					1.032	0,51		<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 57.071 USD)</b>						<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 5,29 % (28. Februar 2023: 1,32 %)</b>						10.768	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	5,29	10.768	5,29		<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 10.768 USD)</b>						<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 241.741 USD)</b>									226.747	111,44		<b>Kontrakte (in Tsd.)</b>						<b>Erworbene Optionen – 0,16 % (28. Februar 2023: 0,05 %)</b>							- 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Put 95,8750, fällig 15.12.2023 – Goldman Sachs	0,01	20	0,01			- 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Put 96,00, fällig 15.12.2023 – Goldman Sachs	0,03	57	0,03			- 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Oktober 2023, Put 97,00, fällig 13.10.2023 – Goldman Sachs	0,04	80	0,04			- CME 3-Monats-SOFR-Futures März 2024 Call 95,25, fällig 15.03.2024 – Goldman Sachs	-	8	-			- CME 3-Monats-SOFR-Futures September 2023 Call 96,00, fällig 15.09.2023 – Goldman Sachs	-	-	-			- US-Anleihe mit 10 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 110,50, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	0,01	13	0,01			- US-Anleihe mit 10 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Rufnummer 111,00, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	-	9	-			- US-Anleihe mit 5 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 106,50, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	0,01	18	0,01			- US-Anleihe mit 5 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 107,25, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	0,01	14	0,01			- US-Anleihe Oktober 2023 Call 119,00, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	0,02	39	0,02			- US-Anleihe Oktober 2023 Call 120,00, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	0,01	15	0,01			- US-Anleihe Oktober 2023 Call 121,00, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	0,02	36	0,02			- US-Anleihe Oktober 2023 Call 121,50, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	-	13	-			- US-Anleihe Oktober 2023 Call 122,00, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	-	5	-				0,16	327	0,16		<b>Summe erworbene Optionen (Anschaffungskosten 233 USD)</b>						<b>Credit Default Swaps – 0,17 % (28. Februar 2023: 0,23 %)</b>							Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		350	0,17		<b>Index Swaps – 0,48 % (28. Februar 2023: 1,66 %)</b>							Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		971	0,48		<b>Futures – 0,15 % (28. Februar 2023: 0,23 %)</b>							Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		310	0,15		<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>									228.705	112,40		<b>Kontrakte (in Tsd.)</b>						<b>geschriebene Optionen – -0,10 % (28. Februar 2023: -0,05 %)</b>							- 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Put 95,25, fällig 15.12.2023 – Goldman Sachs	-0,01	-12	-0,01			- 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Put 95,3750, fällig 15.12.2023 – Goldman Sachs	-0,02	-36	-0,02			- 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Oktober 2023, Put 96,25, fällig 13.10.2023 – Goldman Sachs	-0,02	-34	-0,02			- 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Oktober 2023, Put 96,50, fällig 13.10.2023 – Goldman Sachs	-0,02	-48	-0,02			- CME 3-Monats-SOFR-Futures März 2024 Call 96,1250, fällig 15.03.2024 – Goldman Sachs	-0,01	-8	-0,01			- CME 3-Monats-SOFR-Futures September 2023 Call 96,75, fällig 15.09.2023 – Goldman Sachs	-	-	-			- US Anleihe, Laufzeit 10J, November 2023 Call 112,00, fällig 27.10.2023 – Goldman Sachs	-0,01	-14	-0,01			- US Anleihe, Laufzeit 10J, November 2023 Put 107,50, fällig 27.10.2023 – Goldman Sachs	-	-3	-			- US Anleihe, Laufzeit 10J, November 2023 Put 108,00, fällig 27.10.2023 – Goldman Sachs	-	-3	-			- US Anleihe, Laufzeit 10J, Oktober 2023, Call 111,75, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	-	-7	-	
Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert																																																																																																																																																																																																																																																																																										
300	Uruguay, internationale Staatsanleihe, 5,100 %, fällig 18.06.2050		289	0,14																																																																																																																																																																																																																																																																																											
			1.032	0,51																																																																																																																																																																																																																																																																																											
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 57.071 USD)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 5,29 % (28. Februar 2023: 1,32 %)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
10.768	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	5,29	10.768	5,29																																																																																																																																																																																																																																																																																											
<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 10.768 USD)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 241.741 USD)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
			226.747	111,44																																																																																																																																																																																																																																																																																											
<b>Kontrakte (in Tsd.)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
<b>Erworbene Optionen – 0,16 % (28. Februar 2023: 0,05 %)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
	- 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Put 95,8750, fällig 15.12.2023 – Goldman Sachs	0,01	20	0,01																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Put 96,00, fällig 15.12.2023 – Goldman Sachs	0,03	57	0,03																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Oktober 2023, Put 97,00, fällig 13.10.2023 – Goldman Sachs	0,04	80	0,04																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- CME 3-Monats-SOFR-Futures März 2024 Call 95,25, fällig 15.03.2024 – Goldman Sachs	-	8	-																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- CME 3-Monats-SOFR-Futures September 2023 Call 96,00, fällig 15.09.2023 – Goldman Sachs	-	-	-																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- US-Anleihe mit 10 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 110,50, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	0,01	13	0,01																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- US-Anleihe mit 10 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Rufnummer 111,00, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	-	9	-																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- US-Anleihe mit 5 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 106,50, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	0,01	18	0,01																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- US-Anleihe mit 5 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 107,25, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	0,01	14	0,01																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- US-Anleihe Oktober 2023 Call 119,00, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	0,02	39	0,02																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- US-Anleihe Oktober 2023 Call 120,00, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	0,01	15	0,01																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- US-Anleihe Oktober 2023 Call 121,00, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	0,02	36	0,02																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- US-Anleihe Oktober 2023 Call 121,50, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	-	13	-																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- US-Anleihe Oktober 2023 Call 122,00, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	-	5	-																																																																																																																																																																																																																																																																																											
		0,16	327	0,16																																																																																																																																																																																																																																																																																											
<b>Summe erworbene Optionen (Anschaffungskosten 233 USD)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
<b>Credit Default Swaps – 0,17 % (28. Februar 2023: 0,23 %)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		350	0,17																																																																																																																																																																																																																																																																																											
<b>Index Swaps – 0,48 % (28. Februar 2023: 1,66 %)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		971	0,48																																																																																																																																																																																																																																																																																											
<b>Futures – 0,15 % (28. Februar 2023: 0,23 %)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		310	0,15																																																																																																																																																																																																																																																																																											
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
			228.705	112,40																																																																																																																																																																																																																																																																																											
<b>Kontrakte (in Tsd.)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
<b>geschriebene Optionen – -0,10 % (28. Februar 2023: -0,05 %)</b>																																																																																																																																																																																																																																																																																															
	- 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Put 95,25, fällig 15.12.2023 – Goldman Sachs	-0,01	-12	-0,01																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Put 95,3750, fällig 15.12.2023 – Goldman Sachs	-0,02	-36	-0,02																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Oktober 2023, Put 96,25, fällig 13.10.2023 – Goldman Sachs	-0,02	-34	-0,02																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Oktober 2023, Put 96,50, fällig 13.10.2023 – Goldman Sachs	-0,02	-48	-0,02																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- CME 3-Monats-SOFR-Futures März 2024 Call 96,1250, fällig 15.03.2024 – Goldman Sachs	-0,01	-8	-0,01																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- CME 3-Monats-SOFR-Futures September 2023 Call 96,75, fällig 15.09.2023 – Goldman Sachs	-	-	-																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- US Anleihe, Laufzeit 10J, November 2023 Call 112,00, fällig 27.10.2023 – Goldman Sachs	-0,01	-14	-0,01																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- US Anleihe, Laufzeit 10J, November 2023 Put 107,50, fällig 27.10.2023 – Goldman Sachs	-	-3	-																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- US Anleihe, Laufzeit 10J, November 2023 Put 108,00, fällig 27.10.2023 – Goldman Sachs	-	-3	-																																																																																																																																																																																																																																																																																											
	- US Anleihe, Laufzeit 10J, Oktober 2023, Call 111,75, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	-	-7	-																																																																																																																																																																																																																																																																																											

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Western Asset US Core Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	
<b>geschriebene Optionen – (Fortsetzung)</b>			
- US Anleihe, Laufzeit 10J, Oktober 2023, Call 112,00, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	-4	-	
- US Anleihe, Laufzeit 10J, Oktober 2023, Call 112,50, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	-6	-	
- US Anleihe, Laufzeit 10J, Oktober 2023 Put 109,00, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	-2	-	
- US 5 Year Oktober 2023 Put 105,00, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	-1	-	
- US-Anleihe Oktober 2023 Call 123,00, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	-7	-	
- US-Anleihe Oktober 2023 Call 124,00, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	-9	-0,01	
- US-Anleihe, Oktober 2023, Put 117,00, fällig 22.09.2023 – Goldman Sachs	-1	-	
<b>Summe geschriebene Optionen (Anschaffungskosten -171 USD)</b>	<b>-195</b>	<b>-0,10</b>	
<b>Credit Default Swaps – -0,01 % (28. Februar 2023: -0,03 %)</b>			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-20	-0,01	
<b>Futures – -0,07 % (28. Februar 2023: -0,14 %)</b>			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-152	-0,07	
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>-367</b>	<b>-0,18</b>	
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>228.338</b>	<b>112,22</b>	
<b>Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten</b>	<b>-24.862</b>	<b>-12,22</b>	
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>203.476\$</b>	<b>100,00</b>	
			– 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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 27.078.000 USD und machten 13,29 % des Nettovermögens aus.
		*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.
		†	Nicht liquide.
		∞	Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.
		±	Auf noch bekanntgebender Basis erworbene Wertpapiere.
		β	Der Zinssatz für diese Art von Wertpapier ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Kupon entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.
			<b>ABKÜRZUNGEN:</b>
			Unbefristet – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Unbefristete Anleihen sind nicht rückzahlbar, schütten aber kontinuierlich Zinsen aus.
			REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit.
			TBA – Wird noch bekannt gegeben.
			<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>
			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden
			Organismen für gemeinsame Anlagen
			Finanzderivate
			Sonstige Vermögenswerte
			<b>Gesamtvermögen</b>
			100,00
			% des Gesamtvermögens
			90,97
			4,54
			0,82
			3,67

### Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkaufen	20. Jun. 2033	4.870	\$ -20
Goldman Sachs	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkaufen	20. Jun. 2028	22.680	\$ 350
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 304 USD)				\$ 350
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -44 USD)				-20
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 260 USD)				\$ 330

### Aufstellung der Indexswaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Zahlung Festzins 2,500 %, Erhalt variabler aufgezinsten SOFR (USD)	21. Apr. 2052	559	\$ 105
Goldman Sachs	Zahlung Festzins 2,600 %, Erhalt variabler aufgezinsten SOFR (USD)	15. Feb. 2048	954	160
Goldman Sachs	Zahlung Festzins 2,850 %, Erhalt variabler aufgezinsten SOFR (USD)	15. Feb. 2029	2.092	115
Goldman Sachs	Zahlung Festzins 3,050 %, Erhalt variabler aufgezinsten SOFR (USD)	15. Feb. 2048	2.107	203
Goldman Sachs	Zahlung Festzins 3,150 %, Erhalt variabler aufgezinsten SOFR (USD)	15. Mai 2048	2.163	173
Goldman Sachs	Zahlung Festzins 3,270 %, Erhalt variabler aufgezinsten SOFR (USD)	30. Apr. 2029	1.719	61
Goldman Sachs	Zahlung variabler aufgezinsten SOFR (USD), Erhalt Festzins 4,000 %	29. Feb. 2028	6.950	4
Goldman Sachs	Zahlung variabler aufgezinsten SOFR (USD), Erhalt Festzins 4,180 %	29. Feb. 2028	19.990	150
Nicht realisierte Wertsteigerung von Indexswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 2.192 USD)				\$ 971
Nicht realisierte Wertminderung von Indexswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -2 USD)				-
Nettowertsteigerung von Indexswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 2.190\$)				\$ 971

### Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
3-Monats-SOFR-Index Dezember 2023	Goldman Sachs	-115	\$ -27.197	\$ 165
3-Monats-SOFR-Index Dezember 2024	Goldman Sachs	70	16.770	2
3-Monats-SOFR-Index Dezember 2025	Goldman Sachs	29	6.990	9
3-Monats-SOFR-Index Juni 2023	Goldman Sachs	1	237	-5
Zehnjährige US-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Goldman Sachs	-50	-5.552	-44
Zehnjährige US Ultra Note, Dezember 2023	Goldman Sachs	-15	-1.742	-26
Zweijährige US-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Goldman Sachs	56	11.413	36
Fünfjährige US-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Goldman Sachs	-100	-10.692	-72
US Long Bond (CBT) Dezember 2023	Goldman Sachs	-8	-973	-5
US Ultra Bond (CBT) Dezember 2023	Goldman Sachs	37	4.790	98
Nicht realisierte Wertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 303 USD)				\$ 310
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -180 USD)				-152
Nettowertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 123 USD)				\$ 158

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventar- wertes	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventar- wertes
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere – 6,25 % (28. Februar 2023: 6,51 %)</b>			<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 40,85 % (28. Februar 2023: 32,48 %)</b>		
640			54		
AB BSL CLO 4 Ltd, Serie 2023 4A, Klasse A, 144A, 6,957 %, fällig 20.04.2036 *	643	0,06	Alternative Loan Trust 2005-14, Serie 2005 14, Klasse 2A2, 5,679 %, fällig 25.05.2035 *	39	-
107			190		
Aegis Asset Backed Sec Corp Mort Pass Thr Certs Serie 2003-3, Serie 2003 3, Klasse M2, 7,904 %, fällig 25.01.2034 *	98	0,01	Alternative Loan Trust 2005-56, Serie 2005 56, Klasse 4A1, 6,049 %, fällig 25.11.2035 *	171	0,02
3.060			37		
Ameriquest Mortgage Securities Inc. Asset-Backed Pass-Through Ctrf Ser 2005-R8, Serie 2005 R8, Klasse M4, 6,299 %, fällig 25.10.2035 *	2.944	0,29	Alternative Loan Trust 2006-18CB, Serie 2006 18CB, Klasse A6, 6,882 %, fällig 25.07.2036 *	31	-
2.500			3.660		
Apidos CLO XXXVII, Serie 2021 37A, Klasse A, 144A, 6,737 %, fällig 22.10.2034 *	2.484	0,25	AREIT 2022-CRE7 LLC, Serie 2022 CRE7, Klasse A, 144A, 7,556 %, fällig 17.06.2039 *	3.659	0,37
2.390			992		
BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust, Serie 1996 1, Klasse B1, 7,875 %, fällig 10.10.2026	76	0,01	BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Serie 2016 GG10, Klasse AJA, 144A, 5,810 %, fällig 10.08.2045 *	216	0,02
1.500			2.034		
BCRED MML CLO 2021-1 LLC, Serie 2021 1A, Klasse A, 144A, 7,050 %, fällig 15.01.2035 *	1.482	0,15	Bank of America Funding 2014-R2 Trust, Serie 2014 R2, Klasse 2A2, 144A, 5,645 %, fällig 26.05.2037 *	1.787	0,18
1.000			780		
BCRED MML CLO 2022-1 LLC, Serie 2022 1A, Klasse A1, 144A, 6,976 %, fällig 20.04.2035 *	973	0,10	BANK 2017-BNK7, Serie 2017 BNK7, Klasse A5, 3,435 %, fällig 15.09.2060	719	0,07
1.740			12.085		
Cayuga Park CLO Ltd, Serie 2020 1A, Klasse AR, 144A, 6,690 %, fällig 17.07.2034 *	1.727	0,17	BANK 2017-BNK7, Serie 2017 BNK7, Klasse XA, 0,850 %, fällig 15.09.2060 *	266	0,03
13			1.500		
ContiMortgage Home Equity Loan Trust 1999-1, Serie 1999 1, Klasse B, 9,000 %, fällig 25.04.2030	16	-	1.500		
2.628			2.570		
Landesweite forderungsbesicherte Zertifikate, Serie 2004 3, Klasse 1A, 5,849 %, fällig 25.08.2034 *	2.486	0,25	BBCRE Trust 2015-GTP, Serie 2015 GTP, Klasse E, 144A, 4,715 %, fällig 10.08.2033 *	1.892	0,19
845			254		
DB Master Finance LLC, Serie 2021 1A, Klasse A23, 144A, 2,791 %, fällig 20.11.2051	671	0,07	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR1, Serie 2007 AR1, Klasse 1A1, 5,589 %, fällig 25.01.2037 *	220	0,02
2.713			560		
Educational Funding Co LLC/The, Serie 2006 1A, Klasse A3, 144A, 5,963 %, fällig 25.04.2033 *	1.861	0,19	Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, Serie 2018 B1, Klasse A5, 3,666 %, fällig 15.01.2051 *	512	0,05
2.672			3.100		
Encore Credit Receivables Trust 2005-3, Serie 2005 3, Klasse M5, 6,389 %, fällig 25.10.2035 *	2.470	0,25	BXP Trust 2017-CQHP, Serie 2017 CQHP, Klasse A, 144A, 6,208 %, fällig 15.11.2034 *	2.961	0,30
179			51		
Fannie Mae Grantor Trust 2017-T1, Serie 2017 T1, Klasse A, 2,898 %, fällig 25.06.2027	165	0,02	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-3, Serie 2005 3, Klasse 1A2, 6,009 %, fällig 25.04.2035 *	46	-
8.581			300		
Fieldstone Mortgage Investment Trust Serie 2005-2, Serie 2005 2, Klasse M3, 6,209 %, fällig 25.12.2035 *	7.428	0,74	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27, Serie 2015 GC27, Klasse AS, 3,571 %, fällig 02.10.2048	285	0,03
185			72.508		
Strukturierte Pass-Through-Zertifikate von Freddie Mac FRESR 2017-SR01, Serie 2017 SR01, Klasse A3, 3,089 %, fällig 25.11.2027	172	0,02	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C3, Serie 2016 C3, Klasse XA, 1,121 %, fällig 15.11.2049 *	1.786	0,18
640			8.968		
Golub Capital Partners CLO 66B Ltd, Serie 2023 66A, Klasse A, 144A, 6,926 %, fällig 25.04.2036 *	641	0,06	Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-AR6, Serie 2006 AR6, Klasse 2A4, 5,869 %, fällig 25.09.2036 *	2.812	0,28
2.450			20		
GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, Serie 2021 4GS, Klasse A, 144A, 1,930 %, fällig 20.07.2048	1.845	0,18	COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, Serie 2013 CR12, Klasse B, 4,762 %, fällig 10.10.2046 *	15	-
3.226			10		
Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, Serie 2021 1GS, Klasse A, 144A, 2,290 %, fällig 20.01.2048	2.389	0,24	COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, Serie 2013 CR12, Klasse C, 5,124 %, fällig 10.10.2046 *	4	-
1.264			340		
Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1, Serie 2004 1, Klasse M1, 6,179 %, fällig 25.02.2034 *	1.216	0,12	COMM 2013-CCRE6 Mortgage Trust, Serie 2013 CR6, Klasse B, 144A, 3,397 %, fällig 10.03.2046	289	0,03
2.000			610		
Magnetite XIV-R Ltd, Serie 2015 14RA, Klasse A2, 144A, 6,692 %, fällig 18.10.2031 *	2.000	0,20	COMM 2015-CCRE22 Mortgage Trust, Serie 2015 CR22, Klasse A4, 3,048 %, fällig 10.03.2048	587	0,06
1.757			90		
Magnolia Finance, 8,205 %, fällig 09.08.2024	1.698	0,17	COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Serie 2015 DC1, Klasse B, 4,035 %, fällig 02.10.2048 *	77	0,01
3.113			70		
MF1 2021-FL6 Ltd, Serie 2021 FL6, Klasse A, 144A, 6,526 %, fällig 16.07.2036 *	3.055	0,30	COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Serie 2015 DC1, Klasse C, 4,438 %, fällig 02.10.2048 *	58	0,01
3.319			1.450		
Mosaik Solar Loan Trust 2021-3, Serie 2021 3A, Klasse B, 144A, 1,920 %, fällig 20.06.2052	2.380	0,24	COMM 2015-PC1 Mortgage Trust, Serie 2015 PC1, Klasse A5, 3,902 %, fällig 10.07.2050	1.395	0,14
3.000			77		
National Collegiate II Commutation Trust, Serie 2005 AR15, Klasse AR15, 0,000 %, fällig 01.06.2045	337	0,03	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Serie 2019 R07, Klasse 1M2, 144A, 7,502 %, fällig 25.10.2039 *	77	0,01
3.300			1.620		
National Collegiate Student Loan Trust 2006-3, Serie 2006 3, Klasse B, 5,789 %, fällig 26.01.2032 *	2.503	0,25	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05, Serie 2023 R05, Klasse 1M2, 144A, 8,396 %, fällig 25.06.2043 *	1.650	0,16
2.000			560		
Netnet Student Loan Trust 2014-2, Serie 2014 2A, Klasse B, 144A, 6,902 %, fällig 25.06.2041 *	1.890	0,19	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R06, Serie 2023 R06, Klasse 1M2, 144A, 7,988 %, fällig 25.07.2043 *	564	0,06
2.000			500		
Neuberger Berman Loan Advisers Clo 42 Ltd, Serie 2021 42A, Klasse A, 144A, 6,670 %, fällig 16.07.2035 *	1.989	0,20	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, Serie 2015 C1, Klasse AS, 3,791 %, fällig 15.04.2050 *	459	0,05
1.500			1.050		
Ocean Trails Clo X, Serie 2020 10A, Klasse AR, 144A, 6,790 %, fällig 15.10.2034 *	1.480	0,15	CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Klasse A2, 144A, 3,953 %, fällig 15.09.2037	917	0,09
635			140		
Ocean Trails Clo XI, Serie 2021 11A, Klasse A, 144A, 6,808 %, fällig 20.07.2034 *	628	0,06	CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Klasse F, 144A, 4,373 %, fällig 15.09.2037	73	0,01
1.123			5.170		
Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Serie 2007 FXD1, Klasse 1A1, 5,866 %, fällig 25.01.2037	901	0,09	CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Klasse F, 144A, 4,373 %, fällig 15.09.2037	2.033	0,20
253			1.960		
Origen Manufactured Housing Contract Trust 2006-A, Serie 2006 A, Klasse AZ, 6,675 %, fällig 15.10.2037 *	230	0,02	CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Klasse M2, 144A, 2,963 %, fällig 25.07.2057 *	1.454	0,15
1.000			2.360		
Point Au Roche Park CLO Ltd, Serie 2021 1A, Klasse A, 144A, 6,668 %, fällig 20.07.2034 *	989	0,10	CSMC 2021-NQMB, Serie 2021 NQMB, Klasse A1, 144A, 1,841 %, fällig 25.10.2066 *	1.959	0,20
3.004			600		
RASC Serie 2007-KS1 Trust, Serie 2007 KS1, Klasse A4, 5,649 %, fällig 25.01.2037 *	2.766	0,28	CSMC Trust 2017-CHOP, Serie 2017 CHOP, Klasse G, 144A, 10,794 %, fällig 15.07.2032 *	553	0,06
1.859			1.680		
Renaissance Home Equity Loan Trust 2004-1, Serie 2004 1, Klasse AV3, 6,369 %, fällig 25.05.2034 *	1.645	0,16	DBCG 2017-BBG Mortgage Trust, Serie 2017 BBG, Klasse A, 144A, 8,500 %, fällig 15.06.2034 *	1.661	0,17
2.565			150		
SLM Private Education Loan Trust 2010-C, Serie 2010 C, Klasse A5, 144A, 10,175 %, fällig 15.10.2041 *	2.715	0,27	Deutsche Mortgage Securities Inc Mortgage Loan Trust Serie 2006-PR1, Serie 2006 PR1, Klasse 3AF1, 144A, 5,705 %, fällig 15.04.2036 *	134	0,01
192			600		
SMB Private Education Loan Trust 2014-A, Serie 2014 A, Klasse A3, 144A, 6,925 %, fällig 15.04.2032 *	192	0,02	Fannie Mae 5-Jahres-Pool, 4,830 %, fällig 01.09.2028 ∞	594	0,06
2			200		
SMB Private Education Loan Trust 2015-A, Serie 2015 A, Klasse R, 144A, 0,000 %, fällig 15.10.2048	463	0,05	Fannie Mae 5-Jahres-Pool, 4,880 %, fällig 01.09.2028 ∞	201	0,02
345			200		
SMB Private Education Loan Trust, Serie 2020 B, Klasse A1A, 144A, 1,290 %, fällig 15.07.2053	308	0,03	Fannie Mae 5-Jahres-Pool, 5,340 %, fällig 01.09.2028 ∞	203	0,02
1.746			320		
Stonepeak 2021-1 ABS, Serie 2021 1A, Klasse A, 144A, 2,675 %, fällig 28.02.2033	1.557	0,16	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2014 C03, Klasse 1M2, 8,402 %, fällig 25.07.2024 *	326	0,03
1.095			1.317		
Structured Asset Investment Loan Trust 2005-HE1, Serie 2005 HE1, Klasse M2, 6,149 %, fällig 25.07.2035 *	1.017	0,10	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C03, Klasse 1B1, 9,152 %, fällig 25.10.2030 *	1.413	0,14
			11		
			Fannie Mae Interest Strip 390, Klasse C3, 6,000 %, fällig 25.07.2038	2	-
			6		
			Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 22, 5,000 %, fällig 25.01.2039	1	-
<b>Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 68.053 USD)</b>	<b>62.530</b>	<b>6,25</b>			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)</b>					
3 Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 23, 5,000 %, fällig 25.01.2039 *	1	-	24 Fannie Mae Pool „AT8394“, 4,000 %, fällig 01.06.2043	23	-
6 Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 27, 5,500 %, fällig 25.01.2039 *	1	-	65 Fannie Mae Pool „AT9637“, 4,000 %, fällig 01.07.2043	62	0,01
5 Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 34, 5,000 %, fällig 25.01.2038	1	-	49 Fannie Mae Pool „AT9653“, 4,000 %, fällig 01.07.2043	46	-
15 Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 41, 6,000 %, fällig 25.01.2038	3	-	38 Fannie Mae Pool „AT9657“, 4,000 %, fällig 01.07.2043	36	-
47 Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C13, 3,500 %, fällig 25.11.2041	7	-	250 Fannie Mae Pool „AU6735“, 3,000 %, fällig 01.10.2043	222	0,02
54 Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C18, 4,000 %, fällig 25.04.2042	10	-	91 Fannie Mae Pool „AW0318“, 4,500 %, fällig 01.02.2044	86	0,01
53 Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C2, 3,000 %, fällig 25.04.2027	2	-	32 Fannie Mae Pool „BC1509“, 3,000 %, fällig 01.08.2046	29	-
53 Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C22, 4,500 %, fällig 25.11.2039	10	-	90 Fannie Mae Pool „BC2817“, 3,000 %, fällig 01.09.2046	79	0,01
644 Fannie Mae Interest Strip 427, Klasse C73, 3,000 %, fällig 25.12.2048	104	0,01	219 Fannie Mae Pool „BC9077“, 3,500 %, fällig 01.12.2046	199	0,02
200 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,500 % ±	179	0,02	573 Fannie Mae Pool „BD2455“, 3,000 %, fällig 01.01.2047	503	0,05
700 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,000 % ±	646	0,06	232 Fannie Mae Pool „BD8104“, 3,000 %, fällig 01.10.2046	203	0,02
1.500 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 % ±	1.455	0,15	799 Fannie Mae Pool „BF0104“, 4,000 %, fällig 01.02.2056	761	0,08
1.500 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,000 % ±	1.195	0,12	558 Fannie Mae Pool „BF0163“, 5,000 %, fällig 01.11.2046	550	0,05
300 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 % ±	249	0,02	463 Fannie Mae Pool „BF0183“, 4,000 %, fällig 01.01.2057	429	0,04
2.300 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 % ±	1.982	0,20	789 Fannie Mae Pool „BF0191“, 4,000 %, fällig 01.06.2057	739	0,07
6.400 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,500 % ±	6.320	0,63	677 Fannie Mae Pool „BF0222“, 4,500 %, fällig 01.09.2057	647	0,06
100 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 6,000 % ±	100	0,01	37 Fannie Mae Pool „BF0301“, 4,500 %, fällig 01.08.2058	35	-
6 Fannie Mae Pool „745000“, 6,000 %, fällig 01.10.2035	6	-	263 Fannie Mae Pool „BF0338“, 4,500 %, fällig 01.01.2059	251	0,02
4 Fannie Mae Pool „843997“, 6,018 %, fällig 01.11.2035 *	4	-	4.925 Fannie Mae Pool „BF0646“, 2,500 %, fällig 01.06.2062	3.964	0,40
4 Fannie Mae Pool „865915“, 6,247 %, fällig 01.03.2036 *	4	-	72 Fannie Mae Pool „BJ2544“, 3,000 %, fällig 01.12.2037	65	0,01
342 Fannie Mae Pool „890604“, 4,500 %, fällig 01.10.2044	331	0,03	656 Fannie Mae Pool „BK7700“, 4,500 %, fällig 01.10.2048	635	0,06
116 Fannie Mae Pool „890827“, 3,500 %, fällig 01.12.2037	108	0,01	179 Fannie Mae Pool „BL2454“, 3,160 %, fällig 01.05.2029	164	0,02
13 Fannie Mae Pool „995072“, 5,500 %, fällig 01.08.2038	14	-	684 Fannie Mae Pool „BM1565“, 3,000 %, fällig 01.04.2047	600	0,06
32 Fannie Mae Pool „AB9683“, 4,000 %, fällig 01.06.2043	30	-	40 Fannie Mae Pool „BM3799“, 3,000 %, fällig 01.08.2047	35	-
29 Fannie Mae Pool „AE0758“, 7,000 %, fällig 01.02.2039	30	-	249 Fannie Mae Pool „BM4751“, 3,500 %, fällig 01.03.2043	230	0,02
26 Fannie Mae Pool „AK8441“, 4,000 %, fällig 01.04.2042	25	-	356 Fannie Mae Pool „BM4897“, 3,500 %, fällig 01.12.2046	328	0,03
319 Fannie Mae Pool „AL3024“, 3,500 %, fällig 01.01.2043	292	0,03	184 Fannie Mae Pool „BM6623“, 2,500 %, fällig 01.10.2050	149	0,01
31 Fannie Mae Pool „AL3026“, 3,500 %, fällig 01.12.2042	29	-	177 Fannie Mae Pool „BM6898“, 2,149 %, fällig 01.02.2032 *	472	0,05
23 Fannie Mae Pool „AL3508“, 4,000 %, fällig 01.04.2043	22	-	584 Fannie Mae Pool „BM6912“, 2,500 %, fällig 01.01.2052	149	0,01
16 Fannie Mae Pool „AL4741“, 4,500 %, fällig 01.01.2044	15	-	290 Fannie Mae Pool „BN1623“, 4,500 %, fällig 01.11.2048	280	0,03
66 Fannie Mae Pool „AL9397“, 3,000 %, fällig 01.10.2046	58	0,01	942 Fannie Mae Pool „BN3898“, 4,500 %, fällig 01.12.2048	909	0,09
339 Fannie Mae Pool „AL9546“, 3,500 %, fällig 01.11.2046	311	0,03	109 Fannie Mae Pool „BO1858“, 3,000 %, fällig 01.08.2049	96	0,01
299 Fannie Mae Pool „AL9631“, 3,000 %, fällig 01.12.2046	263	0,03	79 Fannie Mae Pool „BP3484“, 2,500 %, fällig 01.06.2051	66	0,01
80 Fannie Mae Pool „AM3347“, 3,310 %, fällig 01.05.2033	73	0,01	382 Fannie Mae Pool „BQ3331“, 2,000 %, fällig 01.08.2050	308	0,03
10 Fannie Mae Pool „AM8674“, 2,810 %, fällig 01.04.2025	10	-	515 Fannie Mae Pool „BQ4926“, 2,000 %, fällig 01.10.2050	413	0,04
207 Fannie Mae Pool „AM8700“, 2,930 %, fällig 01.06.2030	186	0,02	240 Fannie Mae Pool „BQ5876“, 2,500 %, fällig 01.11.2050	202	0,02
89 Fannie Mae Pool „AN4677“, 3,200 %, fällig 01.02.2029	82	0,01	96 Fannie Mae Pool „BQ7435“, 2,500 %, fällig 01.09.2051	79	0,01
114 Fannie Mae Pool „AN4927“, 3,450 %, fällig 01.03.2029	106	0,01	84 Fannie Mae Pool „BR0663“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	67	0,01
135 Fannie Mae Pool „AN5386“, 3,250 %, fällig 01.05.2029	125	0,01	322 Fannie Mae Pool „BR1001“, 2,500 %, fällig 01.05.2051	272	0,03
10 Fannie Mae Pool „AO2711“, 4,000 %, fällig 01.05.2042	9	-	246 Fannie Mae Pool „BR1823“, 2,000 %, fällig 01.01.2051	197	0,02
19 Fannie Mae Pool „AO6086“, 4,000 %, fällig 01.06.2042	18	-	224 Fannie Mae Pool „BR2641“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	182	0,02
9 Fannie Mae Pool „AO9859“, 4,000 %, fällig 01.07.2042	8	-	364 Fannie Mae Pool „BR2643“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	294	0,03
14 Fannie Mae Pool „AP0692“, 4,000 %, fällig 01.07.2042	14	-	141 Fannie Mae Pool „BR2644“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	114	0,01
15 Fannie Mae Pool „AP2530“, 4,000 %, fällig 01.08.2042	14	-	214 Fannie Mae Pool „BR3256“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	176	0,02
49 Fannie Mae Pool „AP4710“, 3,500 %, fällig 01.08.2042	45	-	379 Fannie Mae Pool „BR3257“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	310	0,03
233 Fannie Mae Pool „AP4781“, 3,000 %, fällig 01.09.2042	206	0,02	228 Fannie Mae Pool „BR3286“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	184	0,02
23 Fannie Mae Pool „AP4903“, 4,000 %, fällig 01.09.2042	22	-	321 Fannie Mae Pool „BR4035“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	258	0,03
53 Fannie Mae Pool „AP7399“, 4,000 %, fällig 01.09.2042	51	-	535 Fannie Mae Pool „BR4052“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	428	0,04
14 Fannie Mae Pool „AP9229“, 4,000 %, fällig 01.10.2042	13	-	245 Fannie Mae Pool „BR4080“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	196	0,02
55 Fannie Mae Pool „AP9766“, 4,000 %, fällig 01.10.2042	52	0,01	218 Fannie Mae Pool „BR4722“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	176	0,02
49 Fannie Mae Pool „AP9862“, 4,000 %, fällig 01.10.2042	46	-	161 Fannie Mae Pool „BR4753“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	130	0,01
16 Fannie Mae Pool „AQ0100“, 4,000 %, fällig 01.10.2042	15	-	284 Fannie Mae Pool „BR4756“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	229	0,02
54 Fannie Mae Pool „AQ1641“, 4,000 %, fällig 01.10.2042	51	-	158 Fannie Mae Pool „BR5487“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	127	0,01
16 Fannie Mae Pool „AQ3599“, 4,000 %, fällig 01.11.2042	15	-	322 Fannie Mae Pool „BR5587“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	260	0,03
21 Fannie Mae Pool „AQ4078“, 4,000 %, fällig 01.06.2043	20	-	155 Fannie Mae Pool „BR5589“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	124	0,01
16 Fannie Mae Pool „AQ4080“, 4,000 %, fällig 01.06.2043	15	-	407 Fannie Mae Pool „BR5633“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	329	0,03
28 Fannie Mae Pool „AQ4555“, 4,000 %, fällig 01.12.2042	26	-	246 Fannie Mae Pool „BR6462“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	197	0,02
22 Fannie Mae Pool „AQ5137“, 4,000 %, fällig 01.11.2042	21	-	77 Fannie Mae Pool „BR6515“, 2,000 %, fällig 01.04.2051	63	0,01
40 Fannie Mae Pool „AQ7003“, 4,000 %, fällig 01.12.2042	38	-	76 Fannie Mae Pool „BR7744“, 2,000 %, fällig 01.04.2051	62	0,01
54 Fannie Mae Pool „AQ7082“, 4,000 %, fällig 01.01.2043	51	0,01	221 Fannie Mae Pool „BR7745“, 2,000 %, fällig 01.04.2051	179	0,02
109 Fannie Mae Pool „AR7399“, 3,000 %, fällig 01.06.2043	96	0,01	80 Fannie Mae Pool „BR8478“, 2,000 %, fällig 01.04.2051	65	0,01
259 Fannie Mae Pool „AS0038“, 3,000 %, fällig 01.07.2043	230	0,02	122 Fannie Mae Pool „BR8518“, 2,000 %, fällig 01.04.2051	123	0,01
23 Fannie Mae Pool „AS0070“, 4,000 %, fällig 01.08.2043	22	-	100 Fannie Mae Pool „BS5233“, 3,520 %, fällig 01.06.2032	91	0,01
83 Fannie Mae Pool „AS3253“, 4,000 %, fällig 01.09.2044	78	0,01	100 Fannie Mae Pool „BS5754“, 3,900 %, fällig 01.06.2032	93	0,01
22 Fannie Mae Pool „AS4271“, 4,500 %, fällig 01.01.2045	21	-	100 Fannie Mae Pool „BS5808“, 3,830 %, fällig 01.07.2032	93	0,01
38 Fannie Mae Pool „AS4347“, 4,000 %, fällig 01.01.2045	36	-	100 Fannie Mae Pool „BS5955“, 3,730 %, fällig 01.06.2032	92	0,01
101 Fannie Mae Pool „AS6340“, 3,500 %, fällig 01.12.2045	92	0,01	98 Fannie Mae Pool „BS5964“, 3,670 %, fällig 01.06.2032	91	0,01
81 Fannie Mae Pool „AS6541“, 3,500 %, fällig 01.01.2046	74	0,01	100 Fannie Mae Pool „BS6002“, 3,560 %, fällig 01.07.2032	91	0,01
66 Fannie Mae Pool „AS6562“, 3,500 %, fällig 01.01.2046	60	0,01	98 Fannie Mae Pool „BS6023“, 3,860 %, fällig 01.07.2032	92	0,01
57 Fannie Mae Pool „AS7844“, 3,000 %, fällig 01.09.2046	50	-	100 Fannie Mae Pool „BS6084“, 4,185 %, fällig 01.07.2032	95	0,01
190 Fannie Mae Pool „AS8623“, 3,000 %, fällig 01.01.2047	167	0,02	99 Fannie Mae Pool „BS6103“, 4,060 %, fällig 01.07.2032	93	0,01
127 Fannie Mae Pool „AS8740“, 3,500 %, fällig 01.02.2037	119	0,01	100 Fannie Mae Pool „BS6130“, 4,130 %, fällig 01.07.2032	95	0,01
730 Fannie Mae Pool „AS8745“, 3,000 %, fällig 01.02.2047	640	0,06	98 Fannie Mae Pool „BS6147“, 3,880 %, fällig 01.07.2032	92	0,01
18 Fannie Mae Pool „AT7208“, 4,000 %, fällig 01.06.2043	17	-	100 Fannie Mae Pool „BS6169“, 4,110 %, fällig 01.07.2032	95	0,01
			100 Fannie Mae Pool „BS6188“, 4,340 %, fällig 01.07.2032	97	0,01
			200 Fannie Mae Pool „BS6215“, 3,840 %, fällig 01.07.2032	186	0,02
			300 Fannie Mae Pool „BS6565“, 3,740 %, fällig 01.09.2032	276	0,03
			300 Fannie Mae Pool „BS6894“, 4,410 %, fällig 01.12.2032	290	0,03
			300 Fannie Mae Pool „BS6896“, 4,370 %, fällig 01.11.2032	290	0,03
			100 Fannie Mae Pool „BS6914“, 4,440 %, fällig 01.11.2032	97	0,01
			99 Fannie Mae Pool „BS7424“, 4,940 %, fällig 01.12.2032	99	0,01
			900 Fannie Mae Pool „BS7531“, 4,360 %, fällig 01.02.2033	867	0,09
			300 Fannie Mae Pool „BS7599“, 4,420 %, fällig 01.03.2033	290	0,03

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventar- wertes	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventar- wertes
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)</b>					
320			446		
Fannie Mae Pool „BS7657“, 5,080 %, fällig 01.01.2033	325	0,03	Fannie Mae Pool „FM5783“, 3,000 %, fällig 01.06.2038	411	0,04
300			233		
Fannie Mae Pool „BS7752“, 4,310 %, fällig 01.02.2030	291	0,03	Fannie Mae Pool „FM5904“, 2,500 %, fällig 01.02.2051	196	0,02
200			482		
Fannie Mae Pool „BS7753“, 4,310 %, fällig 01.02.2030	194	0,02	Fannie Mae Pool „FM5944“, 2,500 %, fällig 01.01.2051	403	0,04
200			100		
Fannie Mae Pool „BS8162“, 4,480 %, fällig 01.05.2033	195	0,02	Fannie Mae Pool „FM6015“, 3,500 %, fällig 01.08.2039	94	0,01
200			393		
Fannie Mae Pool „BS8410“, 4,740 %, fällig 01.06.2030	196	0,02	Fannie Mae Pool „FM6134“, 3,000 %, fällig 01.03.2040	357	0,04
100			304		
Fannie Mae Pool „BS9106“, 5,350 %, fällig 01.07.2033	101	0,01	Fannie Mae Pool „FM6460“, 2,500 %, fällig 01.03.2051	256	0,03
249			2.430		
Fannie Mae Pool „BT0846“, 2,500 %, fällig 01.07.2051	208	0,02	Fannie Mae Pool „FM6597“, 2,000 %, fällig 01.03.2041	2.034	0,20
190			230		
Fannie Mae Pool „BT0972“, 2,500 %, fällig 01.05.2051	153	0,02	Fannie Mae Pool „FM7100“, 3,500 %, fällig 01.06.2050	209	0,02
345			94		
Fannie Mae Pool „BT3244“, 2,500 %, fällig 01.07.2051	289	0,03	Fannie Mae Pool „FM7141“, 4,000 %, fällig 01.02.2047	89	0,01
86			411		
Fannie Mae Pool „BT3270“, 2,500 %, fällig 01.08.2051	72	0,01	Fannie Mae Pool „FM7675“, 2,500 %, fällig 01.06.2051	345	0,03
176			190		
Fannie Mae Pool „BT3290“, 2,500 %, fällig 01.08.2051	147	0,01	Fannie Mae Pool „FM7676“, 2,500 %, fällig 01.06.2051	142	0,01
165			80		
Fannie Mae Pool „BT3303“, 2,500 %, fällig 01.08.2051	138	0,01	Fannie Mae Pool „FM7727“, 2,500 %, fällig 01.06.2051	68	0,01
409			796		
Fannie Mae Pool „BT5574“, 2,500 %, fällig 01.08.2051	341	0,03	Fannie Mae Pool „FM7786“, 4,000 %, fällig 01.01.2049	748	0,07
274			121		
Fannie Mae Pool „BU1322“, 2,500 %, fällig 01.02.2052	228	0,02	Fannie Mae Pool „FM7796“, 4,000 %, fällig 01.06.2048	114	0,01
802			79		
Fannie Mae Pool „BU1421“, 3,000 %, fällig 01.01.2052	697	0,07	Fannie Mae Pool „FM7869“, 2,500 %, fällig 01.01.2051	66	0,01
351			324		
Fannie Mae Pool „BU2599“, 2,500 %, fällig 01.01.2052	295	0,03	Fannie Mae Pool „FM7900“, 2,500 %, fällig 01.07.2051	272	0,03
81			422		
Fannie Mae Pool „BU5925“, 3,000 %, fällig 01.12.2051	71	0,01	Fannie Mae Pool „FM7910“, 2,500 %, fällig 01.07.2051	357	0,04
92			333		
Fannie Mae Pool „BU8750“, 2,500 %, fällig 01.06.2052	90	0,01	Fannie Mae Pool „FM8025“, 2,500 %, fällig 01.07.2051	282	0,03
349			228		
Fannie Mae Pool „BV3089“, 2,500 %, fällig 01.02.2052	293	0,03	Fannie Mae Pool „FM8166“, 3,000 %, fällig 01.06.2051	201	0,02
189			1.488		
Fannie Mae Pool „BV3167“, 3,500 %, fällig 01.05.2052	171	0,02	Fannie Mae Pool „FM8576“, 3,000 %, fällig 01.02.2050	1.310	0,13
169			1.020		
Fannie Mae Pool „BV4142“, 3,000 %, fällig 01.03.2052	148	0,01	Fannie Mae Pool „FM8577“, 3,000 %, fällig 01.08.2051	897	0,09
179			2.061		
Fannie Mae Pool „BV5373“, 2,500 %, fällig 01.04.2052	150	0,01	Fannie Mae Pool „FM8786“, 2,500 %, fällig 01.10.2051	1.729	0,17
171			202		
Fannie Mae Pool „BV5405“, 4,000 %, fällig 01.04.2052	159	0,02	Fannie Mae Pool „FM8813“, 3,500 %, fällig 01.09.2051	181	0,02
627			658		
Fannie Mae Pool „BV8546“, 3,500 %, fällig 01.05.2052	568	0,06	Fannie Mae Pool „FM8864“, 2,500 %, fällig 01.10.2051	552	0,06
90			163		
Fannie Mae Pool „BV9900“, 4,000 %, fällig 01.05.2052	84	0,01	Fannie Mae Pool „FM8977“, 2,500 %, fällig 01.09.2051	138	0,01
390			1.036		
Fannie Mae Pool „BX2186“, 4,500 %, fällig 01.11.2052	370	0,04	Fannie Mae Pool „FM9195“, 2,500 %, fällig 01.10.2051	861	0,09
84			169		
Fannie Mae Pool „BX6441“, 6,500 %, fällig 01.02.2053	86	0,01	Fannie Mae Pool „FM9205“, 2,500 %, fällig 01.04.2051	142	0,01
297			265		
Fannie Mae Pool „BX6719“, 5,500 %, fällig 01.02.2053	294	0,03	Fannie Mae Pool „FM9335“, 2,500 %, fällig 01.10.2051	221	0,02
280			250		
Fannie Mae Pool „BX7702“, 6,500 %, fällig 01.02.2053	285	0,03	Fannie Mae Pool „FM9365“, 3,000 %, fällig 01.11.2051	219	0,02
292			206		
Fannie Mae Pool „BX9419“, 5,000 %, fällig 01.03.2053	284	0,03	Fannie Mae Pool „FM9413“, 4,000 %, fällig 01.11.2051	191	0,02
342			429		
Fannie Mae Pool „CA2047“, 4,500 %, fällig 01.07.2048	331	0,03	Fannie Mae Pool „FM9441“, 2,000 %, fällig 01.04.2051	343	0,03
595			826		
Fannie Mae Pool „CA2199“, 4,500 %, fällig 01.08.2048	575	0,06	Fannie Mae Pool „FM9464“, 3,000 %, fällig 01.11.2051	722	0,07
504			358		
Fannie Mae Pool „CA2798“, 4,500 %, fällig 01.12.2048	486	0,05	Fannie Mae Pool „FM9489“, 2,000 %, fällig 01.11.2051	286	0,03
262			312		
Fannie Mae Pool „CA4819“, 4,000 %, fällig 01.12.2049	245	0,02	Fannie Mae Pool „FS0024“, 2,500 %, fällig 01.09.2051	265	0,03
467			781		
Fannie Mae Pool „CA5522“, 4,000 %, fällig 01.04.2050	437	0,04	Fannie Mae Pool „FS0028“, 2,500 %, fällig 01.09.2051	655	0,07
451			428		
Fannie Mae Pool „CA7257“, 2,500 %, fällig 01.10.2050	379	0,04	Fannie Mae Pool „FS0034“, 3,000 %, fällig 01.12.2051	375	0,04
516			299		
Fannie Mae Pool „CA7531“, 3,000 %, fällig 01.10.2050	453	0,05	Fannie Mae Pool „FS0037“, 3,000 %, fällig 01.08.2051	263	0,03
1.137			215		
Fannie Mae Pool „CA8779“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	910	0,09	Fannie Mae Pool „FS0067“, 4,500 %, fällig 01.09.2051	205	0,02
1.484			600		
Fannie Mae Pool „CA9220“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	1.188	0,12	Fannie Mae Pool „FS0240“, 3,000 %, fällig 01.01.2052	526	0,05
78			624		
Fannie Mae Pool „CA9358“, 2,500 %, fällig 01.03.2041	68	0,01	Fannie Mae Pool „FS0331“, 3,000 %, fällig 01.01.2052	540	0,05
402			1.175		
Fannie Mae Pool „CB0100“, 2,500 %, fällig 01.04.2041	349	0,03	Fannie Mae Pool „FS0349“, 2,000 %, fällig 01.01.2052	943	0,09
160			82		
Fannie Mae Pool „CB0101“, 2,500 %, fällig 01.04.2041	139	0,01	Fannie Mae Pool „FS0357“, 3,000 %, fällig 12.01.2051	72	0,01
81			264		
Fannie Mae Pool „CB0114“, 2,500 %, fällig 01.04.2041	70	0,01	Fannie Mae Pool „FS0366“, 2,500 %, fällig 01.01.2052	225	0,02
2.304			260		
Fannie Mae Pool „CB0458“, 2,500 %, fällig 01.05.2051	1.924	0,19	Fannie Mae Pool „FS0408“, 3,000 %, fällig 01.01.2052	229	0,02
1.391			967		
Fannie Mae Pool „CB0470“, 2,500 %, fällig 01.05.2041	1.204	0,12	Fannie Mae Pool „FS0424“, 2,500 %, fällig 01.01.2052	812	0,08
878			258		
Fannie Mae Pool „CB1273“, 2,000 %, fällig 01.08.2051	703	0,07	Fannie Mae Pool „FS0434“, 2,500 %, fällig 01.11.2051	218	0,02
167			180		
Fannie Mae Pool „CB1301“, 2,500 %, fällig 01.08.2051	140	0,01	Fannie Mae Pool „FS0483“, 3,500 %, fällig 01.01.2052	161	0,02
257			993		
Fannie Mae Pool „CB2115“, 2,500 %, fällig 01.11.2041	221	0,02	Fannie Mae Pool „FS0523“, 2,500 %, fällig 01.02.2052	832	0,08
3.769			1.359		
Fannie Mae Pool „CB2563“, 2,000 %, fällig 01.01.2042	3.135	0,31	Fannie Mae Pool „FS0549“, 2,500 %, fällig 01.02.2052	1.138	0,11
2.423			269		
Fannie Mae Pool „CB2664“, 3,000 %, fällig 01.01.2052	2.094	0,21	Fannie Mae Pool „FS0551“, 2,500 %, fällig 01.02.2052	226	0,02
173			268		
Fannie Mae Pool „CB2680“, 3,500 %, fällig 01.01.2052	155	0,02	Fannie Mae Pool „FS0582“, 2,500 %, fällig 01.02.2052	225	0,02
1.349			279		
Fannie Mae Pool „CB3031“, 2,500 %, fällig 01.03.2052	1.119	0,11	Fannie Mae Pool „FS0583“, 2,500 %, fällig 01.02.2052	234	0,02
742			88		
Fannie Mae Pool „CB3044“, 2,500 %, fällig 01.03.2052	622	0,06	Fannie Mae Pool „FS0584“, 2,000 %, fällig 01.02.2052	71	0,01
729			91		
Fannie Mae Pool „CB3234“, 3,000 %, fällig 01.04.2052	631	0,06	Fannie Mae Pool „FS0612“, 2,000 %, fällig 01.02.2052	74	0,01
994			346		
Fannie Mae Pool „CB3282“, 3,500 %, fällig 01.04.2052	890	0,09	Fannie Mae Pool „FS0697“, 2,500 %, fällig 01.02.2042	297	0,03
91			622		
Fannie Mae Pool „CB3386“, 3,500 %, fällig 01.04.2042	83	0,01	Fannie Mae Pool „FS0751“, 3,000 %, fällig 01.03.2052	537	0,05
912			440		
Fannie Mae Pool „CB3614“, 4,000 %, fällig 01.05.2052	848	0,08	Fannie Mae Pool „FS1014“, 2,000 %, fällig 01.02.2052	354	0,04
555			100		
Fannie Mae Pool „CB3833“, 3,000 %, fällig 01.06.2052	479	0,05	Fannie Mae Pool „FS1015“, 2,000 %, fällig 01.02.2052	80	0,01
182			3.380		
Fannie Mae Pool „CB3880“, 5,000 %, fällig 01.06.2052	177	0,02	Fannie Mae Pool „FS1074“, 3,000 %, fällig 01.03.2052	2.951	0,29
280			344		
Fannie Mae Pool „CB3899“, 3,500 %, fällig 01.06.2052	251	0,02	Fannie Mae Pool „FS1104“, 2,500 %, fällig 01.11.2051	289	0,03
84			265		
Fannie Mae Pool „CB4418“, 5,500 %, fällig 01.08.2052	83	0,01	Fannie Mae Pool „FS1111“, 2,500 %, fällig 01.05.2051	222	0,02
1.399			1.364		
Fannie Mae Pool „CB5497“, 6,500 %, fällig 01.01.2053	1.432	0,14	Fannie Mae Pool „FS1112“, 2,000 %, fällig 01.03.2052	1.106	0,11
482			520		
Fannie Mae Pool „CB5892“, 4,500 %, fällig 01.03.2053	457	0,05	Fannie Mae Pool „FS1118“, 3,500 %, fällig 01.03.2052	465	0,05
397			512		
Fannie Mae Pool „CB6030“, 4,500 %, fällig 01.04.2053	377	0,04	Fannie Mae Pool „FS1237“, 3,500 %, fällig 01.12.2051	464	0,05
582			795		
Fannie Mae Pool „CB6322“, 5,500 %, fällig 01.05.2053	577	0,06	Fannie Mae Pool „FS1289“, 3,000 %, fällig 01.03.2052	700	0,07
1.780			252		
Fannie Mae Pool „CB6753“, 6,000 %, fällig 01.07.2053	1.790	0,18	Fannie Mae Pool „FS1403“, 3,000 %, fällig 01.01.2045	223	0,02
342			546		
Fannie Mae Pool „FM0068“, 3,500 %, fällig 01.02.2040	315	0,03	Fannie Mae Pool „FS1454“, 3,500 %, fällig 01.04.2052	490	0,05
118			523		
Fannie Mae Pool „FM0071“, 3,500 %, fällig 01.02.2040	109	0,01	Fannie Mae Pool „FS1462“, 3,500 %, fällig 01.01.2052	474	0,05
124			346		
Fannie Mae Pool „FM1263“, 4,500 %, fällig 01.07.2049	119	0,01	Fannie Mae Pool „FS1539“, 3,000 %, fällig 01.11.2048	307	0,03
992			459		
Fannie Mae Pool „FM1727“, 5,000 %, fällig 01.09.2049	978	0,10	Fannie Mae Pool „FS1555“, 3,000 %, fällig 01.04.2052	412	0,04
97			1.917		
Fannie Mae Pool „FM2158“, 4,000 %, fällig 01.10.2049	91	0,01	Fannie Mae Pool „FS1556“, 3,500 %, fällig 01.05.2052	1.735	0,17
870			739		
Fannie Mae Pool „FM3049“, 4,000 %, fällig 01.04.2044	826	0,08	Fannie Mae Pool „FS1626“, 2,500 %, fällig 01.04.2052	616	0,06
872			91		
Fannie Mae Pool „FM3123“, 2,500 %, fällig 01.03.2038	783	0,08	Fannie Mae Pool „FS1628“, 2,500 %, fällig 01.04.2052	77	0,01
172			179		
Fannie Mae Pool „FM3158“, 4,000 %, fällig 01.11.2048	161	0,02	Fannie Mae Pool „FS1631“, 2,500 %, fällig 01.02.2051	149	0,01



# FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinventarwerts
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)</b>					
94 Fannie Mae Pool „FS2768“, 2,000 %, fällig 01.01.2052	75	0,01	45 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 74, Klasse SA, 1,248 %, fällig 25.03.2042 *	3	-
1.331 Fannie Mae Pool „FS3339“, 3,500 %, fällig 01.06.2052	1.191	0,12	145 Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Klasse BC, 6,500 %, fällig 25.07.2042	153	0,02
274 Fannie Mae Pool „FS3411“, 6,000 %, fällig 01.01.2053	277	0,03	178 Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Klasse CB, 5,500 %, fällig 25.04.2042	180	0,02
389 Fannie Mae Pool „FS3672“, 5,500 %, fällig 01.02.2053	387	0,04	1.006 Fannie Mae REMICS, Serie 2016 23, Klasse ST, 0,598 %, fällig 25.11.2045 *	99	0,01
277 Fannie Mae Pool „FS3813“, 4,500 %, fällig 01.11.2052	263	0,03	153 Fannie Mae REMICS, Serie 2016 61, Klasse BS, 0,698 %, fällig 25.09.2046 *	10	-
386 Fannie Mae Pool „FS3835“, 4,500 %, fällig 01.11.2052	366	0,04	766 Fannie Mae REMICS, Serie 2017 76, Klasse SB, 0,698 %, fällig 25.10.2057 *	80	0,01
571 Fannie Mae Pool „FS3836“, 4,500 %, fällig 01.01.2053	542	0,05	202 Fannie Mae REMICS, Serie 2017 85, Klasse SC, 0,798 %, fällig 25.11.2047 *	16	-
392 Fannie Mae Pool „FS3941“, 5,000 %, fällig 01.02.2053	381	0,04	639 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 47, Klasse GZ, 2,000 %, fällig 25.07.2050	372	0,04
382 Fannie Mae Pool „FS3977“, 4,500 %, fällig 01.11.2052	363	0,04	1.700 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 56, Klasse AQ, 2,000 %, fällig 25.08.2050	1.291	0,13
383 Fannie Mae Pool „FS3978“, 5,000 %, fällig 01.01.2053	372	0,04	388 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 56, Klasse DI, 2,500 %, fällig 25.08.2050	67	0,01
278 Fannie Mae Pool „FS4000“, 6,000 %, fällig 01.07.2041	287	0,03	379 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 74, Klasse EI, 2,500 %, fällig 25.10.2050	61	0,01
294 Fannie Mae Pool „FS4108“, 4,000 %, fällig 01.12.2051	272	0,03	2.109 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 89, Klasse DI, 2,500 %, fällig 25.12.2050	318	0,03
99 Fannie Mae Pool „FS4136“, 5,000 %, fällig 01.04.2053	96	0,01	1.318 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 97, Klasse AI, 2,000 %, fällig 25.01.2051	175	0,02
1.359 Fannie Mae Pool „FS4269“, 2,000 %, fällig 01.10.2051	1.098	0,11	2.061 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 3, Klasse QI, 2,500 %, fällig 25.02.2051	313	0,03
776 Fannie Mae Pool „FS4270“, 2,000 %, fällig 01.03.2052	623	0,06	2.019 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 69, Klasse II, 2,500 %, fällig 25.01.2049	272	0,03
478 Fannie Mae Pool „FS4308“, 5,000 %, fällig 01.04.2053	464	0,05	241 Fannie Mae-Aces, Serie 2013 M6, Klasse 1AC, 3,454 %, fällig 25.02.2043 *	224	0,02
194 Fannie Mae Pool „FS4314“, 2,000 %, fällig 01.03.2052	156	0,02	800 Fannie Mae-Aces, Serie 2018 M15, Klasse 1A2, 3,700 %, fällig 25.01.2036	726	0,07
192 Fannie Mae Pool „FS4448“, 4,000 %, fällig 01.12.2044	182	0,02	741 Fannie Mae-Aces, Serie 2018 M9, Klasse APT2, 3,209 %, fällig 25.04.2028 *	692	0,07
286 Fannie Mae Pool „FS4454“, 6,000 %, fällig 01.04.2053	288	0,03	480 Fannie Mae-Aces, Serie 2019 M19, Klasse A2, 2,560 %, fällig 25.09.2029	430	0,04
280 Fannie Mae Pool „FS4480“, 4,500 %, fällig 01.03.2050	271	0,03	1.688 Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M36, Klasse X1, 1,541 %, fällig 25.09.2034 *	108	0,01
389 Fannie Mae Pool „FS4524“, 5,000 %, fällig 01.05.2053	378	0,04	100 Fannie Mae-Aces, Serie 2023 M4, Klasse A2, 3,894 %, fällig 25.08.2032 *	93	0,01
189 Fannie Mae Pool „FS4645“, 4,000 %, fällig 11.01.2051	175	0,02	60 Freddie Mac Gold Pool „C91987“, 3,000 %, fällig 01.04.2038	54	0,01
298 Fannie Mae Pool „FS4805“, 5,500 %, fällig 01.05.2053	296	0,03	113 Freddie Mac Gold Pool „G06409“, 6,000 %, fällig 01.11.2039	117	0,01
3.818 Fannie Mae Pool „FS5059“, 3,500 %, fällig 01.11.2048	3.480	0,35	12 Freddie Mac Gold Pool „G06669“, 6,500 %, fällig 01.09.2039	12	-
9 Fannie Mae Pool „MA0706“, 4,500 %, fällig 01.04.2031	9	-	- Freddie Mac Gold Pool „G13888“, 5,000 %, fällig 01.06.2025	-	-
36 Fannie Mae Pool „MA0734“, 4,500 %, fällig 01.05.2031	36	-	1.240 Freddie Mac Gold Pool „G60985“, 3,000 %, fällig 01.05.2047	1.095	0,11
11 Fannie Mae Pool „MA0776“, 4,500 %, fällig 01.06.2031	10	-	787 Freddie Mac Gold Pool „G67701“, 3,000 %, fällig 01.10.2046	695	0,07
16 Fannie Mae Pool „MA0913“, 4,500 %, fällig 01.11.2031	16	-	21 Freddie Mac Gold Pool „Q19135“, 4,000 %, fällig 01.06.2043	20	-
16 Fannie Mae Pool „MA0939“, 4,500 %, fällig 01.12.2031	16	-	23 Freddie Mac Gold Pool „Q19254“, 4,000 %, fällig 01.06.2043	22	-
63 Fannie Mae Pool „MA1146“, 4,000 %, fällig 01.08.2042	60	0,01	24 Freddie Mac Gold Pool „Q19611“, 4,000 %, fällig 01.07.2043	23	-
16 Fannie Mae Pool „MA1177“, 3,500 %, fällig 01.09.2042	15	-	21 Freddie Mac Gold Pool „Q19615“, 4,000 %, fällig 01.07.2043	20	-
454 Fannie Mae Pool „MA1217“, 4,000 %, fällig 01.10.2042	429	0,04	7 Freddie Mac Gold Pool „Q27298“, 4,000 %, fällig 01.07.2044	6	-
103 Fannie Mae Pool „MA1253“, 4,000 %, fällig 01.11.2042	98	0,01	302 Freddie Mac Gold Pool „Q45560“, 3,000 %, fällig 01.01.2047	265	0,03
288 Fannie Mae Pool „MA1283“, 3,500 %, fällig 01.12.2042	263	0,03	772 Freddie Mac Gold Pool „Q45737“, 3,000 %, fällig 01.01.2047	677	0,07
199 Fannie Mae Pool „MA1437“, 3,500 %, fällig 01.05.2043	182	0,02	213 Freddie Mac Gold Pool „Q45819“, 3,000 %, fällig 01.01.2047	187	0,02
23 Fannie Mae Pool „MA1547“, 4,000 %, fällig 01.08.2043	22	-	191 Freddie Mac Gold Pool „Q45827“, 3,000 %, fällig 01.01.2047	167	0,02
42 Fannie Mae Pool „MA1591“, 4,500 %, fällig 01.09.2043	41	-	74 Freddie Mac Gold Pool „U90316“, 4,000 %, fällig 01.10.2042	70	0,01
38 Fannie Mae Pool „MA1629“, 4,500 %, fällig 01.10.2043	36	-	45 Freddie Mac Gold Pool „U91254“, 4,000 %, fällig 01.04.2043	42	-
18 Fannie Mae Pool „MA1664“, 4,500 %, fällig 01.11.2043	17	-	18 Freddie Mac Gold Pool „U95137“, 4,000 %, fällig 01.08.2043	17	-
40 Fannie Mae Pool „MA1711“, 4,500 %, fällig 01.12.2043	39	-	546 Freddie Mac Gold Pool „U99054“, 4,000 %, fällig 01.06.2043	518	0,05
121 Fannie Mae Pool „MA2110“, 3,500 %, fällig 01.12.2034	115	0,01	6.438 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K058, Klasse X1, 1,039 %, fällig 25.08.2026 *	141	0,01
83 Fannie Mae Pool „MA2138“, 3,500 %, fällig 01.01.2035	79	0,01	8.433 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K128, Klasse X1, 0,612 %, fällig 25.03.2031 *	255	0,03
54 Fannie Mae Pool „MA2320“, 3,000 %, fällig 01.07.2035	50	-	30.132 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K130, Klasse X1, 1,143 %, fällig 25.06.2031 *	1.883	0,19
504 Fannie Mae Pool „MA2523“, 3,000 %, fällig 01.02.2036	465	0,05	4.491 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K131, Klasse X1, 0,830 %, fällig 25.07.2031 *	204	0,02
387 Fannie Mae Pool „MA2579“, 3,000 %, fällig 01.04.2036	357	0,04	7.783 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K144, Klasse X1, 0,436 %, fällig 25.04.2032 *	191	0,02
782 Fannie Mae Pool „MA2672“, 3,000 %, fällig 01.07.2036	721	0,07			
323 Fannie Mae Pool „MA2707“, 3,000 %, fällig 01.08.2036	297	0,03			
1.696 Fannie Mae Pool „MA2773“, 3,000 %, fällig 01.10.2036	1.558	0,16			
839 Fannie Mae Pool „MA2832“, 3,000 %, fällig 01.12.2036	770	0,08			
1.380 Fannie Mae Pool „MA3210“, 3,500 %, fällig 01.12.2047	1.255	0,13			
297 Fannie Mae Pool „MA4031“, 4,500 %, fällig 01.05.2050	286	0,03			
223 Fannie Mae Pool „MA4120“, 2,500 %, fällig 01.09.2050	187	0,02			
300 Fannie Mae Pool „MA4177“, 2,500 %, fällig 01.11.2040	260	0,03			
3.178 Fannie Mae Pool „MA4208“, 2,000 %, fällig 01.12.2050	2.547	0,25			
233 Fannie Mae Pool „MA4237“, 2,000 %, fällig 01.01.2051	186	0,02			
236 Fannie Mae Pool „MA4255“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	189	0,02			
1.016 Fannie Mae Pool „MA4280“, 1,500 %, fällig 01.03.2051	768	0,08			
685 Fannie Mae Pool „MA4306“, 2,500 %, fällig 01.04.2051	570	0,06			
840 Fannie Mae Pool „MA4325“, 2,000 %, fällig 01.05.2051	670	0,07			
164 Fannie Mae Pool „MA4364“, 2,000 %, fällig 01.06.2041	138	0,01			
518 Fannie Mae Pool „MA4474“, 2,000 %, fällig 01.11.2041	429	0,04			
175 Fannie Mae Pool „MA4501“, 2,000 %, fällig 01.12.2041	145	0,01			
445 Fannie Mae Pool „MA4540“, 2,000 %, fällig 01.02.2042	370	0,04			
180 Fannie Mae Pool „MA4570“, 2,000 %, fällig 01.03.2042	150	0,01			
267 Fannie Mae Pool „MA4571“, 2,500 %, fällig 01.03.2042	228	0,02			
545 Fannie Mae Pool „MA4587“, 2,500 %, fällig 01.04.2042	466	0,05			
183 Fannie Mae Pool „MA4606“, 2,000 %, fällig 01.05.2042	152	0,02			
91 Fannie Mae Pool „MA4607“, 2,500 %, fällig 01.05.2042	78	0,01			
69 Fannie Mae REMICS, Serie 2005 29, Klasse 2A, 5,500 %, fällig 25.04.2035	70	0,01			
280 Fannie Mae REMICS, Serie 2011 59, Klasse NZ, 5,500 %, fällig 25.07.2041	284	0,03			
73 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 133, Klasse CS, 0,748 %, fällig 25.12.2042 *	7	-			
4 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 28, Klasse B, 6,500 %, fällig 25.06.2039	4	-			
141 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 35, Klasse SC, 1,098 %, fällig 25.04.2042 *	14	-			
38 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 46, Klasse BA, 6,000 %, fällig 25.05.2042	40	-			
55 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 51, Klasse B, 7,000 %, fällig 25.05.2042	59	0,01			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)</b>					
500			195		0,02
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate			395		0,04
K748, Klasse A2, 2,260 %, fällig 25.01.2029 *	441	0,04	1.642		0,13
10.773			2.410		0,19
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate,			1.780		0,14
Serie K 150, Klasse X1, 0,446 %, fällig 25.09.2032 *	272	0,03	1.940		0,16
18.000			922		0,07
Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate,			257		0,02
Serie K 157, Klasse X1, 0,419 %, fällig 25.05.2033 *	422	0,04	123		0,01
53			262		0,02
Freddie Mac Non Gold Pool „84069“, 2,104 %, fällig			177		0,01
01.03.2047 *	50	-	537		0,04
1.552			269		0,02
Freddie Mac Non Gold Pool „841076“, 3,008 %, fällig			275		0,02
01.11.2048 *	1.453	0,15	1.019		0,08
530			974		0,09
Freddie Mac Non Gold Pool „841077“, 2,871 %, fällig			333		0,03
01.11.2047 *	503	0,05	598		0,05
758			58		0,01
Freddie Mac Non Gold Pool „841081“, 3,099 %, fällig			94		0,01
01.02.2050 *	719	0,07	282		0,02
44			96		0,01
Freddie Mac Pool „QA5770“, 3,000 %, fällig 01.01.2050	39	-	1.273		0,11
402			54		0,00
Freddie Mac Pool „QA7256“, 3,000 %, fällig 01.02.2050	349	0,03	214		0,02
375			438		0,04
Freddie Mac Pool „QB4985“, 2,000 %, fällig 01.11.2050	301	0,03	252		0,02
370			437		0,04
Freddie Mac Pool „QB5092“, 2,500 %, fällig 01.11.2050	311	0,03	529		0,04
227			351		0,03
Freddie Mac Pool „QB5093“, 2,500 %, fällig 01.11.2050	191	0,02	957		0,09
65			83		0,01
Freddie Mac Pool „QB5799“, 2,500 %, fällig 01.11.2050	54	0,01	1.613		0,16
225			1.224		0,10
Freddie Mac Pool „QB8602“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	184	0,02	1.227		0,11
278			652		0,05
Freddie Mac Pool „QB8604“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	225	0,02	758		0,07
143			196		0,02
Freddie Mac Pool „QB8773“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	116	0,01	293		0,03
79			290		0,03
Freddie Mac Pool „QB9057“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	63	0,01	747		0,08
1.146			381		0,04
Freddie Mac Pool „QB9087“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	929	0,09	197		0,02
227			778		0,08
Freddie Mac Pool „QB9482“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	183	0,02	98		0,01
149			88		0,01
Freddie Mac Pool „QB9484“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	121	0,01	285		0,02
76			388		0,04
Freddie Mac Pool „QB9485“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	62	0,01	192		0,02
251			697		0,07
Freddie Mac Pool „QB9961“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	202	0,02	778		0,08
197			98		0,01
Freddie Mac Pool „QC0160“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	159	0,02	98		0,01
234			1.073		0,09
Freddie Mac Pool „QC0161“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	189	0,02	702		0,06
82			1.268		0,11
Freddie Mac Pool „QC0885“, 2,000 %, fällig 01.04.2051	67	0,01	5.483		0,46
145			5.444		0,46
Freddie Mac Pool „QC1164“, 2,000 %, fällig 01.04.2051	118	0,01	1.349		0,13
80			196		0,02
Freddie Mac Pool „QC2044“, 2,500 %, fällig 01.05.2051	68	0,01	200		0,02
255			117		0,01
Freddie Mac Pool „QC3690“, 2,500 %, fällig 01.07.2051	214	0,02	196		0,02
175			2.077		0,17
Freddie Mac Pool „QC4818“, 2,500 %, fällig 01.08.2051	147	0,01	197		0,02
87			191		0,02
Freddie Mac Pool „QC4824“, 2,500 %, fällig 01.08.2051	73	0,01	388		0,04
1.376			399		0,04
Freddie Mac Pool „QC5830“, 2,000 %, fällig 01.08.2051	1.155	0,12	466		0,04
175			1.073		0,09
Freddie Mac Pool „QC6303“, 2,000 %, fällig 01.09.2051	141	0,01	702		0,06
423			1.268		0,11
Freddie Mac Pool „QC6551“, 2,500 %, fällig 01.09.2051	355	0,04	5.483		0,46
174			5.444		0,46
Freddie Mac Pool „QC7127“, 2,000 %, fällig 01.09.2051	141	0,01	1.349		0,13
266			196		0,02
Freddie Mac Pool „QC7411“, 2,500 %, fällig 01.09.2051	223	0,02	200		0,02
712			117		0,01
Freddie Mac Pool „QC9443“, 2,500 %, fällig 01.10.2051	592	0,06	196		0,02
169			2.077		0,17
Freddie Mac Pool „QD1850“, 2,500 %, fällig 01.12.2051	141	0,01	197		0,02
85			191		0,02
Freddie Mac Pool „QD4146“, 2,500 %, fällig 01.01.2052	71	0,01	388		0,04
91			399		0,04
Freddie Mac Pool „QD5620“, 2,000 %, fällig 01.02.2052	73	0,01	466		0,04
717			1.073		0,09
Freddie Mac Pool „QD6079“, 2,500 %, fällig 01.02.2052	602	0,06	702		0,06
92			1.268		0,11
Freddie Mac Pool „QD6142“, 2,500 %, fällig 01.02.2052	78	0,01	5.483		0,46
277			5.444		0,46
Freddie Mac Pool „QD7333“, 3,000 %, fällig 01.02.2052	240	0,02	1.349		0,13
270			196		0,02
Freddie Mac Pool „QD8675“, 2,500 %, fällig 01.03.2052	226	0,02	200		0,02
178			117		0,01
Freddie Mac Pool „QE1492“, 3,000 %, fällig 01.05.2052	161	0,02	196		0,02
386			2.077		0,17
Freddie Mac Pool „QE6418“, 4,000 %, fällig 01.07.2052	356	0,04	197		0,02
195			191		0,02
Freddie Mac Pool „QF3201“, 4,500 %, fällig 01.11.2052	185	0,02	388		0,04
286			399		0,04
Freddie Mac Pool „QF3213“, 4,500 %, fällig 01.11.2052	272	0,03	466		0,04
289			1.073		0,09
Freddie Mac Pool „QF5465“, 5,000 %, fällig 01.12.2052	281	0,03	702		0,06
178			1.268		0,11
Freddie Mac Pool „QF6516“, 6,500 %, fällig 01.01.2053	182	0,02	5.483		0,46
173			5.444		0,46
Freddie Mac Pool „QF6690“, 6,500 %, fällig 01.01.2053	176	0,02	1.349		0,13
192			196		0,02
Freddie Mac Pool „QF8222“, 6,500 %, fällig 01.02.2053	195	0,02	200		0,02
94			117		0,01
Freddie Mac Pool „QG2834“, 5,000 %, fällig 01.04.2053	92	0,01	196		0,02
200			2.077		0,17
Freddie Mac Pool „QG7311“, 5,500 %, fällig 01.07.2053	198	0,02	197		0,02
75			191		0,02
Freddie Mac Pool „QK0701“, 2,500 %, fällig 01.04.2041	65	0,01	388		0,04
445			399		0,04
Freddie Mac Pool „QK1354“, 2,000 %, fällig 01.02.2042	370	0,04	466		0,04
96			1.073		0,09
Freddie Mac Pool „QU7914“, 2,500 %, fällig 01.07.2051	77	0,01	702		0,06
709			1.268		0,11
Freddie Mac Pool „RA3882“, 2,000 %, fällig 01.11.2050	573	0,06	5.483		0,46
1.962			5.444		0,46
Freddie Mac Pool „RA3913“, 2,500 %, fällig 01.11.2050	1.652	0,17	1.349		0,13
512			196		0,02
Freddie Mac Pool „RA4142“, 2,500 %, fällig 01.12.2050	431	0,04	200		0,02
591			117		0,01
Freddie Mac Pool „RA4537“, 1,500 %, fällig 01.02.2051	448	0,04	196		0,02
1.263			2.077		0,17
Freddie Mac Pool „RA4703“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	1.018	0,10	197		0,02
2.887			191		0,02
Freddie Mac Pool „RA5117“, 2,000 %, fällig 01.05.2051	2.319	0,23	388		0,04
428			399		0,04
Freddie Mac Pool „RA5373“, 2,000 %, fällig 01.06.2051	344	0,03	466		0,04
177			1.073		0,09
Freddie Mac Pool „RA6332“, 2,000 %, fällig 01.11.2051	142	0,01	702		0,06
85			1.268		0,11
Freddie Mac Pool „RA6531“, 3,500 %, fällig 01.01.2052	76	0,01	5.483		0,46
516			5.444		0,46
Freddie Mac Pool „RA6562“, 2,500 %, fällig 01.01.2052	434	0,04	1.349		0,13
162			196		0,02
Freddie Mac Pool „RA6599“, 3,500 %, fällig 01.01.2052	145	0,01	200		0,02
7.309			117		0,01
Freddie Mac Pool „RA6694“, 2,000 %, fällig 01.01.2052	5.838	0,58	196		0,02
718			2.077		0,17
Freddie Mac Pool „RA7183“, 4,000 %, fällig 01.04.2052	664	0,07	197		0,02
1.539			191		0,02
Freddie Mac Pool „RA7185“, 4,000 %, fällig 01.04.2052	1.427	0,14	388		0,04
2.427			399		0,04
Freddie Mac Pool „RA7186“, 4,000 %, fällig 01.04.2052	2.254	0,23	466		0,04
836			1.073		0,09
Freddie Mac Pool „RA7928“, 4,500 %, fällig 01.09.2052	793	0,08	702		0,06
886			1.268		0,11
Freddie Mac Pool „RA8790“, 5,000 %, fällig 01.04.2053	860	0,09	5.483		0,46
197			5.444		0,46
Freddie Mac Pool „RA9079“, 6,500 %, fällig 01.05.2053	203	0,02	1.349		0,13
			196		0,02
			2.077		0,17
			197		0,02
			191		0,02
			388		0,04
			399		0,04
			466		0,04
			1.073		0,09
			702		0,06
			1.268		0,11
			5.483		0,46
			5.444		0,46
			1.349		0,13
			196		0,02
			2.077		0,17
			197		0,02
			191		0,02
			388		0,04
			399		0,04
			466		0,04
			1.073		0,09
			702		0,06
			1.268		0,11
			5.483		0,46
			5.444		0,46
			1.349		0,13
			196		0,02
			2.077		0,17
			197		0,02
			191		0,02

## FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)</b>					
5	Freddie Mac Pool „ZS2059“, 5,500 %, fällig 01.04.2038	5	1.038	Ginnie Mae II Pool „785667“, 2,500 %, fällig 20.10.2051	874
17	Freddie Mac Pool „ZS3059“, 5,500 %, fällig 01.12.2038	18	528	Ginnie Mae II Pool „785762“, 2,500 %, fällig 20.11.2051	445
80	Freddie Mac Pool „ZS3204“, 5,000 %, fällig 01.06.2041	79	613	Ginnie Mae II Pool „785789“, 2,500 %, fällig 20.12.2051	516
49	Freddie Mac Pool „ZS3412“, 5,500 %, fällig 01.12.2038	50	895	Ginnie Mae II Pool „785821“, 2,500 %, fällig 20.12.2051	754
96	Freddie Mac Pool „ZS8669“, 3,000 %, fällig 01.09.2032	91	1.335	Ginnie Mae II Pool „785944“, 3,000 %, fällig 20.02.2052	1.179
101	Freddie Mac Pool „ZS8673“, 3,000 %, fällig 01.10.2032	95	351	Ginnie Mae II Pool „786077“, 3,000 %, fällig 20.03.2052	309
13	Freddie Mac Pool „ZS8779“, 5,000 %, fällig 01.07.2025	13	445	Ginnie Mae II Pool „786082“, 3,000 %, fällig 20.11.2051	393
539	Freddie Mac Pool „ZS9316“, 3,500 %, fällig 01.01.2038	500	652	Ginnie Mae II Pool „786095“, 3,000 %, fällig 20.04.2052	561
235	Freddie Mac Pool „ZT1107“, 3,500 %, fällig 01.03.2043	215	263	Ginnie Mae II Pool „786107“, 3,000 %, fällig 20.03.2052	233
22	Freddie Mac Pool „ZT1159“, 3,500 %, fällig 01.02.2044	20	286	Ginnie Mae II Pool „786108“, 3,500 %, fällig 20.03.2052	257
321	Freddie Mac Pool „ZT1257“, 3,000 %, fällig 01.01.2046	284	920	Ginnie Mae II Pool „786134“, 3,000 %, fällig 20.04.2052	795
550	Freddie Mac Pool „ZT1970“, 3,500 %, fällig 01.04.2033	526	558	Ginnie Mae II Pool „786216“, 3,500 %, fällig 20.06.2052	496
49	Freddie Mac Referenz REMIC R007, Klasse ZA, 6,000 %, fällig 15.05.2036	51	955	Ginnie Mae II Pool „786335“, 4,500 %, fällig 20.09.2052	915
33	Freddie Mac REMICS 3621, Klasse SB, 0,927 %, fällig 15.01.2040 *	3	384	Ginnie Mae II Pool „786340“, 5,000 %, fällig 20.09.2052	379
181	Freddie Mac REMICS 4813, Klasse CJ, 3,000 %, fällig 15.08.2048	158	765	Ginnie Mae II Pool „786366“, 4,500 %, fällig 20.08.2052	730
397	Freddie Mac REMICS 5010, Klasse IK, 2,500 %, fällig 25.09.2050	60	287	Ginnie Mae II Pool „786429“, 4,000 %, fällig 20.06.2052	269
1.030	Freddie Mac REMICS 5010, Klasse JL, 2,500 %, fällig 25.09.2050	177	679	Ginnie Mae II Pool „786474“, 5,000 %, fällig 20.01.2053	666
404	Freddie Mac REMICS 5013, Klasse IN, 2,500 %, fällig 25.09.2050	64	1.284	Ginnie Mae II Pool „786535“, 5,500 %, fällig 20.02.2053	1.277
835	Freddie Mac REMICS 5018, Klasse MI, 2,000 %, fällig 25.10.2050	110	295	Ginnie Mae II Pool „786709“, 5,000 %, fällig 20.05.2053	288
213	Freddie Mac REMICS 5040, Klasse IB, 2,500 %, fällig 25.11.2050	37	600	Ginnie Mae II Pool „786843“, 3,000 %, fällig 20.03.2052	524
1.350	Freddie Mac REMICS 5059, Klasse IB, 2,500 %, fällig 25.01.2051	214	757	Ginnie Mae II Pool „AP6338“, 4,000 %, fällig 20.10.2045	717
451	Freddie Mac REMICS 5069, Klasse MI, 2,500 %, fällig 25.02.2051	66	203	Ginnie Mae II Pool „BC4732“, 3,500 %, fällig 20.10.2047	187
1.232	Freddie Mac REMICS 5140, Klasse NI, 2,500 %, fällig 25.05.2049	175	160	Ginnie Mae II Pool „BD0384“, 3,500 %, fällig 20.10.2047	147
1.200	Freddie Mac REMICS 5224, Klasse HL, 4,000 %, fällig 25.04.2052	1.073	86	Ginnie Mae II Pool „BM7534“, 3,500 %, fällig 20.02.2050	78
629	Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, Serie 2020 DNA2, Klasse M2, 144A, 7,252 %, fällig 25.02.2050 *	631	92	Ginnie Mae II Pool „BM9734“, 4,000 %, fällig 20.10.2049	87
1.298	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA6, Serie 2020 DNA6, Klasse M2, 144A, 7,288 %, fällig 25.12.2050 *	1.308	73	Ginnie Mae II Pool „BM9743“, 4,000 %, fällig 20.11.2049	68
950	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Serie 2021 DNA6, Klasse B1, 144A, 8,688 %, fällig 25.10.2041 *	953	76	Ginnie Mae II Pool „BS1728“, 4,000 %, fällig 20.01.2050	73
1.131	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2, Serie 2022 DNA2, Klasse M1B, 144A, 7,688 %, fällig 25.02.2042 *	1.128	63	Ginnie Mae II Pool „BS1742“, 4,000 %, fällig 20.02.2050	60
40	Freddie Mac Strips 334, Klasse S7, 0,797 %, fällig 15.08.2044 *	4	318	Ginnie Mae II Pool „BT0812“, 3,000 %, fällig 20.03.2050	274
320	Freddie Mac Strips 353, Klasse S1, 0,697 %, fällig 15.12.2046 *	29	93	Ginnie Mae II Pool „C11513“, 3,000 %, fällig 20.03.2052	81
1.302	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2015 HQ2, Klasse B, 13,352 %, fällig 25.05.2025 *	1.333	280	Ginnie Mae II Pool „CK9592“, 4,000 %, fällig 20.06.2052	262
28	Ginnie Mae I Pool „733600“, 5,000 %, fällig 15.04.2040	28	177	Ginnie Mae II Pool „CL5523“, 3,000 %, fällig 20.04.2052	153
47	Ginnie Mae I Pool „733627“, 5,000 %, fällig 15.05.2040	47	147	Ginnie Mae II Pool „MA1995“, 3,500 %, fällig 20.06.2044	137
49	Ginnie Mae I Pool „783669“, 3,000 %, fällig 15.09.2042	44	39	Ginnie Mae II Pool „MA2678“, 3,500 %, fällig 20.03.2045	36
373	Ginnie Mae I Pool „784571“, 3,500 %, fällig 15.06.2048	346	62	Ginnie Mae II Pool „MA3375“, 3,000 %, fällig 20.01.2046	55
70	Ginnie Mae I Pool „AA5649“, 3,000 %, fällig 15.09.2042	63	52	Ginnie Mae II Pool „MA3521“, 3,500 %, fällig 20.03.2046	48
165	Ginnie Mae I Pool „AB2892“, 3,000 %, fällig 15.09.2042	149	236	Ginnie Mae II Pool „MA3597“, 3,500 %, fällig 20.04.2046	218
360	Ginnie Mae I Pool „AB9108“, 3,000 %, fällig 15.10.2042	324	127	Ginnie Mae II Pool „MA3663“, 3,500 %, fällig 20.05.2046	117
232	Ginnie Mae I Pool „AB9109“, 3,000 %, fällig 15.10.2042	206	216	Ginnie Mae II Pool „MA3736“, 3,500 %, fällig 20.06.2046	199
1	Ginnie Mae I Pool „AB9205“, 3,000 %, fällig 15.11.2042	1	130	Ginnie Mae II Pool „MA3803“, 3,500 %, fällig 20.07.2046	120
201	Ginnie Mae I Pool „AB9207“, 3,000 %, fällig 15.11.2042	179	79	Ginnie Mae II Pool „MA3937“, 3,500 %, fällig 20.09.2046	73
16	Ginnie Mae II Pool „4040“, 6,500 %, fällig 20.10.2037	16	109	Ginnie Mae II Pool „MA4068“, 3,000 %, fällig 20.11.2046	97
19	Ginnie Mae II Pool „4617“, 4,500 %, fällig 20.01.2040	19	83	Ginnie Mae II Pool „MA4261“, 3,000 %, fällig 20.02.2047	74
22	Ginnie Mae II Pool „4696“, 4,500 %, fällig 20.05.2040	22	21	Ginnie Mae II Pool „MA4381“, 3,000 %, fällig 20.04.2047	18
75	Ginnie Mae II Pool „4747“, 5,000 %, fällig 20.07.2040	75	1.390	Ginnie Mae II Pool „MA4511“, 4,000 %, fällig 20.06.2047	1.318
14	Ginnie Mae II Pool „4772“, 5,000 %, fällig 20.08.2040	14	247	Ginnie Mae II Pool „MA4654“, 4,500 %, fällig 20.08.2047	240
10	Ginnie Mae II Pool „4802“, 5,000 %, fällig 20.09.2040	10	15	Ginnie Mae II Pool „MA4836“, 3,000 %, fällig 20.11.2047	13
5	Ginnie Mae II Pool „4871“, 6,000 %, fällig 20.11.2040	6	558	Ginnie Mae II Pool „MA4838“, 4,000 %, fällig 20.11.2047	528
19	Ginnie Mae II Pool „4905“, 6,000 %, fällig 20.12.2040	19	157	Ginnie Mae II Pool „MA4899“, 3,000 %, fällig 20.12.2047	140
3	Ginnie Mae II Pool „4928“, 6,000 %, fällig 20.01.2041	3	240	Ginnie Mae II Pool „MA4901“, 4,000 %, fällig 20.12.2047	227
12	Ginnie Mae II Pool „4961“, 6,000 %, fällig 20.02.2041	12	210	Ginnie Mae II Pool „MA5020“, 4,000 %, fällig 20.02.2048	198
163	Ginnie Mae II Pool „4978“, 4,500 %, fällig 20.03.2041	160	1.231	Ginnie Mae II Pool „MA5078“, 4,000 %, fällig 20.03.2048	1.164
4	Ginnie Mae II Pool „783050“, 5,000 %, fällig 20.07.2040	4	200	Ginnie Mae II Pool „MA5137“, 4,000 %, fällig 20.04.2048	189
49	Ginnie Mae II Pool „783368“, 4,500 %, fällig 20.07.2041	48	366	Ginnie Mae II Pool „MA5138“, 4,500 %, fällig 20.04.2048	354
104	Ginnie Mae II Pool „784106“, 3,500 %, fällig 20.01.2046	96	113	Ginnie Mae II Pool „MA5192“, 4,000 %, fällig 20.05.2048	107
1.151	Ginnie Mae II Pool „784674“, 3,500 %, fällig 20.04.2048	1.069	561	Ginnie Mae II Pool „MA5193“, 4,500 %, fällig 20.05.2048	542
78	Ginnie Mae II Pool „784825“, 3,500 %, fällig 20.10.2049	71	96	Ginnie Mae II Pool „MA5194“, 5,000 %, fällig 20.05.2048	95
423	Ginnie Mae II Pool „784905“, 3,000 %, fällig 20.01.2050	374	322	Ginnie Mae II Pool „MA5265“, 4,500 %, fällig 20.06.2048	311
73	Ginnie Mae II Pool „784985“, 3,500 %, fällig 20.09.2048	67	140	Ginnie Mae II Pool „MA5331“, 4,500 %, fällig 20.07.2048	135
760	Ginnie Mae II Pool „785565“, 2,500 %, fällig 20.06.2051	640	307	Ginnie Mae II Pool „MA5399“, 4,500 %, fällig 20.08.2048	297
1.245	Ginnie Mae II Pool „785568“, 2,500 %, fällig 20.08.2051	1.048	277	Ginnie Mae II Pool „MA5529“, 4,500 %, fällig 20.10.2048	267
2.660	Ginnie Mae II Pool „785657“, 2,500 %, fällig 20.10.2051	2.241	165	Ginnie Mae II Pool „MA5530“, 5,000 %, fällig 20.10.2048	163
925	Ginnie Mae II Pool „785663“, 2,500 %, fällig 20.10.2051	779	369	Ginnie Mae II Pool „MA5597“, 5,000 %, fällig 20.11.2048	364
			268	Ginnie Mae II Pool „MA5652“, 4,500 %, fällig 20.12.2048	259
			285	Ginnie Mae II Pool „MA5653“, 5,000 %, fällig 20.12.2048	281
			420	Ginnie Mae II Pool „MA5711“, 4,500 %, fällig 20.01.2049	406
			1.144	Ginnie Mae II Pool „MA5712“, 5,000 %, fällig 20.01.2049	1.128
			697	Ginnie Mae II Pool „MA5763“, 4,000 %, fällig 20.02.2049	657
			467	Ginnie Mae II Pool „MA5764“, 4,500 %, fällig 20.02.2049	451
			183	Ginnie Mae II Pool „MA5817“, 4,000 %, fällig 20.03.2049	173
			1.124	Ginnie Mae II Pool „MA5818“, 4,500 %, fällig 20.03.2049	1.086
			181	Ginnie Mae II Pool „MA5819“, 5,000 %, fällig 20.03.2049	179
			154	Ginnie Mae II Pool „MA5876“, 4,000 %, fällig 20.04.2049	146
			91	Ginnie Mae II Pool „MA5877“, 4,500 %, fällig 20.04.2049	88
			135	Ginnie Mae II Pool „MA5878“, 5,000 %, fällig 20.04.2049	133
			119	Ginnie Mae II Pool „MA6157“, 5,000 %, fällig 20.09.2049	112
			113	Ginnie Mae II Pool „MA6287“, 5,000 %, fällig 20.11.2049	118
			285	Ginnie Mae II Pool „MA6342“, 5,000 %, fällig 20.12.2049	281
			363	Ginnie Mae II Pool „MA6413“, 5,000 %, fällig 20.01.2050	358
			170	Ginnie Mae II Pool „MA6603“, 5,000 %, fällig 20.04.2050	168
			1.489	Ginnie Mae II Pool „MA6711“, 3,500 %, fällig 20.06.2050	1.362
			1.685	Ginnie Mae II Pool „MA6997“, 3,500 %, fällig 20.11.2050	1.531
			433	Ginnie Mae II Pool „MA6999“, 4,500 %, fällig 20.11.2050	413

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinventarwerts		
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)</b>							
82	Ginnie Mae II Pool „MA7056“, 4,500 %, fällig 20.12.2050	79	0,01				
144	Ginnie Mae II Pool „MA7135“, 2,000 %, fällig 20.01.2051	119	0,01				
311	Ginnie Mae II Pool „MA7136“, 2,500 %, fällig 20.01.2051	265	0,03				
1.609	Ginnie Mae II Pool „MA7192“, 2,000 %, fällig 20.02.2051	1.332	0,13				
104	Ginnie Mae II Pool „MA7194“, 3,000 %, fällig 20.02.2051	93	0,01				
137	Ginnie Mae II Pool „MA7255“, 2,500 %, fällig 20.03.2051	116	0,01				
1.150	Ginnie Mae II Pool „MA7312“, 2,500 %, fällig 20.04.2051	980	0,10				
1.067	Ginnie Mae II Pool „MA7368“, 3,000 %, fällig 20.05.2051	944	0,09				
2.123	Ginnie Mae II Pool „MA7590“, 3,000 %, fällig 20.09.2051	1.876	0,19				
2.813	Ginnie Mae II Pool „MA7649“, 2,500 %, fällig 20.10.2051	2.397	0,24				
1.062	Ginnie Mae II Pool „MA7650“, 3,000 %, fällig 20.10.2051	938	0,09				
2.620	Ginnie Mae II Pool „MA7767“, 2,500 %, fällig 20.12.2051	2.233	0,22				
2.414	Ginnie Mae II Pool „MA7768“, 3,000 %, fällig 20.12.2051	2.129	0,21				
3.237	Ginnie Mae II Pool „MA7883“, 3,500 %, fällig 20.02.2052	2.941	0,29				
931	Ginnie Mae II Pool „MA8046“, 4,500 %, fällig 20.05.2052	888	0,09				
366	Ginnie Mae II Pool „MA8197“, 2,500 %, fällig 20.08.2052	312	0,03				
186	Ginnie Mae II Pool „MA8264“, 2,500 %, fällig 20.09.2052	158	0,02				
1.056	Ginnie Mae II Pool „MA8268“, 4,500 %, fällig 20.09.2052	1.008	0,10				
671	Ginnie Mae II Pool „MA8348“, 5,000 %, fällig 20.10.2052	654	0,07				
1.063	Ginnie Mae II Pool „MA8428“, 5,000 %, fällig 20.11.2052	1.036	0,10				
766	Ginnie Mae II Pool „MA8429“, 5,500 %, fällig 20.11.2052	758	0,08				
1.233	Ginnie Mae II Pool „MA8485“, 2,500 %, fällig 20.12.2052	1.050	0,10				
2.084	Ginnie Mae II Pool „MA8486“, 3,000 %, fällig 20.12.2052	1.838	0,18				
195	Ginnie Mae II Pool „MA8490“, 5,000 %, fällig 20.12.2052	189	0,02				
1.154	Ginnie Mae II Pool „MA8642“, 2,500 %, fällig 20.02.2053	984	0,10				
688	Ginnie Mae II Pool „MA8727“, 6,000 %, fällig 20.03.2053	691	0,07				
484	Ginnie Mae II Pool „MA8796“, 3,000 %, fällig 20.04.2053	429	0,04				
197	Ginnie Mae II Pool „MA8798“, 4,000 %, fällig 20.04.2053	184	0,02				
1.800	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,000 % ±	1.485	0,15				
1.100	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,000 % ±	967	0,10				
200	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,500 % ±	182	0,02				
300	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 4,000 % ±	280	0,03				
1.900	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 % ±	1.849	0,18				
2.200	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,500 % ±	2.178	0,22				
1.800	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 6,000 % ±	1.806	0,18				
200	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 6,500 % ±	203	0,02				
122	Government National Mortgage Association, Serie 2009 H01, Klasse FA, 6,578 %, fällig 20.11.2059 *	123	0,01				
4	Government National Mortgage Association, Serie 2010 42, Klasse BS, 1,052 %, fällig 20.04.2040 *	-	-				
1	Government National Mortgage Association, Serie 2010 85, Klasse HS, 1,222 %, fällig 20.01.2040 *	-	-				
390	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H11, Klasse FA, 6,430 %, fällig 20.06.2060 *	391	0,04				
240	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H20, Klasse AF, 5,585 %, fällig 20.10.2060 *	238	0,02				
1	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H22, Klasse FE, 5,605 %, fällig 20.05.2059 *	1	-				
380	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H24, Klasse FA, 5,605 %, fällig 20.10.2060 *	377	0,04				
15	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H26, Klasse LF, 5,605 %, fällig 20.08.2058 *	14	-				
133	Government National Mortgage Association, Serie 2011 H01, Klasse AF, 5,705 %, fällig 20.11.2060 *	133	0,01				
30	Government National Mortgage Association, Serie 2011 H09, Klasse AF, 5,755 %, fällig 20.03.2061 *	30	-				
299	Government National Mortgage Association, Serie 2013 107, Klasse AD, 2,840 %, fällig 16.11.2047 *	266	0,03				
4.514	Government National Mortgage Association, Serie 2013 50, Klasse IO, 0,062 %, fällig 16.10.2048 *	6	-				
821	Government National Mortgage Association, Serie 2014 169, Klasse IO, 0,622 %, fällig 16.10.2056 *	18	-				
35	Government National Mortgage Association, Serie 2014 17, Klasse AM, 3,537 %, fällig 16.06.2048 *	33	-				
206	Government National Mortgage Association, Serie 2014 176, Klasse IA, 4,000 %, fällig 20.11.2044	37	-				
1.535	Government National Mortgage Association, Serie 2014 H20, Klasse FA, 5,648 %, fällig 20.10.2064 *	1.524	0,15				
460	Government National Mortgage Association, Serie 2015 167, Klasse OI, 4,000 %, fällig 16.04.2045	87	0,01				
797	Government National Mortgage Association, Serie 2015 183, Klasse IO, 0,529 %, fällig 16.09.2057 *	19	-				
393	Government National Mortgage Association, Serie 2016 135, Klasse SB, 0,673 %, fällig 16.10.2046 *	52	0,01				
750	Government National Mortgage Association, Serie 2016 21, Klasse ST, 0,722 %, fällig 20.02.2046 *	79	0,01				
356	Government National Mortgage Association, Serie 2016 84, Klasse IG, 4,500 %, fällig 16.11.2045	70	0,01				
929	Government National Mortgage Association, Serie 2017 111, Klasse IO, 0,526 %, fällig 16.02.2059 *	29	-				
920	Government National Mortgage Association, Serie 2017 157, Klasse IO, 0,504 %, fällig 16.12.2059 *	32	-				
896	Government National Mortgage Association, Serie 2017 28, Klasse IO, 0,680 %, fällig 16.02.2057 *	31	-				
				511	Government National Mortgage Association, Serie 2017 41, Klasse IO, 0,592 %, fällig 16.07.2058 *	15	-
				102	Government National Mortgage Association, Serie 2017 H15, Klasse KI, 0,835 %, fällig 20.07.2067 *	5	-
			4.037	Government National Mortgage Association, Serie 2017 H18, Klasse BI, 0,452 %, fällig 20.09.2067 *	174	0,02	
				52	Government National Mortgage Association, Serie 2017 H20, Klasse IB, 0,203 %, fällig 20.10.2067 *	2	-
				235	Government National Mortgage Association, Serie 2018 H06, Klasse PF, 5,518 %, fällig 20.02.2068 *	233	0,02
				435	Government National Mortgage Association, Serie 2018 H07, Klasse FD, 5,518 %, fällig 20.05.2068 *	433	0,04
				279	Government National Mortgage Association, Serie 2019 90, Klasse AB, 3,000 %, fällig 20.07.2049	245	0,02
			1.464	Government National Mortgage Association, Serie 2020 103, Klasse AD, 1,450 %, fällig 16.01.2063	1.115	0,11	
				296	Government National Mortgage Association, Serie 2020 123, Klasse IL, 2,500 %, fällig 20.08.2050	38	-
				915	Government National Mortgage Association, Serie 2020 123, Klasse NI, 2,500 %, fällig 20.08.2050	127	0,01
				447	Government National Mortgage Association, Serie 2020 127, Klasse IN, 2,500 %, fällig 20.08.2050	61	0,01
				388	Government National Mortgage Association, Serie 2020 129, Klasse IE, 2,500 %, fällig 20.09.2050	53	0,01
			15.965	Government National Mortgage Association, Serie 2020 157, Klasse IO, 0,940 %, fällig 16.06.2062 *	1.000	0,10	
				241	Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Klasse IH, 2,500 %, fällig 20.10.2050	33	-
				309	Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Klasse VI, 2,500 %, fällig 20.10.2050	44	-
			1.331	Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Klasse YI, 2,500 %, fällig 20.10.2050	177	0,02	
			1.445	Government National Mortgage Association, Serie 2020 173, Klasse MI, 2,500 %, fällig 20.11.2050	189	0,02	
			12.214	Government National Mortgage Association, Serie 2020 178, Klasse IO, 1,422 %, fällig 16.10.2060 *	1.111	0,11	
			2.907	Government National Mortgage Association, Serie 2020 181, Klasse WI, 2,000 %, fällig 20.12.2050	316	0,03	
			759	Government National Mortgage Association, Serie 2020 47, Klasse MI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	128	0,01	
			284	Government National Mortgage Association, Serie 2020 47, Klasse NI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	47	-	
			804	Government National Mortgage Association, Serie 2020 H09, Klasse FL, 4,850 %, fällig 20.05.2070 *	806	0,08	
			162	Government National Mortgage Association, Serie 2020 H09, Klasse NF, 6,468 %, fällig 20.04.2070 *	163	0,02	
			97	Government National Mortgage Association, Serie 2020 H12, Klasse F, 5,530 %, fällig 20.07.2070 *	95	0,01	
			383	Government National Mortgage Association, Serie 2020 H13, Klasse FA, 4,989 %, fällig 20.07.2070 *	375	0,04	
			97	Government National Mortgage Association, Serie 2020 H13, Klasse FC, 4,796 %, fällig 20.07.2070 *	95	0,01	
			943	Government National Mortgage Association, Serie 2021 14, Klasse AB, 1,340 %, fällig 16.06.2063	707	0,07	
			1.834	Government National Mortgage Association, Serie 2021 21, Klasse AH, 1,400 %, fällig 16.06.2063	1.390	0,14	
			25.502	Government National Mortgage Association, Serie 2021 5, Klasse IO, 1,112 %, fällig 16.01.2061 *	1.875	0,19	
			1.107	Government National Mortgage Association, Serie 2021 77, Klasse LC, 1,250 %, fällig 20.07.2050	850	0,08	
			1.500	Government National Mortgage Association, Serie 2022 139, Klasse AL, 4,000 %, fällig 20.07.2051	1.353	0,14	
			1.748	Government National Mortgage Association, Serie 2022 3, Klasse IO, 0,640 %, fällig 16.02.2061 *	88	0,01	
			200	Government National Mortgage Association, Serie 2022 63, Klasse LM, 3,500 %, fällig 20.10.2050	166	0,02	
			3.000	Government National Mortgage Association, Serie 2023 92, Klasse AH, 2,000 %, fällig 16.06.2064	2.290	0,23	
			2.000	Government National Mortgage Association, Serie 2023 92, Klasse IA, 0,611 %, fällig 16.06.2064 *	124	0,01	
			2.849	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Klasse A, 144A, 7,225 %, fällig 15.09.2031 *	2.365	0,24	
			2.160	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Klasse B, 144A, 8,425 %, fällig 15.09.2031 *	1.167	0,12	
			851	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20, Serie 2014 GC20, Klasse XA, 1,167 %, fällig 10.04.2047 *	1	-	
			15	HarborView Mortgage Loan Trust 2007-7, Serie 2007 7, Klasse 2A1A, 6,429 %, fällig 25.10.2037 *	14	-	
			3.980	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHH, Serie 2018 PHH, Klasse F, 144A, 8,667 %, fällig 15.06.2035 **	835	0,08	
			4.070	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Serie 2020 MKST, Klasse F, 144A, 8,524 %, fällig 15.12.2036 *	1.085	0,11	
			1.812	JP Morgan Mortgage Trust 2017-5, Serie 2017 5, Klasse A2, 144A, 3,470 %, fällig 26.10.2048 *	1.750	0,17	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)</b>					
175	154	0,02	57	57	0,01
JP Morgan Mortgage Trust 2018-4, Serie 2018 4, Klasse A1, 144A, 3,500 %, fällig 25.10.2048 *					
30	28	-	3.440	3.405	0,34
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17, Serie 2013 C17, Klasse B, 5,039 %, fällig 15.01.2047 *					
160	133	0,01	290	255	0,02
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C31, Serie 2015 C31, Klasse B, 4,776 %, fällig 15.08.2048 *					
72	18	-	190	161	0,02
ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Klasse AJ, 5,450 %, fällig 12.08.2048 *					
14	13	-	2.050	1.621	0,16
ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-9, Serie 2007 9, Klasse AJ, 6,193 %, fällig 12.09.2049 *					
20	10	-	Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125 %, fällig 15.01.2031		
Morgan Stanley Capital I Trust 2007-IQ16, Serie 2007 IQ16, Klasse AJ, 6,282 %, fällig 12.12.2049 *					
280	258	0,03	60	62	0,01
MSCG Trust 2015-ALDR, Serie 2015 ALDR, Klasse A2, 144A, 3,577 %, fällig 07.06.2035 *					
2.870	2.519	0,25	Vale Overseas Ltd, 7,200 %, fällig 15.09.2032		
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019 – FAME, Serie 2019 FAME, Klasse A, 144A, 3,047 %, fällig 15.08.2036 *					
341	309	0,03	410	428	0,04
New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Serie 2016 3A, Klasse A1B, 144A, 3,250 %, fällig 25.09.2056 *					
632	596	0,06	5.989		
Neuer Residential Mortgage Loan Trust 2017-6, Serie 2017 6A, Klasse A1, 144A, 4,000 %, fällig 27.08.2057 *					
857	703	0,07	<b>Kanada – 0,38 % (28. Februar 2023: 0,34 %)</b>		
Prime Mortgage Trust 2006-DR1, Serie 2006 DR1, Klasse 2A1, 144A, 5,500 %, fällig 25.05.2035					
103	95	0,01	120	109	0,01
Residential Asset Securitization Trust 2005-A15, Serie 2005 A15, Klasse 1A4, 5,750 %, fällig 25.02.2036					
4	4	-	110	96	0,01
Sequoia Mortgage Trust 2004-10, Serie 2004 10, Klasse A1A, 6,048 %, fällig 20.11.2034 *					
2.694	2.652	0,27	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.01.2028		
Towd Point Mortgage Trust 2017-5, Serie 2017 5, Klasse B1, 144A, 5,118 %, fällig 25.02.2057 *					
690	630	0,06	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15.02.2029		
UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C2, Serie 2017 C2, Klasse A4, 3,487 %, fällig 15.08.2050					
553	514	0,05	160	142	0,01
UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C7, Serie 2017 C7, Klasse A3, 3,418 %, fällig 15.12.2050					
72.635	2.456	0,25	550	475	0,05
UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C9, Serie 2018 C9, Klasse XA, 1,082 %, fällig 15.03.2051 *					
176	153	0,02	290	289	0,03
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2007 – OA2 Trust, Serie 2007 OA2, Klasse 2A, 5,228 %, fällig 25.03.2047 *					
38	37	-	500	501	0,05
Waterfall Commercial Mortgage Trust 2015-SBC5, Serie 2015 SBC5, Klasse A, 144A, 4,104 %, fällig 14.09.2022 *					
250	235	0,02	650	442	0,05
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-LC20, Serie 2015 LC20, Klasse AS, 3,467 %, fällig 15.04.2050					
160	149	0,01	30	26	-
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1, Serie 2015 NXS1, Klasse AS, 3,406 %, fällig 15.05.2048					
4.826	151	0,01	40	33	-
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RB1, Serie 2017 RB1, Klasse XA, 1,353 %, fällig 15.03.2050 *					
2.330	1.895	0,19	20	19	-
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013-C14, Serie 2013 C14, Klasse B, 3,841 %, fällig 15.06.2046 *					
2.010	1.824	0,18	1.350	1.258	0,13
WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21, Serie 2014 C21, Klasse B, 4,213 %, fällig 15.08.2047 *					
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 450.409 USD)					
			390		
			Yamana Gold Inc, 4,625 %, fällig 15.12.2027		
			3.760		
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 35,79 % (28. Februar 2023: 36,53 %)</b>					
<b>Australien – 0,04 % (28. Februar 2023: 0,04 %)</b>					
300	290	0,03	<b>China – 0,33 % (28. Februar 2023: 0,30 %)</b>		
200	166	0,01	370		
BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000 %, fällig 30.09.2043					
Commonwealth Bank of Australia, 144A, 3,900 %, fällig 12.07.2047					
2.650					
Prosus NV, 144A, 3,061 %, fällig 13.07.2031					
1.660					
Prosus NV, 144A, 3,832 %, fällig 08.02.2051					
3.312					
<b>Kolumbien – 0,14 % (28. Februar 2023: 0,13 %)</b>					
940					
Ecopetrol SA, 4,625 %, fällig 02.11.2031					
960					
Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045					
1.421					
<b>Dänemark – 0,22 % (28. Februar 2023: 0,19 %)</b>					
280					
Danske Bank A/S, 144A, 3,244 %, fällig 20.12.2025 *					
2.040					
Danske Bank A/S, 144A, 4,298 %, fällig 01.04.2028 *					
2.189					
<b>Frankreich – 1,17 % (28. Februar 2023: 1,08 %)</b>					
280					
BNP Paribas SA, 144A, 3,375 %, fällig 09.01.2025					
310					
BNP Paribas SA, 144A, 4,705 %, fällig 10.01.2025 *					
1.660					
BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, fällig 09.06.2026 *					
620					
BNP Paribas SA, 144A, 4,625 %, fällig 13.03.2027					
2.890					
BNP Paribas SA, 144A, 1,675 %, fällig 30.06.2027 *					
1.160					
BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, fällig 14.08.2028					
1.620					
BNP Paribas SA, 144A, 5,125 %, fällig 13.01.2029 *					
340					
BNP Paribas SA, 144A, 5,198 %, fällig 10.01.2030 *					
550					
BNP Paribas SA, 144A, 4,375 %, fällig 01.03.2033 *					
710					
BNP Paribas SA, 144A, 8,500 %, unbefristet *					
500					
BPCE SA, 144A, 5,150 %, fällig 21.07.2024					
590					
Credit Agricole SA, 144A, 4,000 %, fällig 10.01.2033 *					
240					
Danone SA, 144A, 2,947 %, fällig 02.11.2026					
940					
WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 3,750 %, fällig 17.09.2024					
897					
11.692					
<b>Indien – 0,10 % (28. Februar 2023: 0,10 %)</b>					
330					
Reliance Industries Ltd, 144A, 2,875 %, fällig 01.12.2032					
1.020					
Reliance Industries Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 01.12.2052					
695					
966					
<b>Irland – 0,42 % (28. Februar 2023: 0,38 %)</b>					
850					
AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,150 %, fällig 15.02.2024					
1.990					
AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 2,450 %, fällig 29.10.2026					
1.000					
AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,000 %, fällig 29.10.2028					
480					
AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30.01.2032					
162					
Avolon TLB Borrower 1 (US) LLC, 7,664 %, fällig 01.12.2027 *					
120					
Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 15.02.2024					
119					
4.169					

# FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>			<b>Spanien – 0,22 % (28. Februar 2023: 0,19 %)</b>		
<b>Israel – 0,41 % (28. Februar 2023: 0,42 %)</b>			<b>Schweiz – 1,19 % (28. Februar 2023: 1,28 %)</b>		
590 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125 %, fällig 31.01.2025	594	0,06	1.200 Banco Santander SA, 2,746 %, fällig 28.05.2025	1.136	0,11
1.570 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	1.421	0,14	200 Banco Santander SA, 4,175 %, fällig 24.03.2028 *	188	0,02
430 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, fällig 09.05.2027	402	0,04	500 Telefonica Emisiones SA, 4,103 %, fällig 08.03.2027	476	0,05
1.530 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, fällig 09.05.2029	1.417	0,14	210 Telefonica Emisiones SA, 5,213 %, fällig 08.03.2047	176	0,02
240 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, fällig 15.09.2031	255	0,03	260 Telefonica Emisiones SA, 4,895 %, fällig 06.03.2048	208	0,02
	4.089	0,41		2.184	0,22
<b>Italien – 0,19 % (28. Februar 2023: 0,17 %)</b>			<b>Vereinigte Arabische Emirate – 0,09 % (28. Februar 2023: 0,08 %)</b>		
1.160 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, fällig 26.06.2024	1.134	0,11	200 DP World Ltd/Vereinigte Arabische Emirate, 144A, 5,625 %, fällig 25.09.2048	186	0,02
850 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, fällig 15.01.2026	818	0,08	760 DP World Ltd/Vereinigte Arabische Emirate, 5,625 %, fällig 25.09.2048	704	0,07
	1.952	0,19		890	0,09
<b>Japan – 0,40 % (28. Februar 2023: 0,37 %)</b>			<b>Vereinigtes Königreich – 0,93 % (28. Februar 2023: 1,05 %)</b>		
540 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3,837 %, fällig 17.04.2026 *	523	0,05	410 Barclays Plc, 4,972 %, fällig 16.05.2029 *	390	0,04
560 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 4,080 %, fällig 19.04.2028 *	532	0,05	2.610 Barclays Plc, 5,088 %, fällig 20.06.2030 *	2.393	0,24
580 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,043 %, fällig 15.09.2023	579	0,06	430 HSBC Holdings Plc, 4,250 %, fällig 18.08.2025	415	0,04
1.600 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,522 %, fällig 17.09.2025	1.516	0,15	330 HSBC Holdings Plc, 4,300 %, fällig 08.03.2026	319	0,03
990 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 4,345 %, fällig 17.09.2027	908	0,09	400 HSBC Holdings Plc, 4,041 %, fällig 13.03.2028	376	0,04
	4.058	0,40	400 HSBC Holdings Plc, 4,583 %, fällig 19/06/2029	378	0,04
<b>Kasachstan – 0,06 % (28. Februar 2023: 0,05 %)</b>			<b>USA – 27,10 % (28. Februar 2023: 27,97 %)</b>		
200 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 5,750 %, fällig 19.04.2047	161	0,02	470 3M Co, 2,375 %, fällig 26.08.2029	406	0,04
520 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 6,375 %, fällig 24.10.2048	437	0,04	130 3M Co, 3,050 %, fällig 15.04.2030	116	0,01
	598	0,06	670 3M Co, 3,700 %, fällig 15.04.2050	515	0,05
<b>Kuwait – 0,05 % (28. Februar 2023: 0,04 %)</b>			230 Abbott Laboratories, 4,750 %, fällig 30.11.2036		
520 MEGlobal BV, 144A, 4,250 %, fällig 03.11.2026	499	0,05	420 Abbott Laboratories, 4,900 %, fällig 30.11.2046	410	0,04
<b>Luxemburg – 0,06 % (28. Februar 2023: 0,01 %)</b>			140 AbbVie Inc, 3,750 %, fällig 14.11.2023		
620 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2029	491	0,05	1.990 AbbVie Inc, 2,600 %, fällig 21.11.2024	1.921	0,19
150 ArcelorMittal SA, 7,000 %, fällig 15.10.2039	155	0,01	590 AbbVie Inc, 3,800 %, fällig 15.03.2025	575	0,06
	646	0,06	250 AbbVie Inc, 3,600 %, fällig 14.05.2025	243	0,02
<b>Macau – 0,40 % (28. Februar 2023: 0,43 %)</b>			520 AbbVie Inc, 2,950 %, fällig 21.11.2026		
2.290 Sands China Ltd, 5,375 %, fällig 08.08.2025	2.216	0,22	3.520 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21.11.2029	3.175	0,32
710 Sands China Ltd, 2,800 %, fällig 03.08.2027	619	0,06	7 AbbVie Inc, 4,750 %, fällig 15.03.2045	6	-
580 Sands China Ltd, 5,650 %, fällig 08.08.2028	548	0,06	90 AbbVie Inc, 4,875 %, fällig 14.11.2048	83	0,01
730 Sands China Ltd, 3,100 %, fällig 03.08.2029	609	0,06	110 AbbVie Inc, 4,250 %, fällig 21.11.2049	93	0,01
	3.992	0,40	450 Air Lease Corp, 3,375 %, fällig 01.07.2025	429	0,04
<b>Mexiko – 0,11 % (28. Februar 2023: 0,11 %)</b>			600 Air Lease Corp, 5,300 %, fällig 01.02.2028		
20 America Movil SAB de CV, 6,375 %, fällig 01.03.2035	22	-	370 Alphabet Inc, 1,100 %, fällig 15.08.2030	297	0,03
20 America Movil SAB de CV, 6,125 %, fällig 15.11.2037	21	-	370 Alphabet Inc, 1,900 %, fällig 15.08.2040	249	0,03
1.110 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	1.027	0,11	230 Alphabet Inc, 2,050 %, fällig 15.08.2050	138	0,01
	1.070	0,11	210 Amazon.com Inc, 3,300 %, fällig 13.04.2027	200	0,02
<b>Marokko – 0,11 % (28. Februar 2023: 0,12 %)</b>			800 Amazon.com Inc, 1,200 %, fällig 03.06.2027		
940 OCP SA, 144A, 3,750 %, fällig 23.06.2031	778	0,08	320 Amazon.com Inc, 3,150 %, fällig 22.08.2027	301	0,03
480 OCP SA, 144A, 5,125 %, fällig 23.06.2051	341	0,03	430 Amazon.com Inc, 3,450 %, fällig 13.04.2029	405	0,04
	1.119	0,11	510 Amazon.com Inc, 1,500 %, fällig 03.06.2030	415	0,04
<b>Niederlande – 0,49 % (28. Februar 2023: 0,45 %)</b>			260 Amazon.com Inc, 2,100 %, fällig 12.05.2031		
200 ABN AMRO Bank NV, 144A, 4,750 %, fällig 28.07.2025	194	0,02	1.040 Amazon.com Inc, 3,600 %, fällig 13.04.2032	957	0,10
1.840 Cooperatieve Rabobank UA, 4,375 %, fällig 04.08.2025	1.785	0,18	1.710 Amazon.com Inc, 3,875 %, fällig 22.08.2037	1.540	0,15
250 Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 1,339 %, fällig 24.06.2026 *	230	0,02	340 Amazon.com Inc, 4,950 %, fällig 05.12.2044	336	0,03
600 Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 3,649 %, fällig 06.04.2028 *	557	0,06			
350 Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 3,758 %, fällig 06.04.2033 *	302	0,03			
160 Shell International Finance BV, 4,550 %, fällig 12.08.2043	145	0,01			
770 Shell International Finance BV, 4,375 %, fällig 11.05.2045	669	0,07			
270 Shell International Finance BV, 4,000 %, fällig 10.05.2046	222	0,02			
1.120 Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06.04.2050	796	0,08			
	4.900	0,49			
<b>Südafrika – 0,11 % (28. Februar 2023: 0,10 %)</b>					
670 Anglo American Capital Plc, 144A, 3,625 %, fällig 11.09.2024	655	0,06			
200 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig 10.04.2027	194	0,02			
290 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,000 %, fällig 11.09.2027	274	0,03			
	1.123	0,11			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
320 Amazon.com Inc, 4,050 %, fällig 22.08.2047	276	0,03	760 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23.07.2025	747	0,07
650 Amazon.com Inc, 2,500 %, fällig 03.06.2050	415	0,04	1.440 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	1.342	0,13
140 Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig 22.08.2057	121	0,01	1.200 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, fällig 30.03.2029	1.143	0,11
440 American Express Co, 3,375 %, fällig 03.05.2024	433	0,04	380 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,400 %, fällig 01.04.2033	335	0,03
1.000 American Express Co, 4,050 %, fällig 03.05.2029	951	0,10	500 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	424	0,04
246 American International Group Inc, 2,500 %, fällig 30.06.2025	233	0,02	270 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01.03.2042	177	0,02
220 American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, fällig 15.01.2032	180	0,02	260 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, fällig 23.10.2045	239	0,02
34 Amgen Inc, 4,663 %, fällig 15.06.2051	29	-	70 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.05.2047	56	0,01
270 Apache Corp, 7,750 %, fällig 15.12.2029	282	0,03	430 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, fällig 01.04.2048	363	0,04
17 Apache Corp, 6,000 %, fällig 15.01.2037	16	-	240 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, fällig 01.07.2049	185	0,02
930 Apache Corp, 5,100 %, fällig 01.09.2040	774	0,08	210 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, fällig 01.03.2050	156	0,02
60 Apache Corp, 5,250 %, fällig 01.02.2042	49	0,01	440 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,500 %, fällig 01.04.2063	346	0,03
510 Apache Corp, 4,750 %, fällig 15.04.2043	390	0,04	400 Cheniere Energy Inc, 4,625 %, fällig 15.10.2028	377	0,04
180 Apache Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2044	123	0,01	130 Cheniere Energy Partners LP, 4,000 %, fällig 01.03.2031	115	0,01
290 Apache Corp, 5,350 %, fällig 01.07.2049	233	0,02	690 Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, fällig 31.01.2032	571	0,06
720 Apple Inc, 2,450 %, fällig 04.08.2026	674	0,07	340 Chevron Corp, 2,954 %, fällig 16.05.2026	324	0,03
250 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 4,000 %, fällig 01.09.2029	203	0,02	240 Chevron Corp, 1,995 %, fällig 11.05.2027	218	0,02
300 AT&T Inc, 3,800 %, fällig 15.02.2027	286	0,03	80 Chevron Corp, 3,078 %, fällig 11.05.2050	57	0,01
970 AT&T Inc, 2,300 %, fällig 01.06.2027	869	0,09	950 Chevron USA Inc, 3,850 %, fällig 15.01.2028	919	0,09
150 AT&T Inc, 2,250 %, fällig 01.02.2032	117	0,01	140 Chubb INA Holdings Inc, 3,350 %, fällig 03.05.2026	134	0,01
60 AT&T Inc, 2,550 %, fällig 01.12.2033	46	-	290 Cigna Group/The, 4,125 %, fällig 15.11.2025	283	0,03
170 AT&T Inc, 5,350 %, fällig 01.09.2040	159	0,02	2.840 Cigna Group/The, 4,375 %, fällig 15.10.2028	2.737	0,27
190 AT&T Inc, 5,550 %, fällig 15.08.2041	179	0,02	110 Cigna Group/The, 4,900 %, fällig 15.12.2048	98	0,01
161 AT&T Inc, 4,350 %, fällig 15.06.2045	127	0,01	90 Cigna Group/The, 3,400 %, fällig 15.03.2050	63	0,01
1.218 AT&T Inc, 4,500 %, fällig 09.03.2048	973	0,10	270 Cintas Corp Nr. 2, 3,700 %, fällig 01.04.2027	259	0,03
70 AT&T Inc, 3,800 %, fällig 01.12.2057	47	-	300 Cintas Corp Nr. 2, 4,000 %, fällig 01.05.2032	281	0,03
465 AT&T Inc, 3,650 %, fällig 15.09.2059	301	0,03	330 Citigroup Inc, 3,300 %, fällig 27.04.2025	319	0,03
530 Ball Corp, 3,125 %, fällig 15.09.2031	430	0,04	440 Citigroup Inc, 4,400 %, fällig 10.06.2025	429	0,04
520 Bank of America Corp, 4,200 %, fällig 26.08.2024	511	0,05	220 Citigroup Inc, 5,500 %, fällig 13.09.2025	219	0,02
470 Bank of America Corp, 4,000 %, fällig 22.01.2025	458	0,05	490 Citigroup Inc, 3,106 %, fällig 08.04.2026 *	469	0,05
130 Bank of America Corp, 4,450 %, fällig 03.03.2026	126	0,01	110 Citigroup Inc, 4,300 %, fällig 20.11.2026	106	0,01
830 Bank of America Corp, 3,500 %, fällig 19.04.2026	790	0,08	1.260 Citigroup Inc, 4,450 %, fällig 29.09.2027	1.205	0,12
1.510 Bank of America Corp, 1,319 %, fällig 19.06.2026 *	1.390	0,14	450 Citigroup Inc, 4,658 %, fällig 24.05.2028 *	438	0,04
970 Bank of America Corp, 4,250 %, fällig 22.10.2026	932	0,09	60 Citigroup Inc, 4,125 %, fällig 25.07.2028	56	0,01
1.290 Bank of America Corp, 4,376 %, fällig 27.04.2028 *	1.239	0,12	1.360 Citigroup Inc, 3,520 %, fällig 27.10.2028 *	1.256	0,13
940 Bank of America Corp, 3,593 %, fällig 21.07.2028 *	875	0,09	1.180 Citigroup Inc, 4,075 %, fällig 23.04.2029 *	1.107	0,11
1.770 Bank of America Corp, 3,419 %, fällig 20.12.2028 *	1.624	0,16	1.470 Citigroup Inc, 3,980 %, fällig 20.03.2030 *	1.355	0,14
2.470 Bank of America Corp, 3,970 %, fällig 05.03.2029 *	2.309	0,23	1.590 Citigroup Inc, 4,412 %, fällig 31.03.2031 *	1.477	0,15
1.480 Bank of America Corp, 3,974 %, fällig 07.02.2030 *	1.363	0,14	1.180 Citigroup Inc, 2,520 %, fällig 03.11.2032 *	937	0,09
1.500 Bank of America Corp, 2,884 %, fällig 22.10.2030 *	1.288	0,13	1.150 Citigroup Inc, 3,785 %, fällig 17.03.2033 *	1.000	0,10
1.580 Bank of America Corp, 2,572 %, fällig 20.10.2032 *	1.267	0,13	540 Citigroup Inc, 4,910 %, fällig 24.05.2033 *	514	0,05
1.870 Bank of America Corp, 2,972 %, fällig 04.02.2033 *	1.538	0,15	1.456 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	1.814	0,18
560 Bank of America Corp, 4,330 %, fällig 15.03.2050 *	475	0,05	255 Citigroup Inc, 5,300 %, fällig 06.05.2044	232	0,02
2.070 Bank of America Corp, 4,083 %, fällig 20.03.2051 *	1.665	0,17	390 Citigroup Inc, Serie P, 5,950 %, unbefristet *	377	0,04
380 Bank of New York Mellon Corp/The, 1,600 %, fällig 24.04.2025	357	0,04	90 Citigroup Inc, Serie M, 6,300 %, unbefristet *	89	0,01
30 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.11.2025	27	-	100 Citigroup Inc, Serie O, 9,699 %, unbefristet *	100	0,01
435 Becton Dickinson & Co, 3,363 %, fällig 06.06.2024	427	0,04	720 Coca-Cola Co/The, 3,375 %, fällig 25.03.2027	690	0,07
26 Becton Dickinson & Co, 3,734 %, fällig 15.12.2024	25	-	370 Coca-Cola Co/The, 1,450 %, fällig 01.06.2027	331	0,03
377 Becton Dickinson & Co, 4,685 %, fällig 15.12.2044	334	0,03	20 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 01.06.2040	14	-
180 Becton Dickinson & Co, 4,669 %, fällig 06.06.2047	160	0,02	280 Coca-Cola Co/The, 2,600 %, fällig 01.06.2050	187	0,02
850 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2049	749	0,08	1.090 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,036 %, fällig 15.11.2033	1.102	0,11
3.380 Boston Properties LP, 3,400 %, fällig 21.06.2029	2.895	0,29	380 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,544 %, fällig 15.11.2053	389	0,04
950 BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, fällig 04.05.2026	904	0,09	130 Comcast Corp, 3,950 %, fällig 15.10.2025	127	0,01
440 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06.04.2030	407	0,04	640 Comcast Corp, 3,150 %, fällig 01.03.2026	611	0,06
900 BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, fällig 24.02.2050	600	0,06	280 Comcast Corp, 3,300 %, fällig 01.04.2027	264	0,03
43 Brighthouse Financial Inc, 4,700 %, fällig 22.06.2047	32	-	1.090 Comcast Corp, 4,150 %, fällig 15.10.2028	1.052	0,11
532 Bristol-Myers Squibb Co, 3,200 %, fällig 15.06.2026	508	0,05	390 Comcast Corp, 3,400 %, fällig 01.04.2030	356	0,04
705 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029	653	0,07	510 Comcast Corp, 4,250 %, fällig 15.10.2030	486	0,05
2.040 Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, fällig 15.11.2035	1.558	0,16	60 Comcast Corp, 4,250 %, fällig 01.08.2031	56	0,01
110 Builders FirstSource Inc, 144A, 4,250 %, fällig 01.02.2032	94	0,01	1.170 Charles Schwab Corp/The, 5,875 %, fällig 24.08.2026	62	0,01
630 Cameron LNG LLC, 144A, 2,902 %, fällig 15.07.2031	539	0,05	230 Charles Schwab Corp/The, 6,136 %, fällig 24.08.2034 *	234	0,02
850 Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, fällig 15.01.2035	704	0,07			
30 Carrier Global Corp, 2,700 %, fällig 15.02.2031	25	-			
50 Carrier Global Corp, 3,577 %, fällig 05.04.2050	36	-			
70 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 15.08.2030	59	0,01			
370 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, fällig 01.02.2032	307	0,03			
770 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	625	0,06			
360 Centene Corp, 4,250 %, fällig 15.12.2027	337	0,03			
520 Centene Corp, 4,625 %, fällig 15.12.2029	479	0,05			
290 Centene Corp, 3,375 %, fällig 15.02.2030	248	0,03			
50 Centene Corp, 3,000 %, fällig 15.10.2030	42	-			
60 Centene Corp, 2,625 %, fällig 01.08.2031	48	-			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventar- tarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventar- tarwerts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
1.420 Comcast Corp, 3,900 %, fällig 01.03.2038	1.212	0,12	280 Enterprise Products Operating LLC, 3,700 %, fällig 31.01.2051	205	0,02
400 Comcast Corp, 3,250 %, fällig 01.11.2039	308	0,03	90 Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, fällig 31.01.2060	66	0,01
300 Comcast Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2040	247	0,02	220 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15.02.2078 *	183	0,02
80 Comcast Corp, 3,400 %, fällig 15.07.2046	59	0,01	240 EOG Resources Inc, 4,150 %, fällig 15.01.2026	235	0,02
120 Comcast Corp, 4,000 %, fällig 15.08.2047	96	0,01	190 EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	185	0,02
224 Comcast Corp, 3,969 %, fällig 01.11.2047	180	0,02	690 EOG Resources Inc, 3,900 %, fällig 01.04.2035	611	0,06
110 Comcast Corp, 4,000 %, fällig 01.03.2048	89	0,01	180 EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig 15.04.2050	170	0,02
293 Comcast Corp, 3,999 %, fällig 01.11.2049	234	0,02	28 EQT Corp, 6,125 %, fällig 01.02.2025	28	-
200 Comcast Corp, 3,450 %, fällig 01.02.2050	146	0,01	20 EQT Corp, 144A, 3,125 %, fällig 15.05.2026	19	-
619 Comcast Corp, 2,887 %, fällig 01.11.2051	397	0,04	1.340 EQT Corp, 3,900 %, fällig 01.10.2027	1.252	0,13
66 Comcast Corp, 4,049 %, fällig 01.11.2052	53	0,01	200 EQT Corp, 5,000 %, fällig 15.01.2029	190	0,02
137 Comcast Corp, 2,937 %, fällig 01.11.2056	85	0,01	420 EQT Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15.05.2031	363	0,04
100 Comcast Corp, 4,950 %, fällig 15.10.2058	92	0,01	180 Exxon Mobil Corp, 3,043 %, fällig 01.03.2026	172	0,02
74 Comcast Corp, 2,987 %, fällig 01.11.2063	45	-	440 Exxon Mobil Corp, 3,482 %, fällig 19.03.2030	407	0,04
20 CommonSpirit Health, 4,350 %, fällig 11.01.2042	17	-	1.010 Exxon Mobil Corp, 4,114 %, fällig 01.03.2046	859	0,09
300 CommScope Inc, 144A, 6,000 %, fällig 01.03.2026	273	0,03	80 Exxon Mobil Corp, 4,327 %, fällig 19.03.2050	69	0,01
130 CommScope Inc, 144A, 4,750 %, fällig 01.09.2029	97	0,01	270 FirstEnergy Corp, Serie A, 1,600 %, fällig 15.01.2026	245	0,02
85 ConocoPhillips Co, 6,950 %, fällig 15.04.2029	94	0,01	3.160 FirstEnergy Corp, Serie B, 4,150 %, fällig 15.07.2027	2.984	0,30
240 Consolidated Edison Co of New York Inc, Serie 20A, 3,350 %, fällig 01.04.2030	217	0,02	1.000 FirstEnergy Corp, Serie C, 5,100 %, fällig 15.07.2047	871	0,09
190 Consolidated Edison Co of New York Inc, Serie 20B, 3,950 %, fällig 01.04.2050	151	0,02	770 Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	602	0,06
440 Constellation Brands Inc, 4,750 %, fällig 15.11.2024	436	0,04	570 Ford Motor Co, 6,100 %, fällig 19.08.2032	545	0,05
450 Constellation Brands Inc, 4,350 %, fällig 09.05.2027	436	0,04	150 Ford Motor Co, 4,750 %, fällig 15.01.2043	112	0,01
130 Continental Resources Inc.OK, 3,800 %, fällig 01.06.2024	128	0,01	400 Ford Motor Credit Co LLC, 5,125 %, fällig 16.06.2025	390	0,04
290 Continental Resources Inc.OK, 144A, 2,268 %, fällig 15.11.2026	259	0,03	1.390 Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, fällig 28.05.2027	1.306	0,13
1.000 Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, fällig 15.01.2028	942	0,09	600 Ford Motor Credit Co LLC, 4,125 %, fällig 17.08.2027	545	0,05
390 Continental Resources Inc.OK, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2031	373	0,04	610 Ford Motor Credit Co LLC, 7,350 %, fällig 04.11.2027	621	0,06
100 Continental Resources Inc.OK, 4,900 %, fällig 01.06.2044	77	0,01	260 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, fällig 16.02.2028	222	0,02
1.020 Costco Wholesale Corp, 1,375 %, fällig 20.06.2027	902	0,09	200 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, fällig 10.02.2029	165	0,02
340 Costco Wholesale Corp, 1,600 %, fällig 20.04.2030	281	0,03	810 Ford Motor Credit Co LLC, 5,113 %, fällig 03.05.2029	746	0,07
1.790 Coterra Energy Inc, 3,900 %, fällig 15.05.2027	1.703	0,17	890 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13.11.2030	754	0,08
560 Coterra Energy Inc, 4,375 %, fällig 15.03.2029	527	0,05	500 Ford Motor Credit Co LLC, 3,625 %, fällig 17.06.2031	406	0,04
300 CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig 01.12.2030	214	0,02	30 Freeport-McMoRan Inc, 4,550 %, fällig 14.11.2024	30	-
200 CSC Holdings LLC, 144A, 3,375 %, fällig 15.02.2031	138	0,01	260 Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, fällig 01.08.2030	241	0,02
510 CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15.11.2031	363	0,04	240 Freeport-McMoRan Inc, 5,400 %, fällig 14.11.2034	228	0,02
130 CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp, 144A, 3,875 %, fällig 30.06.2028	113	0,01	670 Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	602	0,06
541 CVS Health Corp, 3,875 %, fällig 20.07.2025	525	0,05	440 General Motors Co, 6,125 %, fällig 01.10.2025	442	0,04
220 CVS Health Corp, 3,625 %, fällig 01.04.2027	208	0,02	210 General Motors Co, 5,600 %, fällig 15.10.2032	202	0,02
268 CVS Health Corp, 4,300 %, fällig 25.03.2028	258	0,03	50 General Motors Co, 6,600 %, fällig 01.04.2036	50	0,01
530 CVS Health Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2030	482	0,05	50 General Motors Co, 5,150 %, fällig 01.04.2038	44	-
410 CVS Health Corp, 2,125 %, fällig 15.09.2031	324	0,03	230 General Motors Co, 6,250 %, fällig 02.10.2043	217	0,02
400 CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25.03.2038	358	0,04	330 General Motors Co, 5,950 %, fällig 01.04.2049	296	0,03
220 CVS Health Corp, 4,125 %, fällig 01.04.2040	179	0,02	50 General Motors Financial Co Inc, 4,350 %, fällig 17.01.2027	48	-
440 CVS Health Corp, 5,125 %, fällig 20.07.2045	392	0,04	200 Gilead Sciences Inc, 3,500 %, fällig 01.02.2025	195	0,02
2.800 CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048	2.458	0,25	250 Gilead Sciences Inc, 4,750 %, fällig 01.03.2046	228	0,02
70 CVS Health Corp, 4,250 %, fällig 01.04.2050	55	0,01	10 GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,250 %, fällig 01.06.2025	10	-
15 CVS Pass-Through Trust, 6,036 %, fällig 12.10.2028	15	-	80 GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,375 %, fällig 15.04.2026	78	0,01
28 CVS Pass-Through Trust, 6,943 %, fällig 01.10.2030	28	-	3 Goldman Sachs Capital II, 6,439 %, unbefristet *	2	-
150 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig 03.11.2036	153	0,02	800 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,850 %, fällig 08.07.2024	787	0,08
140 Deere & Co, 3,100 %, fällig 15.04.2030	127	0,01	760 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 01.04.2025	734	0,07
510 Deere & Co, 3,750 %, fällig 15.04.2050	437	0,04	460 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250 %, fällig 21.10.2025	447	0,04
410 Delta Air Lines Inc, 2,900 %, fällig 28.10.2024	398	0,04	1.390 Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, fällig 12.02.2026 *	1.290	0,13
630 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	649	0,07	1.970 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 16.11.2026	1.852	0,19
530 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15.12.2025	533	0,05	270 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,615 %, fällig 15.03.2028 *	253	0,03
260 Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig 15.01.2030	243	0,02	4.320 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,814 %, fällig 23.04.2029 *	3.999	0,40
40 Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15.07.2041	37	-	2.240 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223 %, fällig 01.05.2029 *	2.112	0,21
520 Devon Energy Corp, 4,750 %, fällig 15.05.2042	434	0,04	2.940 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,650 %, fällig 21.10.2032 *	2.360	0,24
1.480 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	1.268	0,13	670 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, fällig 01.02.2041	708	0,07
50 Diamondback Energy Inc, 3,250 %, fällig 01.12.2026	47	-	160 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,210 %, fällig 22.04.2042 *	115	0,01
660 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01.12.2029	598	0,06	380 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,908 %, fällig 21.07.2042 *	263	0,03
480 Diamondback Energy Inc, 4,400 %, fällig 24.03.2051	373	0,04	450 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	414	0,04
450 DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15.11.2024	419	0,04	540 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750 %, fällig 21.10.2045	486	0,05
410 DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	307	0,03	100 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.12.2028	87	0,01
230 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, fällig 01.12.2026	194	0,02	580 Haleon US Capital LLC, 3,375 %, fällig 24.03.2027	546	0,05
40 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	31	-	410 Haleon US Capital LLC, 3,375 %, fällig 24.03.2029	375	0,04
170 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01.06.2029	92	0,01	370 Haleon US Capital LLC, 3,625 %, fällig 24.03.2032	329	0,03
130 Duke Energy Carolinas LLC, 5,300 %, fällig 15.02.2040	127	0,01	11 Halliburton Co, 3,800 %, fällig 15.11.2025	11	-
640 Duke Energy Ohio Inc, 3,650 %, fällig 01.02.2029	597	0,06	60 Halliburton Co, 4,850 %, fällig 15.11.2035	56	0,01
420 Eaton Corp, 4,150 %, fällig 02.11.2042	365	0,04	320 Halliburton Co, 5,000 %, fällig 15.11.2045	288	0,03
36 El Paso Natural Gas Co LLC, 8,375 %, fällig 15.06.2032	41	-	100 HCA Inc, 5,000 %, fällig 15.03.2024	99	0,01
200 Elevance Health Inc, 3,350 %, fällig 01.12.2024	195	0,02	270 HCA Inc, 5,375 %, fällig 01.02.2025	268	0,03
840 Elevance Health Inc, 4,100 %, fällig 15.05.2032	774	0,08	10 HCA Inc, 5,250 %, fällig 15.04.2025	10	-
360 Elevance Health Inc, 4,550 %, fällig 15.05.2052	310	0,03	170 HCA Inc, 5,250 %, fällig 15.06.2026	168	0,02
720 Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, fällig 16.10.2028	688	0,07	30 HCA Inc, 5,375 %, fällig 01.09.2026	30	-
510 Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, fällig 31.01.2030	442	0,04	90 HCA Inc, 5,625 %, fällig 01.09.2028	90	0,01
1.880 Enterprise Products Operating LLC, 4,200 %, fällig 31.01.2050	1.504	0,15	660 HCA Inc, 5,875 %, fällig 01.02.2029	664	0,07
			930 HCA Inc, 3,500 %, fällig 01.09.2030	813	0,08
			400 HCA Inc, 5,500 %, fällig 15.06.2047	364	0,04
			180 Hershey Co/The, 0,900 %, fällig 01.06.2025	167	0,02
			380 Home Depot Inc/The, 2,500 %, fällig 15.04.2027	351	0,04

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventar- tarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventar- tarwerts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
70 Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig 06.12.2028	67	0,01	10 Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17.03.2052	7	-
440 Home Depot Inc/The, 2,700 %, fällig 15.04.2030	387	0,04	207 Microsoft Corp, 3,041 %, fällig 17.03.2062	144	0,01
360 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	284	0,03	584 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	583	0,06
90 Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig 15.06.2047	73	0,01	960 Mondelez International Inc, 1,500 %, fällig 04.05.2025	898	0,09
1.120 Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	821	0,08	2.060 Morgan Stanley, Serie I, 0,864 %, fällig 21.10.2025 *	1.940	0,19
430 Humana Inc, 3,950 %, fällig 15.03.2027	413	0,04	340 Morgan Stanley, 2,188 %, fällig 28.04.2026 *	321	0,03
1.100 Humana Inc, 3,125 %, fällig 15.08.2029	979	0,10	1.150 Morgan Stanley, 3,772 %, fällig 24.01.2029 *	1.067	0,11
190 Humana Inc, 2,150 %, fällig 03.02.2032	149	0,02	50 Morgan Stanley, 4,431 %, fällig 23.01.2030 *	48	-
70 Humana Inc, 4,625 %, fällig 01.12.2042	60	0,01	960 Morgan Stanley, 2,699 %, fällig 22.01.2031 *	809	0,08
20 Humana Inc, 4,800 %, fällig 15.03.2047	18	-	1.190 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	1.058	0,11
50 ILFC E-Capital Trust II, 144A, 7,314 %, fällig 21.12.2065 *	37	-	460 Morgan Stanley, 2,511 %, fällig 20.10.2032 *	366	0,04
350 Intel Corp, 1,600 %, fällig 12.08.2028	301	0,03	680 Morgan Stanley, 2,484 %, fällig 16.09.2036 *	513	0,05
240 Intel Corp, 5,125 %, fällig 10.02.2030	241	0,02	230 MPLX LP, 4,000 %, fällig 15.03.2028	216	0,02
130 Intel Corp, 3,734 %, fällig 08.12.2047	99	0,01	840 MPLX LP, 4,800 %, fällig 15.02.2029	810	0,08
380 Intel Corp, 4,750 %, fällig 25.03.2050	334	0,03	410 MPLX LP, 4,500 %, fällig 15.04.2038	348	0,03
200 Intel Corp, 3,050 %, fällig 12.08.2051	130	0,01	20 MPLX LP, 5,200 %, fällig 01.03.2047	17	-
1.230 Intercontinental Exchange Inc, 4,600 %, fällig 15.03.2033	1.176	0,12	830 MPLX LP, 4,700 %, fällig 15.04.2048	667	0,07
210 Intercontinental Exchange Inc, 4,950 %, fällig 15.06.2052	196	0,02	320 MPLX LP, 5,500 %, fällig 15.02.2049	285	0,03
1.940 International Business Machines Corp, 3,000 %, fällig 15.05.2024	1.905	0,19	580 NIKE Inc, 2,750 %, fällig 27.03.2027	542	0,05
790 Johnson & Johnson, 3,625 %, fällig 03.03.2037	699	0,07	290 NIKE Inc, 3,250 %, fällig 27.03.2040	234	0,02
250 JPMorgan Chase & Co, 3,875 %, fällig 10.09.2024	245	0,02	760 NIKE Inc, 3,375 %, fällig 27.03.2050	588	0,06
1.400 JPMorgan Chase & Co, 4,023 %, fällig 05.12.2024 *	1.393	0,14	320 NVIDIA Corp, 2,850 %, fällig 01.04.2030	287	0,03
940 JPMorgan Chase & Co, 2,083 %, fällig 22.04.2026 *	885	0,09	860 NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2040	717	0,07
1.000 JPMorgan Chase & Co, 3,509 %, fällig 23.01.2029 *	922	0,09	350 NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2050	276	0,03
610 JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, fällig 23.07.2029 *	576	0,06	620 NVIDIA Corp, 3,700 %, fällig 01.04.2060	495	0,05
780 JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, fällig 05.12.2029 *	744	0,07	14 Occidental Petroleum Corp, 6,950 %, fällig 01.07.2024	14	-
640 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	537	0,05	130 Occidental Petroleum Corp, 5,550 %, fällig 15.03.2026	129	0,01
790 JPMorgan Chase & Co, 2,545 %, fällig 08.11.2032 *	638	0,06	410 Occidental Petroleum Corp, 3,400 %, fällig 15.04.2026	385	0,04
1.660 JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, fällig 01.06.2045	1.527	0,15	610 Occidental Petroleum Corp, 3,200 %, fällig 15.08.2026	558	0,06
300 JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig 22.04.2051 *	203	0,02	260 Occidental Petroleum Corp, 3,000 %, fällig 15.02.2027	234	0,02
870 Kenvue Inc, 144A, 4,900 %, fällig 22.03.2033	866	0,09	360 Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, fällig 15.08.2029	311	0,03
380 Kinder Morgan Energy Partners LP, 3,500 %, fällig 01.09.2023	380	0,04	760 Occidental Petroleum Corp, 7,875 %, fällig 15.09.2031	288	0,03
110 Kinder Morgan Energy Partners LP, 4,250 %, fällig 01.09.2024	108	0,01	230 Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, fällig 15.09.2036	747	0,07
300 Kinder Morgan Inc, 4,300 %, fällig 01.06.2025	293	0,03	200 Occidental Petroleum Corp, 6,200 %, fällig 15.03.2040	198	0,02
520 Kinder Morgan Inc, 4,300 %, fällig 01.03.2028	496	0,05	240 Occidental Petroleum Corp, 4,625 %, fällig 15.06.2045	183	0,02
270 Kinder Morgan Inc, 5,300 %, fällig 01.12.2034	257	0,03	240 Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, fällig 15.03.2046	247	0,02
370 Kinder Morgan Inc, 5,550 %, fällig 01.06.2045	335	0,03	100 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.04.2046	77	0,01
60 Kinder Morgan Inc, 5,200 %, fällig 01.03.2048	52	0,01	380 Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, fällig 15.02.2047	262	0,03
30 KKR Group Finance Co II LLC, 144A, 5,500 %, fällig 01.02.2043	27	-	260 Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, fällig 15.03.2048	192	0,02
130 Kraft Heinz Foods Co, 3,000 %, fällig 01.06.2026	123	0,01	1.000 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.08.2049	716	0,07
150 Kraft Heinz Foods Co, 4,250 %, fällig 01.03.2031	141	0,01	200 ONEOK Inc, 5,550 %, fällig 01.11.2026	220	0,02
20 Kraft Heinz Foods Co, 6,750 %, fällig 15.03.2032	22	-	350 ONEOK Inc, 5,800 %, fällig 01.11.2030	351	0,04
80 Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, fällig 15.07.2035	78	0,01	720 ONEOK Inc, 6,050 %, fällig 01.09.2033	726	0,07
50 Kraft Heinz Foods Co, 6,875 %, fällig 26.01.2039	55	0,01	930 ONEOK Inc, 6,625 %, fällig 01.09.2053	939	0,09
10 Kraft Heinz Foods Co, 144A, 7,125 %, fällig 01.08.2039	11	-	1.000 Oracle Corp, 1,650 %, fällig 25.03.2026	912	0,09
10 Kraft Heinz Foods Co, 4,625 %, fällig 01.10.2039	9	-	90 Oracle Corp, 2,950 %, fällig 01.04.2030	78	0,01
170 Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, fällig 04.06.2042	155	0,02	430 Oracle Corp, 4,650 %, fällig 06.05.2030	413	0,04
520 Kraft Heinz Foods Co, 5,200 %, fällig 15.07.2045	478	0,05	1.390 Oracle Corp, 2,875 %, fällig 25.03.2031	1.175	0,12
80 Kraft Heinz Foods Co, 4,375 %, fällig 01.06.2046	66	0,01	300 Otis Worldwide Corp, 2,056 %, fällig 05.04.2025	284	0,03
260 Kraft Heinz Foods Co, 4,875 %, fällig 01.10.2049	231	0,02	310 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, fällig 01.08.2027	268	0,03
300 Kraft Heinz Foods Co, 5,500 %, fällig 01.06.2050	290	0,03	390 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig 01.02.2031	305	0,03
1.860 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08.08.2024	1.802	0,18	80 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig 01.08.2040	54	0,01
1.320 Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, fällig 25.06.2025	1.247	0,12	190 Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, fällig 01.08.2050	120	0,01
160 Lehman Brothers Escrow, Serie DMTN, Nullkupon, unbefristet ☹	-	-	90 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2028	85	0,01
120 Lennar Corp, 4,500 %, fällig 30.04.2024	119	0,01	560 PayPal Holdings Inc, 1,650 %, fällig 01.06.2025	525	0,05
50 Lennar Corp, 4,750 %, fällig 30.05.2025	49	0,01	70 PepsiCo Inc, 2,625 %, fällig 19.03.2027	65	0,01
460 Lennar Corp, 4,750 %, fällig 29.11.2027	446	0,04	320 PepsiCo Inc, 1,625 %, fällig 01.05.2030	264	0,03
280 Lowe's Cos Inc, 4,500 %, fällig 15.04.2030	270	0,03	220 PepsiCo Inc, 2,875 %, fällig 15.10.2049	156	0,02
300 Mars Inc, 144A, 3,200 %, fällig 01.04.2030	271	0,03	620 Pfizer Inc, 2,625 %, fällig 01.04.2030	545	0,05
110 Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26.03.2050	91	0,01	580 Pfizer Inc, 1,700 %, fällig 28.05.2030	478	0,05
100 McDonald's Corp, 1,450 %, fällig 01.09.2025	93	0,01	170 Pioneer Natural Resources Co, 1,125 %, fällig 15.01.2026	154	0,02
460 McDonald's Corp, 3,700 %, fällig 30.01.2026	445	0,04	270 Pioneer Natural Resources Co, 1,900 %, fällig 15.08.2030	218	0,02
310 McDonald's Corp, 3,500 %, fällig 01.03.2027	295	0,03	470 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, fällig 15.01.2031	381	0,04
360 McDonald's Corp, 3,500 %, fällig 01.07.2027	342	0,03	250 PNC Bank NA, 3,875 %, fällig 10.04.2025	242	0,02
260 McDonald's Corp, 3,800 %, fällig 01.04.2028	249	0,03	310 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,812 %, fällig 12.06.2026 *	310	0,03
130 McDonald's Corp, 3,600 %, fällig 01.07.2030	120	0,01	1.070 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,582 %, fällig 12.06.2029 *	1.062	0,11
80 McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01.09.2049	60	0,01	240 Principal Life Global Funding II, 144A, 1,250 %, fällig 23.06.2025	221	0,02
60 McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	499	0,05	120 Procter & Gamble Co/The, 2,800 %, fällig 25.03.2027	113	0,01
60 MDC Holdings Inc, 6,000 %, fällig 15.01.2043	53	0,01	340 Procter & Gamble Co/The, 3,000 %, fällig 25.03.2030	311	0,03
450 Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig 24.06.2030	363	0,04	3.900 Prologis LP, 1,250 %, fällig 15.10.2030	3.007	0,30
790 Merck & Co Inc, 2,750 %, fällig 10.12.2051	519	0,05	200 Range Resources Corp, 4,875 %, fällig 15.05.2025	196	0,02
300 MetLife Inc, 6,400 %, fällig 15.12.2036	297	0,03	60 Republic Services Inc, 2,500 %, fällig 15.08.2024	58	0,01
540 Micron Technology Inc, 5,875 %, fällig 09.02.2033	534	0,05	140 Salesforce Inc, 3,700 %, fällig 11.04.2028	134	0,01
50 Micron Technology Inc, 5,875 %, fällig 15.09.2033	49	0,01	80 Santander Holdings USA Inc, 4,500 %, fällig 17.07.2025	78	0,01
10 Microsoft Corp, 3,450 %, fällig 08.08.2036	9	-	322 Schlumberger Holdings Corp, 3,900 %, fällig 17.05.2028	306	0,03
650 Microsoft Corp, 2,525 %, fällig 06.01.2050	430	0,04	430 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, fällig 01.03.2032	487	0,05
			20 Southwestern Energy Co, 5,375 %, fällig 01.02.2029	19	-
			160 Southwestern Energy Co, 5,375 %, fällig 15.03.2030	150	0,02
			250 Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig 01.02.2032	222	0,02

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventar- werts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
552 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025	553	0,06	962 Verizon Communications Inc, 4,329 %, fällig 21.09.2028	922	0,09
20 Sprint Capital Corp, 6,875 %, fällig 15.11.2028	21	-	190 Verizon Communications Inc, 3,875 %, fällig 08.02.2029	178	0,02
655 Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	781	0,08	500 Verizon Communications Inc, 3,150 %, fällig 22.03.2030	439	0,04
10 Sprint LLC, 7,875 %, fällig 15.09.2023	10	-	630 Verizon Communications Inc, 1,750 %, fällig 20.01.2031	491	0,05
220 Sprint LLC, 7,625 %, fällig 15.02.2025	225	0,02	544 Verizon Communications Inc, 2,550 %, fällig 21.03.2031	448	0,04
370 Targa Resources Corp, 5,200 %, fällig 01.07.2027	366	0,04	1.060 Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig 10.08.2033	980	0,10
240 Targa Resources Corp, 4,200 %, fällig 01.02.2033	212	0,02	580 Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16.03.2037	565	0,06
150 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,000 %, fällig 15.01.2028	144	0,01	670 Verizon Communications Inc, 2,650 %, fällig 20.11.2040	448	0,04
290 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500 %, fällig 01.03.2030	278	0,03	180 Verizon Communications Inc, 3,400 %, fällig 22.03.2041	134	0,01
490 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig 01.02.2031	451	0,05	510 Verizon Communications Inc, 3,850 %, fällig 01.11.2042	396	0,04
200 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, fällig 15.01.2032	173	0,02	430 Verizon Communications Inc, 4,125 %, fällig 15.08.2046	342	0,03
16 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, fällig 16.12.2039	18	-	550 Verizon Communications Inc, 4,862 %, fällig 21.08.2046	484	0,05
300 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 4,900 %, fällig 15.09.2044	270	0,03	50 Verizon Communications Inc, 5,500 %, fällig 16.03.2047	48	0,01
30 Tenet Healthcare Corp, 4,375 %, fällig 15.01.2030	27	-	270 Verizon Communications Inc, 4,000 %, fällig 22.03.2050	207	0,02
160 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, fällig 01.03.2030	137	0,01	60 Verizon Communications Inc, 2,875 %, fällig 20.11.2050	37	-
380 Texas Instruments Inc, 1,750 %, fällig 04.05.2030	317	0,03	690 Verizon Communications Inc, 3,550 %, fällig 22.03.2051	484	0,05
980 The Vanguard Group Inc, 3,050 %, fällig 22.08.2050 †=>	604	0,06	200 Vertiv Group Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.11.2028	180	0,02
85 Time Warner Cable Enterprises LLC, 8,375 %, fällig 15.07.2033	95	0,01	770 Visa Inc, 3,150 %, fällig 14.12.2025	739	0,07
182 Time Warner Cable LLC, 6,550 %, fällig 01.05.2037	173	0,02	640 Visa Inc, 4,300 %, fällig 14.12.2045	579	0,06
420 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig 01.07.2038	426	0,04	300 Walmart Inc, 1,500 %, fällig 22.09.2028	259	0,03
560 Time Warner Cable LLC, 5,875 %, fällig 15.11.2040	488	0,05	150 Walmart Inc, 1,800 %, fällig 22.09.2031	123	0,01
50 TJX Cos Inc/The, 2,250 %, fällig 15.09.2026	46	-	170 Walt Disney Co/The, 6,650 %, fällig 15.11.2037	192	0,02
1.660 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2025	1.606	0,16	510 Warnermedia Holdings Inc, 6,412 %, fällig 15.03.2026	511	0,05
160 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15.02.2026	148	0,01	300 Warnermedia Holdings Inc, 3,755 %, fällig 15.03.2027	281	0,03
120 T-Mobile USA Inc, 3,750 %, fällig 15.04.2027	114	0,01	370 Warnermedia Holdings Inc, 4,054 %, fällig 15.03.2029	340	0,03
520 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.02.2029	451	0,05	640 Warnermedia Holdings Inc, 4,279 %, fällig 15.03.2032	565	0,06
1.720 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030	1.571	0,16	130 Warnermedia Holdings Inc, 5,050 %, fällig 15.03.2042	107	0,01
450 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15.02.2031	371	0,04	600 Warnermedia Holdings Inc, 5,141 %, fällig 15.03.2052	479	0,05
380 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, fällig 15.02.2031	320	0,03	240 Wells Fargo & Co, 3,750 %, fällig 24.01.2024	238	0,02
270 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2031	236	0,02	1.150 Wells Fargo & Co, 2,188 %, fällig 30.04.2026 *	1.082	0,11
70 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15.11.2031	56	0,01	870 Wells Fargo & Co, 3,000 %, fällig 23.10.2026	806	0,08
1.170 T-Mobile USA Inc, 2,700 %, fällig 15.03.2032	953	0,10	880 Wells Fargo & Co, 4,300 %, fällig 22.07.2027	843	0,08
220 T-Mobile USA Inc, 3,000 %, fällig 15.02.2041	156	0,02	560 Wells Fargo & Co, 3,584 %, fällig 22.05.2028 *	520	0,05
10 T-Mobile USA Inc, 3,300 %, fällig 15.02.2051	7	-	750 Wells Fargo & Co, 2,393 %, fällig 02.06.2028 *	668	0,07
850 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig 01.02.2026	889	0,09	370 Wells Fargo & Co, 4,150 %, fällig 24.01.2029	349	0,04
560 Truist Financial Corp, 6,047 %, fällig 08.06.2027 *	560	0,06	320 Wells Fargo & Co, 5,574 %, fällig 25.07.2029 *	319	0,03
340 Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 15.07.2025	331	0,03	1.040 Wells Fargo & Co, 2,879 %, fällig 30.10.2030 *	890	0,09
820 Union Pacific Corp, 2,891 %, fällig 06.04.2036	649	0,07	620 Wells Fargo & Co, 4,478 %, fällig 04.04.2031 *	580	0,06
1.010 Union Pacific Corp, 3,839 %, fällig 20.03.2060	776	0,08	330 Wells Fargo & Co, 3,350 %, fällig 03.02.2033 *	278	0,03
470 Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 05.02.2070	343	0,03	410 Wells Fargo & Co, 5,557 %, fällig 25.07.2034 *	405	0,04
440 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2026	415	0,04	580 Wells Fargo & Co, 4,900 %, fällig 17.11.2045	498	0,05
690 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	614	0,06	720 Wells Fargo & Co, 4,400 %, fällig 14.06.2046	571	0,06
70 United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.11.2027	65	0,01	1.200 Wells Fargo & Co, 4,750 %, fällig 07.12.2046	999	0,10
160 United Rentals North America Inc, 4,875 %, fällig 15.01.2028	152	0,02	5.340 Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	4.826	0,48
210 United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig 15.01.2030	200	0,02	130 Wells Fargo & Co, Serie U, 5,875 %, unbefristet *	129	0,01
1.370 United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.02.2031	1.173	0,12	460 Western Midstream Operating LP, 3,100 %, fällig 01.02.2025	441	0,04
420 United Rentals North America Inc, 3,750 %, fällig 15.01.2032	354	0,04	110 Western Midstream Operating LP, 4,500 %, fällig 01.03.2028	104	0,01
660 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15.12.2028	632	0,06	1.340 Western Midstream Operating LP, 4,050 %, fällig 01.02.2030	1.197	0,12
430 UnitedHealth Group Inc, 4,000 %, fällig 15.05.2029	411	0,04	40 Western Midstream Operating LP, 5,300 %, fällig 01.03.2048	33	-
200 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15.05.2030	167	0,02	250 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig 15.08.2048	208	0,02
110 UnitedHealth Group Inc, 2,300 %, fällig 15.05.2031	92	0,01	310 Western Midstream Operating LP, 5,250 %, fällig 01.02.2050	251	0,03
400 UnitedHealth Group Inc, 4,200 %, fällig 15.05.2032	378	0,04	350 Williams Cos Inc/The, Serie A, 7,500 %, fällig 15.01.2031	384	0,04
160 UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, fällig 15.06.2048	136	0,01	760 Williams Cos Inc/The, 7,750 %, fällig 15.06.2031	835	0,08
130 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15.12.2048	114	0,01	718 Williams Cos Inc/The, 8,750 %, fällig 15.03.2032	842	0,08
990 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, fällig 15.08.2049	769	0,08	110 Wyeth LLC, 5,950 %, fällig 01.04.2037	118	0,01
300 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15.08.2059	232	0,02		271.019	27,10
80 UnitedHealth Group Inc, 3,125 %, fällig 15.05.2060	53	0,01			
1.410 US Bancorp, 1,450 %, fällig 12.05.2025	1.319	0,13			
90 US Bancorp, Serie mtn, 2,215 %, fällig 27.01.2028 *	80	0,01			
500 US Bancorp, 5,775 %, fällig 12.06.2029 *	499	0,05			
260 US Bancorp, 5,836 %, fällig 12.06.2034 *	260	0,03			
410 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig 01.11.2033	334	0,03			
260 Verizon Communications Inc, 2,625 %, fällig 15.08.2026	242	0,02			
190 Verizon Communications Inc, 3,000 %, fällig 22.03.2027	177	0,02			
580 Verizon Communications Inc, 2,100 %, fällig 22.03.2028	507	0,05			
			<b>Sambia – 0,07 % (28. Februar 2023: 0,06 %)</b>		
			680 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2027	663	0,07
			<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 401.364 USD)</b>	<b>357.924</b>	<b>35,79</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinventarwerts
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 14,64 % (28. Februar 2023: 23,40 %)</b>					
<b>Argentinien – 0,21 % (28. Februar 2023: 0,18 %)</b>					
212	Republik Argentinien, internationale Staatsanleihe, 1,000 %, fällig 09.07.2029	69	0,01		
596	Republik Argentinien, internationale Staatsanleihe, 0,750 %, fällig 09.07.2030	200	0,02		
1.062	Republik Argentinien, internationale Staatsanleihe, 3,625 %, fällig 09.07.2035	316	0,03		
1.850	Republik Argentinien, internationale Staatsanleihe, 3,500 %, fällig 09.07.2041	576	0,06		
1.680	Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 6,375 %, fällig 01.09.2037	640	0,06		
757	Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 6,375 %, fällig 01.09.2037	289	0,03		
		2.090	0,21		
<b>Brasilien – 1,14 % (28. Februar 2023: 1,02 %)</b>					
BRL 14.000	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, fällig 01.01.2027	2.799	0,28		
BRL 17.099	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, fällig 01.01.2033	3.243	0,32		
6.000	Brasilien, internationale Staatsanleihe, 5,000 %, fällig 27.01.2045	4.685	0,47		
880	Brasilien, internationale Staatsanleihe, 4,750 %, fällig 14.01.2050	649	0,07		
		11.376	1,14		
<b>Kolumbien – 0,20 % (28. Februar 2023: 0,17 %)</b>					
890	Kolumbien, internationale Staatsanleihe, 3,250 %, fällig 22.04.2032	669	0,07		
900	Kolumbien, internationale Staatsanleihe, 4,125 %, fällig 22.02.2042	585	0,06		
990	Kolumbien, internationale Staatsanleihe, 5,625 %, fällig 26.02.2044	753	0,07		
		2.007	0,20		
<b>Indonesien – 1,09 % (28. Februar 2023: 0,93 %)</b>					
610	Indonesien, internationale Staatsanleihe, 3,700 %, fällig 30.10.2049	467	0,04		
IDR 159.624.000	Indonesien Treasury Bond, Serie FR91, 6,375 %, fällig 15.04.2032	10.476	1,05		
		10.943	1,09		
<b>Israel – 0,08 % (28. Februar 2023: 0,08 %)</b>					
650	Israel, internationale Staatsanleihe, 2,750 %, fällig 03.07.2030	568	0,05		
390	Israel, 3,375 %, fällig 15.01.2050	277	0,03		
		845	0,08		
<b>Kenia – 0,17 % (28. Februar 2023: 0,15 %)</b>					
2.270	Republik Kenia, internationale Staatsanleihe, 144A, 6,300 %, fällig 23.01.2034	1.650	0,17		
<b>Mexiko – 3,76 % (28. Februar 2023: 3,56 %)</b>					
MXN 37.380	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,500 %, fällig 31.05.2029	2.113	0,21		
MXN 194.400	Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig 23.11.2034	10.217	1,02		
MXN 232.457	Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	11.651	1,16		
MXN 220.640	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	11.259	1,13		
2.710	Mexiko, internationale Staatsanleihe, 4,600 %, fällig 10.02.2048	2.185	0,22		
190	Mexiko, internationale Staatsanleihe, 5,750 %, fällig 12.10.2110	167	0,02		
		37.592	3,76		
<b>Nigeria – 0,03 % (28. Februar 2023: 0,02 %)</b>					
300	Nigeria, internationale Staatsanleihe, 144A, 6,500 %, fällig 28.11.2027	258	0,03		
<b>Panama – 0,12 % (28. Februar 2023: 0,10 %)</b>					
670	Panama, internationale Staatsanleihe, 2,252 %, fällig 29.09.2032	510	0,05		
950	Panama, internationale Staatsanleihe, 4,500 %, fällig 01.04.2056	692	0,07		
		1.202	0,12		
<b>Paraguay – 0,04 % (28. Februar 2023: 0,04 %)</b>					
470	Paraguay, internationale Staatsanleihe, 144A, 3,849 %, fällig 28.06.2033	402	0,04		
<b>Peru – 0,10 % (28. Februar 2023: 0,10 %)</b>					
730	Peru, internationale Staatsanleihe, 2,783 %, fällig 23.01.2031	621	0,06		
380	Peru, internationale Staatsanleihe, 5,625 %, fällig 18.11.2050	379	0,04		
		1.000	0,10		
<b>Russland – 0,41 % (28. Februar 2023: 0,08 %)</b>					
RUB 16.270	Anleihe der Russischen Föderation - OFZ, 0,000 %, fällig 16.09.2026 1y	51	-		
RUB 89.250	Anleihe der Russischen Föderation - OFZ, 0,000 %, fällig 03.02.2027 1y	279	0,03		
RUB 203.271	Anleihe der Russischen Föderation - OFZ, 0,000 %, fällig 19.01.2028 1y	636	0,06		
RUB 436.124	Anleihe der Russischen Föderation - OFZ, 0,000 %, fällig 23.05.2029 1y	1.365	0,14		
RUB 232.730	Anleihe der Russischen Föderation - OFZ, 0,000 %, fällig 10.04.2030 1y	728	0,07		
RUB 22.030	Anleihe der Russischen Föderation - OFZ, 0,000 %, fällig 10.05.2034 1y	59	0,01		
RUB 382.680	Anleihe der Russischen Föderation - OFZ, 0,000 %, fällig 16.03.2039 1y	1.018	0,10		
		4.136	0,41		
<b>USA – 7,29 % (28. Februar 2023: 16,97 %)</b>					
1.440	Federal National Mortgage Association, 6,625 %, fällig 15.11.2030	1.640	0,16		
13.460	United States Treasury, inflationsindexierte Anleihen, 1,125 %, fällig 15.01.2033 β	12.864	1,29		
7.480	United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 15.08.2043	7.461	0,75		
1.630	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2048	1.294	0,13		
1.510	United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, fällig 15.11.2048	1.284	0,13		
5.770	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2049	4.581	0,46		
900	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2049	698	0,07		
5.320	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2050	3.408	0,34		
9.430	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15.05.2050	4.931	0,49		
15.600	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15/08/2050	8.434	0,84		
1.270	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.11.2050	735	0,07		
14.670	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	9.052	0,91		
11.000	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15/05/2051	7.648	0,76		
7.650	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.08.2051	4.858	0,49		
4.679	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051	2.876	0,29		
810	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.02.2053	730	0,07		
470	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.05.2053	424	0,04		
		72.918	7,29		
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 195.617 USD)</b>				146.419	14,64
<b>Schuldscheine – 3,25 % (28. Februar 2023: 4,08 %)</b>					
554	Air Canada, 9,128 %, fällig 27.07.2028 *	556	0,06		
562	Ali Group S,R,L., 7,446 %, fällig 13.10.2028 *	563	0,06		
546	Alterra Mountain Co, 8,946 %, fällig 30.07.2028 *	548	0,06		
445	AmWINS Group, Inc., 7,696 %, fällig 17.02.2028 *	445	0,04		
614	API Group Inc, 7,946 %, fällig 01.10.2026 *	616	0,06		
90	Asplundh Tree Expert LLC, 7,181 %, fällig 04.09.2027 *	90	0,01		
768	Asurion LLC, 8,788 %, fällig 18.12.2026 *	748	0,08		
1.074	Asurion LLC, 9,681 %, fällig 19.08.2028 *	1.040	0,10		
746	Brown Group Holding LLC, 7,820 %, fällig 07.06.2028 *	738	0,07		
90	Caesars Entertainment, 8,681 %, fällig 25.01.2030 *	90	0,01		
106	Castlelake Aviation Ltd, 8,302 %, fällig 22.10.2026 *	106	0,01		
196	Charter Communications Operating LLC, 7,116 %, fällig 01.02.2027 *	195	0,02		
896	Citadel Securities, 7,888 %, fällig 25.07.2030 *	894	0,09		
1.174	DCert Buyer, Inc., 9,331 %, fällig 16.10.2026 *	1.171	0,12		
1.021	Deerfield Dakota Holding LLC, 8,992 %, fällig 05.03.2027 *	988	0,10		
262	Energizer Holdings, Inc., 7,679 %, fällig 16.12.2027 *	262	0,03		
256	Eyecare Partners LLC, 9,253 %, fällig 20.02.2027 *	204	0,02		
232	First Eagle Holdings Inc, 8,038 %, fällig 17.02.2027 *	228	0,02		
857	Focus Financial Partners LLC, 8,581 %, fällig 30.06.2028 *	856	0,09		
1.836	Gainwell Acquisition Corp, 9,342 %, fällig 01.10.2027 *	1.811	0,18		
350	Garda World Security Corp, 9,668 %, fällig 30.10.2026 *	351	0,03		
1.325	Gen Digital Inc, 7,431 %, fällig 12.09.2029 *	1.325	0,13		
1.897	Genesee & Wyoming Inc, 7,342 %, fällig 30.12.2026 *	1.899	0,19		
59	GFL Environmental Inc, 8,469 %, fällig 31.05.2027 *	59	0,01		
1.060	Griifos Worldwide Operations USA Inc, 7,481 %, fällig 15.11.2027 *	1.048	0,10		
283	GVC Holdings Gibraltar Ltd, 7,437 %, fällig 16.03.2027 *	284	0,03		
861	Harbor Freight Tools USA Inc, 8,196 %, fällig 19.10.2027 *	858	0,09		
1.405	Hilton Worldwide Finance LLC, 7,165 %, fällig 21.06.2026 *	1.406	0,14		
709	ICON Luxembourg S,a,r,l., 7,753 %, fällig 01.07.2028 *	711	0,07		
177	Indigo Merger Sub, Inc., 7,753 %, fällig 01.07.2028 *	177	0,02		
229	Mozart Borrower LP, 8,696 %, fällig 30.09.2028 *	229	0,02		
264	PCI Gaming Authority, 7,946 %, fällig 31.05.2026 *	264	0,03		
619	Phoenix Guarantor Inc, 8,696 %, fällig 05.03.2026 *	616	0,06		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventar- tarwerts	Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventar- tarwerts
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>Schuldscheine – (Fortsetzung)</b>					
793 Prime Security Installations Ltd, 8,182 %, fällig 23.09.2026 *	795	0,08			
349 Project Sky Merger Sub, Inc., 9,181 %, fällig 10.08.2028 *	342	0,03			
612 Quikrete Holdings, Inc., 8,320 %, fällig 11.06.2028 *	613	0,06			
219 Rackspace Technology Global, Inc, 8,177 %, fällig 09.02.2028 *	99	0,01			
1.420 Setanta Aircraft Leasing DAC, 7,538 %, fällig 05.11.2028 *	1.422	0,14			
1.258 SkyMiles IP Ltd, 9,076 %, fällig 16.09.2027 *	1.310	0,13			
1.400 Sotera Health, 8,196 %, fällig 13.12.2026 *	1.388	0,14			
1.278 Station Casinos LLC, 7,681 %, fällig 08.02.2027 *	1.276	0,13			
470 Terrier Media Buyer, Inc., 8,842 %, fällig 17.12.2026 *	438	0,04			
9 Triton Water Holdings, Inc., 8,753 %, fällig 16.03.2028 *	9	-			
1.063 UFC Holdings LLC, 8,369 %, fällig 29.04.2026 *	1.065	0,11			
864 United Airlines Inc, 9,292 %, fällig 14.04.2028 *	867	0,09			
1.472 Virgin Media Bristol LLC, 7,925 %, fällig 01.04.2028 *	1.434	0,14			
<b>Summe Schuldscheine (Anschaffungskosten 32.727 USD)</b>	<b>32.434</b>	<b>3,25</b>			
<b>Stammaktien – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
<b>Schweiz: 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
2.840 Credit Suisse Group AG Escrow †	-	-			
<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten – USD)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>			
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen und verpfändeten Anlagen (Anschaffungskosten 1.148.170 USD)</b>					
	<b>1.007.788</b>	<b>100,78</b>			
<b>Kontrakte</b>					
<b>(in Tsd.)</b>	<b>Wert (in Tsd.) USD</b>	<b>% des Nettoinventar- tarwerts</b>			
<b>Erworbene Optionen – 0,23 % (28. Februar 2023: 0,05 %)</b>					
- 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures Dezember 2023, Put 95,8750, fällig 15.12.2023 – Morgan Stanley	176	0,02			
- 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures Dezember 2023, Put 96,00, fällig 15.12.2023 – Morgan Stanley	501	0,05			
- 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures Oktober 2023, Put 97,00, fällig 13.10.2023 – Morgan Stanley	651	0,06			
- CME 3 Month SOFR Futures März 2024 Call 95,25, fällig 15.03.2024 – Morgan Stanley	43	-			
- CME 3 Month SOFR Futures September 2023 Call 96,00, fällig 15.09.2023 – Morgan Stanley	-	-			
- Zehnjährige US-Anleihe Oktober 2023, Call 110,50, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	63	0,01			
- Zehnjährige US-Anleihe November 2023 Call 111,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	46	-			
- Fünfjährige US-Anleihe Oktober 2023, Call 106,50, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	89	0,01			
- Fünfjährige US-Anleihe Oktober 2023, Call 107,25, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	69	0,01			
- US-Anleihe Oktober 2023, Call 119,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	186	0,02			
- US-Anleihe Oktober 2023 Call 120,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	77	0,01			
- US-Anleihe Oktober 2023 Call 121,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	194	0,02			
- US-Anleihe Oktober 2023, Call 121,50, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	68	0,01			
- US-Anleihe Oktober 2023 Call 122,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	23	-			
10.370 USD Put/AUD Call 0,67, fällig 11.03.2023 – JP Morgan	56	0,01			
5.227 USD Put/MXN Call 16,9310, fällig 06.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	14	-			
<b>Summe erworbene Optionen (Anschaffungskosten 1.698 USD)</b>	<b>2.256</b>	<b>0,23</b>			
<b>Credit Default Swaps – 0,27 % (28. Februar 2023: 0,19 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	2.759	0,27			
<b>Index Swaps – 0,67 % (28. Februar 2023: 0,53 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	6.710	0,67			
<b>Devisenterminkontrakte – 0,06 % (28. Februar 2023: 0,05 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	567	0,06			
<b>Futures – 0,25 % (28. Februar 2023: 0,22 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	2.534	0,25			
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>1.022.614</b>	<b>102,26</b>			
<b>geschriebene Optionen – -0,16 % (28. Februar 2023: -0,06 %)</b>					
- 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures Dezember 2023, Put 95,25, fällig 15.12.2023 – Morgan Stanley	-102	-0,01			
-1 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures Dezember 2023, Put 95,3750, fällig 15.12.2023 – Morgan Stanley	-319	-0,03			
- 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures Oktober 2023, Put 96,25, fällig 13.10.2023 – Morgan Stanley	-275	-0,03			
- 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures Oktober 2023, Put 96,50, fällig 13.10.2023 – Morgan Stanley	-394	-0,04			
- CME 3 Month SOFR Futures März 2024 Call 96,1250, fällig 15.03.2024 – Morgan Stanley	-44	-0,01			
- CME 3 Month SOFR Futures September 2023 Call 96,75, fällig 15.09.2023 – Morgan Stanley	-1	-			
- Zehnjährige US-Anleihe November 2023 Call 112,00, fällig 27.10.2023 – Morgan Stanley	-67	-0,01			
- Zehnjährige US-Anleihe November 2023 Put 107,50, fällig 27.10.2023 – Morgan Stanley	-13	-			
- Zehnjährige US-Anleihe November 2023 Put 108,00, fällig 27.10.2023 – Morgan Stanley	-16	-			
- Zehnjährige US-Anleihe November 2023 Call 111,75, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-37	-			
- Zehnjährige US-Anleihe November 2023 Call 112,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-20	-			
- Zehnjährige US-Anleihe November 2023 Call 112,50, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-28	-			
- Zehnjährige US-Anleihe Oktober 2023 Put 109,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-10	-			
- Fünfjährige US-Anleihe Oktober 2023 Put 105,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-3	-			
- Fünfjährige US-Anleihe Oktober 2023 Call 123,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-33	-			
- Fünfjährige US-Anleihe Oktober 2023 Call 124,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-44	-0,01			
- US-Anleihe Oktober 2023 Put 117,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-3	-			
-14.030 USD Put/MXN Call 17,0655, fällig 10.11.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-179	-0,02			
<b>Summe geschriebene Optionen (Anschaffungskosten -1.280 USD)</b>	<b>-1.588</b>	<b>-0,16</b>			
<b>Credit Default Swaps – -0,02 % (28. Februar 2023: -0,01 %)</b>					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-222	-0,02			
<b>Indexswaps – -0,02 % (28. Februar 2023: -0,04 %)</b>					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-253	-0,02			
<b>Zinsswaps – -0,13 % (28. Februar 2023: -0,11 %)</b>					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-1.274	-0,13			
<b>Devisenterminkontrakte – -0,20 % (28. Februar 2023: -0,23 %)</b>					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-2.005	-0,20			
<b>Futures – -0,15 % (28. Februar 2023: -0,32 %)</b>					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-1.496	-0,15			
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>-6.838</b>	<b>-0,68</b>			
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>1.015.776</b>	<b>101,58</b>			
<b>Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten</b>	<b>-15.747</b>	<b>-1,58</b>			
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>1.000.029\$</b>	<b>100,00</b>			
-	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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 126.582.000 USD und machten 12,70 % des Nettovermögens aus.				
*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.				
†	Nicht liquide.				
∞	Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.				
ε	Die Sicherheit ist zum 31. August 2023 in Verzug (Kapital und/oder Zinsen).				
≠	Wertpapier zum 31. August 2023 (ganz oder teilweise) als Sicherheit für den Derivatehandel verpfändet.				
±	Auf noch bekanntgebender Basis erworbene Wertpapiere.				
β	Der Zinssatz für diese Art von Wertpapier ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Kupon entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.				
γ	Aufgrund der unsicheren Zinszahlungen fallen auf das Wertpapier während und/oder nach dem Finanzzeitraum, der am 31. August 2023 endet, keine Erträge mehr an.				

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

### ABKÜRZUNGEN:

Unbefristet	– Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Unbefristete Anleihen sind nicht rückzahlbar, schütten aber kontinuierlich Zinsen aus.
REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit.
TBA	– Wird noch bekannt gegeben.
BRL	– Brasilianischer Real
IDR	– Indonesische Rupiah
MXN	– Mexikanischer Peso
RUB	– Russischer Rubel

Verteilung des Gesamtvermögens		% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		92,40
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		3,07
Finanzderivate		1,40
Sonstige Vermögenswerte		3,13
<b>Gesamtvermögen</b>		<b>100,00</b>

### Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	CDX.NA.HY, 5,000 % – Kaufen	20. Jun. 2028	7.385	\$ -207
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkaufen	20. Jun. 2033	3.640	-15
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkaufen	20. Jun. 2028	178.551	2.759
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 2.240 USD)				\$ 2.759
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -158 USD)				-222
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 2.082 USD)				\$ 2.537

### Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Prozentsatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
JP Morgan	Zahlung variabel verzinsliche BRL CDI, Erhalt Festzins 10,230 %	02. Jan. 2029	82.920	\$ -222
Morgan Stanley	Zahlung variabel verzinsliche MXN TIIE Banxico, Erhalt Festzins 7,450 %	18. Juli 2029	142.060	-513
Morgan Stanley	Zahlung variabel verzinsliche MXN TIIE Banxico, Erhalt Festzins 7,440 %	20. Juli 2029	147.960	-539
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): – USD)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.287 USD)				-1.274
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.287 USD)				\$ -1.274

### Aufstellung der Indexswaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen	Ablaufdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Zahlung Festzins 2,500 %, Erhalt variabler aufgezinsten SOFR (USD)	21. Apr. 2052	86	\$ 16
Morgan Stanley	Zahlung Festzins 2,600 %, Erhalt variabler aufgezinsten SOFR (USD)	15. Feb. 2048	6.547	1.100
Morgan Stanley	Zahlung Festzins 2,850 %, Erhalt variabler aufgezinsten SOFR (USD)	15. Feb. 2029	966	53
Morgan Stanley	Zahlung Festzins 3,050 %, Erhalt variabler aufgezinsten SOFR (USD)	15. Feb. 2048	44.763	4.314
Morgan Stanley	Zahlung Festzins 3,850 %, Erhalt variabler aufgezinsten SOFR (USD)	30. Jun. 2029	30.262	169
Morgan Stanley	Zahlung variabler aufgezinsten SOFR (USD), Erhalt Festzins 4,180 %	29. Feb. 2028	140.700	1.058
Morgan Stanley	Zahlung variabler aufgezinsten SOFR (USD), Erhalt Festzins 3,500 %	30. Sep. 2024	13.390	-253
Nicht realisierte Wertsteigerung von Indexswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 6.036 USD)				\$ 6.710
Nicht realisierte Wertminderung von Indexswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -422 USD)				-253
Nettowertsteigerung von Indexswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 5.614 USD)				\$ 6.457

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Devisenkauf (in Tsd.)	Devisenverkauf (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
07. Sep. 2023	Bank of America Merrill Lynch.	Kauf	USD 1.443	Verkauf MXN 25.059	\$ -25
07. Sep. 2023	Goldman Sachs	Kauf	MXN 25.418	Verkauf USD 1.464	26
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD 15	Verkauf AUD 23	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD 882	Verkauf EUR 808	5
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD 1	Verkauf GBP 1	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD 13	Verkauf USD 8	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD 1.037	Verkauf USD 678	-6
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR 37.206	Verkauf USD 40.926	-553
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP 35	Verkauf USD 46	-
12. Okt. 2023	Bank of America Merrill Lynch.	Kauf	MXN 65.485	Verkauf USD 3.704	108
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf	NOK 66.018	Verkauf EUR 5.692	31
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf	CAD 24.270	Verkauf USD 18.313	-338
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf	AUD 13.031	Verkauf USD 8.696	-237
20. Okt. 2023	Goldman Sachs	Kauf	USD 2.334	Verkauf MXN 40.567	-23
20. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf	USD 5.210	Verkauf CNH 37.268	75
20. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf	USD 1.551	Verkauf IDR 23.418.528	15
20. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf	ZAR 29.450	Verkauf USD 1.552	-
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD 13.195	Verkauf CNH 94.905	118
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD 7.133	Verkauf GBP 5.511	151
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	JPY 2.944.327	Verkauf USD 21.129	-727
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	INR 156.175	Verkauf USD 1.890	-4
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	EUR 3.034	Verkauf USD 3.350	-52

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Devisenkauf (in Tsd.)			Devisenverkauf (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
06. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	USD	3.714	Verkauf	AUD	5.660	\$ 38
06. Nov. 2022	Morgan Stanley	Kauf	AUD	5.690	Verkauf	USD	3.735	-40
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 540 USD)								\$ 567
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -2.578 USD)								-2.005
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -2.038 USD)								\$ -1.438

## Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)				
3-Monats-SOFR-Index Dezember 2023	Morgan Stanley	-240	\$ -56.760	\$ 121				
3-Monats-SOFR-Index Dezember 2024	Morgan Stanley	393	94.153	-43				
3-Monats-SOFR-Index Dezember 2025	Morgan Stanley	196	47.238	49				
3-Monats-SOFR-Index Juni 2023	Morgan Stanley	5	1.184	-23				
Australien, zehnjährige Anleihe, September 2023	Morgan Stanley	148	11.141	-13				
Euro-FX-Devisen September 2023	Morgan Stanley	3	407	1				
Euro-Bobl Dezember 2023	Morgan Stanley	50	6.369	29				
Euro-Buxl Anleihe (30 J) Dezember 2023	Morgan Stanley	-25	-3.626	-47				
Euro-OAT Dezember 2023	Morgan Stanley	91	12.578	91				
Japan, zehnjährige Anleihe (OSE) September 2023	Morgan Stanley	-17	-17.155	136				
Long Gilt Dezember 2023	Morgan Stanley	60	7.264	68				
Zehnjährige US-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Morgan Stanley	-72	-7.994	-61				
Zehnjährige US Ultra Note, Dezember 2023	Morgan Stanley	-633	-73.497	-1.081				
Zweijährige US-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Morgan Stanley	72	14.674	41				
Fünffährige US-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Morgan Stanley	-425	-45.442	-228				
US Long Bond (CBT) Dezember 2023	Morgan Stanley	315	38.332	526				
US Ultra Bond (CBT) Dezember 2023	Morgan Stanley	554	71.726	1.472				
Nicht realisierte Wertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 2.474 USD)								\$ 2.534
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -3.625 USD)								-1.496
Nettowertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.151 USD)								\$ 1.038

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% des Nettoinventar- tarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% des Nettoinventar- tarwerts
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 2,72 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
USD	300	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 % ±	229	0,25	
USD	100	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 % ±	89	0,10	
USD	76	Fannie Mae Pool „BQ3331“, 2,000 %, fällig 01.08.2050	57	0,06	
USD	74	Fannie Mae Pool „BQ4926“, 2,000 %, fällig 01.10.2050	54	0,06	
USD	76	Fannie Mae Pool „BR4052“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	56	0,06	
USD	29	Fannie Mae Pool „CA2472“, 4,000 %, fällig 01.10.2048	25	0,03	
USD	81	Fannie Mae Pool „CA8779“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	60	0,07	
USD	269	Fannie Mae Pool „CB2664“, 3,000 %, fällig 01.01.2052	215	0,24	
USD	41	Fannie Mae Pool „FM1263“, 4,500 %, fällig 01.07.2049	37	0,04	
USD	83	Fannie Mae Pool „FM3049“, 4,000 %, fällig 01.04.2044	73	0,08	
USD	86	Fannie Mae Pool „FM9195“, 2,500 %, fällig 01.10.2051	66	0,07	
USD	86	Fannie Mae Pool „FM9441“, 2,000 %, fällig 01.04.2051	63	0,07	
USD	72	Fannie Mae Pool „FS0067“, 4,500 %, fällig 01.09.2051	63	0,07	
USD	87	Fannie Mae Pool „FS1118“, 3,500 %, fällig 01.03.2052	72	0,08	
USD	91	Fannie Mae Pool „FS1374“, 3,000 %, fällig 01.03.2052	72	0,08	
USD	185	Fannie Mae Pool „MA3210“, 3,500 %, fällig 01.12.2047	155	0,17	
USD	23	Fannie Mae Pool „MA4031“, 4,500 %, fällig 01.05.2050	20	0,02	
USD	75	Freddie Mac Pool „QB4985“, 2,000 %, fällig 01.11.2050	55	0,06	
USD	89	Freddie Mac Pool „QC9443“, 2,500 %, fällig 01.10.2051	68	0,08	
USD	89	Freddie Mac Pool „QK1354“, 2,000 %, fällig 01.02.2042	68	0,08	
USD	86	Freddie Mac Pool „RB5131“, 2,000 %, fällig 01.10.2041	66	0,07	
USD	98	Freddie Mac Pool „SD2762“, 5,500 %, fällig 01.05.2053	90	0,10	
USD	95	Freddie Mac Pool „SD2792“, 4,500 %, fällig 01.03.2047	85	0,10	
USD	193	Freddie Mac Pool „SD7560“, 4,000 %, fällig 01.02.2053	166	0,18	
USD	86	Ginnie Mae II Pool „785657“, 2,500 %, fällig 20.10.2051	67	0,07	
USD	73	Ginnie Mae II Pool „MA7192“, 2,000 %, fällig 20.02.2051	56	0,06	
USD	100	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 % ±	79	0,09	
USD	100	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,000 % ±	81	0,09	
USD	100	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,500 % ±	84	0,09	
USD	100	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 4,000 % ±	86	0,10	
<b>Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 2.495 EUR)</b>		2.457	2,72		
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 45,77 % (28. Februar 2023: 43,18 %)</b>					
<b>Australien – 1,04 % (28. Februar 2023: 0,70 %)</b>					
	970	Glencore Finance Europe Ltd, 1,750 %, fällig 17.03.2025	938	1,04	
<b>Belgien – 0,15 % (28. Februar 2023: 0,16 %)</b>					
	140	Anheuser-Busch InBev SA.NV, 2,125 %, fällig 02.12.2027	132	0,15	
<b>Brasilien – 0,75 % (28. Februar 2023: 0,52 %)</b>					
USD	930	Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125 %, fällig 15.01.2032	678	0,75	
<b>Kanada – 2,01 % (28. Februar 2023: 1,89 %)</b>					
USD	60	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15.02.2029	48	0,05	
	1.000	Bank of Montreal, 2,750 %, fällig 15.06.2027	963	1,07	
USD	10	MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01.02.2029	9	0,01	
GBP	280	Royal Bank of Canada, 3,625 %, fällig 14.06.2027	300	0,33	
GBP	440	Royal Bank of Canada, 5,000 %, fällig 24.01.2028	494	0,55	
			1.814	2,01	
<b>Frankreich – 4,63 % (28. Februar 2023: 3,70 %)</b>					
	310	Altice France SA.France, 3,375 %, fällig 15.01.2028	219	0,24	
	1.400	BNP Paribas SA, 0,500 %, fällig 30.05.2028 *	1.221	1,35	
	700	Credit Agricole SA, 1,875 %, fällig 22.04.2027 *	658	0,73	
GBP	200	Credit Agricole SA, 4,875 %, fällig 23.10.2029	221	0,25	
	200	Credit Agricole SA, 4,000 %, fällig 18.01.2033	200	0,22	
	400	Dassault Systemes SE, 0,125 %, fällig 16.09.2026	362	0,40	
	660	Orange SA, 5,000 %, unbefristet *	659	0,73	
	200	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR, 2,125 %, fällig 27.09.2038	162	0,18	
	500	Thales SA, 0,750 %, fällig 23.01.2025	478	0,53	
			4.180	4,63	
<b>Deutschland – 2,74 % (28. Februar 2023: 2,06 %)</b>					
	800	Allianz SE, 2,625 %, unbefristet *	565	0,63	
	400	Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG in München, 3,250 %, fällig 26.05.2049 *	369	0,41	
	1.020	NRW Bank, 0,375 %, fällig 16.05.2029	878	0,97	
	690	Volkswagen Financial Services AG, 0,875 %, fällig 31.01.2028	598	0,66	
	100	Vonovia SE, 1,000 %, fällig 16.06.2033	68	0,07	
			2.478	2,74	
<b>Israel – 0,26 % (28. Februar 2023: 0,28 %)</b>					
USD	280	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	234	0,26	
<b>Italien – 2,49 % (28. Februar 2023: 1,91 %)</b>					
	760	CA Auto Bank SPA.Ireland, 0,500 %, fällig 13.09.2024	730	0,81	
	950	Intesa Sanpaolo SpA, 1,000 %, fällig 04.07.2024	926	1,02	
	620	UniCredit SpA, 2,000 %, fällig 23.09.2029 *	596	0,66	
			2.252	2,49	
<b>Japan – 0,31 % (28. Februar 2023: 0,21 %)</b>					
	300	Asahi Group Holdings Ltd, 1,151 %, fällig 19.09.2025	284	0,31	
<b>Luxemburg – 2,55 % (28. Februar 2023: 1,71 %)</b>					
	555	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,750 %, fällig 12.03.2029	435	0,48	
	1.400	Logicor Financing Sarl, 1,625 %, fällig 15.07.2027	1.177	1,30	
	260	Prologis International Funding II SA, 2,375 %, fällig 14.11.2030	225	0,25	
	500	SELP Finance Sarl, 1,500 %, fällig 20.11.2025	466	0,52	
			2.303	2,55	
<b>Macau – 0,34 % (28. Februar 2023: 0,23 %)</b>					
USD	400	Sands China Ltd, 3,100 %, fällig 03.08.2029	308	0,34	
<b>Niederlande – 1,45 % (28. Februar 2023: 1,45 %)</b>					
	100	ABN AMRO Bank NV, 4,500 %, fällig 21.11.2034	101	0,11	
	250	CTP NV, 0,625 %, fällig 27.11.2023	247	0,27	
	320	Enxsis Holding NV, 0,750 %, fällig 02.07.2031	262	0,29	
	740	Euronext NV, 1,000 %, fällig 18.04.2025	704	0,78	
			1.314	1,45	
<b>Norwegen – 0,87 % (28. Februar 2023: 0,76 %)</b>					
	790	DNB Bank ASA, 0,050 %, fällig 14.11.2023	784	0,87	
<b>Singapur – 0,34 % (28. Februar 2023: 0,24 %)</b>					
	500	Temasek Financial I Ltd, 1,250 %, fällig 20.11.2049	303	0,34	
<b>Südafrika – 0,33 % (28. Februar 2023: 0,22 %)</b>					
	310	Anglo American Capital Plc, 1,625 %, fällig 18.09.2025	296	0,33	
<b>Spanien – 2,47 % (28. Februar 2023: 1,43 %)</b>					
	1.400	Banco Santander SA, 2,500 %, fällig 18.03.2025	1.360	1,50	
	400	Cellnex Finance Co SA, 2,000 %, fällig 15.09.2032	319	0,35	
	600	Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, fällig 18.09.2027	557	0,62	
			2.236	2,47	
<b>Supranational – 1,19 % (28. Februar 2023: 3,10 %)</b>					
	1.240	African Development Bank, 0,500 %, fällig 21.03.2029	1.078	1,19	
<b>Schweiz – 2,03 % (28. Februar 2023: 1,32 %)</b>					
	160	Holcim Finance Luxembourg SA, 3,000 %, unbefristet *	156	0,17	
	320	UBS AG/London, 0,500 %, fällig 31.03.2031	249	0,28	
	550	UBS Group AG, 1,500 %, fällig 30.11.2024	544	0,60	
	700	UBS Group AG, 3,250 %, fällig 02.04.2026 *	685	0,76	
	220	UBS Group AG, 1,000 %, fällig 24.06.2027 *	199	0,22	
			1.833	2,03	
<b>Vereinigte Arabische Emirate – 0,31 % (28. Februar 2023: 0,21 %)</b>					
USD	200	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd, 2,625 %, fällig 31.03.2036	146	0,16	
	180	MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000 %, fällig 10.03.2034	133	0,15	
			279	0,31	
<b>Vereinigtes Königreich – 5,84 % (28. Februar 2023: 5,38 %)</b>					
	780	Annington Funding Plc, 1,650 %, fällig 12.07.2024	754	0,83	
	100	Aviva Plc, 3,375 %, fällig 12.04.2045 *	96	0,11	
	1.050	Barclays Plc, 3,375 %, fällig 02.04.2025 *	1.043	1,16	
	1.110	Lloyds Banking Group Plc, 4,331 %, fällig 21/06/2024	1.114	1,23	
GBP	140	Pinewood Finance Co Ltd, 3,250 %, fällig 30.09.2025	152	0,17	
GBP	130	Premier Foods Finance Plc, 3,500 %, fällig 15.10.2026	138	0,15	
	420	Rentokil Initial Plc, 0,950 %, fällig 22.11.2024	404	0,45	
	100	Segro Capital Sarl, 1,875 %, fällig 23.03.2030	86	0,10	
	580	Standard Chartered Plc, 3,125 %, fällig 19.11.2024	572	0,63	
GBP	140	Virgin Media Secured Finance Plc, 5,250 %, fällig 15.05.2029	140	0,15	
	800	Vodafone Group Plc, 2,875 %, fällig 20.11.2037	685	0,76	
	100	Wellcome Trust Ltd/The, 1,125 %, fällig 21.01.2027	92	0,10	
			5.276	5,84	
<b>USA – 13,46 % (28. Februar 2023: 14,56 %)</b>					
	430	AbbVie Inc, 1,250 %, fällig 01.06.2024	421	0,47	
USD	200	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl, 144A, 4,625 %, fällig 01.06.2028	156	0,17	
USD	20	American International Group Inc, 2,500 %, fällig 30.06.2025	18	0,02	
	220	AT&T Inc, 3,550 %, fällig 17.12.2032	207	0,23	
USD	40	Ball Corp, 3,125 %, fällig 15.09.2031	30	0,03	
	1.390	Bank of America Corp, 1,379 %, fällig 07.02.2025 *	1.373	1,52	
	420	Berkshire Hathaway Inc, 1,125 %, fällig 16.03.2027	385	0,43	
USD	290	Boeing Co/The, 5,150 %, fällig 01.05.2030	263	0,29	
USD	13	Bristol-Myers Squibb Co, 2,900 %, fällig 26.07.2024	12	0,01	
USD	70	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	52	0,06	
USD	200	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 01.06.2033	146	0,16	
USD	20	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23.07.2025	18	0,02	
USD	30	Cheniere Energy Inc, 4,625 %, fällig 15.10.2028	26	0,03	
USD	50	Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, fällig 31.01.2032	38	0,04	
	1.200	Citigroup Inc, 1,750 %, fällig 28.01.2025	1.164	1,29	
USD	290	CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig 01.12.2030	191	0,21	
USD	170	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.05.2025	159	0,18	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% des Nettoinventarwerts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>			<b>Italien – 5,97 % (28. Februar 2023: 6,17 %)</b>		
<b>USA – (Fortsetzung)</b>			1.670	1.484	1,64
USD	76	0,08	Italien Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie 10Y, 2,500 %, fällig 01.12.2032		
USD	90	0,09	4.685	3.913	4,33
430	281	0,31	Italien Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie 31Y, 144A, 3,250 %, fällig 01.09.2046		
30	25	0,03	5.397		
USD	130	0,12	<b>Mexiko – 1,24 % (28. Februar 2023: 1,91 %)</b>		
USD	60	0,04	1.530 Mexiko, internationale Staatsanleihe, 2,875 %, fällig 08.04.2039		
USD	60	0,05	1.123		
USD	200	0,17	<b>Niederlande – 4,30 % (28. Februar 2023: 4,24 %)</b>		
USD	20	0,02	4.660 Niederlande, Staatsanleihe, 144A, 0,000 %, fällig 15.07.2030		
USD	350	0,32	3.887		
780	742	0,82	<b>Polen – 1,43 % (28. Februar 2023: 1,27 %)</b>		
260	255	0,28	PLN 7.770 Republik Polen, Staatsanleihe, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032		
USD	50	0,05	1.293		
1.290	1.067	1,18	<b>Südafrika – 1,36 % (28. Februar 2023: 1,59 %)</b>		
USD	20	0,02	USD 1.500 Republik Südafrika, internationale Staatsanleihe, 4,300 %, fällig 12.10.2028		
USD	1.130	1,23	1.224		
USD	60	0,05	<b>Südkorea – 1,25 % (28. Februar 2023: 0,84 %)</b>		
USD	110	0,08	1.150 Export-Import Bank of Korea, 0,375 %, fällig 26.03.2024		
400	375	0,41	1.126		
230	189	0,21	<b>Spanien – 5,03 % (28. Februar 2023: 5,75 %)</b>		
100	106	0,12	1.080 Spanien, Staatsanleihe, 144A, 1,300 %, fällig 31.10.2026		
320	316	0,35	1.210 Spanien, Staatsanleihe, 144A, 1,400 %, fällig 30.04.2028		
180	174	0,19	890 Spanien, Staatsanleihe, 144A, 2,900 %, fällig 31.10.2046		
190	168	0,19	2.050 Spanien, Staatsanleihe, Serie 30Y, 144A, 2,700 %, fällig 31.10.2048		
700	519	0,57	1.646		
USD	180	0,16	4.541		
USD	42	0,04	<b>Supranational – 2,06 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
USD	40	0,04	2.080 Europäischer Stabilitätsmechanismus, Serie EUR, 0,750 %, fällig 05.09.2028		
USD	130	0,11	1.864		
USD	10	0,01	<b>Vereinigtes Königreich – 0,42 % (28. Februar 2023: 0,35 %)</b>		
USD	40	0,03	GBP 10 Vereinigtes Königreich Gilt, 2,500 %, fällig 22.07.2065		
USD	110	0,10	8		
USD	30	0,03	GBP 290 Inflationsgebundene Gilts des Vereinigten Königreichs, Serie 3MO, 0,125 %, fällig 22.03.2068 β		
USD	40	0,04	368		
USD	10	0,01	376		
USD	150	0,14	<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 49.965 USD)</b>		
USD	110	0,10	42.146		
USD	30	0,03	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,58 % (28. Februar 2023: 0,50 %)</b>		
USD	40	0,04	USD 564 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)		
USD	10	0,01	520		
USD	150	0,14	<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 508€)</b>		
USD	110	0,10	520		
USD	20	0,02	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 97.472€)</b>		
USD	450	0,48	86.466		
	12.155	13,46	95,73		
<b>Sambia – 0,21 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			<b>Inflationsswaps – 0,02 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
USD	200	0,21	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	188	0,21	22		
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 44.504 USD)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – 0,01 % (28. Februar 2023: -0,05 %)</b>		
	41.343	45,77	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 46,66 % (28. Februar 2023: 51,32 %)</b>			4		
<b>Österreich – 2,42 % (28. Februar 2023: 2,40 %)</b>			<b>Futures – 0,36 % (28. Februar 2023: -0,36 %)</b>		
	2.590	2,42	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	2.189	2,42	322		
<b>Belgien – 2,12 % (28. Februar 2023: 2,12 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
	1.830	1,919	86.814		
	1.919	2,12	96,12		
<b>Frankreich – 11,17 % (28. Februar 2023: 11,80 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – -0,20 % (28. Februar 2023: -0,25 %)</b>		
	4.210	3,81	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	1.890	1,63	-179		
	3.545	3,86	<b>Futures – -0,10 % (28. Februar 2023: -0,80 %)</b>		
	590	0,44	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	400	0,49	-91		
	1.000	0,94	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>		
	10.087	11,17	-270		
<b>Deutschland – 6,83 % (28. Februar 2023: 11,53 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
	970	1,00	86.544		
	580	0,55	95,82		
	5.050	5,28	<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>		
	6.165	6,83	3.779		
			4,18		
<b>Irland – 1,06 % (28. Februar 2023: 1,03 %)</b>			<b>Gesamtvermögen</b>		
	1.190	1,06	90.323€		
			100,00		
<p>– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.</p> <p>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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 16.144.000 EUR und machten 17,87 % des Nettovermögens aus.</p> <p>* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.</p> <p>± Auf noch bekanntgebender Basis erworbene Wertpapiere.</p> <p>β Der Zinssatz für diese Art von Wertpapier ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Kupon entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.</p>					

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

### ABKÜRZUNGEN:

Unbefristet	– Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Unbefristete Anleihen sind nicht rückzahlbar, schütten aber kontinuierlich Zinsen aus.
TBA	– Wird noch bekannt gegeben.
GBP	– Britisches Pfund
PLN	– polnischer Zloty
USD	– US-Dollar

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,13
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,57
Finanzderivate	0,38
Sonstige Vermögenswerte	4,92
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

### Aufstellung der Inflationsswaps

Gegenpartei	Prozentsatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch.	USD – VPI städtische Verbraucher	08. März 2053	930	€ -
Bank of America Merrill Lynch.	EUR – Harmonisierter Verbraucherpreisindex	15. März 2053	1.120	€ 22
Nicht realisierte Wertsteigerung von Inflationsswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): –€)				€ 22
Nicht realisierte Wertminderung von Inflationsswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): –€)				-
Nettowertsteigerung von Inflationsswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): –€)				€ 22

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Devisenkauf (in Tsd.)		Devisenverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
16. Nov. 2023	Citi	Kauf	SEK 10.430	Verkauf	EUR 893	€ -14
16. Nov. 2023	Citi	Kauf	EUR 122	Verkauf	JPY 18.900	2
16. Nov. 2023	Goldman Sachs	Kauf	EUR 68	Verkauf	CAD 100	-
16. Nov. 2023	Goldman Sachs	Kauf	EUR 451	Verkauf	GBP 391	-4
16. Nov. 2023	Goldman Sachs	Kauf	EUR 70	Verkauf	GBP 60	-
16. Nov. 2023	Goldman Sachs	Kauf	EUR 3.212	Verkauf	USD 3.541	-41
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	EUR 91	Verkauf	AUD 152	-
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	EUR 62	Verkauf	CAD 92	-
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	PLN 1.120	Verkauf	EUR 250	-2
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	NOK 10.885	Verkauf	EUR 971	-29
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	JPY 19.538	Verkauf	EUR 125	-
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	EUR 2.573	Verkauf	GBP 2.229	-21
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	EUR 147	Verkauf	JPY 22.627	2
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	EUR 665	Verkauf	USD 733	-9
16. Nov. 2023	UBS	Kauf	EUR 4.581	Verkauf	USD 5.050	-59
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 72€)						€ 4
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -338€)						-179
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -266€)						€ -175

### Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bobl Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	77	€ 9.045	€ 58
Euro-Bund Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	65	8.621	86
Euro-Buxl Anleihe (30 J) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	-8	-1.070	-15
Euro-Schatz Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	134	14.134	35
ICE SONIA (3 Monate) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	50	13.769	-25
ICE SONIA (3 Monate) Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	50	13.785	9
Japan, zehnjährige Anleihe (OSE) September 2023	Bank of America Merrill Lynch	-11	-10.237	74
Long Gilt Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	9	1.005	18
Zehnjährige US Ultra Note, Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	-33	-3.533	-51
Fünfjährige US-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	61	6.015	37
US Ultra Bond (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	3	358	5
Nicht realisierte Wertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 476€)				€ 322
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.065€)				-91
Nettowertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -589€)				€ 231



# FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Forderungenbesicherte Wertpapiere – 0,24 % (28. Februar 2023: 0,24 %)</b>			<b>Guatemala – 0,50 % (28. Februar 2023: 1,05 %)</b>		
590 Home Equity Asset Trust 2005-6, Serie 2005 6, Klasse M5, 6,374 %, fällig 25.12.2035 *	540	0,24	1.233 Millicom International Cellular SA, 5,125 %, fällig 15.01.2028	1.119	0,50
<b>Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 577 USD)</b>	<b>540</b>	<b>0,24</b>	<b>Indonesien – 0,18 % (28. Februar 2023: 0,17 %)</b>		
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 2,34 % (28. Februar 2023: 1,81 %)</b>			460 Pertamina Persero PT, 3,100 %, fällig 27.08.2030	398	0,18
580 BANK 2018-BNK15, Serie 2018 BN15, Klasse B, 4,814 %, fällig 15.11.2061 *	505	0,23	<b>Irland – 0,71 % (28. Februar 2023: 0,69 %)</b>		
234 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Serie 2019 R05, Klasse 1B1, 144A, 9,502 %, fällig 25.07.2039 *	241	0,11	590 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30.01.2032	480	0,22
260 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Serie 2020 R01, Klasse 1B1, 144A, 8,652 %, fällig 25.01.2040 *	261	0,12	1.100 Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 15.02.2024	1.093	0,49
450 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Klasse 1B1, 144A, 8,388 %, fällig 25.10.2041 *	449	0,20		1.573	0,71
390 Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05, Serie 2023 R05, Klasse 1M2, 144A, 8,396 %, fällig 25.06.2043 *	397	0,18	<b>Israel – 0,81 % (28. Februar 2023: 0,99 %)</b>		
730 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, Serie 2021 DNA3, Klasse B1, 144A, 8,788 %, fällig 25.10.2033 *	753	0,34	EUR 300 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 7,375 %, fällig 15.09.2029	334	0,15
947 Hilton USA Trust 2016-HHV, Serie 2016 HHV, Klasse D, 144A, 4,333 %, fällig 11.05.2038 *	870	0,39	1.250 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	1.131	0,51
5.300 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Serie 2018 PHMZ, Klasse M, 144A, 13,933 %, fällig 15.06.2035 *+e	–	–	310 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, fällig 15.09.2031	329	0,15
4 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-LDP12, Serie 2007 LD12, Klasse AJ, 6,561 %, fällig 15.02.2051 * 4	–	–		1.794	0,81
365 PMT Credit Risk Transfer Trust 2021-1R, Serie 2021 1R, Klasse A, 144A, 8,343 %, fällig 27.02.2024 *	363	0,16	<b>Italien – 1,22 % (28. Februar 2023: 1,51 %)</b>		
427 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-1, Serie 2017 1, Klasse M1, 144A, 4,000 %, fällig 25.01.2056 *	423	0,19	EUR 500 International Design Group SPA, 8,031 %, fällig 15.05.2026 *	542	0,25
1.426 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR17 Trust, Serie 2005 AR17, Klasse A1C3, 6,389 %, fällig 25.12.2045 *	927	0,42	GBP 770 Intesa Sanpaolo SpA, 6,500 %, fällig 14.03.2029 *	938	0,42
<b>Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 10.949 USD)</b>	<b>5.193</b>	<b>2,34</b>	EUR 270 Marcolin SpA, 6,125 %, fällig 15.11.2026	271	0,12
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 50,58 % (28. Februar 2023: 55,37 %)</b>			EUR 1.010 Telecom Italia SpA.Milano, 2,375 %, fällig 10.12.2027	956	0,43
<b>Argentinien – 0,21 % (28. Februar 2023: 0,20 %)</b>				2.707	1,22
500 YPF SA, 8,500 %, fällig 28.07.2025	473	0,21	<b>Kasachstan – 1,04 % (28. Februar 2023: 1,01 %)</b>		
<b>Belgien – 0,14 % (28. Februar 2023: 0,18 %)</b>			460 KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, fällig 24.04.2030	419	0,19
180 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, fällig 01.02.2046	168	0,08	660 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 3,500 %, fällig 14.04.2033	498	0,22
110 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig 01.06.2040	98	0,04	1.520 QazaqGaz NC JSC, 4,375 %, fällig 26.09.2027	1.401	0,63
40 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,439 %, fällig 06.10.2048	35	0,02		2.318	1,04
	301	0,14	<b>Luxemburg – 0,65 % (28. Februar 2023: 0,47 %)</b>		
<b>Brasilien – 1,50 % (28. Februar 2023: 1,95 %)</b>			EUR 820 Altice Financing SA, 2,250 %, fällig 15.01.2025	854	0,38
1.400 B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, fällig 20.09.2031	1.185	0,53	GBP 530 Citidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, fällig 01.04.2028	592	0,27
1.310 Braskem America Finance Co, 7,125 %, fällig 22.07.2041	1.189	0,53		1.446	0,65
1.040 Suzano Austria GmbH, 5,000 %, fällig 15.01.2030	968	0,44	<b>Mexiko – 1,97 % (28. Februar 2023: 1,97 %)</b>		
	3.342	1,50	1.250 Banco Mercantil del Norte SA.Grand Cayman, 7,500 %, unbefristet *	1.141	0,51
<b>Kanada – 0,56 % (28. Februar 2023: 0,99 %)</b>			1.360 BBVA Bancomer SA/Texas, 5,125 %, fällig 18/01/2033	1.184	0,53
380 MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01.02.2029	363	0,16	1.220 Orbia Advance Corp SAB de CV, 5,875 %, fällig 17.09.2044	1.070	0,48
260 Open Text Corp, 144A, 3,875 %, fällig 15.02.2028	232	0,11	1.070 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	991	0,45
740 Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2030	638	0,29		4.386	1,97
	1.233	0,56	<b>Niederlande – 1,97 % (28. Februar 2023: 1,90 %)</b>		
<b>China – 0,51 % (28. Februar 2023: 0,53 %)</b>			250 Cooperatieve Rabobank UA, 3,649 %, fällig 06.04.2028 *	232	0,11
1.980 Prosus NV, 3,832 %, fällig 08.02.2051	1.128	0,51	800 Cooperatieve Rabobank UA, 3,250 %, unbefristet *	729	0,33
<b>Kolumbien – 0,25 % (28. Februar 2023: 0,24 %)</b>			EUR 200 Cooperatieve Rabobank UA, 4,875 %, unbefristet *	184	0,08
550 Ecopetrol SA, 8,875 %, fällig 13.01.2033	558	0,25	GBP 1.100 ING Groep NV, 5,000 %, fällig 30.08.2026 *	1.358	0,61
<b>Finnland – 0,30 % (28. Februar 2023: 0,28 %)</b>			1.510 Trivium Packaging Finance BV, 5,500 %, fällig 15.08.2026	1.426	0,64
EUR 650 Nordea Bank Abp, 3,500 %, unbefristet *	663	0,30	550 VZ Secured Financing BV, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2032	449	0,20
<b>Frankreich – 2,37 % (28. Februar 2023: 2,03 %)</b>				4.378	1,97
EUR 840 Altice France SA.France, 2,125 %, fällig 15.02.2025	842	0,38	<b>Peru – 0,18 % (28. Februar 2023: 0,63 %)</b>		
EUR 1.000 BNP Paribas SA, 2,500 %, fällig 31.03.2032 *	978	0,44	610 Petroleos del Peru SA, 5,625 %, fällig 19.06.2047	391	0,18
EUR 1.690 BNP Paribas SA, 7,375 %, unbefristet *	1.660	0,75	<b>Singapur – 0,06 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
EUR 560 Burger King France SAS, 8,475 %, fällig 01.11.2026 *	613	0,27	EUR 139 Cromwell Ereit Lux Finco Sarl, 2,125 %, fällig 19.11.2025	133	0,06
EUR 570 Goldstory SAS, 5,375 %, fällig 01.03.2026	600	0,27	<b>Slowenien – 0,41 % (28. Februar 2023: 0,37 %)</b>		
EUR 300 IPD 3 BV, 8,000 %, fällig 15.06.2028	334	0,15	EUR 1.020 United Group BV, 5,250 %, fällig 01.02.2030	919	0,41
EUR 220 Kapla Holding SAS, 9,163 %, fällig 15.07.2027 *	243	0,11	<b>Südafrika – 0,09 % (28. Februar 2023: 0,09 %)</b>		
	5.270	2,37	200 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig 10.04.2027	194	0,09
<b>Deutschland – 2,06 % (28. Februar 2023: 2,93 %)</b>			<b>Spanien – 1,37 % (28. Februar 2023: 0,49 %)</b>		
2.600 Allianz SE, 3,200 %, unbefristet *	1.976	0,89	EUR 1.000 Banco Santander SA, 5,750 %, fällig 23.08.2033 *	1.083	0,49
EUR 680 APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625 %, fällig 15.01.2027	657	0,29	EUR 600 Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, fällig 18.09.2027	604	0,27
EUR 558 TK Elevator Holdco GmbH, 6,625 %, fällig 15.07.2028	525	0,24	EUR 300 Telefonica Europe BV, 3,875 %, unbefristet *	304	0,14
EUR 540 TUI Cruises GmbH, 6,500 %, fällig 15.05.2026	558	0,25	EUR 300 Telefonica Europe BV, 2,376 %, unbefristet *	258	0,12
EUR 900 ZF Finance GmbH, 2,000 %, fällig 06.05.2027	869	0,39	EUR 770 Via Celere Desarrollos Inmobiliarios SA, 5,250 %, fällig 01.04.2026	787	0,35
	4.585	2,06		3.036	1,37
			<b>Schweden – 0,67 % (28. Februar 2023: 0,77 %)</b>		
			EUR 300 Assemblin Group AB, 8,587 %, fällig 05.07.2029 *	322	0,15
			EUR 680 Heimstaden Bostad AB, 3,625 %, unbefristet *	337	0,15
			EUR 750 Verisure Holding AB, 7,125 %, fällig 01.02.2028	825	0,37
				1.484	0,67
			<b>Schweiz – 0,90 % (28. Februar 2023: 2,00 %)</b>		
			2.010 UBS Group AG, 7,000 %, unbefristet *	1.998	0,90

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigtes Königreich – 8,57 % (28. Februar 2023: 7,21 %)</b>					
EUR	750	888 Acquisitions Ltd, 7,558 %, fällig 15.07.2027	776	0,35	
GBP	620	Barclays Plc, 7,125 %, unbefristet *	726	0,32	
GBP	570	Bellis Acquisition Co Plc, 4,500 %, fällig 16.02.2026	635	0,28	
GBP	210	Galaxy Bidco Ltd, 6,500 %, fällig 31.07.2026	245	0,11	
GBP	1.160	Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, fällig 07.04.2026	1.349	0,61	
GBP	1.459	Greene King Finance Plc, Serie B2, 7,080 %, fällig 15.03.2036 *	1.439	0,65	
	400	HSBC Holdings Plc, 4,762 %, fällig 29/03/2033	356	0,16	
	1.240	HSBC Holdings Plc, 6,375 %, unbefristet *	1.197	0,54	
EUR	110	INEOS Quattro Finance 1 Plc, 3,750 %, fällig 15.07.2026	106	0,05	
EUR	1.600	Lloyds Banking Group Plc, 4,947 %, unbefristet *	1.621	0,73	
GBP	1.275	Marston's Issuer Plc, Serie B1, 7,819 %, fällig 16.07.2035 *	1.155	0,52	
GBP	660	NatWest Group Plc, 3,619 %, fällig 29/03/2029	738	0,33	
GBP	170	NatWest Markets Plc, 6,375 %, fällig 08.11.2027	216	0,10	
EUR	230	PEU Fin Plc, 7,250 %, fällig 01.07.2028	249	0,11	
GBP	540	Pinewood Finance Co Ltd, 3,250 %, fällig 30.09.2025	638	0,29	
GBP	550	Premier Foods Finance Plc, 3,500 %, fällig 15.10.2026	633	0,28	
GBP	1.150	Saga Plc, 5,500 %, fällig 15.07.2026	1.114	0,50	
GBP	453	Tesco Property Finance 5 Plc, 5,661 %, fällig 13.10.2041	530	0,24	
GBP	1.027	Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, fällig 13.07.2044	1.172	0,53	
EUR	300	Victoria Plc, 3,625 %, fällig 24.08.2026	264	0,12	
GBP	810	Vmed O2 UK Financing I Plc, 4,500 %, fällig 15.07.2031	802	0,36	
GBP	1.020	Vodafone Group Plc, 8,000 %, fällig 30.08.2086 *	1.290	0,58	
GBP	680	Wheel Bidco Ltd, 6,750 %, fällig 15.07.2026	713	0,32	
GBP	1.000	Whitbread Group Plc, 2,375 %, fällig 31.05.2027	1.085	0,49	
			19.049	8,57	
<b>USA – 21,38 % (28. Februar 2023: 23,51 %)</b>					
	500	AbbVie Inc, 4,850 %, fällig 15.06.2044	458	0,21	
	202	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 20.04.2026	198	0,09	
	1.320	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.04.2029	1.264	0,57	
	660	American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, fällig 01.10.2029	544	0,25	
	890	American Express Co, 3,550 %, unbefristet *	743	0,33	
	1.790	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	1.535	0,69	
	570	Bank of America Corp, 5,015 %, fällig 22.07.2033 *	549	0,25	
	280	Bank of America Corp, 5,288 %, fällig 25.04.2034 *	273	0,12	
	1.150	Bank of America Corp, 3,311 %, fällig 22.04.2042 *	861	0,39	
	140	Bank of America Corp, 4,083 %, fällig 20.03.2051 *	113	0,05	
	494	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, fällig 15.12.2025	496	0,22	
	650	Carnival Corp, 144A, 10,500 %, fällig 01.06.2030	693	0,31	
	1.400	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,125 %, fällig 01.05.2027	1.317	0,59	
	610	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 01.06.2033	482	0,22	
	1.020	Centene Corp, 4,625 %, fällig 15.12.2029	939	0,42	
	400	Charles Schwab Corp/The, Serie H, 4,000 %, unbefristet *	303	0,14	
	1.380	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01.06.2041	916	0,41	
	250	Cigna Group/The, 4,800 %, fällig 15.08.2038	231	0,10	
	1.030	Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	1.283	0,58	
	572	Comcast Corp, 2,937 %, fällig 01.11.2056	356	0,16	
	420	Comcast Corp, 4,950 %, fällig 15.10.2058	388	0,17	
	1.798	Continental Resources Inc.OK, 4,900 %, fällig 01.06.2044	1.380	0,62	
	750	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2029	621	0,28	
	680	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig 03.11.2036	695	0,31	
	624	Devon Energy Corp, 5,250 %, fällig 15.10.2027	619	0,28	
	246	Devon Energy Corp, 5,875 %, fällig 15.06.2028	246	0,11	
	1.200	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.08.2027	1.065	0,48	
	420	DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15.11.2024	391	0,18	
	1.160	DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	869	0,39	
	670	DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	521	0,24	
	830	Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, fällig 15.06.2025	817	0,37	
	740	Enterprise Products Operating LLC, 4,800 %, fällig 01.02.2049	651	0,29	
	1.050	EQT Corp, 3,900 %, fällig 01.10.2027	981	0,44	
	380	EQT Corp, 5,000 %, fällig 15.01.2029	361	0,16	
GBP	780	Ford Motor Credit Co LLC, 2,748 %, fällig 14.06.2024	954	0,43	
	390	Ford Motor Credit Co LLC, 3,815 %, fällig 02.11.2027	347	0,16	
	1.515	Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, fällig 10.02.2029	1.252	0,56	
	1.430	Freepport-McMoran Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	1.285	0,58	
	235	Goldman Sachs Capital II, 6,439 %, unbefristet *	190	0,09	
GBP	590	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,625 %, fällig 29.10.2029 *	662	0,30	
	1.400	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.12.2028	1.224	0,55	
	200	JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	168	0,08	
	30	JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig 22.04.2051 *	20	0,01	
	330	JPMorgan Chase & Co, 3,328 %, fällig 22.04.2052 *	232	0,10	
	270	Kraft Heinz Foods Co, 5,200 %, fällig 15.07.2045	248	0,11	
	440	Legacy LifePoint Health LLC, 144A, 4,375 %, fällig 15.02.2027	381	0,17	
	170	McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	141	0,06	
	1.430	Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	1.271	0,57	
	40	Morgan Stanley, 5,597 %, fällig 24.03.2051 *	40	0,02	
	640	Netflix Inc, 144A, 4,875 %, fällig 15.06.2030	623	0,28	
	490	Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, fällig 15.08.2029	597	0,27	
	690	Radiology Partners Inc, 144A, 9,250 %, fällig 01.02.2028	193	0,09	
	1.850	Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.02.2030	1.672	0,75	
	205	Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, fällig 01.03.2032	232	0,10	
	500	Southwestern Energy Co, 8,375 %, fällig 15.09.2028	521	0,23	
	1.210	Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig 01.02.2032	1.073	0,48	
	700	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025	702	0,32	
	1.620	Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	1.932	0,87	
	640	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500 %, fällig 01.03.2030	614	0,28	
	450	T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030	411	0,19	
	1.130	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	1.006	0,45	
	790	United Rentals North America Inc, 5,500 %, fällig 15.05.2027	775	0,35	
	1.000	United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.02.2031	856	0,39	
	530	Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 15.02.2029	493	0,22	
	1.000	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	929	0,42	
GBP	510	Wells Fargo & Co, 3,473 %, fällig 26.04.2028 *	581	0,26	
	730	Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	660	0,30	
	880	Wells Fargo & Co, Serie U, 5,875 %, unbefristet *	875	0,39	
	210	Western Midstream Operating LP, 3,950 %, fällig 01.06.2025	203	0,09	
	480	Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig 15.08.2048	400	0,18	
	720	Western Midstream Operating LP, 5,250 %, fällig 01.02.2050	583	0,26	
			47.505	21,38	
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 124.539 USD)</b>				112.381	50,58
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 36,60 % (28. Februar 2023: 26,03 %)</b>					
<b>Argentinien – 0,56 % (28. Februar 2023: 0,55 %)</b>					
	3.264	Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 6,375 %, fällig 01.09.2037	1.244	0,56	
<b>Brasilien – 1,32 % (28. Februar 2023: 0,90 %)</b>					
BRL	14.694	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2027	2.938	1,32	
<b>Kolumbien – 0,46 % (28. Februar 2023: 0,43 %)</b>					
	1.350	Koumbien, internationale Staatsanleihe, 5,625 %, fällig 26.02.2044	1.027	0,46	
<b>Elfenbeinküste (Elfenbeinküste) – 0,36 % (28. Februar 2023: 0,34 %)</b>					
EUR	880	Elfenbeinküste, internationale Staatsanleihe, 5,250 %, fällig 22.03.2030	809	0,36	
<b>Dominikanische Republik – 0,52 % (28. Februar 2023: 0,50 %)</b>					
	1.360	Dominikanische Republik, internationale Staatsanleihe, 144A, 4,875 %, fällig 23.09.2032	1.157	0,52	
<b>Ägypten – 0,76 % (28. Februar 2023: 0,85 %)</b>					
	1.360	Ägypten, internationale Staatsanleihe, 3,875 %, fällig 16.02.2026	982	0,44	
EUR	1.180	Ägypten, internationale Staatsanleihe, 6,375 %, fällig 11.04.2031	708	0,32	
			1.690	0,76	
<b>Deutschland – 0,16 % (28. Februar 2023: 0,15 %)</b>					
EUR	360	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.02.2029	348	0,16	
<b>Indonesien – 3,24 % (28. Februar 2023: 2,96 %)</b>					
IDR	50.976.000	Indonesien, Staatsanleihe, Serie FR59, 7,000 %, fällig 15.05.2027	3.431	1,55	
IDR	52.396.000	Indonesien, Staatsanleihe, Serie FR78, 8,250 %, fällig 15.05.2029	3.757	1,69	
			7.188	3,24	
<b>Jordanien – 0,18 % (28. Februar 2023: 0,17 %)</b>					
	430	Jordanien, internationale Staatsanleihe, 5,850 %, fällig 07.07.2030	399	0,18	
<b>Mexiko – 3,68 % (28. Februar 2023: 3,33 %)</b>					
MXN	69.240	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,500 %, fällig 31.05.2029	3.913	1,76	
MXN	84.947	Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	4.258	1,92	
			8.171	3,68	

# FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinventarwerts
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>			<b>Schuldscheine – 3,48 % (28. Februar 2023: 3,84 %)</b>		
<b>Nigeria – 0,44 % (28. Februar 2023: 0,42 %)</b>			579 Alterra Mountain Co, 8,946 %, fällig 30.07.2028 *		
1.400			873	876	0,26
Nigeria, internationale Staatsanleihe, 7,625 %, fällig 28.11.2047			674	652	0,40
	970	0,44	626 Focus Financial Partners LLC, 8,581 %, fällig 30.06.2028 *		
<b>Oman – 0,18 % (28. Februar 2023: 0,17 %)</b>			463	625	0,28
390			463 Grifols Worldwide Operations USA Inc, 7,481 %, fällig 15.11.2027 *		
Oman, internationale Staatsanleihe, 6,000 %, fällig 01.08.2029				458	0,21
	393	0,18	1.166	1.167	0,53
<b>Polen – 1,76 % (28. Februar 2023: 1,46 %)</b>			138 Nexstar Broadcasting Inc, 7,946 %, fällig 19.09.2026 *		
PLN	21.700		269	270	0,12
Republik Polen, Staatsanleihe, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032			584	585	0,26
	3.916	1,76	926 Sedgwick CMS Inc, 9,081 %, fällig 17.02.2028 *		
<b>Rumänien – 0,33 % (28. Februar 2023: 0,29 %)</b>			600	595	0,27
EUR	940		643 Terrier Media Buyer, Inc., 8,842 %, fällig 17.12.2026 *		
Rumänien, internationale Staatsanleihe, 2,000 %, fällig 14.04.2033			245	245	0,11
	729	0,33	<b>Summe Schuldscheine (Anschaffungskosten 7.792 USD)</b>		
<b>Russland – 0,80 % (28. Februar 2023: 0,18 %)</b>				7.721	3,48
RUB	288.495		<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,36 % (28. Februar 2023: 1,77 %)</b>		
Anleihe der Russischen Föderation – OFZ, 0,000 %, fällig 19.01.2028†‡			22 Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – LM-Klasse US USD thesaurierend		
	903	0,41		3.032	1,36
RUB	329.535		<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 2.474 USD)</b>		
Anleihe der Russischen Föderation – OFZ, 0,000 %, fällig 10.05.2034†‡				3.032	1,36
	876	0,39	<b>Stammaktien – 0,17 % (28. Februar 2023: 0,18 %)</b>		
	1.779	0,80	<b>Schweiz – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
<b>Südafrika – 1,63 % (28. Februar 2023: 1,46 %)</b>			1.760 Credit Suisse Group AG Escrow †		
ZAR	90.478			–	–
Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041			<b>USA – 0,17 % (28. Februar 2023: 0,18 %)</b>		
	2.828	1,27	44 Berry Corp		
				376	0,17
			<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 491 USD)</b>		
				376	0,17
			<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 246.864 USD)</b>		
				210.547	94,77
			<b>Devisenterminkontrakte – 0,24 % (28. Februar 2023: 0,34 %)</b>		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
				535	0,24
			<b>Futures – 0,10 % (28. Februar 2023: 0,03 %)</b>		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
				221	0,10
			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
				211.303	95,11
			<b>Devisenterminkontrakte – -0,63 % (28. Februar 2023: -1,76 %)</b>		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
				-1.411	-0,63
			<b>Futures – -0,08 % (28. Februar 2023: -0,01 %)</b>		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
				-166	-0,08
			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>		
				-1.577	-0,71
			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
				209.726	94,40
			<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>		
				12.437	5,60
			<b>Gesamtvermögen</b>		
				222.163\$	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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 26.920.000 USD und machten 12,11 % des Nettovermögens aus.		
			* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.		
			† Nicht liquide.		
			ε Die Sicherheit ist zum 31. August 2023 in Verzug (Kapital und/oder Zinsen).		
			γ Aufgrund der unsicheren Zinszahlungen fallen auf das Wertpapier während und/oder nach dem Finanzzeitraum, der am 31. August 2023 endet, keine Erträge mehr an.		
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 100.042 USD)</b>			<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 100.042 USD)</b>		
	81.304	36,60		81.304	36,60

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

### ABKÜRZUNGEN:

Unbefristet	– Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Unbefristete Anleihen sind nicht rückzahlbar, schütten aber kontinuierlich Zinsen aus.
REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit.
BRL	– Brasilianischer Real
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund
IDR	– indonesische Rupiah
MXN	– Mexikanischer Peso
PLN	– polnischer Zloty
RUB	– Russischer Rubel
ZAR	– südafrikanischer Rand

### Verteilung des Gesamtvermögens

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	89,05
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	3,44
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,35
Finanzderivate	0,34
Sonstige Vermögenswerte	5,82
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

% des  
Gesamtvermögens

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei		Devisenkauf (in Tsd.)			Devisenverkauf (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	15	Verkauf	EUR	14	\$ -
06. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	-	Verkauf	SGD	-	-
06. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	4	Verkauf	USD	3	-
13. Sep. 2023	Citi	Kauf	USD	1.450	Verkauf	IDR	21.548.873	35
13. Sep. 2023	Citi	Kauf	USD	1.630	Verkauf	INR	134.728	2
13. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	3.267	Verkauf	TWD	99.169	148
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	652	Verkauf	CHF	572	4
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	130	Verkauf	EUR	118	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	-	Verkauf	EUR	-	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	8	Verkauf	GBP	6	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	10	Verkauf	GBP	8	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	34	Verkauf	PLN	138	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	3	Verkauf	SGD	4	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	SGD	1	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	ZAR	6	Verkauf	USD	-	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	ZAR	6.128	Verkauf	USD	322	3
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CHF	51.864	Verkauf	USD	59.386	-577
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	560	Verkauf	USD	362	1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	90.618	Verkauf	USD	59.245	-496
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	PLN	11.606	Verkauf	USD	2.847	-37
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	1.279	Verkauf	USD	952	-5
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	-	Verkauf	USD	-	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	2	Verkauf	USD	3	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	5.901	Verkauf	USD	6.492	-88
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	3	Verkauf	USD	3	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.334	Verkauf	USD	1.698	-8
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	3	Verkauf	ZAR	62	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf	ZAR	41	-
16. Nov. 2022	BNP Paribas	Kauf	USD	1.901	Verkauf	PLN	7.723	36
16. Nov. 2022	BNP Paribas	Kauf	JPY	965.332	Verkauf	USD	6.854	-136
16. Nov. 2022	Citi	Kauf	USD	8.106	Verkauf	GBP	6.381	22
16. Nov. 2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	5.245	Verkauf	EUR	4.772	51
16. Nov. 2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.802	Verkauf	GBP	1.418	5
16. Nov. 2022	Goldman Sachs	Kauf	USD	2.051	Verkauf	MXN	35.905	-25
16. Nov. 2022	HSBC	Kauf	USD	21.021	Verkauf	EUR	19.127	202
16. Nov. 2022	JP Morgan	Kauf	USD	3.490	Verkauf	GBP	2.747	9
16. Nov. 2022	JP Morgan	Kauf	ZAR	5.000	Verkauf	USD	264	-1
16. Nov. 2022	JP Morgan	Kauf	AUD	3.230	Verkauf	USD	2.127	-29
16. Nov. 2022	Morgan Stanley	Kauf	CAD	1.230	Verkauf	USD	921	-9
16. Nov. 2022	UBS	Kauf	USD	7.002	Verkauf	GBP	5.513	17
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 775 USD)								\$ 535
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -4.011 USD)								-1.411
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -3.236 USD)								\$ -876

# FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bobl Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	-5	\$ -637	\$ -4
Euro-Bund Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	89	12.800	127
Euro-Buxl 30 Year Bond Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	-1	-145	-2
Long Gilt Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	40	4.843	87
Zehnjährige US-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	-39	-4.330	-39
Zweijährige US-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	12	2.445	7
US Long Bond (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	-23	-2.799	-40
US Ultra Bond (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	-30	-3.884	-81
Nicht realisierte Wertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 74 USD)				\$ 221
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -29 USD)				-166
Nettowertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 45 USD)				\$ 55

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US High Yield Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinventarwerts
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere – 7,24 % (28. Februar 2023: 6,50 %)</b>					
500	522	0,46	450	477	0,45
522 Funding CLO 2018-3A Ltd, Series 2018 3A, Class DR, 144A, 8,688 %, fällig 20.10.2031 *					
250	239	0,23	1.216 1,15		
239 AB BSL CLO 2 Ltd, Series 2021 2A, Class D, 144A, 8,920 %, fällig 15.04.2034 *					
310	300	0,28	<b>Italien – 1,48 % (28. Februar 2023: 0,70 %)</b>		
300 AGL CLO 6 Ltd, Series 2020 6A, Class ER, 144A, 12,088 %, fällig 20.07.2034 *					
300	292	0,28	700	673	0,64
292 Apex Credit CLO 2022-1 Ltd, Series 2022 1A, Class D, 144A, 9,746 %, fällig 22.04.2033 *					
440	432	0,41	380	319	0,30
432 Ballyrock CLO 2018-1 Ltd, Series 2018 1A, Class C, 144A, 8,738 %, fällig 20.04.2031 *					
420	401	0,38	660	574	0,54
401 Canyon CLO 2020-1 Ltd, Series 2020 1A, Class ER, 144A, 11,920 %, fällig 15.07.2034 *					
250	250	0,24	1.566 1,48		
250 C1FC Funding 2017-1 Ltd, Series 2017 1A, Class D, 144A, 9,095 %, fällig 23.04.2029 *					
300	300	0,28	<b>Luxemburg – 1,19 % (28. Februar 2023: 1,51 %)</b>		
300 GoldenTree Loan Opportunities IX Ltd, Series 2014 9A, Class DR2, 144A, 8,631 %, fällig 29.10.2029 *					
250	207	0,19	500	396	0,37
207 Greenwood Park CLO Ltd, Series 2018 1A, Class E, 144A, 10,520 %, fällig 15.04.2031 *					
510	465	0,44	710	386	0,36
465 Grippen Park CLO Ltd, Series 2017 1A, Class E, 144A, 11,288 %, fällig 20.01.2030 *					
250	234	0,22	600	483	0,46
234 Harriman Park CLO Ltd, Series 2020 1A, Class ER, 144A, 11,988 %, fällig 20.04.2034 *					
443	425	0,40	1.265 1,19		
425 Magnetite XII Ltd, Series 2015 12A, Class ER, 144A, 11,250 %, fällig 15.10.2031 *					
500	467	0,44	<b>Macau – 1,56 % (28. Februar 2023: 1,80 %)</b>		
467 Marble Point CLO XIV Ltd, Series 2018 2A, Class D, 144A, 9,118 %, fällig 20.01.2032 *					
280	252	0,24	200	188	0,18
252 Mountain View CLO IX Ltd, Series 2015 9A, Class CR, 144A, 8,690 %, fällig 15.07.2031 *					
500	479	0,45	200	189	0,18
479 Nassau 2021-1 Ltd, Series 2021 IA, Class D, 144A, 9,320 %, fällig 26.08.2034 *					
250	232	0,22	450	362	0,34
232 Neuberger Berman CLO XVIII Ltd, Series 2014 18A, Class DR2, 144A, 11,515 %, fällig 21.10.2030 *					
500	485	0,46	200	188	0,18
485 Neuberger Berman Loan Advisers CLO 34 Ltd, Series 2019 34A, Class ER, 144A, 11,826 %, fällig 20.01.2035 *					
300	271	0,25	820	724	0,68
271 Ocean Trails CLO V, Series 2014 5A, Class DRR, 144A, 9,013 %, fällig 13.10.2031 *					
200	200	0,19	1.651 1,56		
200 Ocean Trails CLO XIV Ltd, Series 2023 14A, Class D, 144A, 11,146 %, fällig 20.01.2035 *					
580	488	0,46	<b>Niederlande – 0,35 % (28. Februar 2023: 0,30 %)</b>		
488 Saranac CLO III Ltd, Series 2014 3A, Class DR, 144A, 8,770 %, fällig 22.06.2030 *					
280	263	0,25	420	374	0,35
263 Trinitas CLO X Ltd, Series 2019 10A, Class DR, 144A, 8,908 %, fällig 15.01.2035 *					
320	311	0,29	<b>Polen – 0,28 % (28. Februar 2023: 0,36 %)</b>		
311 Venture XVII CLO Ltd, Series 2014 17A, Class DRR, 144A, 8,390 %, fällig 15.04.2027 *					
190	190	0,18	370	299	0,28
190 Wanwick Capital CLO 1 Ltd, Series 2023 1A, Class D, 144A, 0,000 %, fällig 20.10.2036 *					
<b>Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 8.0045)</b>					
	7.670	7,24	3.427 3,24		
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 81,60 % (28. Februar 2023: 84,70 %)</b>					
<b>Bermuda – 0,53 % (28. Februar 2023: 0,65 %)</b>					
591	559	0,53	<b>Schweiz – 0,60 % (28. Februar 2023: 2,04 %)</b>		
559 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, fällig 15.10.2025					
<b>Kanada – 2,75 % (28. Februar 2023: 2,47 %)</b>					
230	205	0,19	210	190	0,18
205 ATS Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.12.2028					
180	180	0,17	130	120	0,12
180 Bombardier Inc, 144A, 7,875 %, fällig 15.04.2027					
200	188	0,18	390	321	0,30
188 Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,375 %, fällig 15.01.2028					
440	425	0,40	631 0,60		
425 Empire Communities Corp, 144A, 7,000 %, fällig 15.12.2025					
420	381	0,36	<b>Vereinigtes Königreich – 3,24 % (28. Februar 2023: 2,54 %)</b>		
381 GFL Environmental Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15.06.2029					
700	659	0,62	1.280	1.257	1,19
659 Hudbay Minerals Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.04.2029					
550	558	0,53	800	621	0,59
558 Open Text Corp, 144A, 6,900 %, fällig 01.12.2027					
310	312	0,30	540	490	0,46
312 Toronto-Dominion Bank/The, 8,125 %, fällig 31.10.2082 *					
2.908 2,75					
<b>Anschaffungskosten Kaimaninseln – 0,94 % (28. Februar 2023: 0,91 %)</b>					
1.059	996	0,94	770	770	0,73
996 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 15.09.2024					
<b>Frankreich – 1,20 % (28. Februar 2023: 0,28 %)</b>					
240	180	0,17	742	770	0,73
180 Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, fällig 15.01.2028					
670	474	0,45	450 0,42		
474 Altice France SA/France, 144A, 5,125 %, fällig 15.07.2029					
310	302	0,28	120	99	0,09
302 BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, unbefristet *					
320	320	0,30	290	286	0,27
320 Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, unbefristet *					
1.276 1,20					
<b>Deutschland – 0,47 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
490	497	0,47	500	378	0,36
497 ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, fällig 14.04.2030					
<b>Hongkong – 0,36 % (28. Februar 2023: 0,45 %)</b>					
450	378	0,36	1.830	1.049	0,99
378 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 04.12.2029					
<b>Indien – 0,29 % (28. Februar 2023: 0,25 %)</b>					
340	304	0,29	370	343	0,32
304 CA Magnum Holdings, 144A, 5,375 %, fällig 31.10.2026					
<b>Israel – 1,15 % (28. Februar 2023: 1,26 %)</b>					
500	461	0,44	910	622	0,59
461 Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, fällig 01.02.2036					
300	278	0,26	480	526	0,50
278 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, fällig 09.05.2029					
526 American Airlines Inc, 144A, 11,750 %, fällig 15.07.2025					
305 0,29					
305 American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2028					
326 0,31					
326 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.04.2029					
379 0,36					
379 American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, fällig 01.10.2029					
553 0,52					
553 American News Co LLC, 144A, 8,500 %, fällig 01.09.2026					
67 0,06					
67 Anagram International Inc / Anagram Holdings LLC, 144A, 10,000 %, fällig 15.08.2026					
730 0,69					
730 Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.06.2029					
163 0,15					
163 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 4,000 %, fällig 01.09.2029					
443 0,42					
443 AthenaHealth Group Inc, 144A, 6,500 %, fällig 15.02.2030					
908 0,86					
908 Bath & Body Works Inc, 7,500 %, fällig 15.06.2029					
176 0,17					
176 Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.10.2030					
72 0,07					
72 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.02.2027					
303 0,29					
303 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.02.2029					
169 0,16					
169 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,250 %, fällig 30.01.2030					
168 0,16					
168 Beacon Roofing Supply Inc, 144A, 6,500 %, fällig 01.08.2030					
385 0,36					
385 Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026					
689 0,65					
689 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15.07.2026					
334 0,32					
334 Boyne USA Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15.05.2029					
553 0,52					
553 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,250 %, fällig 15.04.2028					

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US High Yield Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventar- werts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventar- werts		
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>							
<b>USA – (Fortsetzung)</b>							
330	Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2030	303	0,29	150	iHeartCommunications Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	119	0,11
350	Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 9,250 %, fällig 01.07.2031	354	0,33	230	iHeartCommunications Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15.01.2028	177	0,17
280	Caesars Entertainment Inc, 144A, 8,125 %, fällig 01.07.2027	285	0,27	680	IIP Operating Partnership LP, 5,500 %, fällig 25.05.2026	604	0,57
640	Caesars Entertainment Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.02.2030	643	0,61	600	Iron Mountain Information Management Services Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.07.2032	519	0,49
400	Cano Health LLC, 144A, 6,250 %, fällig 01.10.2028	136	0,13	310	Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.11.2029	272	0,26
100	Carnival Corp, 144A, 7,625 %, fällig 01.03.2026	100	0,09	180	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,250 %, fällig 01.02.2027	163	0,15
230	Carnival Corp, 144A, 7,000 %, fällig 15.08.2029	234	0,22	390	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.06.2029	328	0,31
570	Carnival Corp, 144A, 10,500 %, fällig 01.06.2030	608	0,57	600	Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08.08.2024	581	0,55
220	Carnival Holdings Bermuda Ltd, 144A, 10,375 %, fällig 01.05.2028	239	0,23	740	Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.02.2026	696	0,66
800	Carriage Purchaser Inc, 144A, 7,875 %, fällig 15.10.2029	601	0,57	610	LifePoint Health Inc, 144A, 9,875 %, fällig 15.08.2030	603	0,57
250	Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.05.2029	217	0,21	300	LSF11 A5 HoldCo LLC, 144A, 6,625 %, fällig 15.10.2029	250	0,24
370	Carrolls Restaurant Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig 01.07.2029	319	0,30	130	Madison IAQ LLC, 144A, 4,125 %, fällig 30.06.2028	115	0,11
740	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, fällig 01.02.2032	613	0,58	570	Madison IAQ LLC, 144A, 5,875 %, fällig 30.06.2029	480	0,45
550	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	446	0,42	830	Match Group Holdings II LLC, 144A, 3,625 %, fällig 01.10.2031	677	0,64
200	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 01.06.2033	158	0,15	600	Medline Borrower LP, 144A, 5,250 %, fällig 01.10.2029	533	0,50
470	Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.06.2029	464	0,44	440	Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250 %, fällig 01.05.2028	367	0,35
600	Chord Energy Corp, 144A, 6,375 %, fällig 01.06.2026	592	0,56	740	Michaels Cos Inc/The, 144A, 7,875 %, fällig 01.05.2029	514	0,49
140	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.04.2030	81	0,08	280	Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 6,500 %, fällig 01.05.2028	249	0,24
860	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.05.2030	679	0,64	420	Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 5,625 %, fällig 15.01.2030	339	0,32
470	Clarivate Science Holdings Corp, 144A, 4,875 %, fällig 01.07.2029	410	0,39	650	MIWD Holdco II LLC / MIWD Finance Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.02.2030	552	0,52
165	Clean Harbors Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.02.2031	164	0,16	430	Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 13,250 %, fällig 15.12.2027	458	0,43
410	Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.06.2029	306	0,29	340	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,500 %, fällig 15.03.2031	221	0,21
480	CNX Midstream Partners LP, 144A, 4,750 %, fällig 15.04.2030	415	0,39	700	Nabors Industries Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 15.01.2026	674	0,64
360	Coinbase Global Inc, 144A, 3,625 %, fällig 01.10.2031	243	0,23	880	NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.02.2027	854	0,81
700	CommScope Inc, 144A, 4,750 %, fällig 01.09.2029	521	0,49	200	NCL Corp Ltd, 144A, 8,375 %, fällig 01.02.2028	206	0,19
130	CommScope Technologies LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.03.2027	72	0,07	200	NCL Corp Ltd, 144A, 7,750 %, fällig 15.02.2029	19	0,02
290	Crescent Energy Finance LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.02.2028	297	0,28	140	NextEra Energy Partners LP, 144A, 2,500 %, fällig 15.06.2026	125	0,12
270	CSC Holdings LLC, 144A, 11,250 %, fällig 15.05.2028	267	0,25	490	NMG Holding Co Inc / Neiman Marcus Group LLC, 144A, 7,125 %, fällig 01.04.2026	466	0,44
810	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2029	670	0,63	410	NMI Holdings Inc, 144A, 7,375 %, fällig 01.06.2025	413	0,39
320	CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2030	177	0,17	400	Northern Oil and Gas Inc, 144A, 8,125 %, fällig 01.03.2028	401	0,38
250	CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig 01.12.2030	179	0,17	760	Northwest Acquisitions ULC / Dominion Finco Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.11.2022	-	-
300	CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15.11.2031	214	0,20	30	Pactiv LLC, 8,375 %, fällig 15.04.2027	30	0,03
430	CSC Holdings LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.11.2031	230	0,22	510	Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2027	364	0,34
110	Cushman & Wakefield US Borrower LLC, 144A, 8,875 %, fällig 01.09.2031	111	0,10	220	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer, 144A, 5,875 %, fällig 01.10.2028	204	0,19
350	Darling Ingredients Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.06.2030	342	0,32	600	Park-Ohio Industries Inc, 6,625 %, fällig 15.04.2027	521	0,49
600	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.08.2027	532	0,50	450	Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp, 144A, 4,000 %, fällig 15.06.2029	382	0,36
1.130	DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	846	0,80	250	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp, 144A, 7,750 %, fällig 15.02.2029	239	0,23
1.050	DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	817	0,77	370	PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500 %, fällig 01.10.2028	357	0,34
1.010	DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01.06.2029	547	0,52	660	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.01.2028	629	0,59
90	Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, fällig 15.06.2025	89	0,08	430	Rackspace Technology Global Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15.02.2028	204	0,19
170	Diversified Healthcare Trust, 4,750 %, fällig 15.02.2028	130	0,12	40	Radiology Partners Inc, 144A, 9,250 %, fällig 01.02.2028	16	0,01
440	Dornoch Debt Merger Sub Inc, 144A, 6,625 %, fällig 15.10.2029	380	0,36	400	Range Resources Corp, 8,250 %, fällig 15.01.2029	416	0,39
350	DraftKings Holdings Inc, Nullkupon, fällig 15.03.2028	268	0,25	290	Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.02.2030	262	0,25
170	Earthstone Energy Holdings LLC, 144A, 8,000 %, fällig 15.04.2027	174	0,16	280	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 3,875 %, fällig 01.03.2031	228	0,22
140	Earthstone Energy Holdings LLC, 144A, 9,875 %, fällig 15.07.2031	154	0,15	1.060	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 4,000 %, fällig 15.10.2033	839	0,79
400	Elastic NV, 144A, 4,125 %, fällig 15.07.2029	344	0,33	630	Roller Bearing Co of America Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.10.2029	564	0,53
510	FirstCash Inc, 144A, 4,625 %, fällig 01.09.2028	454	0,43	310	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 11,625 %, fällig 15.08.2027	338	0,32
250	FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig 01.01.2030	227	0,21	430	Royal Caribbean Cruises Ltd, 3,700 %, fällig 15.03.2028	375	0,35
770	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 7,875 %, fällig 15.11.2025	719	0,68	590	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 15.01.2030	600	0,57
1.090	Foot Locker Inc, 144A, 4,000 %, fällig 01.10.2029	821	0,78	220	RR Donnelley & Sons Co, 144A, 9,750 %, fällig 31.07.2028	220	0,21
440	Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	344	0,32	370	Ryan Specialty LLC, 144A, 4,375 %, fällig 01.02.2030	331	0,31
570	Ford Motor Credit Co LLC, 5,113 %, fällig 03.05.2029	525	0,50	2	S Corp International/US, 7,500 %, fällig 01.04.2027	3	-
590	Ford Motor Credit Co LLC, 7,350 %, fällig 06.03.2030	601	0,57	360	Sizzling Platter LLC / Sizzling Platter Finance Corp, 144A, 8,500 %, fällig 28.11.2025	357	0,34
1.000	Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13.11.2030	847	0,80	340	Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 6,000 %, fällig 01.11.2028	327	0,31
670	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	602	0,57	800	Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig 01.02.2032	710	0,67
570	Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.02.2028	508	0,48	260	Speedway Motorsports LLC / Speedway Funding II Inc, 144A, 4,875 %, fällig 01.11.2027	241	0,23
410	Gannett Holdings LLC, 144A, 6,000 %, fällig 01.11.2026	352	0,33	250	Spirit Airlines Inc, 1,000 %, fällig 15.05.2026	212	0,20
370	Gen Digital Inc, 144A, 7,125 %, fällig 30.09.2030	373	0,35	360	Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	429	0,41
1.080	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.12.2028	944	0,89	240	StoneX Group Inc, 144A, 8,625 %, fällig 15.06.2025	243	0,23
110	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.01.2026	102	0,10	1.120	Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01.09.2026	987	0,93
207	HCA Inc, 7,500 %, fällig 15.11.2095	228	0,22	200	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 31.12.2030	179	0,17
360	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 6,250 %, fällig 15.04.2032	331	0,31	480	Titan International Inc, 7,000 %, fällig 30.04.2028	458	0,43
400	Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.01.2027	386	0,36				

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US High Yield Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>			<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,14 % (28. Februar 2023: 1,33 %)</b>		
<b>USA – (Fortsetzung)</b>			143 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		
200 TopBuild Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15.03.2029	172	0,16	143	0,14	
580 TransDigm Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.08.2028	583	0,55	<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 143\$)</b>	143	0,14
320 Triton Water Holdings Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.04.2029	272	0,26	<b>Stammaktien – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
460 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	410	0,39	<b>Schweiz – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
1.050 United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig 15.01.2030	999	0,94	2640 Credit Suisse Group AG Escrow †		
240 Univision Communications Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.08.2028	240	0,23	<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten –\$)</b>		
250 Upbound Group Inc, 144A, 6,375 %, fällig 15.02.2029	227	0,21	<b>Vorzugsaktien – 0,28 % (28. Februar 2023: 0,51 %)</b>		
370 Urban One Inc, 144A, 7,375 %, fällig 01.02.2028	322	0,30	<b>USA – 0,28 % (28. Februar 2023: 0,51 %)</b>		
459 US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, fällig 28.06.2028	296	0,28	9 MPLX LP, Series A ∞		
420 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 6,250 %, fällig 15.01.2030	410	0,39	<b>Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 286\$)</b>		
180 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 4,125 %, fällig 15.08.2031	153	0,14	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 112.449\$)</b>		
120 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig 01.11.2033	98	0,09	<b>Credit Default Swaps – 0,09 % (28. Februar 2023: 0,08 %)</b>		
750 Vericast Corp, 144A, 11,000 %, fällig 15.09.2026	785	0,74	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
510 Vertiv Group Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.11.2028	458	0,43	101	0,09	
120 Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.09.2027	112	0,11	<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
450 Viking Cruises Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2029	427	0,40	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
260 Viking Cruises Ltd, 144A, 9,125 %, fällig 15.07.2031	269	0,25	<b>Futures – 0,05 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
390 VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	362	0,34	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
800 WW International Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.04.2029	555	0,52	50	0,05	
740 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, fällig 15.02.2031	728	0,69	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
690 XPO CNW Inc, 6,700 %, fällig 01.05.2034	687	0,65	101.851	96,21	
440 ZipRecruiter Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2030	370	0,35	<b>Credit Default Swaps – -0,05 % (28. Februar 2023: -0,09 %)</b>		
	68.081	64,31	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
<b>Sambia – 0,90 % (28. Februar 2023: 1,27 %)</b>			-58 -0,05		
940 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig 01.06.2031	958	0,90	<b>Devisenterminkontrakte – -0,03 % (28. Februar 2023: -0,03 %)</b>		
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 96.408\$)</b>			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	86.386	81,60	-88	-0,08	
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 0,26 % (28. Februar 2023: 0,22 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
<b>Argentinien – 0,26 % (28. Februar 2023: 0,22 %)</b>			101.763 96,13		
55 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 1,000 %, fällig 09.07.2029	18	0,02	<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>		
408 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 0,750 %, fällig 09.07.2030	137	0,13	4.096 3,87		
94 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 3,625 %, fällig 09.07.2035	28	0,02	<b>Gesamtvermögen</b>		
60 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 6,375 %, fällig 01.09.2037	23	0,02	105.859\$ 100,00		
190 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 6,375 %, fällig 01.09.2037	73	0,07			
	279	0,26			
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 378\$)</b>					
	279	0,26			
<b>Schuldscheine – 6,55 % (28. Februar 2023: 5,28 %)</b>					
178 19th Holdings Golf, LLC, 8,666 %, fällig 07.02.2029 *	175	0,16			
322 Adtalem Global Education Inc, 9,446 %, fällig 12.02.2028 *	322	0,30			
150 Agiliti Health Inc, 8,247 %, fällig 01.05.2030 *	150	0,14			
427 Asurion LLC, 9,431 %, fällig 17.08.2028 *	412	0,39			
250 Clarios Global LP, 9,081 %, fällig 20.04.2030 *	250	0,24			
570 DCert Buyer, Inc., 12,331 %, fällig 16.02.2029 *	535	0,51			
190 Deerfield Dakota Holding LLC, 12,288 %, fällig 14.04.2028 *	180	0,17			
340 Equinox Holdings Inc, 14,731 %, fällig 08.03.2024 *†	329	0,31			
388 Eyecare Partners LLC, 9,253 %, fällig 05.02.2027 *	309	0,29			
494 Focus Financial Partners LLC, 8,581 %, fällig 30.06.2028 *	493	0,47			
231 Global Tel'Link Corp, 9,769 %, fällig 29.11.2025 *	218	0,21			
351 Great Outdoors Group LLC, 9,196 %, fällig 05.03.2028 *	351	0,33			
203 Magenta Buyer LLC, 10,631 %, fällig 03.05.2028 *	153	0,14			
82 MRI Software LLC, 10,842 %, fällig 10.02.2026 *	80	0,08			
47 MRI Software LLC, 10,842 %, fällig 10.02.2026 *	46	0,04			
160 Neptune Bidco U.S. Inc, 10,398 %, fällig 11.04.2029 *	146	0,14			
461 Phoenix Guarantor Inc, 8,696 %, fällig 05.03.2026 *	459	0,43			
417 R.R. Donnelley, 14,500 %, fällig 08.03.2028 *	418	0,40			
183 Redstone Holdco 2 LP, 10,179 %, fällig 27.04.2028 *	143	0,14			
660 Rent-A-Center Inc/ITX, 8,881 %, fällig 17.02.2028 *	659	0,62			
410 Spencer Spirit IH LLC, 11,429 %, fällig 14.06.2026 *	408	0,39			
140 TruGreen LP, 14,131 %, fällig 30.10.2028 *†	88	0,08			
332 U.S. Renal Care Inc, 10,346 %, fällig 28.06.2028 *	214	0,20			
392 Verscend Holding Corp., 9,446 %, fällig 27.08.2025 *	392	0,37			
<b>Summe Schuldscheine (Anschaffungskosten 7.230\$)</b>	6.930	6,55			

– 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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 76.170.000 USD und machten 71,94 % des Nettovermögens aus.

\* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.

† Nicht liquide.

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

ε Das Wertpapier ist zum 31. August 2023 in Verzug (Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).

### ABKÜRZUNGEN:

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

### Verteilung des Gesamtvermögens

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	88,76
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	6,50
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,13
Finanzderivate	0,14
Sonstige Vermögenswerte	4,47
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

# FTGF Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Ford Motor Co, 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2026	900	\$ 77
Goldman Sachs	Nova Chemicals Corp, 5,000 % – Kauf	20. Juni 2027	429	-16
Goldman Sachs	Occidental Petroleum Corporation, 1,000 % – Verkauf	20. Juni 2026	920	11
Goldman Sachs	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5,000 % – Kauf	20. Juni 2027	580	-42
Goldman Sachs	Xerox Holdings Corp, 1,000 % – Kauf	20. Juni 2027	231	13
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 102\$)				\$ 101
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -116\$)				-58
Nettowertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -14\$)				\$ 43

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 5	Verkauf HKD 40	\$ -
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 19	Verkauf EUR 17	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 8	Verkauf GBP 6	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 4	Verkauf SGD 6	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 1.651	Verkauf USD 1.816	-24
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP -	Verkauf USD -	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf SGD 1	Verkauf USD 1	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf SGD 537	Verkauf USD 399	-2
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 578	Verkauf USD 737	-4
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf USD 6	Verkauf CAD 8	-
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 1\$)				\$ -
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -35\$)				-30
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -34\$)				\$ -30

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2023	Goldman Sachs	76	\$ 50
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -\$)			\$ 50
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -31\$)			-
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -31\$)			\$ 50

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Western Asset Global High Yield Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere – 0,46 % (28. Februar 2023: 0,40 %)</b>			<b>Peru – 1,08 % (28. Februar 2023: 1,00 %)</b>		
250 Magnetite XII Ltd, Series 2015 12A, Class ER, 144A, 11,250 %, fällig 15.10.2031 *	239	0,46	750 Petroleos del Peru SA, 144A, 4,750 %, fällig 19.06.2032	557	1,08
<b>Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 2475)</b>	<b>239</b>	<b>0,46</b>	<b>Polen – 0,47 % (28. Februar 2023: 0,42 %)</b>		
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 75,74 % (28. Februar 2023: 73,14 %)</b>			<b>Slowenien – 0,35 % (28. Februar 2023: 0,28 %)</b>		
<b>Brasilien – 2,13 % (28. Februar 2023: 1,86 %)</b>			<b>Schweden – 1,44 % (28. Februar 2023: 1,47 %)</b>		
450 B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, fällig 20.09.2031	381	0,74	EUR 200 United Group BV, 5,250 %, fällig 01.02.2030	180	0,35
900 MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig 14.01.2031	721	1,39	<b>EUR 100 Assemlin Group AB, 8,587 %, fällig 05.07.2029 *</b>	108	0,21
	1.102	2,13	EUR 200 Heimstaden AB, 4,250 %, fällig 09.03.2026	114	0,22
<b>Kanada – 2,11 % (28. Februar 2023: 0,50 %)</b>			EUR 300 Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 1,125 %, fällig 04.09.2026	213	0,41
340 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15.02.2029	298	0,58	EUR 280 Verisure Holding AB, 7,125 %, fällig 01.02.2028	308	0,60
150 Bombardier Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15.06.2026	148	0,28		743	1,44
400 GFL Environmental Inc, 144A, 4,250 %, fällig 01.06.2025	387	0,75	<b>Türkei – 1,36 % (28. Februar 2023: 1,19 %)</b>		
250 Ritchie Bros Holdings Inc, 144A, 7,750 %, fällig 15.03.2031	259	0,50	300 TC Ziraat Bankasi AS, 144A, 5,125 %, fällig 29.09.2023	300	0,58
	1.092	2,11	410 Turk Telekomunikasyon AS, 144A, 6,875 %, fällig 28.02.2025	402	0,78
<b>Kaimaninseln – 2,06 % (28. Februar 2023: 1,78 %)</b>				702	1,36
1.131 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 15.09.2024	1.064	2,06	<b>Vereinigtes Königreich – 7,44 % (28. Februar 2023: 5,97 %)</b>		
<b>China – 0,05 % (28. Februar 2023: 0,28 %)</b>			EUR 220 888 Acquisitions Ltd, 7,558 %, fällig 15.07.2027	228	0,44
400 China Aoyuan Group Ltd, 0,000 %, fällig 23.01.2024	11	0,02	EUR 200 888 Acquisitions Ltd, 144A, 7,558 %, fällig 15.07.2027	207	0,40
400 China Aoyuan Group Ltd, 6,350 %, fällig 08.02.2024	13	0,03	200 Ashtead Capital Inc, 144A, 2,450 %, fällig 12.08.2031	157	0,30
	24	0,05	220 Bellis Acquisition Co Plc, 4,500 %, fällig 16.02.2026	245	0,47
<b>Kolumbien – 0,78 % (28. Februar 2023: 0,44 %)</b>			GBP 100 Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, fällig 07.04.2026	116	0,23
260 Ecopetrol SA, 8,875 %, fällig 13.01.2033	264	0,51	EUR 310 INEOS Quattro Finance 1 Plc, 3,750 %, fällig 15.07.2026	299	0,58
200 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	141	0,27	280 Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, unbefristet *	254	0,49
	405	0,78	GBP 100 Marks & Spencer Plc, 3,750 %, fällig 19.05.2026	118	0,23
<b>Frankreich – 0,56 % (28. Februar 2023: 0,93 %)</b>			GBP 510 Marston's Issuer Plc, Series B1, 7,819 %, fällig 16.07.2035 *	462	0,89
220 Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, fällig 15.10.2029	159	0,31	GBP 310 Saga Plc, 5,500 %, fällig 15.07.2026	300	0,58
EUR 120 Burger King France SAS, 8,475 %, fällig 01.11.2026 *	131	0,25	EUR 100 Victoria Plc, 3,625 %, fällig 24.08.2026	88	0,17
	290	0,56	400 Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2029	366	0,71
<b>Deutschland – 3,22 % (28. Februar 2023: 2,00 %)</b>			560 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	469	0,91
EUR 360 APCOA Parking Holdings GmbH, 144A, 4,625 %, fällig 15.01.2027	348	0,68	400 Vodafone Group Plc, 4,125 %, fällig 30.05.2025	391	0,76
EUR 450 APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625 %, fällig 15.01.2027	434	0,84	GBP 140 Wheel Bidco Ltd, 144A, 6,750 %, fällig 15.07.2026	147	0,28
EUR 240 TUI Cruises GmbH, 6,500 %, fällig 15.05.2026	248	0,48		3.847	7,44
430 ZF North America Capital Inc, 144A, 6,875 %, fällig 14.04.2028	429	0,83	<b>USA – 38,27 % (28. Februar 2023: 36,14 %)</b>		
200 ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, fällig 14.04.2030	203	0,39	200 Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144A, 5,000 %, fällig 01.05.2028	162	0,31
	1.662	3,22	550 American Airlines Group Inc, 144A, 3,750 %, fällig 01.03.2025	527	1,02
<b>Guatemala – 1,61 % (28. Februar 2023: 1,14 %)</b>			150 American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2028	147	0,29
690 Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 144A, 5,250 %, fällig 27.04.2029 *	634	1,23	660 American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, fällig 01.10.2029	544	1,05
250 Millicom International Cellular SA, 4,500 %, fällig 27.04.2031	198	0,38	280 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000 %, fällig 15.06.2027	273	0,53
	832	1,61	200 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	172	0,33
<b>Hongkong – 0,42 % (28. Februar 2023: 0,67 %)</b>			40 Arsenal AIC Parent LLC, 144A, 8,000 %, fällig 01.10.2030	41	0,08
260 Melco Resorts Finance Ltd, 5,375 %, fällig 04.12.2029	218	0,42	390 Ball Corp, 2,875 %, fällig 15.08.2030	319	0,62
<b>Israel – 2,54 % (28. Februar 2023: 3,90 %)</b>			250 Ball Corp, 3,125 %, fällig 15.09.2031	203	0,39
1.450 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	1.312	2,54	80 Beacon Roofing Supply Inc, 144A, 6,500 %, fällig 01.08.2030	79	0,15
<b>Italien – 2,60 % (28. Februar 2023: 1,71 %)</b>			340 Boise Cascade Co, 144A, 4,875 %, fällig 01.07.2030	307	0,59
1.120 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, fällig 01.06.2032 *	854	1,66	210 Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2030	211	0,41
70 Telecom Italia Capital SA, 7,200 %, fällig 18.07.2036	63	0,12	230 Carnival Holdings Bermuda Ltd, 144A, 10,375 %, fällig 01.05.2028	250	0,48
430 Telecom Italia SpA/Milano, 144A, 5,303 %, fällig 30.05.2024	425	0,82	EUR 500 Carnival Plc, 1,000 %, fällig 28.10.2029	367	0,71
	1.342	2,60	120 Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.05.2029	104	0,20
<b>Luxemburg – 4,17 % (28. Februar 2023: 3,83 %)</b>			320 Carrols Restaurant Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig 01.07.2029	276	0,53
1.330 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2029	1.055	2,04	1.050 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.01.2034	805	1,56
200 Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, fällig 15.05.2027	109	0,21	150 Charles Schwab Corp/The, Series H, 4,000 %, unbefristet *	113	0,22
410 Altice France Holding SA, 144A, 6,000 %, fällig 15.02.2028	181	0,35	270 Comerica Bank, 2,500 %, fällig 23.07.2024	257	0,50
390 ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, fällig 30.06.2027	314	0,61	230 CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2030	127	0,25
GBP 220 Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, fällig 01.04.2028	245	0,48	380 CSC Holdings LLC, 144A, 4,625 %, fällig 01.12.2030	199	0,39
260 FAGE International SA / FAGE USA Dairy Industry Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.08.2026	250	0,48	250 CSC Holdings LLC, 144A, 3,375 %, fällig 15.02.2031	172	0,33
	2.154	4,17	870 CSC Holdings LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.11.2031	466	0,90
<b>Macau – 1,03 % (28. Februar 2023: 1,90 %)</b>			60 Cushman & Wakefield US Borrower LLC, 144A, 8,875 %, fällig 01.09.2031	61	0,12
210 Sands China Ltd, 3,500 %, fällig 08.08.2031	169	0,33	200 Delta Air Lines Inc, 2,900 %, fällig 28.10.2024	194	0,38
440 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125 %, fällig 15.12.2029	361	0,70	870 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.08.2027	772	1,49
	530	1,03	230 DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15.11.2024	214	0,41
<b>Mexiko – 1,66 % (28. Februar 2023: 1,56 %)</b>			270 DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	202	0,39
200 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,625 %, unbefristet *	186	0,36	280 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01.06.2029	152	0,29
360 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 6,625 %, unbefristet *	290	0,56	300 DISH Network Corp, 2,375 %, fällig 15.03.2024	285	0,55
440 BBVA Bancomer SA/Texas, 144A, 5,125 %, fällig 18.01.2033 *	383	0,74	890 DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026	543	1,05
	859	1,66	100 Diversified Healthcare Trust, 4,375 %, fällig 01.03.2031	75	0,15
			1.580 Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	1.235	2,39

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Global High Yield Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
830 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.12.2028	725	1,40	400 Internationale Anleihe der Dominikanischen Republik, 144A, 7,050 %, fällig 03.02.2031	399	0,77
500 Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,375 %, fällig 01.05.2025	496	0,96	220 Staatsanleihe der Dominikanischen Republik, 4,875 %, fällig 23.09.2032	187	0,36
810 JB Poindexter & Co Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15.04.2026	793	1,53		918	1,78
270 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08.08.2024	262	0,51	<b>Ecuador – 0,36 % (28. Februar 2023: 0,58 %)</b>		
540 Match Group Holdings II LLC, 144A, 3,625 %, fällig 01.10.2031	441	0,85	660 Internationale Anleihe der Regierung von Ecuador, 144A, Nullkupon, fällig 31.07.2030	186	0,36
385 NCL Corp Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 15.12.2024	369	0,71	<b>Ägypten – 0,82 % (28. Februar 2023: 0,89 %)</b>		
410 NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.03.2026	387	0,75	300 Internationale Anleihe der ägyptischen Regierung, 6,588 %, fällig 21.02.2028	197	0,38
200 NCL Finance Ltd, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2028	180	0,35	350 Internationale Anleihe der ägyptischen Regierung, 144A, 7,600 %, fällig 01.03.2029	226	0,44
340 Rackspace Technology Global Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15.02.2028	162	0,31		423	0,82
200 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 4,250 %, fällig 01.07.2026	187	0,36	<b>Jordanien – 0,88 % (28. Februar 2023: 0,79 %)</b>		
930 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 01.04.2028	873	1,69	440 Internationale Anleihe der jordanischen Regierung, 144A, 7,750 %, fällig 15.01.2028	452	0,88
200 Service Corp International/US, 5,125 %, fällig 01.06.2029	189	0,37	<b>Kenia – 0,33 % (28. Februar 2023: 0,30 %)</b>		
520 Service Properties Trust, 5,500 %, fällig 15.12.2027	461	0,89	200 Internationale Anleihe der Republik Kenia, 144A, 7,250 %, fällig 28.02.2028	170	0,33
160 Service Properties Trust, 4,950 %, fällig 01.10.2029	126	0,24	<b>Mexiko – 2,08 % (28. Februar 2023: 1,29 %)</b>		
290 Sirius XM Radio Inc, 144A, 4,125 %, fällig 01.07.2030	237	0,46	MXN 550 Mexikanische Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 29.05.2031	29	0,06
320 Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig 01.02.2032	284	0,55	MXN 10.720 Mexikanische Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 23.11.2034	563	1,09
250 Spirit Airlines Inc, 1,000 %, fällig 15.05.2026	212	0,41	MXN 4.680 Mexikanische Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	235	0,45
80 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025	80	0,16	300 Internationale Anleihe der mexikanischen Regierung, 2,659 %, fällig 24.05.2031	249	0,48
360 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025	361	0,70		1.076	2,08
300 StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.05.2029	251	0,49	<b>Nigeria – 1,04 % (28. Februar 2023: 0,40 %)</b>		
150 Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp, 5,875 %, fällig 01.03.2027	147	0,28	360 Internationale Anleihe der nigerianischen Regierung, 144A, 7,143 %, fällig 23.02.2030	295	0,57
520 Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01.09.2026	458	0,89	300 Internationale Anleihe der nigerianischen Regierung, 144A, 7,875 %, fällig 16.02.2032	245	0,47
190 Tenet Healthcare Corp, 6,250 %, fällig 01.02.2027	187	0,36		540	1,04
170 Titan International Inc, 7,000 %, fällig 30.04.2028	162	0,31	<b>Panama – 0,96 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
250 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.04.2026	232	0,45	650 Internationale Anleihe der panamesischen Regierung, 2,252 %, fällig 29.09.2032	495	0,96
450 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.02.2029	390	0,75	<b>Russland – 0,80 % (28. Februar 2023: 0,15 %)</b>		
400 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	356	0,69	RUB 69.969 Anleihe der Russischen Föderation – OFZ, 0,000 %, fällig 19.01.2028 τγ	219	0,43
550 United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.11.2027	510	0,99	RUB 61.500 Anleihe der Russischen Föderation – OFZ, 0,000 %, fällig 23.05.2029 τγ	192	0,37
50 Venture Global LNG Inc, 144A, 8,375 %, fällig 01.06.2031	50	0,10		411	0,80
120 Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 15.02.2029	112	0,22	<b>Sambia – 0,39 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
230 WW International Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.04.2029	159	0,31	200 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig 01.06.2031	204	0,39
90 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, fällig 15.02.2031	88	0,17			
	19.781	38,27	<b>Senegal – 0,31 % (28. Februar 2023: 0,28 %)</b>		
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 44.2575)</b>					
	39.143	75,74	230 Internationale Anleihe der senegalesischen Regierung, 144A, 6,750 %, fällig 13.03.2048	161	0,31
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 21,43 % (28. Februar 2023: 17,71 %)</b>					
<b>Angola – 0,53 % (28. Februar 2023: 0,52 %)</b>					
330 Internationale Anleihe der Regierung von Angola, 144A, 8,750 %, fällig 14.04.2032	272	0,53	<b>Südafrika – 0,34 % (28. Februar 2023: 0,32 %)</b>		
<b>Argentinien – 2,31 % (28. Februar 2023: 2,30 %)</b>					
161 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 1,000 %, fällig 09.07.2029	53	0,10	250 Internationale Anleihe der Republik Südafrika, 5,650 %, fällig 27.09.2047	178	0,34
297 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 0,750 %, fällig 09.07.2030	100	0,19	<b>Türkei – 1,03 % (28. Februar 2023: 1,46 %)</b>		
944 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 3,625 %, fällig 09.07.2035	281	0,55	360 Internationale Anleihe der türkischen Regierung, 4,250 %, fällig 14.04.2026	333	0,64
1.271 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 6,375 %, fällig 01.09.2037	484	0,94	300 Internationale Anleihe der türkischen Regierung, 4,875 %, fällig 16.04.2043	200	0,39
340 Provincia de Cordoba, 144A, 6,990 %, fällig 01.06.2027	275	0,53		533	1,03
	1.193	2,31	<b>Ukraine – 0,25 % (28. Februar 2023: 0,15 %)</b>		
<b>Bahamas – 0,38 % (28. Februar 2023: 0,34 %)</b>					
200 Internationale Anleihe der Regierung der Bahamas, 144A, 5,750 %, fällig 16.01.2024	198	0,38	450 Internationale Anleihe der ukrainischen Regierung, 144A, 7,750 %, fällig 01.09.2028	131	0,25
<b>Bahrain – 0,48 % (28. Februar 2023: 0,43 %)</b>					
310 Internationale Anleihe der Regierung von Bahrain, 144A, 6,000 %, fällig 19.09.2044	250	0,48	<b>USA – 5,16 % (28. Februar 2023: 4,50 %)</b>		
<b>Kolumbien – 0,52 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
350 Internationale Anleihe der kolumbianischen Regierung, 3,125 %, fällig 15.04.2031	271	0,52	250 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 05.09.2023	250	0,48
<b>Costa Rica – 0,39 % (28. Februar 2023: 0,34 %)</b>					
200 Internationale Anleihe der Regierung von Costa Rica, 6,125 %, fällig 19.02.2031	200	0,39	650 United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30.04.2026	588	1,14
<b>Côte d'Ivoire (Elfenbeinküste) – 0,68 % (28. Februar 2023: 0,62 %)</b>					
410 Internationale Staatsanleihe Côte d'Ivoire, 144A, 6,125 %, fällig 15.06.2033	352	0,68	750 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.05.2029	693	1,34
<b>Dominikanische Republik – 1,78 % (28. Februar 2023: 1,60 %)</b>					
380 Internationale Anleihe der Dominikanischen Republik, 144A, 4,500 %, fällig 30.01.2030	332	0,65	700 United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, fällig 31.08.2029	659	1,28
			500 United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 15.02.2033	476	0,92
				2.666	5,16
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 14.1885)</b>					
			<b>Schuldscheine – 0,44 % (28. Februar 2023: 0,31 %)</b>		
			300 WW International Inc, 8,946 %, fällig 13.04.2028 *	227	0,44
<b>Summe Schuldscheine (Anschaffungskosten 2295)</b>					
			<b>Stammaktien – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
<b>Schweiz – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
			1.680 Credit Suisse Group AG Escrow †	–	–
<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten –5)</b>					
				–	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Global High Yield Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% des Nettoinventarwerts
<b>Optionsscheine – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
<b>USA – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
4 EG Acquisition Corp	1	-
<b>Summe Optionsscheine (Anschaffungskosten 4\$)</b>	<b>1</b>	<b>-</b>
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 58.925\$)</b>		
	50.686	98,07
<b>Devisenterminkontrakte – 0,06 % (28. Februar 2023: 0,10 %)</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	32	0,06
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
	50.718	98,13
<b>Devisenterminkontrakte – -0,20 % (28. Februar 2023: -0,47 %)</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	-105	-0,20
<b>Futures – -0,02 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	-10	-0,02
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>		
	-115	-0,22
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
	50.603	97,91
<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>		
	1.080	2,09
<b>Gesamt Nettovermögen</b>		
	51.683\$	100,00

– Beträge, die mit „-“ bezeichnet sind, beaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1,000 Anteile oder weniger als 0,01 %.

144A 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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 28.353.000 USD und machten 54,87 % des Nettovermögens aus.

\* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.

† Nicht liquide.

‡ Aufgrund der Unsicherheit der Zinszahlungen fallen während und/oder nach dem am 31. August 2023 endenden Berichtszeitraum keine Erträge mehr an.

### ABKÜRZUNGEN:

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

EUR – Euro

GBP – Britisches Pfund

MXN – Mexikanischer Peso

RUB – Russischer Rubel

### Verteilung des Gesamtvermögens

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	95,35
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	0,43
Finanzderivate	0,06
Sonstige Vermögenswerte	4,16
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 4	Verkauf GBP 3	\$ -
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 2	Verkauf SGD 3	-
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf SGD -	Verkauf USD -	-
06. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 2	Verkauf SGD 2	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 82	Verkauf AUD 126	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 62	Verkauf AUD 97	-1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 28	Verkauf EUR 27	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 203	Verkauf GBP 160	1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 124	Verkauf SGD 166	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 10	Verkauf SGD 14	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf AUD 6.716	Verkauf USD 4.391	-37
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf AUD 73	Verkauf USD 47	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 105	Verkauf USD 132	1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf SGD 2.414	Verkauf USD 1.796	-9
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 1.719	Verkauf USD 1.893	-26
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf SGD 1	Verkauf USD -	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 3.091	Verkauf USD 3.936	-20
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 2.048	Verkauf GBP 1.592	30
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf GBP 306	Verkauf USD 400	-12
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf EUR 8	Verkauf USD 9	-
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 60\$)				\$ 32
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -271\$)				-105
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -211\$)				\$ -73

### Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
Euro FX Currency September 2023	UBS	-23	\$ -3.120
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 38\$)			\$ -
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -\$)			-10
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 38\$)			\$ -10

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert		
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 13,21 % (28. Februar 2023: 14,21 %)</b>			<b>Malaysia – 10,85 % (28. Februar 2023: 11,48 %)</b>				
<b>Frankreich – 1,46 % (28. Februar 2023: 1,32 %)</b>			<b>Philippinen – 5,46 % (28. Februar 2023: 4,92 %)</b>				
SGD 8.000	Credit Agricole SA, 3,800 %, fällig 30.04.2031 *	5,744	1,46	PHP 1.256.000	Internationale Anleihe der philippinischen Regierung, 6,250 %, fällig 14.01.2036	21,486	5,46
<b>Hongkong – 0,45 % (28. Februar 2023: 0,46 %)</b>			<b>Singapur – 5,22 % (28. Februar 2023: 6,16 %)</b>				
3.000	Panther Ventures Ltd, 3,500 %, Ewige Anleihe	1,785	0,45	SGD 2.000	Housing & Development Board, 3,995 %, fällig 06.12.2029	1,509	0,38
<b>Indien – 0,92 % (28. Februar 2023: 0,80 %)</b>			<b>Supranational – 4,06 % (28. Februar 2023: 1,46 %)</b>				
4.000	REC Ltd, 2,250 %, fällig 01.09.2026	3,611	0,92	SGD 4.000	Monetary Authority of Singapore Bill, Series 84, Nullkupon, fällig 15.09.2023	2,955	0,75
<b>Indonesien – 1,76 % (28. Februar 2023: 2,30 %)</b>			<b>Südkorea – 17,49 % (28. Februar 2023: 18,25 %)</b>				
3.350	Pelabuhan Indonesia Persero PT, 5,375 %, fällig 05.05.2045	3,134	0,80	IDR 50.000.000	Export-Import Bank of Korea, 144A, 6,700 %, fällig 02.12.2024	3,285	0,84
4.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 4,125 %, fällig 15.05.2027	3,796	0,96	2.600	Korea Electric Power Corp, 5,375 %, fällig 31.07.2026	2,602	0,66
<b>Malaysia – 0,56 % (28. Februar 2023: 0,51 %)</b>			<b>Thailand – 6,03 % (28. Februar 2023: 5,38 %)</b>				
SGD 3.000	Cagamas Global Plc, 3,850 %, fällig 11.09.2023	2,220	0,56	THB 801.030	Thailändische Staatsanleihe, 3,300 %, fällig 17.06.2038	23,744	6,03
<b>Katar – 2,32 % (28. Februar 2023: 2,05 %)</b>			<b>Vietnam – 1,12 % (28. Februar 2023: 0,34 %)</b>				
IDR 140.000.000	QNB Finance Ltd, 6,900 %, fällig 23.01.2025	9,123	2,32	4.500	Internationale Anleihe der vietnamesischen Regierung, 4,800 %, fällig 19.11.2024	4,413	1,12
<b>Singapur – 1,68 % (28. Februar 2023: 3,78 %)</b>			<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 57.0375)</b>				
SGD 11.500	Temasek Financial I Ltd, 2,800 %, fällig 17.08.2071	6,593	1,68	51.958	13,21		
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 57.0375)</b>			<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 85,50 % (28. Februar 2023: 83,94 %)</b>				
<b>Australien – 1,57 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			<b>Australien – 1,57 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>				
AUD 10.000	Australische Staatsanleihe, 3,750 %, fällig 21.04.2037	6,192	1,57				
<b>China – 18,85 % (28. Februar 2023: 17,35 %)</b>			<b>China – 18,85 % (28. Februar 2023: 17,35 %)</b>				
CNY 110.000	Agricultural Development Bank of China, Series 1806, 4,650 %, fällig 11.05.2028	16,480	4,19				
HKD 7.500	China Development Bank/Hong Kong, 5,710 %, fällig 24.01.2024 *	957	0,24				
CNY 33.000	Chinesische Staatsanleihe, 3,380 %, fällig 21.11.2024	4,593	1,17				
CNY 50.000	Chinesische Staatsanleihe, Series INBK, 2,680 %, fällig 21.05.2030	6,914	1,76				
CNY 96.500	Chinesische Staatsanleihe, 3,600 %, fällig 21.05.2030	13,979	3,55				
CNY 100.000	Chinesische Staatsanleihe, Series INBK, 3,390 %, fällig 16.03.2050	14,877	3,78				
CNY 5.000	Export-Import Bank of China/The, 4,400 %, fällig 14.05.2024	695	0,18				
CNY 40.000	Export-Import Bank of China/The, Series 2007, 3,260 %, fällig 24.02.2027	5,622	1,43				
CNY 30.000	Export-Import Bank of China/The, Series 1910, 3,860 %, fällig 20.05.2029	4,380	1,11				
CNY 40.000	Export-Import Bank of China/The, Series 2010, 3,230 %, fällig 23.03.2030	5,669	1,44				
			74,166	18,85			
<b>Indien – 7,40 % (28. Februar 2023: 7,70 %)</b>			<b>Indien – 7,40 % (28. Februar 2023: 7,70 %)</b>				
INR 280.000	Indische Staatsanleihe, 8,150 %, fällig 24.11.2026	3,480	0,88				
INR 750.000	Indische Staatsanleihe, Series SPB, 8,240 %, fällig 15.02.2027	9,354	2,38				
INR 450.000	Indische Staatsanleihe, 7,170 %, fällig 08.01.2028	5,433	1,38				
INR 700.000	Indische Staatsanleihe, 7,610 %, fällig 09.05.2030	8,667	2,20				
INR 190.000	Indische Staatsanleihe, 6,570 %, fällig 05.12.2033	2,196	0,56				
			29,130	7,40			
<b>Indonesien – 11,51 % (28. Februar 2023: 10,13 %)</b>			<b>Indonesien – 11,51 % (28. Februar 2023: 10,13 %)</b>				
IDR 108.875.000	Indonesische Schatzanleihe, Series FR59, 7,000 %, fällig 15.05.2027	7,328	1,86				
IDR 20.000.000	Indonesische Schatzanleihe, Series FR47, 10,000 %, fällig 15.02.2028	1,490	0,38				
IDR 27.500.000	Indonesische Schatzanleihe, Series FR64, 6,125 %, fällig 15.05.2028	1,799	0,46				
IDR 100.000.000	Indonesische Schatzanleihe, Series FR87, 6,500 %, fällig 15.02.2031	6,611	1,68				
IDR 114.000.000	Indonesische Schatzanleihe, Series FR54, 9,500 %, fällig 15.07.2031	8,862	2,25				
IDR 25.000.000	Indonesische Schatzanleihe, Series FR58, 8,250 %, fällig 15.06.2032	1,820	0,46				
IDR 160.000.000	Indonesische Schatzanleihe, Series FR89, 6,875 %, fällig 15.08.2051	10,681	2,72				
IDR 100.000.000	Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia, Series OB, 8,250 %, fällig 15.08.2024	6,685	1,70				
			45,276	11,51			
			<b>Malaysia – 10,85 % (28. Februar 2023: 11,48 %)</b>				
MYR 25.000	Malaysische Staatsanleihe, Series 0115, 3,955 %, fällig 15.09.2025	5,438	1,38				
MYR 1.200	Malaysische Staatsanleihe, Series 0308, 5,248 %, fällig 15.09.2028	277	0,07				
MYR 26.850	Malaysische Staatsanleihe, Series 0219, 3,885 %, fällig 15.08.2029	5,824	1,48				
MYR 50.000	Malaysische Staatsanleihe, Series 0411, 4,232 %, fällig 30.06.2031	11,051	2,81				
MYR 51.780	Malaysische Staatsanleihe, Series 0122, 3,582 %, fällig 15.07.2032	10,920	2,78				
MYR 22.510	Malaysische Staatsanleihe, Series 0413, 3,844 %, fällig 15.04.2033	4,833	1,23				
MYR 20.360	Malaysische Staatsanleihe, Series 0419, 3,828 %, fällig 05.07.2034	4,327	1,10				
			42,670	10,85			
			<b>Philippinen – 5,46 % (28. Februar 2023: 4,92 %)</b>				
PHP 1.256.000	Internationale Anleihe der philippinischen Regierung, 6,250 %, fällig 14.01.2036	21,486	5,46				
			<b>Singapur – 5,22 % (28. Februar 2023: 6,16 %)</b>				
SGD 2.000	Housing & Development Board, 3,995 %, fällig 06.12.2029	1,509	0,38				
SGD 4.000	Monetary Authority of Singapore Bill, Series 84, Nullkupon, fällig 15.09.2023	2,955	0,75				
SGD 4.600	Monetary Authority of Singapore Bill, Series 84, Nullkupon, fällig 13.10.2023	3,388	0,86				
SGD 8.250	National Environment Agency, 2,500 %, fällig 15.09.2051	4,858	1,24				
SGD 11.000	Singapurische Staatsanleihe, 2,625 %, fällig 01.08.2032	7,814	1,99				
			20,524	5,22			
			<b>Südkorea – 17,49 % (28. Februar 2023: 18,25 %)</b>				
IDR 50.000.000	Export-Import Bank of Korea, 144A, 6,700 %, fällig 02.12.2024	3,285	0,84				
2.600	Korea Electric Power Corp, 5,375 %, fällig 31.07.2026	2,602	0,66				
KRW 25.000.000	Koreanische Staatsanleihe, Series 2912, 1,375 %, fällig 10.12.2029	16,424	4,17				
KRW 46.300.000	Koreanische Schatzanleihe, Series 3006, 1,375 %, fällig 10.06.2030	30,062	7,64				
KRW 13.200.000	Koreanische Schatzanleihe, Series 3206, 3,375 %, fällig 10.06.2032	9,721	2,47				
KRW 13.000.000	Koreanische Schatzanleihe, Series 3909, 1,125 %, fällig 10.09.2039	6,731	1,71				
			68,825	17,49			
			<b>Thailand – 6,03 % (28. Februar 2023: 5,38 %)</b>				
THB 801.030	Thailändische Staatsanleihe, 3,300 %, fällig 17.06.2038	23,744	6,03				
			<b>Vietnam – 1,12 % (28. Februar 2023: 0,34 %)</b>				
4.500	Internationale Anleihe der vietnamesischen Regierung, 4,800 %, fällig 19.11.2024	4,413	1,12				
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 389.2225)</b>			336,426	85,50			
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,67 % (28. Februar 2023: 0,88 %)</b>			<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,67 % (28. Februar 2023: 0,88 %)</b>				
2.645 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)			2,645	0,67			
<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 2.6455)</b>			2,645	0,67			
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 448.9045)</b>			391,029	99,38			
<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,04 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,04 %)</b>				
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			6	–			
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>			391,035	99,38			
<b>Devisenterminkontrakte – -0,16 % (28. Februar 2023: -0,26 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – -0,16 % (28. Februar 2023: -0,26 %)</b>				
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			-618	-0,16			
<b>Futures – -0,07 % (28. Februar 2023: -0,09 %)</b>			<b>Futures – -0,07 % (28. Februar 2023: -0,09 %)</b>				
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			-269	-0,07			
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>			-887	-0,23			
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>			390,148	99,15			
<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>			3,317	0,85			
<b>Gesamtnettovermögen</b>			393,465\$	100,00			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

- Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.
- 144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 3.285.000 USD und machten 0,84 % des Nettovermögens aus.
- \* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.

### ABKÜRZUNGEN:

Unbefristet	– Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
AUD	– Australischer Dollar
CNY	– Chinesischer Renminbi
HKD	– Hongkong-Dollar
IDR	– Indonesische Rupiah
INR	– Indische Rupie
KRW	– Südkoreanischer Won
MYR	– Malaysischer Ringgit
PHP	– Philippinischer Peso
SGD	– Singapur-Dollar
THB	– Thailändischer Baht

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,90
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,67
Finanzderivate	-
Sonstige Vermögenswerte	1,43
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)			
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	34	Verkauf	CNH	250	\$	-
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	-	Verkauf	EUR	-		-
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	-	Verkauf	USD	-		-
06. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	-	Verkauf	SGD	-		-
06. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	2	Verkauf	USD	1		-
06. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	-	Verkauf	USD	-		-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	38	Verkauf	AUD	60		-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	316	Verkauf	AUD	487		3
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	4	Verkauf	CHF	3		-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	30	Verkauf	CNH	215		-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	289	Verkauf	CNH	2.107		-1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	304	Verkauf	EUR	277		3
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	-	Verkauf	SGD	-		-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	27	Verkauf	SGD	36		-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	18.993	Verkauf	USD	12.417		-142
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	20	Verkauf	USD	13		-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CHF	269	Verkauf	USD	308		-4
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CNH	48.745	Verkauf	USD	6.762		-60
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CNH	450	Verkauf	USD	62		-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	3.174	Verkauf	USD	2.362		-18
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	11	Verkauf	USD	9		-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	13.712	Verkauf	USD	15.087		-274
25. Sep. 2023	Citi	Kauf	SGD	5.500	Verkauf	USD	4.146		-83
28. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	16.150	Verkauf	USD	11.970		-36
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 162\$)								\$	6
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.130\$)									-618
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -968\$)								\$	-612

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
Koreanische 10-jährige Anleihe September 2023 UBS	234	\$ 19.400	\$ -269
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -\$)			\$ -
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -373\$)			-269
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -373\$)			\$ -269



# FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 89,69 % (28. Februar 2023: 83,61 %)</b>					
<b>Australien – 0,80 % (28. Februar 2023: 0,69 %)</b>					
EUR	720	Optus Finance Pty Ltd, 1,000 %, fällig 20.06.2029	652	0,14	
EUR	3.000	Westpac Banking Corp, 0,625 %, fällig 22.11.2024	3.122	0,66	
			3.774	0,80	
<b>Kanada – 2,14 % (28. Februar 2023: 2,72 %)</b>					
GBP	1.230	Royal Bank of Canada, 1,375 %, fällig 09.12.2024	1.470	0,31	
GBP	3.270	Royal Bank of Canada, 5,000 %, fällig 24.01.2028	3.979	0,84	
GBP	1.980	Toronto-Dominion Bank/The, 2,875 %, fällig 05.04.2027	2.254	0,47	
GBP	2.000	Toronto-Dominion Bank/The, 5,288 %, fällig 11.01.2028	2.454	0,52	
			10.157	2,14	
<b>Dänemark – 1,07 % (28. Februar 2023: 2,09 %)</b>					
EUR	1.580	Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, fällig 12.01.2024	1.574	0,33	
GBP	2.890	Danske Bank A/S, 4,625 %, fällig 13.04.2027 *	3.519	0,74	
			5.093	1,07	
<b>Finnland – 0,28 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
EUR	1.220	Neste Oyj, 3,875 %, fällig 16.03.2029	1.328	0,28	
<b>Frankreich – 7,49 % (28. Februar 2023: 6,57 %)</b>					
EUR	300	Air Liquide Finance SA, 1,000 %, fällig 02.04.2025	312	0,07	
EUR	2.300	APRR SA, 0,125 %, fällig 18.01.2029	2.087	0,44	
EUR	800	APRR SA, 1,500 %, fällig 25.01.2030	772	0,16	
GBP	2.600	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1,500 %, fällig 07.10.2026	2.884	0,61	
			229	0,05	
EUR	2.700	BNP Paribas SA, 0,375 %, fällig 14.10.2027 *	2.607	0,55	
EUR	1.100	BNP Paribas SA, 1,375 %, fällig 28.05.2029	1.020	0,21	
GBP	2.600	BNP Paribas SA, 5,750 %, fällig 13.06.2032	3.155	0,66	
EUR	1.800	Bouygues SA, 4,625 %, fällig 07.06.2032	2.042	0,43	
EUR	1.000	BPCE SA, 1,000 %, fällig 01.04.2025	1.035	0,22	
GBP	2.600	BPCE SA, 1,375 %, fällig 23.12.2026	2.861	0,60	
EUR	300	Credit Agricole SA/London, 1,250 %, fällig 14.04.2026	305	0,06	
			5.914	1,25	
EUR	300	Credit Agricole SA/London, 1,750 %, fällig 05.03.2029	288	0,06	
EUR	400	Engie SA, 1,000 %, fällig 13.03.2026	405	0,09	
EUR	300	Engie SA, 2,375 %, fällig 19.05.2026	314	0,07	
EUR	1.100	Engie SA, 0,500 %, fällig 24.10.2030	951	0,20	
EUR	2.400	L'Oreal SA, 0,875 %, fällig 29.06.2026	2.438	0,51	
EUR	2.100	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, 3,375 %, fällig 21.10.2025	2.273	0,48	
EUR	600	RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR, 1,000 %, fällig 19.10.2026	603	0,13	
EUR	1.100	TotalEnergies Capital International SA, 1,023 %, fällig 04.03.2027	1.099	0,23	
GBP	1.700	Vinci SA, 2,250 %, fällig 15.03.2027	1.932	0,41	
			35.526	7,49	
<b>Deutschland – 4,34 % (28. Februar 2023: 5,72 %)</b>					
EUR	900	Allianz Finance II BV, 0,000 %, fällig 14.01.2025	931	0,20	
EUR	700	Allianz Finance II BV, 1,500 %, fällig 15.01.2030	683	0,14	
EUR	300	BASF SE, 0,875 %, fällig 15.11.2027	296	0,06	
EUR	600	Clearstream Banking AG, 0,000 %, fällig 01.12.2025	599	0,13	
EUR	500	Deutsche Boerse AG, 1,125 %, fällig 26.03.2028	501	0,10	
EUR	1.500	HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH, 0,625 %, fällig 01.11.2028	1.357	0,29	
GBP	6.000	Kreditanstalt für Wiederaufbau, 0,875 %, fällig 18.07.2024	7.310	1,54	
EUR	2.500	Robert Bosch GmbH, 3,625 %, fällig 02.06.2027	2.704	0,57	
EUR	4.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1,000 %, fällig 25.02.2030	3.732	0,79	
GBP	2.000	Volkswagen Financial Services NV, 5,500 %, fällig 07.12.2026	2.486	0,52	
			20.599	4,34	
<b>Japan – 1,52 % (28. Februar 2023: 1,80 %)</b>					
EUR	3.370	NTT Finance Corp, 0,010 %, fällig 03.03.2025	3.453	0,73	
EUR	2.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 0,632 %, fällig 23.10.2029	1.772	0,37	
GBP	1.600	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 4,625 %, fällig 08.06.2026	1.976	0,42	
			7.201	1,52	
<b>Luxemburg – 0,47 % (28. Februar 2023: 0,41 %)</b>					
EUR	2.275	Prologis International Funding II SA, 1,750 %, fällig 15.03.2028	2.234	0,47	
<b>Niederlande – 5,98 % (28. Februar 2023: 5,25 %)</b>					
EUR	220	ABN AMRO Bank NV, 1,000 %, fällig 16.04.2025	228	0,05	
GBP	2.400	ABN AMRO Bank NV, 5,250 %, fällig 26.05.2026	2.995	0,63	
GBP	4.300	ABN AMRO Bank NV, 5,125 %, fällig 22.02.2028	5.200	1,10	
EUR	1.470	Alliander NV, 2,625 %, fällig 09.09.2027	1.552	0,33	
GBP	2.500	Coöperatieve Rabobank UA, 1,250 %, fällig 14.01.2025	2.979	0,63	
EUR	2.300	Coöperatieve Rabobank UA, 0,375 %, fällig 01.12.2027 *	2.214	0,47	
			270	0,05	
EUR	2.010	Enxsis Holding NV, 0,750 %, fällig 02.07.2031	1.877	0,38	
EUR	300	ING Groep NV, 2,125 %, fällig 10.01.2026	314	0,07	
EUR	1.300	ING Groep NV, 0,875 %, fällig 29.11.2030 *	1.149	0,24	
			1.724	0,36	
			1.500	0,32	
EUR	1.910	TenneT Holding BV, 1,625 %, fällig 17.11.2026	1.971	0,42	
EUR	2.220	TenneT Holding BV, 1,375 %, fällig 05.06.2028	2.206	0,46	
EUR	1.000	Vesteda Finance BV, 2,000 %, fällig 10.07.2026	1.019	0,21	
EUR	1.500	Vesteda Finance BV, 0,750 %, fällig 18.10.2031	1.247	0,26	
			28.346	5,98	
<b>Norwegen – 1,94 % (28. Februar 2023: 1,69 %)</b>					
EUR	940	Avinor AS, 0,750 %, fällig 01.10.2030	835	0,18	
GBP	2.150	DNB Bank ASA, 4,000 %, fällig 17.08.2027 *	2.547	0,54	
EUR	3.400	DNB Bank ASA, 3,125 %, fällig 21.09.2027 *	3.601	0,76	
EUR	1.000	Equinor ASA, 0,750 %, fällig 22.05.2026	1.005	0,21	
EUR	540	Equinor ASA, 1,250 %, fällig 17.02.2027	542	0,11	
EUR	620	Statkraft AS, 2,875 %, fällig 13.09.2029	653	0,14	
			9.183	1,94	
<b>Singapur – 1,20 % (28. Februar 2023: 1,06 %)</b>					
EUR	5.300	Temasek Financial I Ltd, 3,250 %, fällig 15.02.2027	5.699	1,20	
<b>Spanien – 2,35 % (28. Februar 2023: 1,42 %)</b>					
EUR	2.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series gmtm, 3,375 %, fällig 20.09.2027	2.117	0,45	
GBP	500	Banco Santander SA, 2,750 %, fällig 12.09.2023	633	0,13	
			3.336	0,70	
EUR	1.700	Banco Santander SA, 0,625 %, fällig 24.06.2029 *	1.562	0,33	
EUR	3.200	Banco Santander SA, 4,250 %, fällig 12.06.2030	3.495	0,74	
			11.143	2,35	
<b>Supranational – 2,00 % (28. Februar 2023: 2,06 %)</b>					
GBP	6.300	Inter-American Development Bank, 0,500 %, fällig 15.09.2026	6.963	1,47	
GBP	2.090	International Finance Facility for Immunisation Co, 2,750 %, fällig 07.06.2025	2.520	0,53	
			9.483	2,00	
<b>Schweden – 2,12 % (28. Februar 2023: 2,08 %)</b>					
EUR	2.190	Hemso Treasury Oyj, 0,000 %, fällig 19.01.2028	1.935	0,41	
EUR	3.050	Swedbank AB, 0,250 %, fällig 09.10.2024	3.176	0,67	
EUR	2.250	Swedbank AB, 0,300 %, fällig 20.05.2027 *	2.188	0,46	
EUR	2.000	Vattenfall AB, 3,750 %, fällig 18.10.2026	2.174	0,46	
EUR	550	Volvo Treasury AB, 0,125 %, fällig 17.09.2024	573	0,12	
			10.046	2,12	
<b>Schweiz – 4,38 % (28. Februar 2023: 3,77 %)</b>					
EUR	1.480	ABB Finance BV, 3,250 %, fällig 16.01.2027	1.586	0,33	
EUR	800	Cloverie Plc for Zurich Insurance Co Ltd, 1,500 %, fällig 15.12.2028	786	0,16	
GBP	3.530	Credit Suisse AG/London, 1,125 %, fällig 15.12.2025	3.983	0,84	
			487	0,10	
EUR	6.000	Novartis Finance SA, 0,000 %, fällig 23.09.2028	5.545	1,17	
EUR	1.560	Sika Capital BV, 3,750 %, fällig 03.11.2026	1.689	0,36	
EUR	1.050	Sika Capital BV, 3,750 %, fällig 03.05.2030	1.129	0,24	
GBP	1.050	UBS Group AG, 2,125 %, fällig 12.09.2025 *	1.274	0,27	
			4.297	0,91	
			20.776	4,38	
<b>Vereinigtes Königreich – 9,99 % (28. Februar 2023: 9,14 %)</b>					
EUR	3.850	AstraZeneca Plc, 3,625 %, fällig 03.03.2027	4.190	0,88	
GBP	1.700	British Land Co Plc/The, 2,375 %, fällig 14.09.2029	1.689	0,36	
EUR	400	CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd, 1,250 %, fällig 13.04.2025	413	0,09	
EUR	270	GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,250 %, fällig 21.05.2026	276	0,06	
EUR	550	GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,000 %, fällig 12.09.2026	554	0,12	
EUR	5.000	GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,375 %, fällig 12.09.2029	4.826	1,02	
EUR	1.200	GSK Capital BV, 3,125 %, fällig 28.11.2032	1.255	0,26	
EUR	520	HSBC Holdings Plc, 0,875 %, fällig 06.09.2024	547	0,11	
EUR	1.660	HSBC Holdings Plc, 3,803 %, fällig 11.03.2025 *	1.640	0,34	
EUR	390	HSBC Holdings Plc, 1,645 %, fällig 18.04.2026 *	363	0,08	
EUR	1.220	HSBC Holdings Plc, 2,099 %, fällig 04.06.2026 *	1.138	0,24	
EUR	1.630	HSBC Holdings Plc, Series GEN, 0,309 %, fällig 13.11.2026 *	1.619	0,34	
GBP	300	HSBC Holdings Plc, 3,000 %, fällig 22.07.2028 *	335	0,07	
EUR	1.800	HSBC Holdings Plc, 6,161 %, fällig 09.03.2029 *	1.813	0,38	
EUR	1.000	Lloyds Banking Group Plc, 0,500 %, fällig 12.11.2025 *	1.036	0,22	
EUR	890	Lloyds Banking Group Plc, 3,500 %, fällig 01.04.2026 *	951	0,20	
EUR	3.000	Lloyds Banking Group Plc, 3,125 %, fällig 24.08.2030 *	3.015	0,64	
EUR	200	London Stock Exchange Group Plc, 0,875 %, fällig 19.09.2024	210	0,04	
EUR	690	London Stock Exchange Group Plc, 1,750 %, fällig 06.12.2027	697	0,15	
GBP	1.250	London Stock Exchange Group Plc, 1,625 %, fällig 06.04.2030	1.265	0,27	
EUR	1.560	Motability Operations Group Plc, 0,125 %, fällig 20.07.2028	1.424	0,30	
GBP	990	Nationwide Building Society, 6,178 %, fällig 07.12.2027 *	1.237	0,26	
GBP	1.590	Nationwide Building Society, 6,125 %, fällig 21.08.2028	2.024	0,43	
EUR	4.750	NatWest Markets Plc, 1,375 %, fällig 02.03.2027	4.691	0,99	
GBP	1.270	NatWest Markets Plc, 6,375 %, fällig 08.11.2027	1.615	0,34	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



## FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>						
<b>Vereinigtes Königreich – (Fortsetzung)</b>						
EUR	1.340	0,28	EUR	3.000	0,60	
EUR	2.200	0,37	GBP	1.260	0,30	
580	565	0,18	8.000	7.878	1,66	
850	840	0,12	EUR	1.250	1.308	0,28
EUR	480	0,11	EUR	350	336	0,07
EUR	550	0,12	EUR	2.200	2.006	0,42
EUR	2.000	0,45	EUR	2.600	2.195	0,46
EUR	810	0,17	EUR	3.500	3.800	0,80
	47.353	9,99	EUR	4.200	3.636	0,77
			EUR	400	417	0,09
<b>USA – 41,62 % (28. Februar 2023: 37,14 %)</b>						
EUR	3.500	0,64	EUR	1.040	1.005	0,21
EUR	2.000	0,40	EUR	4.900	4.778	1,01
1.240	1.185	0,25	EUR	2.400	2.557	0,54
1.700	1.562	0,33	600	529	0,11	
4.500	3.907	0,82	1.150	1.071	0,23	
1.980	1.945	0,41	3.850	3.833	0,81	
2.200	1.939	0,41	1.630	1.311	0,28	
5.220	5.154	1,09	GBP	1.340	1.467	0,31
340	330	0,07	5.320	5.296	1,12	
EUR	1.520	0,32	EUR	2.000	2.078	0,44
GBP	1.500	0,36	2.800	2.875	0,61	
EUR	2.500	0,57	540	518	0,11	
EUR	800	0,18	4.000	3.627	0,76	
4.800	4.622	0,97	251	224	0,05	
5.200	5.120	1,08		197.365	41,62	
EUR	3.000	0,63	<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen</b>	<b>425.306</b>	<b>89,69</b>	
EUR	530	0,12	<b>(Anschaffungskosten 459.427\$)</b>			
EUR	2.550	0,53	<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 7,37 % (28. Februar 2023: 14,70 %)</b>			
EUR	2.000	0,43	<b>Kanada – 1,08 % (28. Februar 2023: 0,94 %)</b>			
1.276	1.247	0,26	GBP	1.200	1.430	0,30
588	545	0,11	GBP	3.000	3.711	0,78
4.000	3.949	0,83		5.141	1,08	
EUR	1.360	0,31	<b>Niederlande – 2,31 % (28. Februar 2023: 2,02 %)</b>			
3.000	2.640	0,56	GBP	8.800	10.936	2,31
2.400	2.259	0,48	<b>Südkorea – 0,15 % (28. Februar 2023: 0,13 %)</b>			
EUR	1.300	0,27	EUR	660	692	0,15
EUR	800	0,17	<b>Schweden – 1,59 % (28. Februar 2023: 1,40 %)</b>			
GBP	230	0,06	GBP	6.100	7.547	1,59
3.420	3.306	0,70	<b>USA – 2,24 % (28. Februar 2023: 10,21 %)</b>			
2.900	2.396	0,50	1.1180	10.600	2,24	
EUR	5.000	0,96	<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen</b>			
2.600	2.604	0,58	<b>(Anschaffungskosten 34.555\$)</b>			
EUR	1.300	0,25	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,83 % (28. Februar 2023: 3,25 %)</b>			
2.890	2.761	0,58	3.957	3.957	0,83	
1.800	1.592	0,34	<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen</b>			
2.900	2.632	0,55	<b>(Anschaffungskosten 3.957\$)</b>			
7.000	5.705	1,20	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten</b>			
2.000	1.716	0,36	<b>Anlagen (Anschaffungskosten 497.939\$)</b>			
GBP	1.440	0,35	<b>Devisenterminkontrakte – 0,52 % (28. Februar 2023: 0,71 %)</b>			
2.200	2.131	0,45	<b>Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)</b>			
780	745	0,16	<b>Futures – 0,15 % (28. Februar 2023: 0,92 %)</b>			
1.830	1.761	0,37	<b>Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)</b>			
4.500	3.800	0,80	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten</b>			
180	158	0,03	<b>finanziellen Vermögenswerte</b>			
110	110	0,02	<b>Credit Default Swaps – -0,07 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			
3.090	3.074	0,65	<b>Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)</b>			
EUR	320	0,07	<b>Devisenterminkontrakte – -0,68 % (28. Februar 2023: -0,62 %)</b>			
4.400	3.969	0,84	<b>Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)</b>			
240	207	0,04	<b>Futures – -0,15 % (28. Februar 2023: -0,01 %)</b>			
910	883	0,19	<b>Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)</b>			
EUR	2.100	0,44	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten</b>			
EUR	2.800	0,64	<b>finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>			
1.150	1.104	0,23	<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>			
1.700	1.632	0,34	<b>Gesamtvermögen</b>			
280	276	0,06	<b>474.208\$ 100,00</b>			
2.000	1.912	0,40				
EUR	2.550	0,54				
4.340	3.774	0,80				
570	552	0,12				
2.400	2.252	0,47				
EUR	330	0,07				
EUR	2.040	0,48				
EUR	2.790	0,53				
GBP	320	0,08				
EUR	680	0,14				
3.000	3.014	0,64				
2.900	2.776	0,59				
1.600	1.437	0,30				
EUR	310	0,06				

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

### ABKÜRZUNGEN:

EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	95,59
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,82
Finanzderivate	0,66
Sonstige Vermögenswerte	2,93
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

### Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000 % – Kauf	20. Juni 2028	23.140	\$ -326
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 213\$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -\$)				-326
Nettowertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): 213\$)				\$ -326

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 56	Verkauf EUR 51	\$ -
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 141	Verkauf GBP 111	1
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf SEK 130	Verkauf USD 12	-
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 42	Verkauf USD 54	-
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 55	Verkauf USD 60	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 1.077	Verkauf EUR 995	-4
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 28.831	Verkauf EUR 26.487	87
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 578	Verkauf GBP 458	-2
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 2.050	Verkauf GBP 1.613	10
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 165	Verkauf SEK 1.819	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 100	Verkauf SEK 1.077	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 16	Verkauf USD 17	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf AUD 14.578	Verkauf USD 9.531	-80
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf CHF 4.000	Verkauf USD 4.580	-45
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 88.023	Verkauf USD 96.841	-1.320
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 1.165	Verkauf USD 1.472	5
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 214.727	Verkauf USD 273.454	-1.422
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf SEK 121	Verkauf USD 11	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf SEK 131.492	Verkauf USD 12.329	-310
16. Nov. 2023	BNP Paribas	Kauf USD 8.148	Verkauf EUR 7.411	82
16. Nov. 2023	BNP Paribas	Kauf USD 19.786	Verkauf GBP 15.572	57
16. Nov. 2023	BNP Paribas	Kauf GBP 743	Verkauf USD 945	-3
16. Nov. 2023	Citi	Kauf USD 34.253	Verkauf EUR 31.171	325
16. Nov. 2023	Citi	Kauf USD 11.668	Verkauf GBP 9.184	32
16. Nov. 2023	Citi	Kauf EUR 602	Verkauf USD 666	-11
16. Nov. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 34.018	Verkauf EUR 30.951	329
16. Nov. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 6.415	Verkauf GBP 5.048	19
16. Nov. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 568	Verkauf JPY 79.998	11
16. Nov. 2023	HSBC	Kauf USD 29.035	Verkauf EUR 26.419	279
16. Nov. 2023	HSBC	Kauf USD 543	Verkauf EUR 500	-2
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf USD 38.225	Verkauf EUR 34.772	377
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf USD 10.441	Verkauf GBP 8.220	27
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf EUR 9.000	Verkauf USD 9.818	-22
16. Nov. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 34.696	Verkauf EUR 31.568	336
16. Nov. 2023	Morgan Stanley	Kauf EUR 2.000	Verkauf USD 2.180	-3
16. Nov. 2023	Royal Bank of Canada	Kauf USD 16.646	Verkauf GBP 13.106	40
16. Nov. 2023	UBS	Kauf USD 37.727	Verkauf EUR 34.331	359
16. Nov. 2023	UBS	Kauf USD 42.615	Verkauf GBP 33.552	105
16. Nov. 2023	UBS	Kauf EUR 5.032	Verkauf USD 5.500	-23
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 3.707\$)				\$ 2481
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -3.219\$)				-3.247
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 488\$)				\$ -766

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bobl Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	-631	\$ -80.376	\$ -469
Euro-Bund Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	-174	-25.024	-229
Japanische 10-jährige Anleihe (OSE) September 2023	Bank of America Merrill Lynch	-12	-12.110	91
Long Gilt Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	99	11.986	215
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	354	39.305	412
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	-10	-1.069	-7
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 4.839\$)				\$ 718
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -61\$)				-705
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 4.778\$)				\$ 13

# FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 16,05 % (28. Februar 2023: 10,40 %)</b>					
1.000 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,000 % ±	923	0,60	17 Ginnie Mae I Pool „AA5649“, 3,000 %, fällig 15.09.2042	16	0,01
500 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 % ±	474	0,31	10 Ginnie Mae I Pool „AB2892“, 3,000 %, fällig 15.09.2042	9	0,01
600 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 % ±	582	0,38	43 Ginnie Mae I Pool „AB9108“, 3,000 %, fällig 15.10.2042	39	0,03
200 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 1,500 % ±	151	0,10	29 Ginnie Mae I Pool „AB9109“, 3,000 %, fällig 15.10.2042	26	0,02
2.200 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,000 % ±	1.752	1,13	25 Ginnie Mae I Pool „AB9207“, 3,000 %, fällig 15.11.2042	22	0,01
3.300 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 % ±	2.734	1,77	17 Ginnie Mae II Pool „784825“, 3,500 %, fällig 20.10.2049	15	0,01
2.600 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 % ±	2.241	1,45	75 Ginnie Mae II Pool „785218“, 2,000 %, fällig 20.12.2050	62	0,04
1.100 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,500 % ±	983	0,64	148 Ginnie Mae II Pool „785219“, 2,000 %, fällig 20.12.2050	121	0,08
1.600 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,500 % ±	1.580	1,02	79 Ginnie Mae II Pool „785220“, 2,000 %, fällig 20.12.2050	65	0,04
200 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 6,000 % ±	201	0,13	152 Ginnie Mae II Pool „785221“, 2,000 %, fällig 20.12.2050	125	0,08
100 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 6,500 % ±	102	0,07	72 Ginnie Mae II Pool „BS8546“, 2,500 %, fällig 20.12.2050	60	0,04
3 Fannie Mae Pool „255984“, 4,500 %, fällig 01.11.2025	3	–	79 Ginnie Mae II Pool „BT1888“, 2,500 %, fällig 20.12.2050	68	0,04
53 Fannie Mae Pool „AL3024“, 3,500 %, fällig 01.01.2043	49	0,03	93 Ginnie Mae II Pool „BZ4350“, 2,500 %, fällig 20.03.2051	78	0,05
69 Fannie Mae Pool „AL7093“, 4,000 %, fällig 01.05.2045	66	0,04	76 Ginnie Mae II Pool „CD8312“, 2,500 %, fällig 20.05.2051	64	0,04
19 Fannie Mae Pool „AM8700“, 2,930 %, fällig 01.06.2030	17	0,01	129 Ginnie Mae II Pool „MA1995“, 3,500 %, fällig 20.06.2044	120	0,08
22 Fannie Mae Pool „AS4271“, 4,500 %, fällig 01.01.2045	21	0,01	14 Ginnie Mae II Pool „MA3597“, 3,500 %, fällig 20.04.2046	13	0,01
50 Fannie Mae Pool „AS8951“, 3,500 %, fällig 01.03.2047	45	0,03	14 Ginnie Mae II Pool „MA3736“, 3,500 %, fällig 20.06.2046	13	0,01
17 Fannie Mae Pool „AS9760“, 4,500 %, fällig 01.06.2047	16	0,01	18 Ginnie Mae II Pool „MA4068“, 3,000 %, fällig 20.11.2046	16	0,01
299 Fannie Mae Pool „AX0756“, 3,500 %, fällig 01.07.2044	276	0,18	13 Ginnie Mae II Pool „MA4511“, 4,000 %, fällig 20.06.2047	12	0,01
31 Fannie Mae Pool „BC9077“, 3,500 %, fällig 01.12.2046	28	0,02	4 Ginnie Mae II Pool „MA4836“, 3,000 %, fällig 20.11.2047	3	–
96 Fannie Mae Pool „BJ2544“, 3,000 %, fällig 01.12.2037	87	0,06	14 Ginnie Mae II Pool „MA4838“, 4,000 %, fällig 20.11.2047	14	0,01
97 Fannie Mae Pool „BK7700“, 4,500 %, fällig 01.10.2048	94	0,06	50 Ginnie Mae II Pool „MA5019“, 3,500 %, fällig 20.02.2048	46	0,03
36 Fannie Mae Pool „BM4897“, 3,500 %, fällig 01.12.2046	33	0,02	11 Ginnie Mae II Pool „MA5137“, 4,000 %, fällig 20.04.2048	10	0,01
20 Fannie Mae Pool „BM6898“, 2,149 %, fällig 01.02.2032 *	16	0,01	57 Ginnie Mae II Pool „MA5193“, 4,500 %, fällig 20.05.2048	55	0,04
26 Fannie Mae Pool „BN1623“, 4,500 %, fällig 01.11.2048	25	0,02	20 Ginnie Mae II Pool „MA5265“, 4,500 %, fällig 20.06.2048	19	0,01
33 Fannie Mae Pool „BP1585“, 3,500 %, fällig 01.01.2050	30	0,02	28 Ginnie Mae II Pool „MA5331“, 4,500 %, fällig 20.07.2048	27	0,02
71 Fannie Mae Pool „BR3256“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	59	0,04	10 Ginnie Mae II Pool „MA5467“, 4,500 %, fällig 20.09.2048	9	0,01
76 Fannie Mae Pool „BR3257“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	62	0,04	40 Ginnie Mae II Pool „MA5529“, 4,500 %, fällig 20.10.2048	38	0,02
83 Fannie Mae Pool „BR4393“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	67	0,04	25 Ginnie Mae II Pool „MA5711“, 4,500 %, fällig 20.01.2049	24	0,02
82 Fannie Mae Pool „BT5574“, 2,500 %, fällig 01.08.2051	68	0,04	72 Ginnie Mae II Pool „MA7312“, 2,500 %, fällig 20.04.2051	61	0,04
258 Fannie Mae Pool „BU1030“, 2,000 %, fällig 01.11.2051	208	0,13	236 Ginnie Mae II Pool „MA7590“, 3,000 %, fällig 20.09.2051	208	0,13
46 Fannie Mae Pool „CA2047“, 4,500 %, fällig 01.07.2048	44	0,03	86 Ginnie Mae II Pool „MA7705“, 2,500 %, fällig 20.11.2051	73	0,05
92 Fannie Mae Pool „CA2199“, 4,500 %, fällig 01.08.2048	88	0,06	87 Ginnie Mae II Pool „MA7828“, 3,000 %, fällig 20.01.2052	77	0,05
43 Fannie Mae Pool „CA2482“, 4,500 %, fällig 01.10.2048	41	0,03	92 Ginnie Mae II Pool „MA8197“, 2,500 %, fällig 20.08.2052	78	0,05
270 Fannie Mae Pool „CA6672“, 2,000 %, fällig 01.07.2050	217	0,14	284 Ginnie Mae II Pool „MA8486“, 3,000 %, fällig 20.12.2052	251	0,16
25 Fannie Mae Pool „FM1193“, 3,500 %, fällig 01.06.2049	22	0,01	192 Ginnie Mae II Pool „MA8642“, 2,500 %, fällig 20.02.2053	164	0,11
125 Fannie Mae Pool „FM1578“, 3,500 %, fällig 01.09.2034	119	0,08	500 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500 % ±	425	0,28
76 Fannie Mae Pool „FM1579“, 3,500 %, fällig 01.10.2034	72	0,05	1.200 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,000 % ±	1.055	0,68
145 Fannie Mae Pool „FM1727“, 5,000 %, fällig 01.09.2049	143	0,09	400 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,500 % ±	363	0,24
70 Fannie Mae Pool „FM3215“, 3,500 %, fällig 01.01.2049	63	0,04	600 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,000 % ±	559	0,36
46 Fannie Mae Pool „FM4737“, 3,500 %, fällig 01.09.2050	42	0,03	600 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,500 % ±	572	0,37
264 Fannie Mae Pool „FM7786“, 4,000 %, fällig 01.01.2049	248	0,16	800 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,000 % ±	779	0,50
81 Fannie Mae Pool „FM7900“, 2,500 %, fällig 01.07.2051	68	0,04	500 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,500 % ±	495	0,32
84 Fannie Mae Pool „FM7910“, 2,500 %, fällig 01.07.2051	71	0,05	200 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 6,000 % ±	201	0,13
82 Fannie Mae Pool „FM8864“, 2,500 %, fällig 01.10.2051	69	0,04	100 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 6,500 % ±	101	0,07
608 Fannie Mae Pool „FM9579“, 2,000 %, fällig 01.07.2051	487	0,32	97 Government National Mortgage Association, Series 2022 3, Class IO, 0,640 %, fällig 16.02.2061 *	5	–
178 Fannie Mae Pool „FS0331“, 3,000 %, fällig 01.01.2052	154	0,10	<b>Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 25.9455)</b>	24.785	16,05
88 Fannie Mae Pool „FS0424“, 2,500 %, fällig 01.01.2052	74	0,05	<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 26,29 % (28. Februar 2023: 28,56 %)</b>		
91 Fannie Mae Pool „FS0520“, 3,000 %, fällig 01.02.2052	79	0,05	<b>Belgien – 0,23 % (28. Februar 2023: 0,24 %)</b>		
90 Fannie Mae Pool „FS0523“, 2,500 %, fällig 01.02.2052	76	0,05	260 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, fällig 01.02.2046	242	0,16
90 Fannie Mae Pool „FS2740“, 3,500 %, fällig 01.06.2049	82	0,05	110 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig 01.06.2040	98	0,06
95 Fannie Mae Pool „FS3836“, 4,500 %, fällig 01.01.2053	90	0,06	15 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, fällig 15.04.2048	14	0,01
95 Fannie Mae Pool „FS4454“, 6,000 %, fällig 01.04.2053	96	0,06		354	0,23
294 Fannie Mae Pool „FS5059“, 3,500 %, fällig 01.11.2048	268	0,17	<b>Brasilien – 0,63 % (28. Februar 2023: 0,66 %)</b>		
73 Fannie Mae Pool „MA4158“, 2,000 %, fällig 01.10.2050	58	0,04	230 Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, fällig 01.02.2029	225	0,15
60 Freddie Mac Gold Pool „C91987“, 3,000 %, fällig 01.04.2038	54	0,03	940 Suzano Austria GmbH, Series DM3N, 3,125 %, fällig 15.01.2032	743	0,48
20 Freddie Mac Gold Pool „G67721“, 4,500 %, fällig 01.04.2049	20	0,01		968	0,63
18 Freddie Mac Non Gold Pool „840698“, 2,104 %, fällig 01.03.2047 *	17	0,01	<b>Kanada – 1,06 % (28. Februar 2023: 1,09 %)</b>		
40 Freddie Mac Pool „QA7238“, 3,500 %, fällig 01.02.2050	36	0,02	130 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.01.2028	118	0,07
69 Freddie Mac Pool „QB8604“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	56	0,04	130 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15.02.2029	114	0,07
172 Freddie Mac Pool „QC5830“, 2,500 %, fällig 01.08.2051	144	0,09	EUR 750 Bank of Montreal, 2,750 %, fällig 15.06.2027	783	0,51
80 Freddie Mac Pool „QC6768“, 3,000 %, fällig 01.09.2051	69	0,04	GBP 540 Royal Bank of Canada, 3,625 %, fällig 14.06.2027	629	0,41
90 Freddie Mac Pool „QD6079“, 2,500 %, fällig 01.02.2052	75	0,05		1.644	1,06
35 Freddie Mac Pool „RB5130“, 1,500 %, fällig 01.10.2041	28	0,02	<b>China – 0,01 % (28. Februar 2023: 0,01 %)</b>		
71 Freddie Mac Pool „SD0573“, 2,000 %, fällig 01.04.2051	58	0,04	20 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2,700 %, fällig 01.05.2025	19	0,01
88 Freddie Mac Pool „SD0615“, 4,500 %, fällig 01.01.2051	85	0,05	<b>Dänemark – 0,51 % (28. Februar 2023: 0,54 %)</b>		
82 Freddie Mac Pool „SD0653“, 2,500 %, fällig 01.07.2051	69	0,04	840 Danske Bank A/S, 144A, 4,298 %, fällig 01.04.2028 *	791	0,51
175 Freddie Mac Pool „SD0809“, 3,000 %, fällig 01.01.2052	152	0,10	<b>Frankreich – 1,12 % (28. Februar 2023: 0,92 %)</b>		
344 Freddie Mac Pool „SD1218“, 4,000 %, fällig 01.07.2049	322	0,21	200 BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, fällig 09.06.2026 *	187	0,12
187 Freddie Mac Pool „SD2384“, 6,500 %, fällig 01.02.2053	191	0,12	GBP 300 BNP Paribas SA, 1,875 %, fällig 14.12.2027	318	0,21
97 Freddie Mac Pool „SD2578“, 6,000 %, fällig 01.03.2053	97	0,06			
174 Freddie Mac Pool „SD7548“, 2,500 %, fällig 01.11.2051	146	0,09			
150 Freddie Mac Pool „SD8146“, 2,000 %, fällig 01.05.2051	120	0,08			
62 Freddie Mac Pool „ZA6680“, 4,000 %, fällig 01.04.2049	58	0,04			
60 Freddie Mac Pool „ZS3204“, 5,000 %, fällig 01.06.2041	59	0,04			
117 Freddie Mac Pool „ZS3940“, 4,500 %, fällig 01.06.2038	114	0,07			
34 Freddie Mac Pool „ZS4720“, 4,500 %, fällig 01.05.2047	33	0,02			
49 Ginnie Mae I Pool „783669“, 3,000 %, fällig 15.09.2042	44	0,03			
341 Ginnie Mae I Pool „784571“, 3,500 %, fällig 15.06.2048	318	0,21			

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>Frankreich – (Fortsetzung)</b>					
EUR	1.000	BNP Paribas SA, 0,500 %, fällig 30.05.2028 *	946	0,61	
	210	BNP Paribas SA, 144A, 2,824 %, fällig 26.01.2041	137	0,09	
	200	WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 4,750 %, fällig 17.09.2044	136	0,09	
			1.724	1,12	
<b>Deutschland – 0,53 % (28. Februar 2023: 1,15 %)</b>					
GBP	250	E.ON International Finance BV, 5,625 %, fällig 06.12.2023	316	0,21	
EUR	500	Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG in München, 3,250 %, fällig 26.05.2049 *	500	0,32	
			816	0,53	
<b>Israel – 0,58 % (28. Februar 2023: 0,58 %)</b>					
	30	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	27	0,02	
	200	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,750 %, fällig 01.03.2028	200	0,13	
	720	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, fällig 09.05.2029	667	0,43	
			894	0,58	
<b>Italien – 0,74 % (28. Februar 2023: 0,74 %)</b>					
EUR	1.100	UniCredit SpA, 1,200 %, fällig 20.01.2026 *	1.139	0,74	
<b>Luxemburg – 0,58 % (28. Februar 2023: 0,42 %)</b>					
	330	Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2029	262	0,17	
EUR	620	Logicor Financing Sarl, 1,625 %, fällig 15.07.2027	565	0,36	
EUR	100	Logicor Financing Sarl, 2,000 %, fällig 17.01.2034	71	0,05	
			898	0,58	
<b>Macau – 0,11 % (28. Februar 2023: 0,12 %)</b>					
	200	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 26.08.2028	177	0,11	
<b>Niederlande – 0,81 % (28. Februar 2023: 0,97 %)</b>					
EUR	900	ING Groep NV, 2,500 %, fällig 15.02.2029 *	962	0,62	
	80	Shell International Finance BV, 2,750 %, fällig 06.04.2030	70	0,05	
	200	Shell International Finance BV, 4,375 %, fällig 11.05.2045	174	0,11	
	60	Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06.04.2050	43	0,03	
			1.249	0,81	
<b>Spanien – 0,28 % (28. Februar 2022: 0,00 %)</b>					
EUR	500	Cellnex Finance Co SA, 2,000 %, fällig 15.09.2032	432	0,28	
<b>Schweiz – 1,43 % (28. Februar 2023: 1,41 %)</b>					
EUR	1.470	UBS Group AG, 1,500 %, fällig 30.11.2024	1.577	1,02	
EUR	290	UBS Group AG, 3,250 %, fällig 02.04.2026 *	308	0,20	
EUR	100	UBS Group AG, 1,000 %, fällig 24.06.2027 *	98	0,06	
	250	UBS Group AG, 144A, 4,194 %, fällig 01.04.2031 *	225	0,15	
			2.208	1,43	
<b>Vereinigte Arabische Emirate – 0,48 % (28. Februar 2023: 0,50 %)</b>					
	530	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd, 2,625 %, fällig 31.03.2036	420	0,27	
EUR	400	MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000 %, fällig 10.03.2034	320	0,21	
			740	0,48	
<b>Vereinigtes Königreich – 2,51 % (28. Februar 2023: 2,96 %)</b>					
GBP	670	Aviva Plc, 6,125 %, fällig 14.11.2036 *	840	0,54	
GBP	100	Aviva Plc, 5,125 %, fällig 04.06.2050 *	112	0,07	
	565	HSBC Holdings Plc, 4,250 %, fällig 18.08.2025	545	0,35	
EUR	550	HSBC Holdings Plc, 3,019 %, fällig 15.06.2027 *	575	0,37	
GBP	1.000	Lloyds Bank Plc, 7,625 %, fällig 22.04.2025	1.291	0,84	
EUR	140	Segro Capital Sarl, 1,875 %, fällig 23.03.2030	131	0,09	
	460	Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	385	0,25	
			3.879	2,51	
<b>USA – 14,68 % (28. Februar 2023: 15,12 %)</b>					
	100	3M Co, 3,700 %, fällig 15.04.2050	77	0,05	
EUR	120	AbbVie Inc, 1,500 %, fällig 15.11.2023	129	0,08	
	100	AbbVie Inc, 3,800 %, fällig 15.03.2025	97	0,06	
	80	AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21.11.2029	72	0,05	
	120	AbbVie Inc, 4,875 %, fällig 14.11.2048	111	0,07	
	320	AbbVie Inc, 4,250 %, fällig 21.11.2049	270	0,17	
	80	Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig 22.08.2057	69	0,04	
	40	American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, fällig 15.01.2032	33	0,02	
	150	AT&T Inc, 2,250 %, fällig 01.02.2032	117	0,08	
	184	AT&T Inc, 4,500 %, fällig 09.03.2048	147	0,10	
	34	AT&T Inc, 3,650 %, fällig 15.09.2059	22	0,01	
	580	Ball Corp, 3,125 %, fällig 15.09.2031	470	0,30	
	160	Bank of America Corp, 4,250 %, fällig 22.10.2026	154	0,10	
	945	Bank of America Corp, 2,592 %, fällig 29.04.2031 *	787	0,51	
	610	Bank of America Corp, 5,015 %, fällig 22.07.2033 *	587	0,38	
	27	Becton Dickinson & Co, 3,734 %, fällig 15.12.2024	26	0,02	
	220	BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06.04.2030	203	0,13	
	130	Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, fällig 15.11.2035	99	0,06	
	330	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.01.2034	253	0,16	
	130	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23.07.2025	128	0,08	
	60	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	56	0,04	
	290	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, fällig 30.03.2029	276	0,18	
	140	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, fällig 01.04.2048	118	0,08	
	110	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,250 %, fällig 01.04.2053	87	0,06	
	110	Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, fällig 31.01.2032	91	0,06	
	420	Cigna Group/The, 4,375 %, fällig 15.10.2028	405	0,26	
	230	Cigna Group/The, 3,200 %, fällig 15.03.2040	172	0,11	
	130	Cigna Group/The, 4,900 %, fällig 15.12.2048	116	0,07	
EUR	290	Citigroup Inc, 1,750 %, fällig 28.01.2025	305	0,20	
	130	Citigroup Inc, 5,500 %, fällig 13.09.2025	129	0,08	
	120	Citigroup Inc, 4,600 %, fällig 09.03.2026	117	0,08	
	350	Citigroup Inc, 4,300 %, fällig 20.11.2026	336	0,22	
	260	Citigroup Inc, 4,450 %, fällig 29.09.2027	249	0,16	
	230	Citigroup Inc, 3,785 %, fällig 17.03.2033 *	200	0,13	
	93	Citigroup Inc, 5,300 %, fällig 06.05.2044	85	0,05	
	85	Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 30.07.2045	73	0,05	
	120	Comcast Corp, 4,000 %, fällig 01.03.2048	97	0,06	
	66	Comcast Corp, 3,999 %, fällig 01.11.2049	53	0,03	
	360	Comcast Corp, 2,887 %, fällig 01.11.2051	231	0,15	
	51	Comcast Corp, 4,049 %, fällig 01.11.2052	41	0,03	
	57	Comcast Corp, 2,987 %, fällig 01.11.2063	35	0,02	
	200	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2029	166	0,11	
	360	CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15.11.2031	256	0,17	
	180	CVS Health Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2030	164	0,11	
	200	CVS Health Corp, 2,700 %, fällig 21.08.2040	134	0,09	
	390	CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048	342	0,22	
	40	Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01.12.2029	36	0,02	
	120	DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15.11.2024	112	0,07	
	60	DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	47	0,03	
	70	DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01.06.2029	38	0,02	
	180	Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, fällig 31.01.2030	156	0,10	
	330	Enterprise Products Operating LLC, 5,100 %, fällig 15.02.2045	303	0,20	
	6	EQT Corp, 6,125 %, fällig 01.02.2025	6	–	
	10	Exelon Corp, 5,625 %, fällig 15.06.2035	10	0,01	
	100	Exon Mobil Corp, 3,452 %, fällig 15.04.2051	75	0,05	
	310	Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	242	0,16	
	520	Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13.11.2030	440	0,28	
	20	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	18	0,01	
	70	General Motors Co, 6,600 %, fällig 01.04.2036	70	0,05	
	10	General Motors Co, 5,200 %, fällig 01.04.2045	8	0,01	
	70	General Motors Co, 6,750 %, fällig 01.04.2046	69	0,04	
	150	Gilead Sciences Inc, 4,800 %, fällig 01.04.2044	138	0,09	
	30	Gilead Sciences Inc, 4,750 %, fällig 01.03.2046	27	0,02	
	110	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 01.04.2025	106	0,07	
	620	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,750 %, fällig 01.10.2037	658	0,43	
	300	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, fällig 01.02.2041	317	0,21	
	280	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	258	0,17	
	280	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.12.2028	245	0,16	
EUR	140	Haleon Netherlands Capital BV, 1,750 %, fällig 29.03.2030	134	0,09	
	260	Haleon US Capital LLC, 3,625 %, fällig 24.03.2032	231	0,15	
	340	HCA Inc, 5,000 %, fällig 15.03.2024	338	0,22	
	380	HCA Inc, 5,250 %, fällig 15.06.2026	375	0,24	
	200	HCA Inc, 4,500 %, fällig 15.02.2027	193	0,13	
	130	Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	103	0,07	
	70	Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	51	0,03	
	230	Home Depot Inc/The, 4,950 %, fällig 15.09.2052	220	0,14	
	20	Humana Inc, 2,150 %, fällig 03.02.2032	16	0,01	
	430	Humana Inc, 5,875 %, fällig 01.03.2033	445	0,29	
	70	JPMorgan Chase & Co, 4,125 %, fällig 15.12.2026	67	0,04	
	1.080	JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	906	0,59	
	440	JPMorgan Chase & Co, 2,956 %, fällig 13.05.2031 *	374	0,24	
	280	JPMorgan Chase & Co, 5,717 %, fällig 14.09.2033 *	280	0,18	
	30	McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01.09.2049	23	0,01	
	110	McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	91	0,06	
	29	Medtronic Inc, 4,625 %, fällig 15.03.2045	27	0,02	

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
	40	0,03	EUR	1.070	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, fällig 15.08.2032
	10	0,01	EUR	1.110	Deutscher Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 19.06.2024
	760	0,44			
	290	0,20			
EUR	850	0,58			
	70	0,04			
EUR	380	0,19			
EUR	271	0,14			
	180	0,10			
	10	0,01			
	4	–			
	90	0,05			
	100	0,07			
	40	0,02			
	30	0,02			
	90	0,05			
	240	0,14			
	60	0,03			
	100	0,06			
	150	0,08			
	140	0,06			
	50	0,03			
	80	0,05			
	320	0,18			
	70	0,04			
	440	0,29			
	380	0,19			
	190	0,11			
	50	0,03			
	10	0,01			
	10	0,01			
	90	0,04			
	340	0,20			
	180	0,09			
	220	0,11			
	840	0,51			
	810	0,47			
	22.683	14,68			
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 45.6235)</b>					
	40.615	26,29			
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 55,60 % (28. Februar 2023: 53,61 %)</b>					
<b>Belgien – 0,49 % (28. Februar 2023: 0,56 %)</b>					
EUR	670	0,49			
<b>Brasilien – 1,69 % (28. Februar 2023: 1,50 %)</b>					
BRL	1.000	0,57			
BRL	9.000	1,12			
	2.612	1,69			
<b>Kanada – 2,39 % (28. Februar 2023: 1,63 %)</b>					
CAD	1.640	0,75			
CAD	1.900	0,85			
CAD	1.030	0,43			
CAD	860	0,36			
	3.686	2,39			
<b>Frankreich – 2,86 % (28. Februar 2023: 2,99 %)</b>					
EUR	840	0,59			
EUR	1.670	0,91			
EUR	1.400	0,91			
EUR	670	0,32			
EUR	160	0,13			
	4.411	2,86			
<b>Deutschland – 8,66 % (28. Februar 2023: 2,84 %)</b>					
EUR	640	0,43			
EUR	10.710	6,76			
<b>Europa – 13,380 % (28. Februar 2023: 8,66 %)</b>					
<b>Indonesien – 1,16 % (28. Februar 2023: 1,19 %)</b>					
IDR	23.602.000	1,16			
<b>Italien – 1,12 % (28. Februar 2023: 0,99 %)</b>					
EUR	1.910	1,12			
<b>Japan – 1,67 % (28. Februar 2023: 5,86 %)</b>					
JPY	14.850	0,05			
JPY	485.000	1,67			
<b>Mexiko – 3,82 % (28. Februar 2023: 4,03 %)</b>					
MXN	77.520	2,51			
EUR	360	0,19			
	830	0,50			
	1.180	0,62			
	5.907	3,82			
<b>Niederlande – 0,52 % (28. Februar 2023: 0,51 %)</b>					
EUR	970	0,52			
<b>Polen – 1,35 % (28. Februar 2023: 1,32 %)</b>					
PLN	11.570	1,35			
<b>Südafrika – 1,35 % (28. Februar 2023: 1,55 %)</b>					
ZAR	66.492	1,35			
<b>Südkorea – 1,18 % (28. Februar 2023: 1,23 %)</b>					
KRW	2.533.840	1,18			
<b>Spanien – 0,71 % (28. Februar 2022: 1,44 %)</b>					
EUR	500	0,42			
EUR	520	0,29			
	453	0,29			
	1.091	0,71			
<b>Vereinigte Arabische Emirate – 0,46 % (28. Februar 2023: 0,50 %)</b>					
	890	0,46			
<b>Vereinigtes Königreich – 5,33 % (28. Februar 2023: 5,56 %)</b>					
GBP	4.290	3,51			
GBP	100	0,08			
GBP	1.290	1,01			
GBP	550	0,29			
GBP	490	0,44			
	8.231	5,33			
<b>USA – 20,84 % (28. Februar 2023: 19,91 %)</b>					
	9.130	5,73			
	5.000	3,05			
	3.000	1,80			
	42	0,02			
	9.820	5,81			
	3.680	2,07			
	130	0,08			
	20	0,01			
	2.300	1,15			
	2.110	1,06			
	20	0,01			

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventar
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>		
<b>USA – (Fortsetzung)</b>		
80 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.02.2053	72	0,05
	32.188	20,84
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 95.271\$)</b>	<b>85.881</b>	<b>55,60</b>
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 7,95 % (28. Februar 2023: 7,65 %)</b>		
852 Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	11.973	7,75
2 Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – LM-Klasse US\$ Thesaurierend	310	0,20
<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 12.184\$)</b>	<b>12.283</b>	<b>7,95</b>
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 179.023\$)</b>	<b>163.564</b>	<b>105,89</b>
<b>Inflationsswaps – 0,04 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	61	0,04
<b>Devisenterminkontrakte – 0,61 % (28. Februar 2023: 0,69 %)</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	937	0,61
<b>Futures – 0,26 % (28. Februar 2023: 0,23 %)</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	404	0,26
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>164.966</b>	<b>106,80</b>
<b>Devisenterminkontrakte – -0,84 % (28. Februar 2023: -1,43 %)</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-1.300	-0,84
<b>Futures – -0,16 % (28. Februar 2023: -0,71 %)</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-245	-0,16
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>-1.545</b>	<b>-1,00</b>
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>163.421</b>	<b>105,80</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten</b>	<b>-8.957</b>	<b>-5,80</b>
<b>Gesamtnettovermögen</b>	<b>154.464\$</b>	<b>100,00</b>

- 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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 7.257.000 USD und machten 4,69 % des Nettovermögens aus.
- \* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.
- ± 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 31. August 2023.

### ABKÜRZUNGEN:

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

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	86,82
Organismen für gemeinsame Anlagen	7,05
Finanzderivate	0,80
Sonstige Vermögenswerte	5,33
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

### Aufstellung der Inflationsswaps

Gegenpartei	Prozentsatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	USD – CPI Urban Consumers	08. März 2053	1.490	\$ –
Bank of America Merrill Lynch	EUR – Harmonisierter Verbraucherpreisindex	15. März 2053	2.850	61
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Inflationsswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -\$)				\$ 61
Nicht realisierte Wertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -\$)				–
Nettowertsteigerung aus Inflationsswaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -\$)				\$ 61

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
13. Sep. 2023	Citi	Kauf USD	Verkauf CNH	\$ 286
13. Sep. 2023	Citi	Kauf USD	Verkauf INR	-
13. Sep. 2023	Citi	Kauf CNH	Verkauf USD	-7
13. Sep. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD	Verkauf CNH	69
13. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf USD	Verkauf CNH	54
13. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf USD	Verkauf KRW	34
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf CAD	4
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf CAD	-2
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf EUR	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf EUR	6
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf GBP	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf NZD	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf NZD	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP	Verkauf USD	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf NZD	Verkauf USD	-62
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf CAD	Verkauf USD	-560
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf CAD	Verkauf USD	2
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR	Verkauf USD	-518
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP	Verkauf USD	-
19. Sep. 2023	Goldman Sachs	Kauf JPY	Verkauf USD	-
16. Nov. 2023	BNP Paribas	Kauf USD	Verkauf EUR	103
16. Nov. 2023	BNP Paribas	Kauf USD	Verkauf PLN	-6
16. Nov. 2023	Citi	Kauf USD	Verkauf EUR	43

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)		
16. Nov. 2023	Citi	Kauf	USD	3.726	Verkauf	GBP	2.933	10
16. Nov. 2023	Citi	Kauf	SEK	16.710	Verkauf	USD	1.573	-41
16. Nov. 2023	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.077	Verkauf	CAD	1.438	11
16. Nov. 2023	Goldman Sachs	Kauf	USD	132	Verkauf	EUR	120	1
16. Nov. 2023	Goldman Sachs	Kauf	USD	79	Verkauf	MXN	1.386	-1
16. Nov. 2023	Goldman Sachs	Kauf	JPY	182.572	Verkauf	USD	1.295	-25
16. Nov. 2023	Goldman Sachs	Kauf	NOK	16.400	Verkauf	USD	1.607	-61
16. Nov. 2023	HSBC	Kauf	USD	12.196	Verkauf	EUR	11.098	117
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	USD	1.271	Verkauf	CAD	1.698	13
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	USD	2.981	Verkauf	CNH	21.360	32
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	USD	106	Verkauf	EUR	97	-
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	USD	10.807	Verkauf	GBP	8.508	27
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	AUD	46	Verkauf	USD	31	-1
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	ZAR	2.721	Verkauf	USD	144	-
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	EUR	46	Verkauf	USD	50	-
16. Nov. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	118	Verkauf	CAD	158	1
16. Nov. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	2.957	Verkauf	EUR	2.690	29
16. Nov. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.749	Verkauf	GBP	1.376	5
16. Nov. 2023	Morgan Stanley	Kauf	AUD	1.800	Verkauf	USD	1.186	-16
16. Nov. 2023	UBS	Kauf	USD	9.469	Verkauf	EUR	8.617	90
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 1.011\$)							\$	937
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -2.097\$)								-1.300
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.086\$)							\$	-363

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
Australische 10-jährige Anleihe September 2023	Bank of America Merrill Lynch	18	\$ 1.355	\$ -17
Euro-Bobl Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	9	1.146	7
Euro-Bund Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	62	8.917	89
Euro-Buxl 30 Year Bond Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	-1	-145	-2
Euro-Schatz Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	63	7.206	18
ICE 3 Month SONIA Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	86	25.681	-42
ICE 3 Month SONIA Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch	87	26.009	16
Japanische 10-jährige Anleihe (OSE) September 2023	Bank of America Merrill Lynch	-11	-11.100	84
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	48	5.329	56
U.S. 10 Year Ultra Note Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	-103	-11.959	-177
U.S. 2 Year Note (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	71	14.470	35
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	130	13.900	86
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	-4	-487	-7
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	5	647	13
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 338\$)			\$	404
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.043\$)				-245
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -705\$)			\$	159

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Global Credit Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 84,68 % (28. Februar 2023: 80,76 %)</b>					
<b>Australien – 1,15 % (28. Februar 2023: 1,56 %)</b>					
EUR	140	AusNet Services Holdings Pty Ltd, 1,625 %, fällig 11.03.2081 *	133	0,42	
	190	Glencore Finance Canada Ltd, 6,000 %, fällig 15.11.2041	183	0,58	
	60	Westpac Banking Corp, 2,668 %, fällig 15.11.2035 *	46	0,15	
			362	1,15	
<b>Belgien – 0,02 % (28. Februar 2023: 0,39 %)</b>					
	8	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, fällig 15.04.2048	7	0,02	
<b>Brasilien – 0,20 % (28. Februar 2023: 1,03 %)</b>					
	60	Vale Canada Ltd, 7,200 %, fällig 15.09.2032	63	0,20	
<b>Kolumbien – 0,38 % (28. Februar 2023: 0,25 %)</b>					
	170	Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	120	0,38	
<b>Dänemark – 1,61 % (28. Februar 2023: 2,07 %)</b>					
EUR	140	Coloplast Finance BV, 2,250 %, fällig 19.05.2027	144	0,46	
EUR	150	Danske Bank A/S, 1,375 %, fällig 12.02.2030 *	154	0,49	
EUR	190	Danske Bank A/S, 4,750 %, fällig 21.06.2030 *	208	0,66	
			506	1,61	
<b>Finnland – 1,03 % (28. Februar 2023: 0,67 %)</b>					
EUR	130	Fortum Oyj, 1,625 %, fällig 27.02.2026	133	0,43	
EUR	200	Neste Oyj, 0,750 %, fällig 25.03.2028	190	0,60	
			323	1,03	
<b>Frankreich – 6,92 % (28. Februar 2023: 7,01 %)</b>					
	200	BNP Paribas SA, 4,705 %, fällig 10.01.2025 *	199	0,63	
GBP	100	BNP Paribas SA, 2,000 %, fällig 24.05.2031 *	109	0,35	
	200	BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, unbefristet *	195	0,62	
EUR	200	Bouygues SA, 3,875 %, fällig 17.07.2031	216	0,69	
EUR	200	Eiffage SA, 1,625 %, fällig 14.01.2027	194	0,62	
EUR	200	Electricite de France SA, 1,000 %, fällig 29.11.2033	161	0,51	
EUR	100	Engie SA, 0,500 %, fällig 24.10.2030	87	0,28	
EUR	100	Engie SA, 4,250 %, fällig 11.01.2043	107	0,34	
EUR	310	GELF Bond Issuer I SA, 1,125 %, fällig 18.07.2029	274	0,87	
EUR	190	Orange SA, 5,000 %, unbefristet *	206	0,66	
EUR	200	Suez SACA, 1,875 %, fällig 24.05.2027	202	0,64	
EUR	100	Terega SA, 0,875 %, fällig 17.09.2030	86	0,28	
	200	WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 4,750 %, fällig 17.09.2044	136	0,43	
			2.172	6,92	
<b>Deutschland – 7,16 % (28. Februar 2023: 7,27 %)</b>					
	400	Allianz SE, 3,200 %, unbefristet *	304	0,97	
EUR	200	alstria office REIT-AG, 1,500 %, fällig 23.06.2026	168	0,53	
EUR	100	Amprion GmbH, 3,971 %, fällig 22.09.2032	108	0,34	
	140	Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750 %, fällig 15.06.2030	165	0,53	
EUR	100	enBW International Finance BV, 4,049 %, fällig 22.11.2029	110	0,35	
EUR	200	Hannover Rück SE, 1,125 %, fällig 09.10.2039 *	173	0,55	
EUR	100	Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG in München, 3,250 %, fällig 26.05.2049 *	100	0,32	
EUR	100	Robert Bosch GmbH, 4,000 %, fällig 02.06.2035	109	0,35	
EUR	100	Sirius Real Estate Ltd, 1,125 %, fällig 22.06.2026	93	0,30	
EUR	100	Sirius Real Estate Ltd, 1,750 %, fällig 24.11.2028	82	0,26	
EUR	200	Vier Gas Transport GmbH, 4,625 %, fällig 26.09.2032	225	0,72	
GBP	100	Volkswagen Financial Services NV, 4,250 %, fällig 09.10.2025	122	0,39	
EUR	100	Volkswagen International Finance NV, Series PNC5, 7,500 %, unbefristet *	110	0,35	
EUR	200	Vonovia SE, 0,375 %, fällig 16.06.2027	183	0,58	
EUR	200	ZF Finance GmbH, 2,000 %, fällig 06.05.2027	193	0,62	
			2.245	7,16	
<b>Irland – 1,36 % (28. Februar 2023: 0,64 %)</b>					
	240	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,850 %, fällig 29.10.2041	178	0,57	
EUR	230	CRH SMW Finance DAC, 4,000 %, fällig 11.07.2031	248	0,79	
			426	1,36	
<b>Israel – 0,39 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
EUR	110	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 7,375 %, fällig 15.09.2029	122	0,39	
<b>Italien – 3,24 % (28. Februar 2023: 3,22 %)</b>					
EUR	180	CA Auto Bank SPA/Ireland, 0,500 %, fällig 13.09.2024	188	0,60	
	200	Enel Finance International NV, 144A, 7,750 %, fällig 14.10.2052	229	0,73	
	200	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, fällig 01.06.2032 *	152	0,48	
EUR	100	Terna – Rete Elettrica Nazionale, 2,375 %, unbefristet *	94	0,30	
EUR	340	Unicredit SpA, 2,000 %, fällig 23.09.2029 *	354	1,13	
			1.017	3,24	
<b>Luxemburg – 3,30 % (28. Februar 2023: 2,48 %)</b>					
	110	ArcelorMittal SA, 6,550 %, fällig 29.11.2027	113	0,36	
	10	ArcelorMittal SA, 6,750 %, fällig 01.03.2041	10	0,03	
<b>USA – 32,69 % (28. Februar 2023: 27,84 %)</b>					
GBP	100	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 2,625 %, fällig 20.10.2028	97	0,31	
EUR	170	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,625 %, fällig 20.04.2030	137	0,44	
EUR	150	Logicor Financing Sarl, 3,250 %, fällig 13.11.2028	142	0,46	
EUR	125	Prologis International Funding II SA, 1,750 %, fällig 15.03.2028	123	0,39	
EUR	140	SELP Finance Sarl, 1,500 %, fällig 20.11.2025	142	0,45	
EUR	160	SELP Finance Sarl, 1,500 %, fällig 20.12.2026	157	0,50	
EUR	110	SES SA, 3,500 %, fällig 14.01.2029	113	0,36	
			1.034	3,30	
<b>Niederlande – 2,46 % (28. Februar 2023: 2,39 %)</b>					
EUR	170	CTP NV, 2,125 %, fällig 01.10.2025	170	0,54	
EUR	130	Enexis Holding NV, 3,625 %, fällig 12.06.2034	141	0,45	
EUR	140	Euronext NV, 1,000 %, fällig 18.04.2025	144	0,46	
EUR	200	ING Groep NV, 2,500 %, fällig 15.02.2029 *	214	0,68	
EUR	100	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 1,750 %, fällig 02.04.2027	103	0,33	
			772	2,46	
<b>Portugal – 0,97 % (28. Februar 2023: 0,40 %)</b>					
EUR	200	EDP – Energias de Portugal SA, 1,875 %, fällig 02.08.2081 *	194	0,62	
EUR	100	Floene Energias SA, 4,875 %, fällig 03.07.2028	109	0,35	
			303	0,97	
<b>Singapur – 0,61 % (28. Februar 2023: 0,40 %)</b>					
EUR	200	Cromwell Ereit Lux Finco Sarl, 2,125 %, fällig 19.11.2025	191	0,61	
<b>Spanien – 2,22 % (28. Februar 2023: 3,53 %)</b>					
	200	Banco Santander SA, 5,294 %, fällig 18.08.2027	196	0,63	
EUR	100	Banco Santander SA, 5,750 %, fällig 23.08.2033 *	109	0,34	
GBP	100	CaixaBank SA, 6,875 %, fällig 25.10.2033 *	121	0,39	
EUR	200	Cellnex Telecom SA, 1,875 %, fällig 26.06.2029	186	0,59	
EUR	100	Telefonica Europe BV, 2,376 %, unbefristet *	86	0,27	
			698	2,22	
<b>Schweden – 1,34 % (28. Februar 2023: 1,88 %)</b>					
EUR	140	H&M Finance BV, 0,250 %, fällig 25.08.2029	124	0,40	
EUR	100	Heimstaden AB, 4,250 %, fällig 09.03.2026	57	0,18	
EUR	130	Heimstaden Bostad AB, 3,625 %, unbefristet *	65	0,21	
EUR	160	Svenska Handelsbanken AB, 5,000 %, fällig 16.08.2034 *	173	0,55	
			419	1,34	
<b>Schweiz – 2,81 % (28. Februar 2023: 2,96 %)</b>					
EUR	200	Julius Baer Group Ltd, 6,625 %, unbefristet *	192	0,61	
	270	UBS Group AG, 144A, 1,305 %, fällig 02.02.2027 *	241	0,77	
GBP	200	UBS Group AG, 2,250 %, fällig 09.06.2028 *	218	0,70	
	230	UBS Group AG, 7,000 %, unbefristet *	229	0,73	
			880	2,81	
<b>Vereinigtes Königreich – 14,82 % (28. Februar 2023: 13,41 %)</b>					
GBP	130	Anglian Water Osprey Financing Plc, 2,000 %, fällig 31.07.2028	125	0,40	
GBP	130	Barclays Plc, 1,700 %, fällig 03.11.2026 *	148	0,47	
GBP	210	Barclays Plc, 6,375 %, unbefristet *	235	0,75	
EUR	170	Cadent Finance Plc, 0,750 %, fällig 11.03.2032	141	0,45	
GBP	120	CPUK Finance Ltd, 3,588 %, fällig 28.08.2025	143	0,45	
GBP	160	Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, fällig 07.04.2026	186	0,59	
GBP	100	Gatwick Funding Ltd, 2,500 %, fällig 15.04.2030	103	0,33	
GBP	180	Grainger Plc, 3,000 %, fällig 03.07.2030	179	0,57	
GBP	200	HSBC Holdings Plc, 2,357 %, fällig 18.08.2031 *	159	0,51	
GBP	160	Legal & General Group Plc, 4,500 %, fällig 01.11.2050 *	172	0,55	
GBP	180	Lloyds Banking Group Plc, 1,985 %, fällig 15.12.2031 *	194	0,62	
GBP	200	Lloyds Banking Group Plc, 5,125 %, unbefristet *	232	0,74	
GBP	200	Marston's Issuer Plc, Series B1, 7,819 %, fällig 16.07.2035 *	181	0,58	
GBP	220	NatWest Group Plc, 3,754 %, fällig 01.11.2029 *	210	0,67	
GBP	290	NatWest Group Plc, 4,500 %, unbefristet *	280	0,89	
EUR	100	RELX Finance BV, 3,750 %, fällig 12.06.2031	108	0,35	
EUR	100	Rentokil Initial Finance BV, 3,875 %, fällig 27.06.2027	109	0,35	
EUR	140	Smith & Nephew Plc, 4,565 %, fällig 11.10.2029	155	0,49	
EUR	170	SSE Plc, 4,000 %, unbefristet *	171	0,54	
EUR	270	Standard Chartered Plc, 2,500 %, fällig 09.09.2030 *	277	0,88	
EUR	150	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 0,375 %, fällig 27.07.2029	131	0,42	
GBP	100	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,750 %, fällig 27.04.2030	104	0,33	
EUR	130	Tritax EuroBox Plc, 0,950 %, fällig 02.06.2026	123	0,39	
GBP	190	UNITE Group Plc/The, 3,500 %, fällig 15.10.2028	211	0,67	
GBP	200	Vodafone Group Plc, 8,000 %, fällig 30.08.2086 *	253	0,81	
GBP	100	Whitbread Group Plc, 2,375 %, fällig 31.05.2027	108	0,35	
GBP	100	Whitbread Group Plc, 3,000 %, fällig 31.05.2031	99	0,32	
EUR	100	WPP Finance SA, 4,125 %, fällig 30.05.2028	109	0,35	
			4.646	14,82	
<b>USA – 32,69 % (28. Februar 2023: 27,84 %)</b>					
EUR	190	Abbott Ireland Financing DAC, 0,375 %, fällig 19.11.2027	182	0,58	
	110	AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21.11.2029	99	0,32	

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Global Credit Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert				
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>									
<b>USA – (Fortsetzung)</b>									
200	AbbVie Inc, 4,875 %, fällig 14.11.2048	185	0,59	100	Southwestern Energy Co, 5,375 %, fällig 15.03.2030	94	0,30		
110	Air Lease Corp, 1,875 %, fällig 15.08.2026	98	0,31	40	Targa Resources Corp, 4,200 %, fällig 01.02.2033	35	0,11		
60	Air Lease Corp, 5,300 %, fällig 01.02.2028	59	0,19	40	Targa Resources Corp, 4,950 %, fällig 15.04.2052	33	0,10		
EUR 120	Air Products and Chemicals Inc, 4,000 %, fällig 03.03.2035	131	0,42	130	Texas Instruments Inc, 3,875 %, fällig 15.03.2039	113	0,36		
55	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 20.04.2026	54	0,17	100	Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig 01.07.2038	101	0,32		
150	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.04.2029	144	0,46	50	T-Mobile USA Inc, 5,650 %, fällig 15.01.2053	49	0,16		
50	American Express Co, 3,550 %, unbefristet *	42	0,13	30	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig 01.02.2026	31	0,10		
90	Amgen Inc, 5,250 %, fällig 02.03.2033	90	0,29	19	United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, 4,875 %, fällig 15.01.2026	19	0,06		
50	Amgen Inc, 5,650 %, fällig 02.03.2053	50	0,16	120	United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2026	113	0,36		
30	Antero Resources Corp, 144A, 5,375 %, fällig 01.03.2030	28	0,09	130	UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15.12.2048	114	0,36		
160	Apple Inc, 2,650 %, fällig 11.05.2050	107	0,34	50	Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16.03.2037	49	0,16		
EUR 100	AT&T Inc, Series B, 2,875 %, unbefristet *	101	0,32	120	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 4,125 %, fällig 15.08.2030	105	0,34		
EUR 290	Bank of America Corp, 1,662 %, fällig 25.04.2028 *	288	0,92	110	Warnermedia Holdings Inc, 5,050 %, fällig 15.03.2042	91	0,29		
80	Bank of America Corp, 5,288 %, fällig 25.04.2034 *	78	0,25	210	Wells Fargo & Co, 1,000 %, fällig 02.02.2027	205	0,65		
160	Bank of America Corp, 2,676 %, fällig 19.06.2041 *	110	0,35	150	Wells Fargo & Co, 5,389 %, fällig 24.04.2034 *	146	0,47		
90	Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,200 %, fällig 15.08.2048	78	0,25	GBP 100	Wells Fargo & Co, 4,875 %, fällig 29.11.2035	108	0,35		
120	Boeing Co/The, 3,950 %, fällig 01.08.2059	86	0,27	60	Western Midstream Operating LP, 5,450 %, fällig 01.04.2044	50	0,16		
17	Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029	16	0,05	130	Western Midstream Operating LP, 5,250 %, fällig 01.02.2050	105	0,34		
160	Broadcom Inc, 4,300 %, fällig 15.11.2032	145	0,46	50	Williams Cos Inc/The, 5,300 %, fällig 15.08.2028	50	0,16		
EUR 120	Cargill Inc, 3,875 %, fällig 24.04.2030	130	0,42	90	Williams Cos Inc/The, 5,750 %, fällig 24.06.2044	85	0,27		
100	Centene Corp, 4,625 %, fällig 15.12.2029	92	0,29	20	Williams Cos Inc/The, 3,500 %, fällig 15.10.2051	13	0,04		
80	Charles Schwab Corp/The, Series H, 4,000 %, unbefristet *	61	0,19	140	Workday Inc, 3,800 %, fällig 01.04.2032	124	0,40		
420	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01.06.2041	279	0,89			10.250	32,69		
20	Chevron USA Inc, 3,850 %, fällig 15.01.2028	19	0,06	<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 30.4555)</b>			26.556	84,68	
160	Cigna Group/The, 2,400 %, fällig 15.03.2030	135	0,43	<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 8,56 % (28. Februar 2023: 13,07 %)</b>					
220	Cigna Group/The, 3,400 %, fällig 15.03.2050	154	0,49	<b>Deutschland – 4,50 % (28. Februar 2023: 6,86 %)</b>					
100	Citigroup Inc, 6,174 %, fällig 25.05.2034 *	100	0,32	EUR 100	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,100 %, fällig 15.11.2029	106	0,34		
200	Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	249	0,79	EUR 280	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031	255	0,81		
70	Comcast Corp, 4,950 %, fällig 15.10.2058	65	0,21	EUR 380	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2031	342	1,09		
170	ConocoPhillips Co, 5,550 %, fällig 15.03.2054	171	0,54	EUR 110	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,300 %, fällig 15.02.2033	118	0,38		
80	Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2031	77	0,24	EUR 130	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 05, 4,000 %, fällig 04.01.2037	163	0,52		
150	Coterra Energy Inc, 3,900 %, fällig 15.05.2027	143	0,45	EUR 150	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 2007, 4,250 %, fällig 04.07.2039	197	0,63		
110	CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp, 144A, 3,875 %, fällig 30.06.2028	96	0,31	EUR 110	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 08, 4,750 %, fällig 04.07.2040	154	0,49		
160	CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048	140	0,45	EUR 90	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,250 %, fällig 15.08.2048	75	0,24		
70	DCP Midstream Operating LP, 5,625 %, fällig 15.07.2027	70	0,22			1.410	4,50		
38	Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig 15.01.2030	36	0,11	<b>Indonesien – 0,96 % (28. Februar 2023: 0,63 %)</b>					
130	Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	111	0,36	EUR 350	Internationale Anleihe der indonesischen Regierung, 1,400 %, fällig 30.10.2031	301	0,96		
90	Elevance Health Inc, 3,650 %, fällig 01.12.2027	85	0,27	<b>Mexiko – 1,11 % (28. Februar 2023: 1,10 %)</b>					
40	Energy Transfer LP, 6,500 %, fällig 01.02.2042	40	0,13	420	Internationale mexikanische Staatsanleihe, 3,500 %, fällig 12.02.2034	349	1,11		
130	Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15.02.2078 *	108	0,34	<b>Panama – 0,49 % (28. Februar 2023: 0,33 %)</b>					
40	Exelon Corp, 3,400 %, fällig 15.04.2026	38	0,12	200	Internationale Anleihe der panamesischen Regierung, 2,252 %, fällig 29.09.2032	152	0,49		
50	Fidelity & Guaranty Life Holdings Inc, 5,500 %, fällig 01.05.2025	49	0,16	<b>Vereinigtes Königreich – 1,11 % (28. Februar 2023: 0,54 %)</b>					
EUR 180	Ford Motor Credit Co LLC, 2,386 %, fällig 17.02.2026	184	0,59	GBP 100	United Kingdom Gilt, 0,125 %, fällig 30.01.2026	114	0,36		
EUR 100	General Electric Co, 4,125 %, fällig 19.09.2035	109	0,35	GBP 180	United Kingdom Gilt, 4,125 %, fällig 29.01.2027	223	0,71		
110	General Motors Co, 6,125 %, fällig 01.10.2025	110	0,35	GBP 10	United Kingdom Gilt, 0,125 %, fällig 31.01.2028	11	0,04		
130	General Motors Co, 6,750 %, fällig 01.04.2046	128	0,41			348	1,11		
16	Goldman Sachs Capital II, 6,439 %, unbefristet *	13	0,04	<b>USA – 0,39 % (28. Februar 2023: 3,61 %)</b>					
EUR 170	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,875 %, fällig 03.06.2026	181	0,58	130	United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, fällig 15.05.2033	122	0,39		
110	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,800 %, fällig 15.03.2030	100	0,32	<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 2.9625)</b>					
20	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	18	0,06	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,71 % (28. Februar 2023: 1,21 %)</b>					
EUR 120	Haleon Netherlands Capital BV, 1,750 %, fällig 29.03.2030	114	0,36	222	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	222	0,71		
70	Halliburton Co, 5,000 %, fällig 15.11.2045	63	0,20	<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 2225)</b>					
130	HCA Inc, 3,500 %, fällig 01.09.2030	114	0,36	<b>Stammaktien – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
50	HEICO Corp, 5,250 %, fällig 01.08.2028	50	0,16	<b>Schweiz – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
20	HEICO Corp, 5,350 %, fällig 01.08.2033	20	0,06	680	Credit Suisse Group AG Escrow t	–	–		
100	Humana Inc, 3,125 %, fällig 15.08.2029	89	0,28	<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten –\$)</b>					
90	Humana Inc, 5,875 %, fällig 01.03.2033	93	0,30	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 33.6395)</b>					
20	Intercontinental Exchange Inc, 4,250 %, fällig 21.09.2048	17	0,05	<b>Devisenterminkontrakte – 0,69 % (28. Februar 2023: 0,74 %)</b>					
EUR 500	JPMorgan Chase & Co, 0,389 %, fällig 24.02.2028 *	478	1,53	<b>Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)</b>					
30	Lowe's Cos Inc, 3,000 %, fällig 15.10.2050	19	0,06	<b>Futures – 0,35 % (28. Februar 2023: 0,44 %)</b>					
20	Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 3,375 %, fällig 15.04.2050	14	0,04	<b>Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)</b>					
100	McDonald's Corp, 3,700 %, fällig 30.01.2026	97	0,31	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					
270	McDonald's Corp, 5,450 %, fällig 14.08.2053	270	0,86	<b>29.786</b>					
150	Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17.03.2052	106	0,34	<b>94,99</b>					
EUR 340	Morgan Stanley, 4,656 %, fällig 02.03.2029 *	373	1,19						
50	Morgan Stanley, 5,948 %, fällig 19.01.2038 *	49	0,16						
100	MPLX LP, 4,500 %, fällig 15.04.2038	85	0,27						
EUR 130	Netflix Inc, 3,625 %, fällig 15.06.2030	137	0,44						
60	NRG Energy Inc, 144A, 2,450 %, fällig 02.12.2027	51	0,16						
50	Nuveen LLC, 4,000 %, fällig 01.11.2028	47	0,15						
100	Olin Corp, 5,000 %, fällig 01.02.2030	92	0,29						
50	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,750 %, fällig 19.05.2033	49	0,16						
110	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 5,300 %, fällig 19.05.2053	110	0,35						
EUR 170	Prologis Euro Finance LLC, 0,625 %, fällig 10.09.2031	140	0,45						
120	Prudential Financial Inc, 3,000 %, fällig 10.03.2040	89	0,28						
100	Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.02.2030	90	0,29						
120	Service Corp International/US, 3,375 %, fällig 15.08.2030	99	0,32						

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Western Asset Global Credit Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Credit Default Swaps – -0,29 % (28. Februar 2023: -0,17 %)</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-92	-0,29
<b>Devisenterminkontrakte – -0,25 % (28. Februar 2023: -0,19 %)</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-79	-0,25
<b>Futures – -0,13 % (28. Februar 2023: -0,08 %)</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-41	-0,13
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>-212</b>	<b>-0,67</b>
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>29.574</b>	<b>94,32</b>
<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>	<b>1.785</b>	<b>5,68</b>
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>31.359\$</b>	<b>100,00</b>

### ABKÜRZUNGEN:

Unbefristet	– Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	91,92
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,70
Finanzderivate	1,02
Sonstige Vermögenswerte	6,36
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

– 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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.484.000 USD und machten 4,72 % des Nettovermögens aus.

\* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.

† Nicht liquide.

### Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit – Kauf/Verkauf	Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % – Kauf		20. Juni 2028	4.200	\$ -65
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000 % – Kauf		20. Juni 2028	1.940	-27
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -\$)					\$ -
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -76\$)					-92
Nettowertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tsd.): -76\$)					\$ -92

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 63	Verkauf EUR 57	\$ -	
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD -	Verkauf GBP -	-	
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 15	Verkauf USD 19	-	
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 4.386	Verkauf USD 4.825	-65	
16. Nov. 2023	BNP Paribas	Kauf USD 550	Verkauf EUR 500	6	
16. Nov. 2023	BNP Paribas	Kauf USD 48	Verkauf GBP 38	-	
16. Nov. 2023	BNP Paribas	Kauf USD 63	Verkauf JPY 9.130	-1	
16. Nov. 2023	BNP Paribas	Kauf JPY 3.867	Verkauf USD 28	-1	
16. Nov. 2023	Citi	Kauf USD 665	Verkauf EUR 606	6	
16. Nov. 2023	Citi	Kauf USD 360	Verkauf GBP 284	1	
16. Nov. 2023	Citi	Kauf EUR 50	Verkauf USD 55	-1	
16. Nov. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 6.743	Verkauf EUR 6.135	66	
16. Nov. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 392	Verkauf GBP 309	1	
16. Nov. 2023	Goldman Sachs	Kauf EUR 343	Verkauf USD 380	-6	
16. Nov. 2023	Goldman Sachs	Kauf JPY 33.510	Verkauf USD 238	-5	
16. Nov. 2023	HSBC	Kauf USD 66	Verkauf EUR 60	1	
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf USD 4.385	Verkauf EUR 3.989	43	
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf USD 2.481	Verkauf GBP 1.953	6	
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf EUR 276	Verkauf USD 300	-	
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf GBP 556	Verkauf USD 700	5	
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf EUR 2.954	Verkauf USD 3.200	16	
16. Nov. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 1.875	Verkauf EUR 1.706	18	
16. Nov. 2023	Royal Bank of Canada	Kauf USD 811	Verkauf EUR 738	8	
16. Nov. 2023	UBS	Kauf USD 3.697	Verkauf EUR 3.364	35	
16. Nov. 2023	UBS	Kauf USD 1.661	Verkauf GBP 1.307	4	
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 343\$)					\$ 216
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -90\$)					-79
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 253\$)					\$ 137

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Global Credit Fund<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
10 Year Mini Japanese Government Bond September 2023	Bank of America Merrill Lynch	-5	\$ -505	\$ 3
Euro-Bobl Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	-21	-2.675	-15
Euro-BTP Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	-10	-1.252	-10
Euro-Bund Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	4	575	6
Japanische 10-jährige Anleihe (OSE) September 2023	Bank of America Merrill Lynch	-2	-2.018	15
U.S. 10 Year Note (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	20	2.221	23
U.S. 5 Year Note (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	24	2.566	15
U.S. Long Bond (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	-9	-1.095	-16
U.S. Ultra Bond (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	16	2.071	48
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 202\$)				\$ 110
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -34\$)				-41
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 168\$)				\$ 69

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere – 5,94 % (28. Februar 2023: 4,57 %)</b>					
11.500	11.079	0,73	INR 500.000	6.114	0,41
Apidos CLO XXXVI, Serie 2021 36A, Klasse D, 144A, 8,488 %, fällig 20.07.2034 *			INR 250.000	3.048	0,20
Apidos CLO XXXVIII, Serie 2021 38A, Klasse D, 144A, 8,545 %, fällig 21.01.2034 *			23.01.2025		
9.070	8.667	0,57	INR 500.000	6.107	0,40
Bain Capital Credit CLO 2021-4 Ltd, Serie 2021 4A, Klasse D, 144A, 8,688 %, fällig 20.10.2034 *			REC Ltd, Serie 133, 8,300 %, fällig 10.04.2025		
13.950	13.081	0,87	<b>Irland – 0,03 % (28. Februar 2023: 0,02 %)</b>		
Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd 2016-1, Serie 2016 1A, Klasse AA, 144A, 2,487 %, fällig 16.12.2041			490 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30.01.2032		
6.000	5.816	0,38	<b>Israel – 3,29 % (28. Februar 2023: 4,11 %)</b>		
Canyon Capital CLO 2017-1 Ltd, Serie 2017 1A, Klasse DR, 144A, 8,570 %, fällig 15.07.2030 *			8.027 Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, fällig 01.02.2036		
2.829	2.547	0,17	3.805 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026		
CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Serie 2006-I, Serie 2006 I, Klasse 2A, 5,565 %, fällig 15.01.2037 *			310 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, fällig 09.05.2027		
7.153	5.684	0,38	2.110 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,750 %, fällig 01.03.2028		
Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Serie 2018 4, Klasse A, 4,060 %, fällig 15.11.2030			2.810 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, fällig 09.05.2029		
2.123	1.575	0,10	7.400 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, fällig 15.09.2031		
Loanpal Solar Loan Ltd, Serie 2020 3GS, Klasse B, 144A, 3,450 %, fällig 20.12.2047			39.981 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,100 %, fällig 01.10.2046		
5.375	5.148	0,34	26.090		
Nassau 2021-I Ltd, Serie 2021 IA, Klasse D, 144A, 9,320 %, fällig 26.08.2034 *			49.791		
5.110	5.017	0,33	<b>Italien – 0,19 % (28. Februar 2023: 0,13 %)</b>		
Ocean Trails Clo X, Serie 2020 10A, Klasse DR, 144A, 9,290 %, fällig 15.10.2034 *			2.950 Enel Finance International NV, 144A, 6,000 %, fällig 07.10.2039		
2.350	2.351	0,16	<b>Luxemburg – 0,01 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
Ocean Trails CLO XIV Ltd, Serie 2023 14A, Klasse D, 144A, 11,146 %, fällig 20.01.2035 *			220 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2029		
5.295	4.721	0,31	<b>Macau – 1,54 % (28. Februar 2023: 1,08 %)</b>		
Stonepeak 2021-1 ABS, Serie 2021 1A, Klasse A, 144A, 2,675 %, fällig 28.02.2033			10.380 Sands China Ltd, 5,375 %, fällig 08.08.2025		
7.200	6.614	0,44	3.462 Sands China Ltd, 2,800 %, fällig 08.03.2027		
Venture XXVI CLO Ltd, Serie 2017 26A, Klasse D, 144A, 9,838 %, fällig 20.01.2029 *			1.540 Sands China Ltd, 3,100 %, fällig 08.03.2029		
6.000	5.586	0,37	3.570 Wynn Macau Ltd, 144A, 4,875 %, fällig 01.10.2024		
Vibrant Clo VII Ltd, Serie 2017 7A, Klasse C, 144A, 9,188 %, fällig 15.09.2030 *			5.750 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 15.01.2026		
<b>Summe forderungsbesicherten Wertpapiere (Anschaffungskosten: 96.277 USD)</b>			<b>23.237</b>		
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 8,87 % (28. Februar 2023: 0,91 %)</b>			<b>1,54</b>		
10.400	10.150	0,67	<b>Malaysia – 0,52 % (28. Februar 2023: 0,39 %)</b>		
Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Serie 2021 R03, Klasse 1M2, 144A, 6,938 %, fällig 25.12.2041 *			11.920 Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, fällig 19.08.2050		
16.900	16.688	1,10	<b>Mexiko – 0,41 % (28. Februar 2023: 0,43 %)</b>		
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,500 % ±			3.810 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,625 %, unbefristet *		
36.500	36.598	2,42	4.350 Petroleos Mexicanos, 6,375 %, fällig 23.01.2045		
Fannie Mae Pool „CA0907“, 3,500 %, fällig 12.01.2047			6.199		
7.870	7.712	0,51	<b>Supranational – 0,53 % (28. Februar 2023: 0,37 %)</b>		
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Serie 2021 DNA6, Klasse M2, 144A, 6,788 %, fällig 25.10.2041 *			IDR 127.100.000 European Bank for Reconstruction & Development, 5,000 %, fällig 06.10.2026		
40.700	40.290	2,67	<b>Schweden – 0,23 % (28. Februar 2023: 0,18 %)</b>		
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,500 % ±			4.400 Svenska Handelsbanken AB, 4,750 %, unbefristet *		
21.100	21.170	1,40	<b>Schweiz – 0,75 % (28. Februar 2023: 2,18 %)</b>		
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 6,000 % ±			4.540 UBS Group AG, 144A, 9,016 %, fällig 15.11.2033 *		
1.167	1.114	0,08	6.160 UBS Group AG, 6,875 %, unbefristet *		
MortgageIT Trust 2005-3, Serie 2005 3, Klasse A1, 6,029 %, fällig 25.08.2035 *			11.296		
400	356	0,02	<b>Vereinigte Arabische Emirate – 0,44 % (28. Februar 2023: 0,37 %)</b>		
New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Serie 2021 NQM2R, Klasse A3, 144A, 1,353 %, fällig 25.10.2058 *			8.460 MDGH GMTN RSC Ltd, 3,950 %, fällig 21.05.2050		
<b>Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten: 134.164 USD)</b>			<b>6.670</b>		
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 40,36 % (28. Februar 2023: 40,30 %)</b>			<b>0,44</b>		
<b>Bermudas – 0,88 % (28. Februar 2023: 0,61 %)</b>			<b>Vereinigtes Königreich – 0,69 % (28. Februar 2023: 0,65 %)</b>		
14.150	13.376	0,88	3.760 Barclays Plc, 7,750 %, unbefristet *		
Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, fällig 15.10.2025			2.290 BAT Capital Corp, 4,540 %, fällig 15.08.2047		
<b>Brasilien – 0,37 % (28. Februar 2023: 0,38 %)</b>			2.040 Lloyds Banking Group Plc, 7,500 %, unbefristet *		
1.780	1.769	0,12	270 Reynolds American Inc, 6,150 %, fällig 15.09.2043		
Petrobras Global Finance BV, 5,999 %, fällig 27.01.2028			700 Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2029		
4.380	3.847	0,25	2.330 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,250 %, fällig 31.01.2031		
Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig 05.06.2115			210 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031		
			10.399		
			<b>USA – 26,83 % (28. Februar 2023: 26,93 %)</b>		
			520 Altria Group Inc, 2,450 %, fällig 04.02.2032		
			1.720 Altria Group Inc, 5,950 %, fällig 14.02.2049		
			2.395 Altria Group Inc, 6,200 %, fällig 14.02.2059		
			557 Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig 22.08.2057		
			483		
			0,03		
<b>Kanada – 0,29 % (28. Februar 2023: 0,20 %)</b>					
260	262	0,01			
Toronto-Dominion Bank/The, 8,125 %, fällig 31.10.2082 *					
4.430	4.200	0,28			
Yamana Gold Inc, 4,625 %, fällig 15.12.2027					
<b>Kolumbien – 0,45 % (28. Februar 2023: 0,47 %)</b>					
4.130	4.004	0,26			
Ecopetrol SA, 5,375 %, fällig 26.06.2026					
2.770	2.810	0,19			
Ecopetrol SA, 8,875 %, fällig 13.01.2033					
<b>Frankreich – 0,89 % (28. Februar 2023: 0,78 %)</b>					
2.260	1.696	0,11			
Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, fällig 15.01.2028					
400	371	0,03			
BNP Paribas SA, 144A, 7,000 %, unbefristet *					
200	207	0,01			
BNP Paribas SA, 144A, 9,250 %, unbefristet *					
5.420	5.417	0,36			
Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, unbefristet *					
4.830	5.807	0,38			
Credit Agricole SA, 7,500 %, unbefristet *					
<b>Indien – 1,42 % (28. Februar 2023: 1,00 %)</b>					
INR 500.000	6.146	0,41			
NTPC Ltd, Serie 53, 9,170 %, fällig 22.09.2024					

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
1.830 Amazon.com Inc, 2,700 %, fällig 03.06.2060	1.132	0,07	730 EQT Corp, 7,000 %, fällig 01.02.2030	765	0,05
12.480 Amazon.com Inc, 4,100 %, fällig 13.04.2062	10.364	0,69	1.510 EQT Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15.05.2031	1.306	0,09
18.226 Apache Corp, 5,100 %, fällig 01.09.2040	15.171	1,00	90 FirstEnergy Corp, Serie C, 5,100 %, fällig 15.07.2047	78	–
140 Apache Corp, 7,375 %, fällig 15.08.2047	135	0,01	360 Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	281	0,02
1.933 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	1.658	0,11	5.500 Ford Motor Co, 6,100 %, fällig 19.08.2032	5.260	0,35
4.500 BAC Capital Trust XIV, Serie G, 5,952 %, unbefristet *	3.562	0,24	200 Ford Motor Credit Co LLC, 3,375 %, fällig 13.11.2025	187	0,01
19.930 Bank of America Corp, Serie FF, 5,875 %, unbefristet *	18.418	1,22	840 Ford Motor Credit Co LLC, 4,389 %, fällig 08.01.2026	795	0,05
1.719 Bank of America Corp, Serie AA, 6,100 %, unbefristet *	1.694	0,11	200 Ford Motor Credit Co LLC, 4,542 %, fällig 01.08.2026	189	0,01
210 Bank of America Corp, Serie X, 6,250 %, unbefristet *	209	0,01	200 Ford Motor Credit Co LLC, 2,700 %, fällig 10.08.2026	179	0,01
1.300 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.11.2025	1.172	0,08	4.120 Ford Motor Credit Co LLC, 4,271 %, fällig 09.01.2027	3.813	0,25
2.978 Bery Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	2.867	0,19	200 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, fällig 10.02.2029	165	0,01
2.510 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, fällig 15.12.2025	2.520	0,17	760 Ford Motor Credit Co LLC, 5,113 %, fällig 03.05.2029	700	0,05
2.050 Boeing Co/The, 3,250 %, fällig 01.02.2035	1.648	0,11	620 Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, fällig 01.08.2030	574	0,04
780 Boeing Co/The, 3,550 %, fällig 01.03.2038	599	0,04	675 Goldman Sachs Capital II, 6,439 %, unbefristet *	544	0,04
1.130 Boeing Co/The, 5,805 %, fällig 01.05.2050	1.101	0,07	4.620 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,750 %, fällig 01.10.2037	4.902	0,32
992 Boeing Co/The, 5,930 %, fällig 01.05.2060	959	0,06	1.420 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	1.306	0,09
130 Builders FirstSource Inc, 144A, 4,250 %, fällig 01.02.2032	111	0,01	300 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.12.2028	262	0,02
2.320 California Institute of Technology, 3,650 %, fällig 01.09.2119	1.508	0,10	2.440 Hackensack Meridian Health Inc, 4,211 %, fällig 01.07.2048	2.073	0,14
430 Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, fällig 15.01.2035	356	0,02	610 HCA Inc, 3,500 %, fällig 01.09.2030	533	0,04
5.250 Carnival Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01.05.2029	4.745	0,31	4.401 HCA Inc, 7,500 %, fällig 15.11.2095	4.855	0,32
7.320 Carnival Corp, 144A, 10,500 %, fällig 01.06.2030	7.803	0,52	6.290 ILFC E-Capital Trust I, 144A, 7,064 %, fällig 21.12.2065 *	4.566	0,30
320 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, fällig 01.02.2032	265	0,02	1.089 Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,500 %, fällig 01.09.2039	1.098	0,07
2.100 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	1.780	0,12	400 Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,550 %, fällig 15.09.2040	398	0,03
540 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, fällig 01.03.2050	400	0,03	1.180 Kraft Heinz Foods Co, 4,375 %, fällig 01.06.2046	977	0,06
780 Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 5,125 %, fällig 30.06.2027	772	0,05	2.840 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08.08.2024	2.751	0,18
700 Cheniere Energy Inc, 4,625 %, fällig 15.10.2028	660	0,04	610 Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, fällig 25.06.2025	576	0,04
800 Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, fällig 31.01.2032	662	0,04	1.670 Las Vegas Sands Corp, 3,500 %, fällig 18.08.2026	1.550	0,10
6.095 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	7.593	0,50	1.392 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	1.389	0,09
11.765 Citigroup Inc, Serie P, 5,950 %, unbefristet *	11.358	0,75	860 MPLX LP, 5,500 %, fällig 15.02.2049	767	0,05
15.510 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,544 %, fällig 15.11.2053	15.871	1,05	2.490 Northern Oil and Gas Inc, 144A, 8,125 %, fällig 01.03.2028	2.498	0,16
1.019 CommonSpirit Health, 4,350 %, fällig 01.11.2042	852	0,06	6.760 Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, fällig 01.09.2030	6.986	0,46
960 CommonSpirit Health, 3,817 %, fällig 01.10.2049	721	0,05	4.070 Occidental Petroleum Corp, 6,125 %, fällig 01.01.2031	4.105	0,27
330 CommScope Inc, 144A, 4,750 %, fällig 01.09.2029	246	0,02	5.220 Occidental Petroleum Corp, 4,300 %, fällig 15.08.2039	3.992	0,26
900 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2031	861	0,06	11.725 Occidental Petroleum Corp, 4,500 %, fällig 15.07.2044	8.542	0,56
3.290 Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, fällig 01.06.2044	2.526	0,17	9.150 Occidental Petroleum Corp, 4,625 %, fällig 15.06.2045	5.447	0,36
5.110 CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2029	4.229	0,28	8.980 Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, fällig 15.03.2046	9.251	0,61
2.150 CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2030	1.191	0,08	4.520 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.04.2046	3.473	0,23
3.390 CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig 01.12.2030	2.420	0,16	2.360 Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, fällig 15.02.2047	1.630	0,11
2.405 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig 03.11.2036	2.457	0,16	16.140 Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, fällig 15.03.2048	11.889	0,79
1.160 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,750 %, fällig 15.09.2037	1.226	0,08	2.572 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.08.2049	1.842	0,12
2.640 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	2.719	0,18	890 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig 01.08.2040	598	0,04
264 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 4,500 %, fällig 20.10.2025	258	0,02	2.280 Plains All American Pipeline LP, Serie B, 9,736 %, unbefristet *	2.103	0,14
2.264 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 20.10.2025	2.214	0,15	2.180 Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 6,700 %, fällig 15.05.2036	2.164	0,14
354 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 4,750 %, fällig 20.10.2028	340	0,02	4.800 Range Resources Corp, 8,250 %, fällig 15.01.2029	4.988	0,33
2.370 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 20.10.2028	2.277	0,15	6.910 Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2040	6.245	0,41
866 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15.12.2025	871	0,06	7.540 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 15.07.2027	7.102	0,47
1.736 Devon Energy Corp, 5,250 %, fällig 15.10.2027	1.723	0,11	670 Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig 01.02.2032	594	0,04
1.670 Devon Energy Corp, 5,875 %, fällig 15.06.2028	1.673	0,11	2.262 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025	2.267	0,15
1.436 Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig 15.01.2030	1.345	0,09	560 Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	668	0,04
1.690 Devon Energy Corp, 7,875 %, fällig 30.09.2031	1.907	0,13	210 Sprint LLC, 7,875 %, fällig 15.09.2023	210	0,01
1.440 Devon Energy Corp, 7,950 %, fällig 15.04.2032	1.636	0,11	1.530 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500 %, fällig 01.03.2030	1.468	0,10
805 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	690	0,05	360 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig 01.02.2031	331	0,02
3.720 Dignity Health, 5,267 %, fällig 01.11.2064	3.344	0,22	280 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, fällig 15.01.2032	242	0,02
170 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, fällig 01.12.2026	144	0,01	11.910 The Vanguard Group Inc, 3,050 %, fällig 22.08.2050 t=	7.340	0,49
90 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	70	–	1.300 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig 01.07.2038	1.318	0,09
1.220 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01.06.2029	661	0,04	120 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15.02.2026	111	0,01
1.530 Energy Transfer LP, 6,850 %, fällig 15.02.2040	1.530	0,10	2.100 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.02.2029	1.820	0,12
2.135 Energy Transfer LP, 6,100 %, fällig 15.02.2042	2.014	0,13	90 T-Mobile USA Inc, 3,375 %, fällig 15.04.2029	81	0,01
412 Energy Transfer LP, 5,400 %, fällig 01.10.2047	355	0,02	200 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2031	175	0,01
410 Energy Transfer LP, 6,000 %, fällig 15.06.2048	379	0,02	5.160 Toll Road Investors Partnership II LP, 144A, Nullkupon, fällig 15.02.2024	4.997	0,33
730 Energy Transfer LP, 6,250 %, fällig 15.04.2049	700	0,05	2.100 Toll Road Investors Partnership II LP, 144A, Nullkupon, fällig 15.02.2038	760	0,05
4.018 Energy Transfer LP, Serie H, 6,500 %, unbefristet *	3.675	0,24	9.590 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2026	9.047	0,60
12.990 Energy Transfer LP, Serie B, 6,625 %, unbefristet *	10.478	0,69	340 United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.02.2031	291	0,02
11.260 Energy Transfer LP, Serie F, 6,750 %, unbefristet *	10.380	0,69	5.130 Warnermedia Holdings Inc, 5,141 %, fällig 15.03.2052	4.092	0,27
8.650 Energy Transfer LP, Serie G, 7,125 %, unbefristet *	7.676	0,51	6.590 Warnermedia Holdings Inc, 5,391 %, fällig 15.03.2062	5.235	0,35
828 Enterprise Products Operating LLC, 6,125 %, fällig 15.10.2039	861	0,06	1.926 Wells Fargo & Co, Serie U, 5,875 %, unbefristet *	1.914	0,13
1 Enterprise Products Operating LLC, 6,450 %, fällig 01.09.2040	1	–	1.630 Wesleyan University, 4,781 %, fällig 01.07.2116	1.298	0,09
1.670 Enterprise Products Operating LLC, 5,100 %, fällig 15.02.2045	1.534	0,10	2.530 Western Midstream Operating LP, 3,950 %, fällig 01.06.2025	2.444	0,16
111 EQT Corp, 6,125 %, fällig 01.02.2025	111	0,01	2.770 Western Midstream Operating LP, 4,500 %, fällig 01.03.2028	2.609	0,17
510 EQT Corp, 144A, 3,125 %, fällig 15.05.2026	475	0,03	5.274 Western Midstream Operating LP, 5,450 %, fällig 01.04.2044	4.436	0,29
			6.980 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig 15.08.2048	5.813	0,38
			1.330 Western Midstream Operating LP, 5,250 %, fällig 01.02.2050	1.078	0,07

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
130 Williams Cos Inc/The, 3,750 %, fällig 15.06.2027	122	0,01	IDR 187.046.000 Indonesien Treasury Bond, Serie FR72, 8,250 %, fällig 15.05.2036	13.957	0,92
2.790 Williams Cos Inc/The, Serie A, 7,500 %, fällig 15.01.2031	3.057	0,20	IDR 75.986.000 Indonesien Treasury Bond, Serie FR92, 7,125 %, fällig 15.06.2042	5.179	0,34
3.400 Williams Cos Inc/The, 8,750 %, fällig 15.03.2032	3.986	0,26	IDR 120.448.000 Indonesien Treasury Bond, Serie FR76, 7,375 %, fällig 15.05.2048	8.484	0,56
1.770 Williams Cos Inc/The, 6,300 %, fällig 15.04.2040	1.816	0,12		111.860	7,40
665 Williams Cos Inc/The, 5,100 %, fällig 15.09.2045	587	0,04	<b>Kenia – 0,22 % (28. Februar 2023: 0,22 %)</b>		
2.070 Willis-Knighton Medical Center, Serie 2018, 4,813 %, fällig 01.09.2048	1.768	0,12	3.870 Internationale Staatsanleihe der Republik Kenia, 7,250 %, fällig 28.02.2028	3.293	0,22
7.313 XPO CNW Inc, 6,700 %, fällig 01.05.2034	7.277	0,48	<b>Mexiko – 5,99 % (28. Februar 2023: 5,39 %)</b>		
	405.718	26,83	MXN 1.344.674 Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	67.399	4,46
<b>Sambia – 0,60 % (28. Februar 2023: 0,01 %)</b>					
220 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2027	215	0,02	MXN 453.610 Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	23.148	1,53
8.640 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig 01.06.2031	8.803	0,58		90.547	5,99
	9.018	0,60	<b>Nigeria – 0,18 % (28. Februar 2023: 0,14 %)</b>		
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 686.474 USD)</b>					
	610.374	40,36	3.240 Internationale Anleihe der nigerianischen Regierung, 6,125 %, fällig 28.09.2028	2.682	0,18
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 40,49 % (28. Februar 2023: 40,57 %)</b>					
<b>Angola – 0,20 % (28. Februar 2023: 0,17 %)</b>					
2.000 Internationale Anleihe der Regierung von Angola, 8,250 %, fällig 09.05.2028	1.754	0,12	<b>Polen – 3,56 % (28. Februar 2023: 2,62 %)</b>		
1.450 Internationale Anleihe der Regierung von Angola, 144A, 8,750 %, fällig 14.04.2032	1.196	0,08	298.370 Staatsanleihe der Republik Polen, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	53.849	3,56
	2.950	0,20	<b>Russland – 1,51 % (28. Februar 2023: 0,25 %)</b>		
<b>Australien – 0,63 % (28. Februar 2023: 0,74 %)</b>					
AUD 18.430 Australische Staatsanleihe, Serie 150, 3,000 %, fällig 21.03.2047	9.494	0,63	RUB 354.791 Russische Föderale Anleihe – OFZ, 0,000 %, fällig 03.02.2027†y	1.110	0,07
<b>Brasilien – 1,32 % (28. Februar 2023: 1,07 %)</b>					
BRL 21.530 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, fällig 01.01.2027	4.304	0,28	RUB 1.685.880 Russische Föderale Anleihe – OFZ, 0,000 %, fällig 23.05.2029†y	5.275	0,35
BRL 81.647 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, fällig 01.01.2031	15.710	1,04	RUB 287.190 Russische Föderale Anleihe – OFZ, 0,000 %, fällig 10.04.2030†y	899	0,06
	20.014	1,32	RUB 4.428.300 Russische Föderale Anleihe – OFZ, 0,000 %, fällig 10.05.2034†y	11.778	0,78
<b>Elfenbeinküste – 1,15 % (28. Februar 2023: 1,01 %)</b>					
EUR 4.020 Internationale Staatsanleihe der Elfenbeinküste, 144A, 4,875 %, fällig 30.01.2032	3.369	0,22	RUB 1.407.660 Russische Föderale Anleihe – OFZ, 0,000 %, fällig 16.03.2039†y	3.744	0,25
EUR 4.010 Internationale Staatsanleihe der Elfenbeinküste, 144A, 4,875 %, fällig 30.01.2032	3.360	0,22		22.806	1,51
590 Internationale Staatsanleihe der Elfenbeinküste, 144A, 5,750 %, fällig 31.12.2032	536	0,04	<b>Südafrika – 3,03 % (28. Februar 2023: 1,46 %)</b>		
7.540 Internationale Staatsanleihe der Elfenbeinküste, 144A, 6,125 %, fällig 15.06.2033	6.472	0,43	ZAR 1.101.930 Staatsanleihe der Republik Südafrika, Serie R209, 6,250 %, fällig 31.03.2036	37.388	2,47
4.164 Internationale Staatsanleihe der Elfenbeinküste, 144A, 6,125 %, fällig 15.06.2033	3.574	0,24	ZAR 271.600 Staatsanleihe der Republik Südafrika, Serie R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	8.488	0,56
	17.311	1,15		45.876	3,03
<b>Dominikanische Republik – 0,35 % (28. Februar 2023: 0,35 %)</b>					
6.920 Internationale Anleihe der Dominikanischen Republik, 144A, 5,875 %, fällig 30.01.2060	5.336	0,35	<b>USA – 5,82 % (28. Februar 2023: 14,05 %)</b>		
<b>Ägypten – 0,28 % (28. Februar 2023: 0,24 %)</b>					
EGP 22.000 Ägyptische Staatsanleihe, Serie 7YR, 18,400 %, fällig 30.05.2024	679	0,04	1.820 Morongo Band of Mission Indians/The, 144A, 7,000 %, fällig 01.10.2039	1.895	0,13
4.620 Internationale Staatsanleihe von Ägypten, 5,250 %, fällig 06.10.2025	3.592	0,24	3.500 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.05.2043	3.256	0,22
	4.271	0,28	11.250 United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 15.08.2043	11.222	0,74
<b>Ungarn – 1,32 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
HUF 2.116.280 Staatsanleihe von Ungarn, Serie 25/C, 1,000 %, fällig 26.11.2025	5.151	0,34	1.320 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2049	1.048	0,07
HUF 6.112.350 Staatsanleihe von Ungarn, Serie 26/E, 1,500 %, fällig 22.04.2026	14.782	0,98	2.570 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051	1.580	0,11
	19.933	1,32	18.446 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	12.450	0,82
<b>Indien – 7,53 % (28. Februar 2023: 5,07 %)</b>					
INR 1.050.000 Indische Staatsanleihe, 8,830 %, fällig 25.11.2023	12.754	0,84	16.910 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	13.481	0,89
INR 800.000 Indische Staatsanleihe, 6,180 %, fällig 04.11.2024	9.584	0,63	27.000 United States Treasury Note/Anleihe, 4,000 %, fällig 15.11.2052 =	26.060	1,72
INR 900.000 Indische Staatsanleihe, 5,630 %, fällig 12.04.2026	10.500	0,69	14.474 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.02.2053	13.044	0,86
INR 1.300.000 Indische Staatsanleihe, 8,150 %, fällig 24.11.2026	16.156	1,07	2.900 United States Treasury Note/Anleihe, 3,625 %, fällig 15.05.2053 =	2.616	0,17
INR 270.000 Indische Staatsanleihe, 7,170 %, fällig 08.01.2028	3.260	0,22	1.400 United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.08.2053	1.381	0,09
INR 1.150.000 Indische Staatsanleihe, 7,590 %, fällig 20.03.2029	14.185	0,94		88.033	5,82
INR 1.350.000 Indische Staatsanleihe, 5,790 %, fällig 11.05.2030	15.169	1,00	<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 747.016 USD)</b>		
INR 2.900.000 Indische Staatsanleihe, 6,190 %, fällig 16.09.2034	32.326	2,14		612.189	40,49
	113.934	7,53	<b>Schuldscheine – 1,87 % (28. Februar 2023: 1,98 %)</b>		
<b>Indonesien – 7,40 % (28. Februar 2023: 7,79 %)</b>					
IDR 18.941.000 Indonesien Treasury Bond, Serie FR56, 8,375 %, fällig 15.09.2026	1.317	0,09	3.991 1.011.778 BC ULC, 7,196 %, fällig 14.11.2026 *	3.975	0,26
IDR 482.628.000 Indonesien Treasury Bond, Serie FR78, 8,250 %, fällig 15.05.2029	34.604	2,29	1.421 Alterra Mountain Co, 8,946 %, fällig 30.07.2028 *	1.426	0,09
IDR 500.248.000 Indonesien Treasury Bond, Serie FR87, 6,500 %, fällig 15.02.2031	33.073	2,19	2.745 Asurion LLC, 9,681 %, fällig 19.08.2028 *	2.657	0,17
IDR 222.343.000 Indonesien Treasury Bond, Serie FR96, 7,000 %, fällig 15.02.2033	15.246	1,01	6.033 Charter Communications Operating LLC, 7,116 %, fällig 30.04.2025 *	6.042	0,40
			1.807 Hunter Douglas Inc, 8,891 %, fällig 09.02.2029 *	1.761	0,12
			1.600 Jane Street Group, LLC, 8,196 %, fällig 21.01.2027 *	1.599	0,11
			1.315 Phoenix Guarantor Inc, 8,696 %, fällig 05.03.2026 *	1.309	0,09
			5.685 Prime Security Installations Ltd, 8,182 %, fällig 23.09.2026 *	5.693	0,38
			2.358 RegionalCare Hospital Partners Holding, 9,377 %, fällig 16.11.2025 *	2.342	0,15
			1.550 Virgin Media Bristol LLC, 7,925 %, fällig 04.01.2028 *	1.510	0,10
			<b>Summe Schuldscheine (Anschaffungskosten 28.551 USD)</b>		
				28.314	1,87
<b>Kommunalanleihen – 0,86 % (28. Februar 2023: 0,61 %)</b>					
			4.240 City of Detroit MI, 4,000 %, fällig 01.04.2044	3.173	0,21
			950 Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue, 3,706 %, fällig 15.05.2120	617	0,04
			9.530 State of Illinois, 5,100 %, fällig 01.06.2033	9.257	0,61
			<b>Summe Kommunalanleihen (Anschaffungskosten 13.943 USD)</b>		
				13.047	0,86
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,11 % (28. Februar 2023: 0,87 %)</b>					
			1.606 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.606	0,11
			<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 1.606 USD)</b>		
				1.606	0,11

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Stammaktien – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – 0,89 % (28. Februar 2023: 1,01 %)</b>		
<b>Schweiz – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
41.200 Credit Suisse Group AG Escrow t	–	–		13.409	0,89
<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten –5)</b>			<b>Futures – 3,64 % (28. Februar 2023: 0,96 %)</b>		
	–	–	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen und der als Sicherheit hinterlegten Anlagen (Anschaffungskosten 1.708.031 \$)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
	1.489.432	98,50		54.997	3,64
				1.692.854	111,96
Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Gekaufte Optionen – 1,42 % (28. Februar 2023: 0,28 %)</b>			<b>Geschriebene Optionen – -3,03 % (28. Februar 2023: -2,17 %)</b>		
1 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Put 95,8750, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	662	0,04	– 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Call 96,75, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-51	–
2 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Put 96,00, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	1.834	0,12	-7 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Call 97,00, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-1.023	-0,07
1 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Oktober 2023, Put 97,00, fällig 13.10.2023 – Bank of America Merrill Lynch	3.806	0,25	-2 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Put 95,25, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-385	-0,03
– Australischer Dollar-Währungs-Future Oktober 2023 Call 65,00, fällig 06.10.2023 – Bank of America Merrill Lynch	171	0,01	-3 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Put 95,3750, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-1.165	-0,08
– Australischer Dollar-Währungs-Future September 2023 Call 65,50, fällig 08.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	32	–	-1 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Oktober 2023, Put 96,25, fällig 13.10.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-1.608	-0,11
– Australischer Dollar-Währungs-Future September 2023 Call 66,00, fällig 08.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	21	–	-1 1-Jahres-Mid-Curve-3-Monats-SOFR-Futures, Oktober 2023, Put 96,50, fällig 13.10.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-2.303	-0,15
– Australischer Dollar-Währungs-Future September 2023 Call 67,00, fällig 08.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	1	–	-2 CME 3-Monats-SOFR-Futures Dezember 2023 Call 94,75, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-517	-0,03
– Australischer Dollar-Währungs-Future September 2023 Call 68,00, fällig 08.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	1	–	-1 CME 3-Monats-SOFR-Futures Dezember 2023 Call 95,00, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-202	-0,01
12 CME 3-Monats-SOFR-Futures Dezember 2023 Call 97,3750, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	466	0,03	-3 CME 3-Monats-SOFR-Futures Dezember 2023 Call 95,50, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-341	-0,02
– Euro-Währungs-Future Oktober 2023 Put 1,09, fällig 06.10.2023 – Bank of America Merrill Lynch	354	0,02	– CME 3-Monats-SOFR-Futures Dezember 2023 Call 95,75, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-11	–
– Euro-Währungs-Future September 2023 Put 1,1050, fällig 08.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	247	0,02	-4 CME 3-Monats-SOFR-Futures Dezember 2023 Call 97,25, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-136	-0,01
– Euro-Bund Oktober 2023 Call 132,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	312	0,02	-6 CME 3-Monats-SOFR-Futures Dezember 2023 Call 98,1250, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-156	-0,01
– Japanischer Yen-Währungs-Future September 2023 Call 69,50, fällig 08.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	106	0,01	-1 CME 3-Monats-SOFR-Futures Dezember 2023 Put 94,50, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-175	-0,01
1 Japanischer Yen-Währungs-Future September 2023 Call 70,00, fällig 08.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	69	0,01	-8 CME 3-Monats-SOFR-Futures Dezember 2023 Put 95,50, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-18.997	-1,26
1 Japanischer Yen FX-Währung Oktober 2023 Call 70,00, fällig 06.10.2023 – Bank of America Merrill Lynch	584	0,04	-1 CME 3-Monats-SOFR-Futures März 2024 Put 95,00, fällig 15.03.2024 – Bank of America Merrill Lynch	-852	-0,06
1 US-Anleihe mit 10 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 110,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	1.381	0,09	– Euro-Währungs-Future Oktober 2023 Call 1,09, fällig 06.10.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-120	-0,01
– US-Anleihe mit 10 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 110,50, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	207	0,01	– Euro-Währungs-Future Oktober 2023 Call 1,10, fällig 06.10.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-67	–
1 US-Anleihe mit 10 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 111,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	605	0,04	– Euro-Bund Oktober 2023 Put 130,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-121	-0,01
– US-Anleihe 10 Jahre Oktober 2023 Put 110,75, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	247	0,02	-1 Euro-Bund Oktober 2023 Put 131,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-518	-0,03
1 US 10 Jahre W1 September 2023 Call 109,75, fällig 01.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	1.271	0,09	– Euro-Bund Oktober 2023 Put 132,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-698	-0,05
1 US-Anleihe mit 5 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 106,25, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	1.099	0,07	– Japanischer Yen-Währungs-Future September 2023 Call 71,00, fällig 08.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-2	–
2 US-Anleihe mit 5 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 106,75, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	1.036	0,07	– Japanischer Yen-Währungs-Future September 2023 Call 71,50, fällig 08.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-1	–
1 US 5 Jahre W1 September 2023 Call 106,25, fällig 01.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	1.033	0,07	-1 US 10 Jahre November 2023 Call 111,00, fällig 27.10.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-1.195	-0,08
1 US 5 Jahre W1 September 2023 Call 106,50, fällig 01.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	585	0,04	-1 US 10 Jahre November 2023 Call 112,50, fällig 27.10.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-601	-0,04
1 US 5 Jahre W1 September 2023 Put 106,25, fällig 01.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	21	–	-1 US 10 Jahre November 2023 Call 113,00, fällig 27.10.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-370	-0,02
– US-Anleihe Oktober 2023, Call 119,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	948	0,06	-1 US-Anleihe mit 10 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 112,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-210	-0,01
– US-Anleihe Oktober 2023, Call 120,50, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	633	0,04	– US-Anleihe mit 10 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 112,50, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-93	-0,01
– US-Anleihe Oktober 2023, Call 121,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	357	0,02	-5 US-Anleihe mit 10 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 113,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-704	-0,05
– US-Anleihe Oktober 2023, Call 122,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	255	0,02	– US-Anleihe 10 Jahre Oktober 2023 Put 109,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-31	–
1 US-Anleihe Oktober 2023, Call 123,50, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	561	0,04	-1 US-Anleihe 10 Jahre Oktober 2023 Put 110,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-392	-0,03
1 US-Anleihe Oktober 2023, Call 126,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	187	0,01	-1 US-Anleihe 10 Jahre Oktober 2023 Put 110,50, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-408	-0,03
– US Long Bond W1 September 2023 Call 119,00, fällig 01.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	1.064	0,07	-1 US-Anleihe 10 Jahre Oktober 2023 Put 111,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-433	-0,03
1 US Long Bond W1 September 2023 Call 119,50, fällig 01.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	1.306	0,09	-2 US-Anleihe mit 2 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 102,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-592	-0,04
16.066 USD Put/INR Call 82,00, fällig 16.09.2023 – JP Morgan	6	–	-1 US 5 Jahre November 2023 Call 107,50, fällig 27.10.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-555	-0,04
16.066 USD Put/INR Call 82,00, fällig 19.12.2023 – JP Morgan	58	–	-2 US-Anleihe mit 5 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 106,50, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-1.334	-0,09
<b>Summe Gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 19.225 USD)</b>			<b>– 1 US-Anleihe mit 5 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 107,75, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch</b>		
	21.526	1,42		-133	-0,01
<b>Indexswaps – 6,68 % (28. Februar 2023: 6,92 %)</b>			<b>– 1 US-Anleihe mit 5 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 108,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			-266		
<b>Zinsswaps – 0,83 % (28. Februar 2023: 0,12 %)</b>			<b>– 2 US-Anleihe mit 5 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 109,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			-146		
	12.503	0,83			

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	
<b>Geschriebene Optionen – (Fortsetzung)</b>			
- US-Anleihe 5 Jahre Oktober 2023 Put 105,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-19	-	
-2 US-Anleihe 5 Jahre Oktober 2023 Put 106,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-446	-0,03	
-1 US-Anleihe 5 Jahre Oktober 2023 Put 106,50, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-231	-0,01	
-3 US 5 Jahre W1 September 2023 Call 106,00, fällig 01.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-2.718	-0,18	
-1 US-Anleihe November 2023, Put 118,00, fällig 27.10.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-581	-0,04	
- US-Anleihe Oktober 2023, Call 120,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-239	-0,02	
-1 US-Anleihe Oktober 2023, Call 123,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-508	-0,03	
-1 US-Anleihe Oktober 2023, Call 124,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-330	-0,02	
-2 US-Anleihe Oktober 2023, Call 125,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-854	-0,06	
- US-Anleihe Oktober 2023, Call 130,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-19	-	
- US-Anleihe, Oktober 2023, Put 117,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-40	-	
-1 US-Anleihe, Oktober 2023, Put 118,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-324	-0,02	
- US-Anleihe, Oktober 2023, Put 119,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-51	-	
- US-Anleihe, Oktober 2023, Put 120,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-309	-0,02	
- US-Anleihe, Oktober 2023, Put 121,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-199	-0,01	
-1 US Long Bond W1 September 2023 Call 120,00, fällig 01.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-1.698	-0,11	
-15.910 USD Call/BRL Put 4,9620, fällig 20.09.2023 – Morgan Stanley	-193	-0,01	
-15.910 USD Put/BRL Call 4,9620, fällig 20.09.2023 – Morgan Stanley	-187	-0,01	
<b>Gesamtbetrag der geschriebenen Optionen (Anschaffungskosten \$-48.781)</b>	<b>-45.858</b>	<b>-3,03</b>	
<b>Credit Default Swaps – -0,11 % (28. Februar 2023: -0,03 %)</b>			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-1.582	-0,11	
<b>Indexswaps – -1,60 % (28. Februar 2023: -0,92 %)</b>			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-24.167	-1,60	
<b>Zinsswaps – -1,82 % (28. Februar 2023: -1,07 %)</b>			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-27.540	-1,82	
<b>Devisenterminkontrakte – -0,95 % (28. Februar 2023: -2,05 %)</b>			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-14.349	-0,95	
<b>Futures – -3,58 % (28. Februar 2023: -2,21 %)</b>			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-54.049	-3,58	
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>-167.545</b>	<b>-11,09</b>	
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>1.525.309</b>	<b>100,87</b>	
<b>Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten</b>	<b>-13.149</b>	<b>-0,87</b>	
<b>Gesamtnettvermögen</b>	<b>1.512.160\$</b>	<b>100,00</b>	
			<b>% des Gesamtvermögens</b>
			<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>
			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden
			77,03
			Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden
			1,49
			Organismen für gemeinsame Anlagen
			0,08
			Finanzderivate
			10,74
			Sonstige Vermögenswerte
			10,66
			<b>Gesamtvermögen</b>
			<b>100,00</b>

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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 265.530.000 USD und machten 17,57 % des Nettovermögens aus.

\* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.

† Nicht liquide.

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

≠ Wertpapier (ganz oder teilweise) als Sicherheit für den Derivatehandel zum 31. August 2023 hinterlegt.

± Auf Basis ausstehender Bekanntgabe erworbene Wertpapiere.

γ Aufgrund der Unsicherheit der Zinszahlungen fallen während und/oder nach dem am 31. August 2023 endenden Finanzzeitraum keine Erträge mehr an.

### ABKÜRZUNGEN:

Unbefristet	– Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Unbefristete Anleihen sind nicht kündbar, zahlen aber einen stetigen Zinsstrom.
REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit.
TBA	– Wird noch bekannt gegeben.
AUD	– Australischer Dollar
BRL	– Brasilianischer Real
EGP	– Ägyptisches Pfund
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund
HUF	– Ungarischer Forint
IDR	– Indonesische Rupiah
INR	– Indische Rupie
MXN	– Mexikanischer Peso
PLN	– Polnischer Zloty
RUB	– Russischer Rubel
ZAR	– Südafrikanischer Rand

### Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tausend)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000 % – Kauf	20. Jun. 2028	9.923	\$ -278
Bank of America Merrill Lynch.	CDX.NA.IG, 1,000 % – Kauf	20. Jun. 2028	71.900	-1.111
Bank of America Merrill Lynch.	Teva Pharmaceutical Industries Ltd, 1,000 % – Verkauf	20. Juni 2026	12.479	-193
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tausend): 5.762\$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-520)				-1.582
Nettowertverlust von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tausend): 5.242\$)				\$ -1.582

### Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Prozentsatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tausend)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay variabel USD SOFR Compound, Receive fest 3,550 %	01. Mrz. 2025	2.219.704	\$ -26.833
Bank of America Merrill Lynch.	Pay variabel BRL CDI, receive fest 11,993 %	04. Jan. 2027	496.488	2559
Bank of America Merrill Lynch.	Pay variabel MXN TIIE Banxico, receive fest 9,260 %	25. Okt. 2032	1.009.497	1912
Bank of America Merrill Lynch.	Pay variabel MXN TIIE Banxico, receive fest 8,450 %	01. Mrz. 2033	640.415	-707
BNP Paribas	Pay variabel BRL CDI, receive fest 12,610 %	02. Jan. 2029	679.541	7142
JP Morgan	Pay variabel BRL CDI, receive fest 12,893 %	02. Jan. 2029	73.048	890
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tausend): 2.585\$)				\$ 12.503
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-22.883)				-27.540
Netto-Wertminderung der Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-20.298)				\$ -15.037

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Indexswaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tausend)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fest 1,520 %, Receive Variabel USD SOFR Compound	15. Feb. 2047	26.146	\$ 8742
Bank of America Merrill Lynch.	Pay Fest 2,500 %, Receive Variabel USD SOFR Compound	21. Apr. 2052	111.770	20.918
Bank of America Merrill Lynch.	Pay Fest 2,600 %, Receive Variabel USD SOFR Compound	15. Feb. 2048	261.696	43.970
Bank of America Merrill Lynch.	Pay Fest 2,850 %, Receive Variabel USD SOFR Compound	15. Feb. 2029	25.846	1425
Bank of America Merrill Lynch.	Pay Fest 3,050 %, Receive Variabel USD SOFR Compound	15. Feb. 2048	38.696	3730
Bank of America Merrill Lynch.	Pay Fest 3,150 %, Receive Variabel USD SOFR Compound	15. May 2048	44.912	3597
Bank of America Merrill Lynch.	Pay Fest 3,220 %, Receive Variabel USD SOFR Compound	15. May 2032	230.335	10.330
Bank of America Merrill Lynch.	Pay Fest 3,270 %, Receive Variabel USD SOFR Compound	30. Apr. 2029	116.556	4097
Bank of America Merrill Lynch.	Pay Fest 3,850 %, Receive Variabel USD SOFR Compound	30. Jun. 2029	23.101	129
Bank of America Merrill Lynch.	Pay variabel USD SOFR Compound, Receive fest 1,396 %	13. Okt. 2025	582.851	-14.081
Bank of America Merrill Lynch.	Pay variabel USD SOFR Compound, Receive fest 3,400 %	21. Jun. 2025	826.407	-7.760
Bank of America Merrill Lynch.	Pay variabel USD SOFR Compound, Receive fest 4,000 %	29. Feb. 2028	531.450	305
Bank of America Merrill Lynch.	Pay variabel USD SOFR Compound, Receive fest 4,180 %	29. Feb. 2028	498.040	3744
Bank of America Merrill Lynch.	Pay variabel USD SOFR Compound, Receive fest 4,600 %	04. Jun. 2024	354.373	-2.326
Nicht realisierte Wertsteigerung von Indexswaps (28. Februar 2023 (in Tausend): 147.520\$)				\$ 100.987
Nicht realisierte Wertminderung von Indexswaps (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-19.599)				-24.167
Nettowertsteigerung der Indexswaps (28. Februar 2023 (in Tausend): 127.921\$)				\$ 76.820

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)		
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	39.976	Verkauf	BRL	195.607	\$ 508
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1.440	Verkauf	BRL	7.175	-8
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	4	Verkauf	CHF	4	-
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	354	Verkauf	EUR	324	2
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	-	Verkauf	GBP	-	-
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	56	Verkauf	GBP	44	-
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	11	Verkauf	NOK	116	-
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	74	Verkauf	USD	48	-
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	62	Verkauf	USD	67	-
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	72	Verkauf	USD	53	-
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NOK	23	Verkauf	USD	2	-
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	BRL	202.782	Verkauf	USD	42.695	-1.780
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	30	Verkauf	USD	38	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	76	Verkauf	AUD	116	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1.591	Verkauf	AUD	2.479	-13
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	901	Verkauf	CHF	793	6
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	166	Verkauf	CHF	147	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	29	Verkauf	CNH	211	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	85	Verkauf	CNH	627	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	21.893	Verkauf	EUR	20.043	142
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1.673	Verkauf	EUR	1.546	-6
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	5.084	Verkauf	GBP	3.993	21
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	132	Verkauf	GBP	104	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	631	Verkauf	JPY	90.997	3
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1.549	Verkauf	JPY	225.757	-6
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	143	Verkauf	NOK	1.486	1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	76	Verkauf	NOK	801	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	48	Verkauf	PLN	199	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	40	Verkauf	SEK	444	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	20	Verkauf	SEK	226	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	53	Verkauf	SGD	72	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1.911	Verkauf	SGD	2.588	-6
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	JPY	7.368.520	Verkauf	USD	51.522	-755
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	12	Verkauf	USD	14	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	377.463	Verkauf	USD	415.138	-5.537
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	46.660	Verkauf	USD	34.721	-173
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	1.280	Verkauf	USD	948	1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CNH	497	Verkauf	USD	68	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CHF	-	Verkauf	USD	1	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	47.263	Verkauf	USD	30.900	-259
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	1.147	Verkauf	USD	741	1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	417	Verkauf	USD	451	1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NOK	193	Verkauf	USD	18	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	PLN	5.067	Verkauf	USD	1.243	-16
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	4	Verkauf	USD	-	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	15.069	Verkauf	USD	1.410	-35
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NOK	37.670	Verkauf	USD	3.687	-141
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	61.363	Verkauf	USD	78.143	-405
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CNH	19.036	Verkauf	USD	2.641	-23

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf CHF 18.402	Verkauf USD 21.068	\$ -204
20. Sep. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 4.667	Verkauf RUB 338.380	1159
20. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf USD 7.381	Verkauf INR 606.961	46
03. Okt. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 2.644	Verkauf BRL 13.000	33
03. Okt. 2023	BNY Mellon	Kauf BRL 187.700	Verkauf USD 38.175	-470
20. Okt. 2023	Bank of America Merrill Lynch.	Kauf USD 3.253	Verkauf EUR 3.000	-8
20. Okt. 2023	Bank of America Merrill Lynch.	Kauf USD 4.345	Verkauf GBP 3.410	26
20. Okt. 2023	Bank of America Merrill Lynch.	Kauf USD 1.507	Verkauf JPY 219.000	-11
20. Okt. 2023	Bank of America Merrill Lynch.	Kauf USD 53.026	Verkauf PLN 218.312	247
20. Okt. 2023	Bank of America Merrill Lynch.	Kauf USD 36.723	Verkauf TWD 1.138.961	730
20. Okt. 2023	Bank of America Merrill Lynch.	Kauf AUD 8.600	Verkauf USD 5.660	-78
20. Okt. 2023	Bank of America Merrill Lynch.	Kauf GBP 8.010	Verkauf USD 10.343	-195
20. Okt. 2023	Bank of America Merrill Lynch.	Kauf EUR 2.950	Verkauf USD 3.281	-74
20. Okt. 2023	Bank of America Merrill Lynch.	Kauf TWD 19.728	Verkauf USD 621	3
20. Okt. 2023	Bank of America Merrill Lynch.	Kauf JPY 1.155.000	Verkauf USD 8.017	-14
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf USD 8.726	Verkauf NOK 88.076	429
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf NOK 360.721	Verkauf USD 33.945	35
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf KRW 43.312.887	Verkauf USD 33.439	-661
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf CAD 56.254	Verkauf USD 42.447	-784
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf AUD 67.276	Verkauf USD 44.966	-1.293
20. Okt. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 63.100	Verkauf MXN 1.096.623	-630
20. Okt. 2023	Goldman Sachs	Kauf MXN 16.381	Verkauf USD 961	-9
20. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf USD 3.116	Verkauf CNH 22.291	45
20. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf USD 18.586	Verkauf HUF 6.687.871	-242
20. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf USD 99.676	Verkauf IDR 1.505.267.629	911
20. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf USD 17.115	Verkauf MXN 290.466	235
20. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf CNH 22.291	Verkauf USD 3.117	-45
20. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf COP 32.482.100	Verkauf USD 7.648	174
20. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf USD 19.111	Verkauf ZAR 362.607	-3
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 15.185	Verkauf CNH 109.335	120
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 7.871	Verkauf COP 32.482.100	49
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 20.624	Verkauf EUR 18.679	320
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 66.150	Verkauf GBP 51.499	901
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 43.434	Verkauf INR 3.589.152	92
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 19.501	Verkauf INR 1.616.645	-22
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 195.080	Verkauf JPY 27.183.749	6708
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 16.964	Verkauf MXN 287.712	244
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 16.462	Verkauf MYR 75.281	175
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf BRL 101.634	Verkauf USD 20.537	-167
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf CNH 109.335	Verkauf USD 15.261	-196
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf MYR 75.281	Verkauf USD 16.310	-23
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf GBP 8.750	Verkauf USD 11.143	-57
20. Dez. 2023	JP Morgan	Kauf USD 6.783	Verkauf INR 559.782	41
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 21.504\$)				\$ 13.409
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-43.616)				-14.349
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-22.112)				\$ -940

## Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
3-Monats-SOFR-Index Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-2.417	\$ -571.620	896
3-Monats-SOFR-Index Dezember 2024	Bank of America Merrill Lynch	935	224.003	-937
3-Monats-SOFR-Index März 2024	Bank of America Merrill Lynch.	1.591	377.067	-809
3-Monats-SOFR-Index September 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-4.585	-1.084.209	4224
Australischer Dollar Währung Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-50	-3.250	-
Australische Dollar-Währung September 2023	Bank of America Merrill Lynch.	922	59.727	-1.286
Britische Pfund-Währung Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-100	-7.916	37
Britische Pfund-Währung September 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-292	-23.114	177
Kanadischer Dollar Währung September 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-590	-43.651	735
Euribor 3 Monate Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	1.788	465.995	-257
Euro FX-Währung Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-24	-3.270	15
Euro FX-Währung September 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-416	-56.433	1206
Euro-Bund Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-756	-108.726	-979
Euro-Buxl 30-jährige Anleihe Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	161	23.352	349
Euro-Buxl 30-jährige Anleihe September 2023	Bank of America Merrill Lynch.	40	5803	230
Fed Fund 30 Tage August 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-7.532	-2.971.298	199
Fed Fund 30 Tage September 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-56	-22.089	1
ICE 3-Monats-SONIA Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	1.330	397.160	-1.287

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Terminkontrakte – (Fortsetzung)

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
ICE 3-Monats-SONIA Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch.	1.352	404.179	\$ 100
Japanische 10-jährige Anleihe (OSE) September 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-661	-667.020	4925
Japanische Yen-Währung Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-278	-24.301	-47
Japanische Yen-Währung September 2023	Bank of America Merrill Lynch.	2.826	243.460	-12.122
Long Gilt Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	338	40.921	724
Mexikanischer Peso Währung September 2023	Bank of America Merrill Lynch.	3.062	89.946	1416
US-10-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-16.133	-1.791.267	-15.224
US 10 Jahre Ultra Note Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-8.421	-977.757	-14.383
US-2-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	3.662	746.333	2480
US-5-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-9.577	-1.023.991	-6.718
US Long Bond (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	14.987	1.823.731	30.929
US Ultra Bond (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	2.496	323.154	6354
Nicht realisierte Wertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): 20.467\$)				\$ 54.997
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-47.194)				-54.049
Nettowertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-26.727)				\$ 948

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere – 12,81 % (28. Februar 2023: 14,21 %)</b>					
140			710		
AB BSL CLO 4 Ltd, Serie 2023 4A, Klasse A, 144A, 6,957 %, fällig 20.04.2036 *	141	0,05	National Collegiate II Commutation Trust, Serie 2005 AR15, Klasse AR15, 0,000 %, fällig 01.06.2045	80	0,03
68			600		
ABFC 2003-OPT1 Trust, Serie 2003 OPT1, Klasse A3, 6,109 %, fällig 25.04.2033 *	65	0,02	National Collegiate Student Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Klasse B, 5,809 %, fällig 26.03.2035 *	529	0,18
1.274			65		
ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Serie 2005-HE3, Serie 2005 HE3, Klasse M4, 6,374 %, fällig 25.05.2035 *	1.144	0,40	National Collegiate Student Loan Trust 2006-1, Serie 2006 1, Klasse A5, 5,779 %, fällig 25.03.2033 *	62	0,02
617			790		
Aegis Asset Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Cfs Ser 2005-4, Serie 2005 4, Klasse M2, 6,134 %, fällig 25.10.2035 *	573	0,20	National Collegiate Student Loan Trust 2006-3, Serie 2006 3, Klasse B, 5,789 %, fällig 26.01.2032 *	599	0,21
950			730		
AGL CLO 12 Ltd, Serie 2021 12A, Klasse D, 144A, 8,438 %, fällig 20.07.2034 *	918	0,32	National Collegiate Student Loan Trust 2007-2, Serie 2007 2, Klasse A4, 5,719 %, fällig 25.01.2033 *	679	0,24
450			1.302		
Anchorage Capital CLO 3-R Ltd, Serie 2014 3RA, Klasse E, 144A, 11,127 %, fällig 28.01.2031 *	416	0,15	National Collegiate V Commutation Trust, Serie 2007 33A6, Klasse 10, 144A, 0,000 %, fällig 25.03.2038 *	309	0,11
480			2.291		
Bain Capital Credit CLO 2022-2 Ltd, Serie 2022 2A, Klasse D1, 144A, 8,996 %, fällig 22.04.2035 *	471	0,16	National Collegiate VI 2007-4 Class A-3L Commutation Trust, Serie 2007 4VI, Klasse O, 144A, 6,279 %, fällig 29.03.2038 *†	409	0,14
660			1.000		
Bain Capital Credit CLO 2023-1 Ltd, Serie 2023 1A, Klasse AN, 144A, 6,573 %, fällig 16.04.2036 *	661	0,23	Ocean Trails CLO V, Serie 2014 5A, Klasse DRR, 144A, 9,013 %, fällig 13.10.2031 *	903	0,32
1.380			600		
Ballyrock CLO 19 Ltd, Serie 2022 19A, Klasse D, 144A, 12,436 %, fällig 20.04.2035 *	1.307	0,46	Ocean Trails Clo X, Serie 2020 10A, Klasse AR, 144A, 6,790 %, fällig 15.10.2034 *	592	0,21
1.225			650		
Ballyrock CLO 2018-1 Ltd, Serie 2018 1A, Klasse C, 144A, 8,738 %, fällig 20.04.2031 *	1.204	0,42	OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 35 Ltd, Serie 2018 1A, Klasse C, 144A, 8,188 %, fällig 20.01.2031 *	607	0,21
720			940		
Barings CLO Ltd 2016-II, Serie 2016 2A, Klasse ER2, 144A, 12,088 %, fällig 20.01.2032 *	679	0,24	Option One Mortgage Loan Trust 2005-3, Serie 2005 3, Klasse M4, 6,359 %, fällig 25.08.2035 *	739	0,26
447			256		
Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-CL1, Serie 2005 CL1, Klasse A1, 3,646 %, fällig 25.09.2034 *	434	0,15	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Serie 2007 FXD1, Klasse 1A1, 5,866 %, fällig 25.01.2037	205	0,07
520			516		
Birch Grove CLO 6 Ltd, Serie 2023 6A, Klasse D, 144A, 11,119 %, fällig 20.07.2035 *	527	0,18	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Serie 2007 FXD1, Klasse 2A1, 5,866 %, fällig 25.01.2037	425	0,15
500			618		
Black Diamond Clo 2019-2 Ltd, Serie 2019 2A, Klasse A1A, 144A, 7,037 %, fällig 23.07.2032 *	499	0,17	RAMP Serie 2006-NC3 Trust, Serie 2006 NC3, Klasse M1, 5,939 %, fällig 25.03.2036 *	594	0,21
1.000			1.320		
BlueMountain CLO XXII Ltd, Serie 2018 22A, Klasse A1, 144A, 6,650 %, fällig 15.07.2031 *	995	0,35	Saranac CLO III Ltd, Serie 2014 3A, Klasse DR, 144A, 8,770 %, fällig 22.06.2030 *	1.110	0,39
720			320		
CarVal CLO VII-C Ltd, Serie 2023 1A, Klasse A1, 144A, 7,526 %, fällig 20.01.2035 *	724	0,25	SMB Private Education Loan Trust 2015-C, Serie 2015 C, Klasse C, 144A, 4,500 %, fällig 17.09.2046	296	0,10
850			1.153		
CIFC Funding 2018-I Ltd, Serie 2018 1A, Klasse C, 144A, 7,322 %, fällig 18.04.2031 *	835	0,29	Sunrun Athena Issuer 2018-1 LLC, Serie 2018 1, Klasse A, 144A, 5,310 %, fällig 30.04.2049	1.075	0,38
17			540		
CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Serie 2005-D, Serie 2005 D, Klasse 2A, 5,615 %, fällig 15.11.2035 *	17	0,01	Symphony CLO 37 Ltd, Serie 2022 37A, Klasse A1A, 144A, 7,626 %, fällig 20.10.2034 *	542	0,19
493			750		
Educational Funding Co LLC/The, Serie 2006 1A, Klasse A3, 144A, 5,963 %, fällig 25.04.2033 *	338	0,12	Voya CLO 2016-3 Ltd, Serie 2016 3A, Klasse A1R, 144A, 6,762 %, fällig 18.10.2031 *	749	0,26
660			639		
Encore Credit Receivables Trust 2005-2, Serie 2005 2, Klasse M4, 6,359 %, fällig 25.11.2035 *	604	0,21	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Serie 2007-HE4 Trust, Serie 2007 HE4, Klasse 1A, 5,599 %, fällig 25.07.2047 *	446	0,16
74			600		
First Franklin Mortgage Loan Trust 2003-FF4, Serie 2003 FF4, Klasse M1, 7,233 %, fällig 25.10.2033 *	70	0,02	Warwick Capital CLO 1 Ltd, Serie 2023 1A, Klasse D, 144A, 0,000 %, fällig 20.10.2036 *	600	0,21
1.125			<b>Summe forderungsbesicherten Wertpapiere (Anschaffungskosten: 38.754 USD)</b>		
FOCUS Brands Funding LLC, Serie 2017 1A, Klasse A2II, 144A, 5,093 %, fällig 30.04.2047	1.051	0,37	<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 11,72 % (28. Februar 2023: 12,42 %)</b>		
540			271		
FS Rialto 2022-FL6 Issuer LLC, Serie 2022 FL6, Klasse A, 144A, 7,894 %, fällig 17.08.2037 *	542	0,19	Alternative Loan Trust 2007-4CB, Serie 2007 4CB, Klasse 1A5, 5,750 %, fällig 25.04.2037	226	0,08
850			167		
Goldentree Loan Management US Clo 3 Ltd, Serie 2018 3A, Klasse D, 144A, 8,438 %, fällig 20.04.2030 *	839	0,29	BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Serie 2016 GG10, Klasse AJA, 144A, 5,810 %, fällig 10.08.2045 *	36	0,01
1.000			546		
Golub Capital Partners CLO 21M Ltd, Serie 2014 21A, Klasse CR, 144A, 8,063 %, fällig 25.01.2031 *	956	0,33	Banc of America Funding Corp, Serie 2015 R3, Klasse 1A2, 144A, 2,951 %, fällig 27.03.2036 *	443	0,15
1.000			780		
Golub Capital Partners CLO 53B Ltd, Serie 2021 53A, Klasse E, 144A, 12,288 %, fällig 20.07.2034 *	936	0,33	BANK 2017-BNK7, Serie 2017 BNK7, Klasse A4, 3,175 %, fällig 15.09.2060	716	0,25
150			140		
Golub Capital Partners CLO 66B Ltd, Serie 2023 66A, Klasse A, 144A, 6,926 %, fällig 25.04.2036 *	150	0,05	BBCRE Trust 2015-GTP, Serie 2015 GTP, Klasse D, 144A, 4,715 %, fällig 10.08.2033 *	111	0,04
132			840		
GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, Serie 2021 4GS, Klasse A, 144A, 1,930 %, fällig 20.07.2048	100	0,03	BBSG 2016-MRP Mortgage Trust, Serie 2016 MRP, Klasse A, 144A, 3,275 %, fällig 05.06.2036	683	0,24
250			510		
Greenwood Park CLO Ltd, Serie 2018 1A, Klasse E, 144A, 10,520 %, fällig 15.04.2031 *	207	0,07	BHMS 2018-ATLS, Serie 2018 ATLS, Klasse C, 144A, 7,507 %, fällig 15.07.2035 *	490	0,17
1.000			520		
Grippen Park CLO Ltd, Serie 2017 1A, Klasse D, 144A, 8,888 %, fällig 20.01.2030 *	982	0,34	BX Trust 2021-VIEW, Serie 2021 VIEW, Klasse C, 144A, 7,774 %, fällig 15.06.2036 *	482	0,17
1.400			341		
Harriman Park CLO Ltd, Serie 2020 1A, Klasse ER, 144A, 11,988 %, fällig 20.04.2034 *	1.309	0,46	BXMT 2020-FL2 Ltd, Serie 2020 FL2, Klasse A, 144A, 6,328 %, fällig 15.02.2038 *	329	0,11
145			430		
HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Serie 2021 FL1, Klasse C, 144A, 7,127 %, fällig 16.06.2036 *	135	0,05	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, Serie 2014 GC23, Klasse C, 4,572 %, fällig 10.07.2047 *	399	0,14
170			770		
HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Serie 2021 FL1, Klasse D, 144A, 7,777 %, fällig 16.06.2036 *	157	0,05	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Serie 2017 P8, Klasse A3, 3,203 %, fällig 15.09.2050	706	0,25
537			11.041		
Home Equity Asset Trust 2006-4, Serie 2006 4, Klasse 2A4, 5,989 %, fällig 25.08.2036 *	521	0,18	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Serie 2017 P8, Klasse XA, 1,010 %, fällig 15.09.2050 *	294	0,10
703			586		
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Serie INABS 2005-C, Serie 2005 C, Klasse M2, 6,179 %, fällig 25.10.2035 *	681	0,24	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2018-C5, Serie 2018 C5, Klasse A3, 3,963 %, fällig 10.06.2051	542	0,19
225			710		
Long Beach Mortgage Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Klasse M4, 6,704 %, fällig 25.02.2035 *	218	0,08	COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Serie 2015 DC1, Klasse C, 4,438 %, fällig 10.02.2048 *	585	0,20
1.000			520		
Magnetite XII Ltd, Serie 2015 12A, Klasse ER, 144A, 11,250 %, fällig 15.10.2031 *	958	0,33	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R03, Serie 2019 R03, Klasse 1B1, 144A, 9,502 %, fällig 25.09.2031 *	546	0,19
1.270			360		
Marble Point CLO XIV Ltd, Serie 2018 2A, Klasse D, 144A, 9,118 %, fällig 20.01.2032 *	1.186	0,41	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Serie 2019 R07, Klasse 1B1, 144A, 8,802 %, fällig 25.10.2039 *	366	0,13
533			260		
Mastr Asset Backed Securities Trust 2007-HE2, Serie 2007 HE2, Klasse A1, 6,579 %, fällig 25.08.2037 *	442	0,15	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Serie 2020 R01, Klasse 1B1, 144A, 8,652 %, fällig 25.01.2040 *	261	0,09
322			723		
Mosaik Solar Loan Trust 2018-1, Serie 2018 1A, Klasse CERT, 144A, 0,000 %, fällig 22.06.2043 ∞	209	0,07	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Klasse 1B1, 144A, 8,388 %, fällig 25.10.2041 *	721	0,25
1.243			670		
Mosaik Solar Loan Trust 2022-1, Serie 2022 1A, Klasse B, 144A, 3,160 %, fällig 20.01.2053	984	0,34	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Klasse 1M2, 144A, 6,838 %, fällig 25.10.2041 *	661	0,23
			190		
			Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Serie 2021 R03, Klasse 1B1, 144A, 8,038 %, fällig 25.12.2041 *	188	0,07

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventar	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventar
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)</b>					
700	711	0,25	220	196	0,07
Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, Serie 2022 R04, Klasse 1M2, 144A, 8,388 %, fällig 25.03.2042 *					
250	255	0,09	419	359	0,12
Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05, Serie 2023 R05, Klasse 1M2, 144A, 8,396 %, fällig 25.06.2043 *					
940	895	0,31	242	238	0,08
CSAIL 2016-C5 Commercial Mortgage Trust, Serie 2016 C5, Klasse A5, 3,757 %, fällig 15.11.2048					
360	294	0,10	391	387	0,13
CSAIL 2017-C8 Commercial Mortgage Trust, Serie 2017 C8, Klasse C, 4,432 %, fällig 15.06.2050 *					
1.480	582	0,20	1.141	1.059	0,37
CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Klasse F, 144A, 4,373 %, fällig 15.09.2037					
630	581	0,20	790	685	0,24
CSMC Trust 2017-CHOP, Serie 2017 CHOP, Klasse F, 144A, 9,794 %, fällig 15.07.2032 *					
585	484	0,17	422	389	0,14
DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Serie 2007 AR1, Klasse 1A1B, 5,568 %, fällig 19.04.2047 *					
630	673	0,23	250	26	0,01
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C07, Klasse 1B1, 9,402 %, fällig 25.05.2030 *					
556	589	0,21	410	16	0,01
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Klasse 1B1, 8,952 %, fällig 25.07.2030 *					
600	569	0,20	370	2	–
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 % ±					
91	89	0,03	853	831	0,29
Fannie Mae Pool „CB3880“, 5,000 %, fällig 06.01.2052					
520	517	0,18	834	808	0,28
Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-DNA1, Serie 2020 DNA1, Klasse B1, 144A, 7,702 %, fällig 25.01.2050 *					
500	541	0,19	891	859	0,30
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA5, Serie 2020 DNA5, Klasse B1, 144A, 10,088 %, fällig 25.10.2050 *					
680	673	0,23	34	30	0,01
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA6, Serie 2020 DNA6, Klasse B1, 144A, 8,288 %, fällig 25.12.2050 *					
580	598	0,21	99	64	0,02
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, Serie 2021 DNA3, Klasse B1, 144A, 8,788 %, fällig 25.10.2033 *					
600	598	0,21	2.284	1.858	0,65
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Serie 2021 DNA5, Klasse B1, 144A, 8,338 %, fällig 25.01.2034 *					
290	291	0,10	320	288	0,10
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Serie 2021 DNA6, Klasse B1, 144A, 8,688 %, fällig 25.10.2041 *					
164	109	0,04	127	111	0,04
Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2017 SP11, Klasse B, 144A, 4,118 %, fällig 25.09.2047 *					
356	356	0,12	651	516	0,18
Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2021 DNA2, Klasse M2, 144A, 7,588 %, fällig 25.08.2033 *					
590	524	0,18	724	665	0,23
GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-375H, Serie 2017 375H, Klasse A, 144A, 3,591 %, fällig 10.09.2037 *					
457	167	0,06	<b>Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 37.924 USD)</b>		
GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Klasse C, 144A, 9,675 %, fällig 15.09.2031 *					
750	602	0,21	<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 60,62 % (28. Februar 2023: 59,17 %)</b>		
GS Mortgage Securities Trust 2015-GC30, Serie 2015 GC30, Klasse D, 3,384 %, fällig 10.05.2050					
58	51	0,02	<b>Argentinien – 0,35 % (28. Februar 2023: 0,35 %)</b>		
GSMPS Mortgage Loan Trust 2006-RP1, Serie 2006 RP1, Klasse 1A2, 144A, 7,500 %, fällig 25.01.2036					
330	303	0,11	410	388	0,13
Hilton USA Trust 2016-HHV, Serie 2016 HHV, Klasse D, 144A, 4,333 %, fällig 05.11.2038 *					
1.199	957	0,33	290	274	0,10
Impac Secured Assets Trust 2006-3, Serie 2006 3, Klasse A7, 5,969 %, fällig 25.11.2036 *					
340	304	0,11	420	355	0,12
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-NINE, Serie 2016 NINE, Klasse A, 144A, 2,949 %, fällig 06.09.2038 *					
1.010	–	–	1.017 0,35		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Serie 2018 PHMZ, Klasse M, 144A, 13,933 %, fällig 15.06.2035 *tc					
1	1	–	<b>Belgien – 0,37 % (28. Februar 2023: 0,37 %)</b>		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-LDP12, Serie 2007 LD12, Klasse AJ, 6,561 %, fällig 15.02.2051 *					
900	725	0,25	EUR 1.000 KBC Group NV, 4,750 %, unbefristet *		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Serie 2018 WPT, Klasse FFL, 144A, 8,705 %, fällig 05.07.2033 *					
280	116	0,04	<b>Bermudas – 0,39 % (28. Februar 2023: 0,38 %)</b>		
JP Morgan Resecuritization Trust Serie 2009-10, Serie 2009 10, Klasse 7A2, 144A, 5,018 %, fällig 26.02.2037 *					
31	8	–	40 Aspen Insurance Holdings Ltd, 4,650 %, fällig 15.11.2023		
ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Klasse AJ, 5,450 %, fällig 12.08.2048 *					
31	8	–	1.130 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, fällig 15.10.2025		
ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Klasse AJFL, 144A, 5,450 %, fällig 12.08.2048 *					
500	476	0,17	1.108 0,39		
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C27, Serie 2015 C27, Klasse A4, 3,753 %, fällig 15.12.2047					
381	312	0,11	<b>Brasilien – 0,88 % (28. Februar 2023: 1,03 %)</b>		
Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP, Serie 2018 MP, Klasse A, 144A, 4,419 %, fällig 11.07.2040 *					
150	113	0,04	460	389	0,14
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2005-2AR, Serie 2005 2AR, Klasse B1, 5,929 %, fällig 25.04.2035 *					
880	564	0,20	350	319	0,11
Natis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Klasse D, 144A, 4,544 %, fällig 15.08.2036 *					
361	194	0,07	370	297	0,10
Natis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Klasse E, 144A, 4,544 %, fällig 15.08.2036 *					
687	628	0,22	490	430	0,15
New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Serie 2016 3A, Klasse B2, 144A, 4,250 %, fällig 25.09.2056 *					
			800	633	0,22
			450	470	0,16
			2.538 0,88		
			<b>Kanada – 2,90 % (28. Februar 2023: 2,18 %)</b>		
			780	721	0,25
			120	107	0,04
			770	769	0,27
			250	236	0,08
			CAD 420 Doman Building Materials Group Ltd, 144A, 5,250 %, fällig 15.05.2026		
			600	581	0,20
			1.300	1.179	0,41
			280	264	0,09
			390	367	0,13

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>Kanada – (Fortsetzung)</b>					
440 MEG Energy Corp, 144A, 7,125 %, fällig 01.02.2027	446	0,16			
1.050 MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01.02.2029	1.004	0,35			
500 Open Text Corp, 144A, 3,875 %, fällig 15.02.2028	445	0,15			
270 Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2030	233	0,08			
250 Superior Plus LP / Superior General Partner Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.03.2029	220	0,08			
400 Toronto-Dominion Bank/The, 8,125 %, fällig 31.10.2082 *	403	0,14			
250 TransAlta Corp, 7,750 %, fällig 15.11.2029	259	0,09			
860 TransAlta Corp, 6,500 %, fällig 15.03.2040	823	0,29			
	8.330	2,90			
<b>Kaimaninseln – 0,42 % (28. Februar 2023: 0,42 %)</b>					
1.274 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 15.09.2024	1.198	0,42			
<b>Chile – 0,17 % (28. Februar 2023: 0,21 %)</b>					
803 VTR Comunicaciones SpA, 144A, 5,125 %, fällig 15.01.2028	498	0,17			
<b>China – 0,18 % (28. Februar 2023: 0,30 %)</b>					
400 Country Garden Holdings Co Ltd, 8,000 %, fällig 27.01.2024	51	0,01			
200 Prosperous Ray Ltd, 4,625 %, fällig 12.11.2023	199	0,07			
370 Prosus NV, 144A, 3,061 %, fällig 13.07.2031	281	0,10			
	531	0,18			
<b>Dänemark – 0,28 % (28. Februar 2023: 0,29 %)</b>					
800 Danske Bank A/S, 144A, 6,466 %, fällig 09.01.2026 *	801	0,28			
<b>Frankreich – 0,76 % (28. Februar 2023: 0,74 %)</b>					
200 Altice France SA/France, 144A, 8,125 %, fällig 01.02.2027	169	0,06			
550 BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, unbefristet *	536	0,19			
1.470 Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, unbefristet *	1.469	0,51			
	2.174	0,76			
<b>Deutschland – 0,75 % (28. Februar 2023: 0,78 %)</b>					
320 Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 144A, 5,500 %, fällig 15.01.2028	290	0,10			
620 Mercer International Inc, 5,125 %, fällig 01.02.2029	508	0,18			
100 Nidda BondCo GmbH, 5,000 %, fällig 30.09.2025	108	0,04			
800 ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750 %, fällig 29.04.2025	778	0,27			
460 ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, fällig 14.04.2030	466	0,16			
	2.150	0,75			
<b>Guatemala – 0,10 % (28. Februar 2023: 0,11 %)</b>					
363 Millicom International Cellular SA, 144A, 4,500 %, fällig 27.04.2031	287	0,10			
<b>Hongkong – 0,29 % (28. Februar 2023: 0,29 %)</b>					
230 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 4,875 %, fällig 06.06.2025	219	0,08			
730 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 04.12.2029	613	0,21			
	832	0,29			
<b>Irland – 0,32 % (28. Februar 2023: 0,33 %)</b>					
630 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30.01.2032	512	0,18			
420 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 4,250 %, fällig 15.04.2026	397	0,14			
	909	0,32			
<b>Israel – 0,70 % (28. Februar 2023: 0,50 %)</b>					
1.030 Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, fällig 01.02.2036	950	0,33			
500 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, fällig 09.05.2027	468	0,16			
550 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, fällig 15.09.2031	584	0,21			
	2.002	0,70			
<b>Italien – 0,45 % (28. Februar 2023: 0,46 %)</b>					
230 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, fällig 15.01.2026	221	0,08			
530 UniCredit SpA, 144A, 7,296 %, fällig 02.04.2034 *	511	0,18			
640 UniCredit SpA, 144A, 5,459 %, fällig 30.06.2035 *	556	0,19			
	1.288	0,45			
<b>Kasachstan – 0,20 % (28. Februar 2023: 0,20 %)</b>					
380 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 4,750 %, fällig 19.04.2027	358	0,13			
230 QazaqGaz NC JSC, 144A, 4,375 %, fällig 26.09.2027	212	0,07			
	570	0,20			
<b>Kuwait – 0,19 % (28. Februar 2023: 0,27 %)</b>					
530 MEGlobal Canada ULC, 144A, 5,875 %, fällig 18.05.2030	536	0,19			
<b>Luxemburg – 0,98 % (28. Februar 2023: 0,94 %)</b>					
370 Altice Financing SA, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2028	301	0,11			
1.650 Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, fällig 15.05.2027	897	0,31			
500 ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, fällig 30.06.2027	402	0,14			
570 Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, fällig 01.04.2028	636	0,22			
587 FAGE International SA / FAGE USA Dairy Industry Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.08.2026	565	0,20			
	2.801	0,98			
<b>Macau – 0,80 % (28. Februar 2023: 0,82 %)</b>					
270 Sands China Ltd, 5,375 %, fällig 08.08.2025	261	0,09			
200 Sands China Ltd, 5,650 %, fällig 08.08.2028	189	0,06			
200 Sands China Ltd, 3,100 %, fällig 08.03.2029	167	0,06			
200 Sands China Ltd, 3,500 %, fällig 08.08.2031	161	0,06			
1.550 Wynn Macau Ltd, 144A, 4,875 %, fällig 01.10.2024	1.515	0,53			
	2.293	0,80			
<b>Malaysia – 0,11 % (28. Februar 2023: 0,12 %)</b>					
490 Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, fällig 19.08.2050	327	0,11			
<b>Mexiko – 0,32 % (28. Februar 2023: 0,35 %)</b>					
1.020 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,500 %, unbefristet *	931	0,32			
<b>Niederlande – 0,46 % (28. Februar 2023: 0,48 %)</b>					
EUR 1.000 Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, unbefristet *	993	0,35			
EUR 310 Stichting AK Rabobank Certificaten, 6,500 %, unbefristet	314	0,11			
	1.307	0,46			
<b>Singapur – 0,08 % (28. Februar 2023: 0,08 %)</b>					
220 Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4,250 %, fällig 19.06.2024	217	0,08			
<b>Südafrika – 0,09 % (28. Februar 2023: 0,09 %)</b>					
310 Sasol Financing USA LLC, 5,500 %, fällig 18.03.2031	248	0,09			
<b>Schweiz – 1,53 % (28. Februar 2023: 1,75 %)</b>					
720 Credit Suisse AG/New York NY, 4,750 %, fällig 09.08.2024	710	0,25			
250 Credit Suisse AG/New York NY, 3,625 %, fällig 09.09.2024	243	0,08			
500 Credit Suisse AG/New York NY, 7,950 %, fällig 09.01.2025	510	0,18			
1.500 UBS Group AG, 144A, 7,000 %, unbefristet *	1.491	0,52			
640 Vistajet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 7,875 %, fällig 01.05.2027	580	0,20			
920 Vistajet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 9,500 %, fällig 01.06.2028	850	0,30			
	4.384	1,53			
<b>Vereinigte Arabische Emirate – 0,08 % (28. Februar 2023: 0,23 %)</b>					
260 DP World Ltd/Vereinigte Arabische Emirate, 144A, 5,625 %, fällig 25.09.2048	241	0,08			
<b>Vereinigtes Königreich – 2,01 % (28. Februar 2023: 1,64 %)</b>					
210 Barclays Plc, 7,750 %, unbefristet *	211	0,07			
680 Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, fällig 07.04.2026	791	0,28			
320 Lloyds Banking Group Plc, 4,947 %, unbefristet *	324	0,11			
250 Lloyds Banking Group Plc, 7,500 %, unbefristet *	244	0,08			
480 Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, unbefristet *	436	0,15			
442 McLaren Finance Plc, 144A, 7,500 %, fällig 01.08.2026	392	0,14			
970 NatWest Group Plc, 4,500 %, unbefristet *	937	0,33			
690 Neptune Energy Bondco Plc, 144A, 6,625 %, fällig 15.05.2025	687	0,24			
800 Saga Plc, 5,500 %, fällig 15.07.2026	775	0,27			
750 Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2029	687	0,24			
330 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	276	0,10			
	5.760	2,01			
<b>USA – 43,34 % (28. Februar 2023: 42,60 %)</b>					
574 Abercrombie & Fitch Management Co, 144A, 8,750 %, fällig 15.07.2025	585	0,20			
1.103 Accelerate360 Holdings LLC, 144A, 8,000 %, fällig 01.03.2028	1.145	0,40			
330 Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144A, 5,000 %, fällig 01.05.2028	268	0,09			
630 AdaptHealth LLC, 144A, 6,125 %, fällig 01.08.2028	569	0,20			
286 Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2028	267	0,09			
690 Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 6,375 %, fällig 15.06.2030	680	0,24			
447 Akumin Escrow Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.08.2028	297	0,10			
300 Akumin Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.11.2025	227	0,08			
240 Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 6,125 %, fällig 15.05.2028	237	0,08			
1.310 Allen Media LLC / Allen Media Co-Emitter Inc, 144A, 10,500 %, fällig 15.02.2028	751	0,26			
300 Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15.07.2026	286	0,10			

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
340 Altria Group Inc, 5,950 %, fällig 14.02.2049	317	0,11	610 Clarios Global LP / Clarios US Finance Co, 144A, 8,500 %, fällig 15.05.2027	617	0,22
300 AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.02.2029	205	0,07	1.380 Comerica Bank, 2,500 %, fällig 23.07.2024	1.314	0,46
293 American Airlines 2017-1 Klasse B Pass Through Trust, Serie B, 4,950 %, fällig 15.02.2025	284	0,10	450 CommScope Inc, 144A, 6,000 %, fällig 01.03.2026	409	0,14
430 American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2028	423	0,15	620 CommScope Inc, 144A, 4,750 %, fällig 01.09.2029	461	0,16
28 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 20.04.2026	27	0,01	910 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2031	870	0,30
720 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.04.2029	689	0,24	910 CoreCivic Inc, 8,250 %, fällig 15.04.2026	914	0,32
1.220 American News Co LLC, 144A, 8,500 %, fällig 01.09.2026	1.377	0,48	350 Crescent Energy Finance LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.02.2028	358	0,13
190 Antero Resources Corp, 144A, 5,375 %, fällig 01.03.2030	178	0,06	310 CrowdStrike Holdings Inc, 3,000 %, fällig 15.02.2029	267	0,09
210 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000 %, fällig 15.06.2027	205	0,07	450 CSC Holdings LLC, 5,250 %, fällig 01.06.2024	427	0,15
480 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 4,000 %, fällig 01.09.2029	391	0,14	1.260 CSC Holdings LLC, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2028	802	0,28
740 AthenaHealth Group Inc, 144A, 6,500 %, fällig 15.02.2030	643	0,22	1.190 CSC Holdings LLC, 144A, 11,250 %, fällig 15.05.2028	1.175	0,41
90 Aviation Capital Group LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15.12.2024	89	0,03	670 CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig 01.12.2030	478	0,17
350 Ball Corp, 2,875 %, fällig 15.08.2030	287	0,10	300 Cushman & Wakefield US Borrower LLC, 144A, 8,875 %, fällig 01.09.2031	303	0,11
340 Ball Corp, 3,125 %, fällig 15.09.2031	276	0,10	520 CVS Health Corp, 5,250 %, fällig 21.02.2033	509	0,18
320 Bath & Body Works Inc, 5,250 %, fällig 01.02.2028	307	0,11	1.000 Darling Ingredients Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.06.2030	978	0,34
510 Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.10.2030	498	0,17	470 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,750 %, fällig 15.09.2037	497	0,17
340 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.11.2025	307	0,11	1.430 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.08.2027	1.269	0,44
280 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.02.2027	184	0,06	800 DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15.11.2024	745	0,26
140 Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.01.2028	64	0,02	400 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	311	0,11
70 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,000 %, fällig 30.01.2028	30	0,01	1.210 DISH Network Corp, Nullkupon, fällig 15.12.2025	785	0,27
280 Beacon Roofing Supply Inc, 144A, 6,500 %, fällig 01.08.2030	277	0,10	116 Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, fällig 15.06.2025	114	0,04
1.540 Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	1.482	0,52	760 DraftKings Holdings Inc, Nullkupon, fällig 15.03.2028	583	0,20
320 Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625 %, fällig 01.09.2028	297	0,10	490 Earthstone Energy Holdings LLC, 144A, 9,875 %, fällig 15.07.2031	538	0,19
1.140 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, fällig 15.12.2025	1.144	0,40	623 Endeavour Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 5,750 %, fällig 30.01.2028	610	0,21
360 Boeing Co/The, 3,250 %, fällig 01.02.2035	289	0,10	220 Energy Transfer LP, 5,350 %, fällig 15.05.2045	188	0,07
500 Boeing Co/The, 5,805 %, fällig 01.05.2050	487	0,17	260 Energy Transfer LP, 6,250 %, fällig 15.04.2049	249	0,09
480 Boyne USA Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15.05.2029	434	0,15	320 Energy Transfer LP, Serie G, 7,125 %, unbefristet *	284	0,10
520 Builders FirstSource Inc, 144A, 4,250 %, fällig 01.02.2032	443	0,15	260 Entegris Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2028	237	0,08
480 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2030	441	0,15	330 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15.02.2078 *	275	0,10
370 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 9,250 %, fällig 01.07.2031	375	0,13	170 EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,000 %, fällig 01.07.2025	169	0,06
1.220 Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2030	1.226	0,43	190 EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500 %, fällig 01.07.2027	189	0,07
1.160 Carnival Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.03.2027	1.093	0,38	740 EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500 %, fällig 01.06.2030	760	0,27
290 Carnival Corp, 144A, 4,000 %, fällig 01.08.2028	260	0,09	360 EQT Corp, 6,125 %, fällig 01.02.2025	360	0,13
180 Carnival Corp, 144A, 7,000 %, fällig 15.08.2029	183	0,06	80 EQT Corp, 7,000 %, fällig 01.02.2030	84	0,03
150 Carnival Corp, 144A, 10,500 %, fällig 01.06.2030	160	0,06	770 FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig 01.01.2030	700	0,24
160 Carriage Purchaser Inc, 144A, 7,875 %, fällig 15.10.2029	120	0,04	250 FirstEnergy Corp, Serie B, 4,150 %, fällig 15.07.2027	236	0,08
460 Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.05.2029	400	0,14	220 FirstEnergy Corp, 2,650 %, fällig 01.03.2030	185	0,06
1.330 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 7,375 %, fällig 01.03.2031	1.323	0,46	426 Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 7,875 %, fällig 15.11.2025	398	0,14
870 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	706	0,25	830 Foot Locker Inc, 144A, 4,000 %, fällig 01.10.2029	625	0,22
120 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 01.06.2033	95	0,03	1.300 Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	1.016	0,35
380 CDW LLC / CDW Finance Corp, 4,125 %, fällig 01.05.2025	368	0,13	1.780 Ford Motor Co, 6,100 %, fällig 19.08.2032	1.702	0,59
170 CDW LLC / CDW Finance Corp, 3,250 %, fällig 15.02.2029	148	0,05	450 Ford Motor Credit Co LLC, 5,125 %, fällig 16.06.2025	438	0,15
1.290 Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.06.2029	1.274	0,44	200 Ford Motor Credit Co LLC, 3,625 %, fällig 17.06.2031	162	0,06
60 Charles Schwab Corp/The, 2,900 %, fällig 03.03.2032	50	0,02	1.930 Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	1.734	0,60
320 Charles Schwab Corp/The, 5,853 %, fällig 19.05.2034 *	321	0,11	1.370 Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.02.2028	1.220	0,43
320 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	298	0,10	480 Gannett Holdings LLC, 144A, 6,000 %, fällig 01.11.2026	412	0,14
680 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,400 %, fällig 01.04.2033	599	0,21	220 Gartner Inc, 144A, 3,625 %, fällig 15.06.2029	193	0,07
210 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	178	0,06	1.440 Gen Digital Inc, 144A, 7,125 %, fällig 30.09.2030	1.451	0,51
420 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, fällig 01.07.2049	323	0,11	540 GEO Group Inc/The, 10,500 %, fällig 30.06.2028	541	0,19
1.020 Chord Energy Corp, 144A, 6,375 %, fällig 01.06.2026	1.006	0,35	950 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.12.2028	830	0,29
430 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.03.2026	420	0,15	440 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.01.2026	408	0,14
1.050 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.04.2030	605	0,21	650 Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 6,250 %, fällig 15.04.2032	597	0,21
490 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15.02.2031	365	0,13	580 Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.01.2027	559	0,20
470 Citigroup Inc, Serie W, 4,000 %, unbefristet *	422	0,15	340 Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 8,875 %, fällig 15.07.2028	352	0,12
			500 Humana Inc, 5,875 %, fällig 01.03.2033	518	0,18
			1.120 IIP Operating Partnership LP, 5,500 %, fällig 25.05.2026	994	0,35
			1.380 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.11.2029	1.213	0,42
			270 Jazz Securities DAC, 144A, 4,375 %, fällig 15.01.2029	242	0,08
			60 Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,250 %, fällig 01.02.2027	54	0,02
			220 Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.06.2029	185	0,06
			1.130 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08.08.2024	1.095	0,38
			100 Las Vegas Sands Corp, 3,500 %, fällig 18.08.2026	93	0,03
			300 Legacy LifePoint Health LLC, 144A, 4,375 %, fällig 15.02.2027	260	0,09
			620 Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Emitter Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.02.2026	583	0,20
			370 LifePoint Health Inc, 144A, 9,875 %, fällig 15.08.2030	366	0,13

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventar	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventar		
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>			1.240	Southwestern Energy Co, 8,375 %, fällig 15.09.2028	1.292	0,45	
<b>USA – (Fortsetzung)</b>			880	Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig 01.02.2032	781	0,27	
490	LPL Holdings Inc, 144A, 4,000 %, fällig 15.03.2029	436	0,15	508	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025	509	0,18
290	Match Group Holdings II LLC, 144A, 4,625 %, fällig 01.06.2028	268	0,09	610	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025	611	0,21
302	McClatchy Co LLC/The, 144A, 11,000 %, fällig 15.07.2027	334	0,12	500	Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	596	0,21
780	Medline Borrower LP, 144A, 5,250 %, fällig 01.10.2029	693	0,24	530	StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.05.2029	443	0,15
660	Michaels Cos Inc/The, 144A, 7,875 %, fällig 01.05.2029	458	0,16	565	StoneX Group Inc, 144A, 8,625 %, fällig 15.06.2025	573	0,20
560	Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 6,500 %, fällig 01.05.2028	499	0,17	320	Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp, 144A, 9,000 %, fällig 15.10.2026	309	0,11
160	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	160	0,06	490	Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01.09.2026	432	0,15
300	Minerals Technologies Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.07.2028	276	0,10	260	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 31.12.2030	233	0,08
930	Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 13,250 %, fällig 15.12.2027	990	0,35	1.010	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig 01.02.2031	929	0,32
670	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,500 %, fällig 15.03.2031	435	0,15	190	Tenet Healthcare Corp, 4,625 %, fällig 15.06.2028	175	0,06
90	MSCI Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.02.2031	79	0,03	310	Time Warner Cable LLC, 6,750 %, fällig 15.06.2039	300	0,10
1.480	NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.03.2026	1.397	0,49	1.520	Titan International Inc, 7,000 %, fällig 30.04.2028	1.450	0,51
410	NCR Corp, 144A, 5,125 %, fällig 15.04.2029	373	0,13	260	TKC Holdings Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.05.2028	235	0,08
300	Newell Brands Inc, 4,000 %, fällig 01.12.2024	292	0,10	780	TopBuild Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15.03.2029	672	0,23
410	Newell Brands Inc, 4,700 %, fällig 01.04.2026	393	0,14	710	TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2026	704	0,25
250	Newell Brands Inc, 5,875 %, fällig 01.04.2036	222	0,08	200	TransDigm Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.08.2028	201	0,07
140	Newell Brands Inc, 6,000 %, fällig 01.04.2046	114	0,04	238	Transocean Inc, 144A, 8,750 %, fällig 15.02.2030	243	0,09
570	NMI Holdings Inc, 144A, 7,375 %, fällig 01.06.2025	574	0,20	1.220	Triumph Group Inc, 144A, 9,000 %, fällig 15.03.2028	1.230	0,43
300	Noble Finance II LLC, 144A, 8,000 %, fällig 15.04.2030	310	0,11	300	Truist Financial Corp, 5,122 %, fällig 26.01.2034 *	282	0,10
900	Northern Oil and Gas Inc, 144A, 8,125 %, fällig 01.03.2028	903	0,32	410	Truist Financial Corp, 5,867 %, fällig 08.06.2034 *	406	0,14
2.790	Northwest Acquisitions ULC / Dominion Finco Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.11.2022 <sup>es</sup>	–	–	1.660	Tutor Perini Corp, 144A, 6,875 %, fällig 01.05.2025	1.503	0,52
390	Occidental Petroleum Corp, 7,150 %, fällig 15.05.2028	403	0,14	52	United Airlines 2020-1 Klasse B Pass Through Trust, 4,875 %, fällig 15.01.2026	50	0,02
690	Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, fällig 15.09.2036	706	0,25	80	United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2026	75	0,03
1.380	Occidental Petroleum Corp, 7,950 %, fällig 15.06.2039	1.552	0,54	1.490	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	1.327	0,46
140	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.08.2049	100	0,04	280	United Rentals North America Inc, 5,500 %, fällig 15.05.2027	275	0,10
120	Olin Corp, 5,000 %, fällig 01.02.2030	110	0,04	170	United Rentals North America Inc, 4,875 %, fällig 15.01.2028	162	0,06
1.050	Option Care Health Inc, 144A, 4,375 %, fällig 31.10.2029	925	0,32	520	United Rentals North America Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.12.2029	517	0,18
210	Pactiv LLC, 8,375 %, fällig 15.04.2027	212	0,07	930	United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig 15.01.2030	885	0,31
1.104	Park-Ohio Industries Inc, 6,625 %, fällig 15.04.2027	959	0,33	140	Upbound Group Inc, 144A, 6,375 %, fällig 15.02.2029	127	0,04
390	Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp, 144A, 4,000 %, fällig 15.06.2029	331	0,12	310	US Bancorp, 4,839 %, fällig 01.02.2034 *	288	0,10
430	PECF USS Intermediate Holding III Corp, 144A, 8,000 %, fällig 15.11.2029	275	0,10	430	US Bancorp, 5,836 %, fällig 12.06.2034 *	430	0,15
1.580	Permian Resources Operating LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01.07.2029	1.525	0,53	154	US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, fällig 28.06.2028	99	0,03
570	Plains All American Pipeline LP Serie B, 9,736 %, unbefristet *	526	0,18	970	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 6,250 %, fällig 15.01.2030	946	0,33
1.090	PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500 %, fällig 01.10.2028	1.051	0,37	180	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 4,125 %, fällig 15.08.2031	153	0,05
370	PNC Financial Services Group Inc/The, 6,037 %, fällig 28.10.2033 *	376	0,13	120	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig 01.11.2033	98	0,03
350	PNC Financial Services Group Inc/The, 5,068 %, fällig 24.01.2034 *	332	0,12	410	Venture Global LNG Inc, 144A, 8,375 %, fällig 01.06.2031	414	0,14
880	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 3,375 %, fällig 31.08.2027	783	0,27	170	Vericast Corp, 144A, 11,000 %, fällig 15.09.2026	178	0,06
350	QVC Inc, 4,850 %, fällig 01.04.2024	340	0,12	200	Vericast Corp, 144A, 12,500 %, fällig 15.12.2027	227	0,08
750	QVC Inc, 4,450 %, fällig 15.02.2025	675	0,24	830	Vertiv Group Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.11.2028	746	0,26
310	QVC Inc, 4,375 %, fällig 01.09.2028	176	0,06	160	Viavi Solutions Inc, 144A, 3,750 %, fällig 01.10.2029	133	0,05
420	Rackspace Technology Global Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15.02.2028	200	0,07	490	Viking Cruises Ltd, 144A, 9,125 %, fällig 15.07.2031	507	0,18
370	Radiology Partners Inc, 144A, 9,250 %, fällig 01.02.2028	146	0,05	190	Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 15.02.2029	177	0,06
1.140	Range Resources Corp, 8,250 %, fällig 15.01.2029	1.185	0,41	880	Viper Energy Partners LP, 144A, 5,375 %, fällig 01.11.2027	849	0,30
30	Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.02.2030	27	0,01	630	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	585	0,20
1.580	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 3,625 %, fällig 01.03.2029	1.346	0,47	340	Warnermedia Holdings Inc, 3,755 %, fällig 15.03.2027	319	0,11
230	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 4,000 %, fällig 15.10.2033	182	0,06	450	Western Midstream Operating LP, 3,100 %, fällig 01.02.2025	431	0,15
590	Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 7,500 %, fällig 15.07.2038	561	0,20	990	Western Midstream Operating LP, 5,450 %, fällig 01.04.2044	833	0,29
134	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 11,500 %, fällig 01.06.2025	142	0,05	1.000	Western Midstream Operating LP, 5,300 %, fällig 01.03.2048	821	0,29
490	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 4,250 %, fällig 01.07.2026	457	0,16	170	Williams Cos Inc/The, 8,750 %, fällig 15.03.2032	199	0,07
310	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 11,625 %, fällig 15.08.2027	338	0,12	490	Winnebago Industries Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.07.2028	477	0,17
280	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 9,250 %, fällig 15.01.2029	299	0,10	400	WW International Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.04.2029	277	0,10
240	RR Donnelley & Sons Co, 144A, 9,750 %, fällig 31.07.2028	240	0,08	217	XPO CNW Inc, 6,700 %, fällig 01.05.2034	216	0,08
970	Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 5,625 %, fällig 01.12.2025	964	0,34	600	XPO Escrow Sub LLC, 144A, 7,500 %, fällig 15.11.2027	611	0,21
200	Sealed Air Corp/Sealed Air Corp US, 144A, 6,125 %, fällig 01.02.2028	197	0,07	290	XPO Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.06.2028	285	0,10
900	Service Properties Trust, 5,500 %, fällig 15.12.2027	798	0,28	710	Ziff Davis Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.10.2030	611	0,21
530	Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc, 144A, 4,625 %, fällig 01.11.2026	496	0,17			124.303	43,34
550	Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 6,000 %, fällig 01.11.2028	529	0,18	<b>Sambia – 1,12 % (28. Februar 2023: 0,83 %)</b>			
				207	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2025	207	0,07
				610	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 01.03.2026	601	0,21
				1.600	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2027	1.560	0,54
				840	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig 01.06.2031	856	0,30
						3.224	1,12
				<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 186.150 USD)</b>			
						173.873	60,62

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 3,60 % (28. Februar 2023: 5,45 %)</b>					
<b>Angola – 0,06 % (28. Februar 2023: 0,07 %)</b>					
210 Internationale Anleihe der Regierung von Angola, 144A, 8,750 %, fällig 14.04.2032	173	0,06			
<b>Argentinien – 0,59 % (28. Februar 2023: 0,68 %)</b>					
8 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 1,000 %, fällig 09.07.2029	2	–	EUR	790 Froner Lux FinCo SARL, 6,097 %, fällig 30.01.2027 *	848 0,29
47 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 0,750 %, fällig 09.07.2030	16	–	248 Gainwell Acquisition Corp, 9,342 %, fällig 01.10.2027 *	245	0,09
300 Ciudad Autonoma De Buenos Aires/Staatsanleihen, 7,500 %, fällig 01.06.2027	285	0,10	208 Garda World Security Corp, 9,668 %, fällig 30.10.2026 *	208	0,07
2.248 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 6,375 %, fällig 01.09.2037	857	0,30	419 Geo Group Inc/The, 12,456 %, fällig 23.03.2027 *	426	0,15
665 Provincia de Cordoba, 144A, 6,990 %, fällig 01.06.2027	539	0,19	77 Global Medical Response, Inc, 9,780 %, fällig 24.09.2025 *	54	0,02
	1.699	0,59	202 Great Outdoors Group LLC, 9,196 %, fällig 05.03.2028 *	201	0,07
<b>Bahamas – 0,19 % (28. Februar 2023: 0,19 %)</b>					
550 Internationale Anleihe von Bahamas, 144A, 5,750 %, fällig 16.01.2024	544	0,19	624 Greystone Select Financial, 10,582 %, fällig 06.05.2028 *	602	0,21
<b>Elfenbeinküste – 0,19 % (28. Februar 2023: 0,26 %)</b>					
180 Internationale Staatsanleihe der Elfenbeinküste, 144A, 4,875 %, fällig 30.01.2032	151	0,05	888 Harbor Freight Tools USA Inc, 8,196 %, fällig 19.10.2027 *	885	0,31
460 Internationale Staatsanleihe der Elfenbeinküste, 144A, 6,125 %, fällig 15.06.2033	395	0,14	195 Hayward Industries Inc., 8,196 %, fällig 14.05.2028 *	193	0,07
	546	0,19	228 Hayward Industries Inc., 8,681 %, fällig 28.05.2028 *	226	0,08
<b>Dominikanische Republik – 0,22 % (28. Februar 2023: 0,23 %)</b>					
740 Internationale Anleihe der Dominikanischen Republik, 144A, 4,875 %, fällig 23.09.2032	630	0,22	110 Hyperion Refinance S.a.r.l., 9,320 %, fällig 24.03.2030 *	110	0,04
<b>Indonesien – 1,15 % (28. Februar 2023: 1,35 %)</b>					
550 Internationale Staatsanleihe von Indonesien, 3,500 %, fällig 11.01.2028	515	0,18	255 Jazz Financing Lux S.a.r.l., 8,946 %, fällig 22.04.2028 *	255	0,09
IDR 25.412.000 Indonesien Treasury Bond, Serie FR59, 7,000 %, fällig 15.05.2027	1.710	0,59	359 Mavis Tire Express Services TopCo Corp., 9,446 %, fällig 04.05.2028 *	359	0,12
IDR 15.502.000 Indonesien Treasury Bond, Serie FR87, 6,500 %, fällig 15.02.2031	1.025	0,36	436 MRI Software LLC, 10,842 %, fällig 10.02.2026 *	427	0,15
IDR 721.000 Indonesien Treasury Bond, Serie FR68, 8,375 %, fällig 15.03.2034	54	0,02	113 MRI Software LLC, 10,842 %, fällig 10.02.2026 *	110	0,04
	3.304	1,15	473 One Call Corp, 11,113 %, fällig 07.04.2027 *	375	0,13
<b>Jordanien – 0,20 % (28. Februar 2023: 0,21 %)</b>					
560 Internationale Staatsanleihe von Jordanien, 144A, 7,750 %, fällig 15.01.2028	576	0,20	793 PECF USS Intermediate Holding Corp, 9,881 %, fällig 04.11.2028 *	636	0,22
<b>Mexiko – 0,57 % (28. Februar 2023: 0,65 %)</b>					
MXN 8.010 Mexikanische Bonos, Serie M, 5,750 %, fällig 05.03.2026	425	0,15	411 Peraton Corporation, 9,181 %, fällig 22.02.2028 *	407	0,14
MXN 13.970 Mexikanische Bonos, Serie M, 8,500 %, fällig 31.05.2029	790	0,28	509 Planview Parent Inc, 9,503 %, fällig 18.12.2027 *	502	0,17
480 Mexikanische Internationale Staatsanleihe, 4,750 %, fällig 08.03.2044	404	0,14	734 Polyconcept North America Holdings Inc, 10,831 %, fällig 12.05.2029 *	701	0,24
	1.619	0,57	496 Prime Security Installations Ltd, 8,182 %, fällig 23.09.2026 *	497	0,17
<b>Panama – 0,15 % (28. Februar 2023: 0,25 %)</b>					
580 Internationale Staatsanleihe von Panama, 4,500 %, fällig 01.04.2056	422	0,15	130 Project Sky Merger Sub, Inc., 11,431 %, fällig 10.08.2029 *	121	0,04
<b>Peru – 0,20 % (28. Februar 2023: 0,21 %)</b>					
690 Internationale Staatsanleihe von Peru, 2,783 %, fällig 23.01.2031	587	0,20	248 Qikrete Holdings, Inc., 8,320 %, fällig 18.03.2029 *	249	0,09
<b>Katar – 0,08 % (28. Februar 2023: 0,20 %)</b>					
230 Internationale Staatsanleihe von Katar, 144A, 4,817 %, fällig 14.03.2049	215	0,08	626 R.R. Donnelley, 14,500 %, fällig 08.03.2028 *	628	0,22
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 11.237 USD)</b>					
	10.315	3,60	196 Redstone Holdco 2 LP, 10,179 %, fällig 27.04.2028 *	153	0,05
<b>Schuldscheine – 7,03 % (28. Februar 2023: 5,09 %)</b>					
430 8Th Avenue Food & Provisions Inc, 13,196 %, fällig 01.10.2026 *†	293	0,10	384 RegionalCare Hospital Partners Holding, 9,377 %, fällig 16.11.2025 *	382	0,13
458 Acrisure LLC, 11,121 %, fällig 15.02.2027 *	460	0,16	440 Scotera Health Holdings LLC, 9,068 %, fällig 13.12.2026 *	442	0,15
440 Agiliti Health Inc, 8,247 %, fällig 01.05.2030 *	439	0,15	369 Sedgwick CMS Inc, 9,081 %, fällig 17.02.2028 *	370	0,13
113 Allen Media LLC, 10,892 %, fällig 10.02.2027 *	98	0,03	547 Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 9,681 %, fällig 01.04.2029 *	550	0,19
320 Allied Universal Holdco LLC, 9,881 %, fällig 04.05.2028 *	318	0,11	419 Topgolf Callaway Brands, 8,931 %, fällig 09.03.2030 *	419	0,15
3 Allied Universal Holdco LLC, 9,181 %, fällig 14.05.2028 *	3	–	302 U.S. Renal Care Inc, 10,346 %, fällig 28.06.2028 *	194	0,07
52 API Group Inc, 7,946 %, fällig 01.10.2026 *	52	0,02	244 UFC Holdings LLC, 8,369 %, fällig 29.04.2026 *	244	0,08
67 Apollo Group CMR, 8,196 %, fällig 15.05.2026 *	63	0,02	248 Vertex Aerospace Services Corp, 8,931 %, fällig 06.12.2028 *	248	0,09
248 Ascensus Holdings Inc, 8,946 %, fällig 02.08.2028 *	245	0,09	260 Virgin Media Bristol LLC, 7,925 %, fällig 04.01.2028 *	253	0,09
194 Asurion LLC, 9,431 %, fällig 17.08.2028 *	187	0,07	<b>Summe Schuldscheine (Anschaffungskosten 20.595 USD)</b>	20.168	7,03
192 Asurion LLC, 8,788 %, fällig 18.12.2026 *	187	0,07	<b>Stammaktien – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
570 Asurion LLC, 9,681 %, fällig 19.08.2028 *	552	0,19	<b>Schweiz – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
248 Brown Group Holding LLC, 7,820 %, fällig 07.06.2028 *	245	0,09	1.310 Credit Suisse Group AG Escrow †	–	–
90 Brown Group Holding LLC, 9,172 %, fällig 02.07.2029 *	90	0,03	<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten –\$)</b>	–	–
219 Caesars Entertainment, 8,681 %, fällig 25.01.2030 *	220	0,08	<b>Vorzugsaktien – 0,39 % (28. Februar 2023: 0,88 %)</b>		
878 Cinemark USA Inc, 9,069 %, fällig 24.05.2030 *	878	0,31	<b>USA – 0,39 % (28. Februar 2023: 0,88 %)</b>		
630 Clarios Global LP, 9,081 %, fällig 20.04.2030 *	630	0,22	34 MPLX LP, Serie A ∞	1.116	0,39
470 Columbus McKinnon Corp, 8,230 %, fällig 14.05.2028 *	472	0,16	<b>Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 1.095\$)</b>	1.116	0,39
248 DCert Buyer, Inc., 9,331 %, fällig 16.10.2026 *	248	0,09	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 295.755\$)</b>	275.837	96,17
340 Emerald Debt Merger Sub LLC, 8,331 %, fällig 05.05.2030 *	341	0,12			
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 11.237 USD)</b>					
	10.315	3,60			
<b>Schuldscheine – 7,03 % (28. Februar 2023: 5,09 %)</b>					
430 8Th Avenue Food & Provisions Inc, 13,196 %, fällig 01.10.2026 *†	293	0,10	<b>Nennwert (in Tsd.)</b>		
458 Acrisure LLC, 11,121 %, fällig 15.02.2027 *	460	0,16	<b>Wert (in Tsd.)</b>		
440 Agiliti Health Inc, 8,247 %, fällig 01.05.2030 *	439	0,15	<b>% vom Nettoinventarwert</b>		
113 Allen Media LLC, 10,892 %, fällig 10.02.2027 *	98	0,03	<b>Gekaufte Optionen – -0,10 % (28. Februar 2023: 0,20 %)</b>		
320 Allied Universal Holdco LLC, 9,881 %, fällig 04.05.2028 *	318	0,11	– CME 3-Monats-SOFR-Futures Dezember 2023 Call 99,25, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch		
3 Allied Universal Holdco LLC, 9,181 %, fällig 14.05.2028 *	3	–	– iShares iBoxx USD High Yield Corporate Bond ETF September 2023 Put 73,00, fällig 18.09.2023 – Goldman Sachs		
52 API Group Inc, 7,946 %, fällig 01.10.2026 *	52	0,02	– S&P 500 E-mini Dezember 2023 Put 4.100,00, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch		
67 Apollo Group CMR, 8,196 %, fällig 15.05.2026 *	63	0,02	– S&P 500 E-mini Dezember 2023 Put 4.200,00, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch		
248 Ascensus Holdings Inc, 8,946 %, fällig 02.08.2028 *	245	0,09	– S&P 500 E-mini Dezember 2023 Put 4.300,00, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch		
194 Asurion LLC, 9,431 %, fällig 17.08.2028 *	187	0,07	– S&P 500 E-mini Dezember 2023 Put 4.400,00, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch		
192 Asurion LLC, 8,788 %, fällig 18.12.2026 *	187	0,07	– S&P 500 E-mini Dezember 2023 Put 4.500,00, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch		
570 Asurion LLC, 9,681 %, fällig 19.08.2028 *	552	0,19	– S&P 500 E-mini September 2023 Put 3.900,00, fällig 15.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch		
248 Brown Group Holding LLC, 7,820 %, fällig 07.06.2028 *	245	0,09	– S&P 500 E-mini September 2023 Put 4.100,00, fällig 15.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch		
90 Brown Group Holding LLC, 9,172 %, fällig 02.07.2029 *	90	0,03			
219 Caesars Entertainment, 8,681 %, fällig 25.01.2030 *	220	0,08			
878 Cinemark USA Inc, 9,069 %, fällig 24.05.2030 *	878	0,31			
630 Clarios Global LP, 9,081 %, fällig 20.04.2030 *	630	0,22			
470 Columbus McKinnon Corp, 8,230 %, fällig 14.05.2028 *	472	0,16			
248 DCert Buyer, Inc., 9,331 %, fällig 16.10.2026 *	248	0,09			
340 Emerald Debt Merger Sub LLC, 8,331 %, fällig 05.05.2030 *	341	0,12			

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Gekaufte Optionen – (Fortsetzung)</b>			<b>Futures – -0,18 % (28. Februar 2023: -0,32 %)</b>		
– S&P 500 E-mini W3 Oktober 2023 Put 4.300,00, fällig 20.10.2023 – Bank of America Merrill Lynch	28	0,01	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-504	-0,18
– US 10 Jahre Januar 2024 Call 118,50, fällig 22.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	–	–	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>-3.345</b>	<b>-1,17</b>
– US-Anleihe mit 10 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 112,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	14	0,01	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>275.528</b>	<b>96,06</b>
– US-Anleihe mit 5 Jahren Laufzeit, Oktober 2023, Call 108,00, fällig 22.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	7	–	<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>	<b>11.281</b>	<b>3,94</b>
4.100 USD Call/GBP Put 1,2640, fällig 13.10.2023 – JP Morgan	39	0,01	<b>Gesamt Nettovermögen</b>	<b>286.809\$</b>	<b>100,00</b>
3220 USD Put/CAD Call 1,3295, fällig 09.11.2023 – BNP Paribas	12	–	– 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 %.		
2.240 USD Put/CAD Call 1,3405, fällig 18.10.2023 – BNP Paribas	10	–	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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 164.009.000\$ und machten 57,15 % des Nettovermögens aus.		
6.460 USD Put/EUR Call 1,16, fällig 02.09.2023 – Goldman Sachs	–	–	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.		
<b>Summe Gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 589 USD)</b>	<b>280</b>	<b>0,10</b>	† Nicht liquide.		
<b>Credit Default Swaps – 0,05 % (28. Februar 2023: 0,06 %)</b>			∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	150	0,05	ε Die Sicherheit ist zum 31. August 2023 notleidend (Kapital und/oder Zinsen).		
<b>Indexswaps – 0,20 % (28. Februar 2023: 0,32 %)</b>			± Auf Basis ausstehender Bekanntgabe erworbene Wertpapiere.		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	575	0,20	<b>ABKÜRZUNGEN:</b>		
<b>Swaptions – 0,02 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			– Exchange Traded Fund.		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	47	0,02	Unbefristet – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Unbefristete Anleihen sind nicht kündbar, zahlen aber einen stetigen Zinsstrom.		
<b>Devisenterminkontrakte – 0,18 % (28. Februar 2023: 0,20 %)</b>			REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit.		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	536	0,18	TBA – wird noch bekannt gegeben.		
<b>Futures – 0,51 % (28. Februar 2023: 0,02 %)</b>			CAD – Kanadischer Dollar		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1.448	0,51	EUR – Euro		
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>278.873</b>	<b>97,23</b>	GBP – Britisches Pfund		
			IDR – Indonesische Rupiah		
<b>Nennwert (in Tsd.)</b>	<b>Wert (in Tsd.) USD</b>	<b>% vom Nettoinventarwert</b>	MXN – Mexikanischer Peso		
<b>Geschriebene Optionen – -0,02 % (28. Februar 2023: -0,01 %)</b>			<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>		<b>% des Gesamtvermögens</b>
– S&P 500 E-mini Dezember 2023 Put 3.700,00, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-8	–	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	87,00	
– S&P 500 E-mini Dezember 2023 Put 4.000,00, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-38	-0,02	Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	6,86	
– S&P 500 E-mini September 2023 Put 3.500,00, fällig 15.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	–	–	Finanzderivate	1,03	
– S&P 500 E-mini September 2023 Put 3.700,00, fällig 15.09.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-1	–	Sonstige Vermögenswerte	5,11	
– S&P 500 E-mini W3 Oktober 2023 Put 4.000,00, fällig 20.10.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-9	–	<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>	
<b>Gesamtbetrag der geschriebenen Optionen (Anschaffungskosten 170 USD)</b>	<b>-56</b>	<b>-0,02</b>			
<b>Zinsswaps – 0,12 % (28. Februar 2023: -0,28 %)</b>					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-353	-0,12			
<b>Swaptions – -0,03 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-73	-0,03			
<b>Devisenterminkontrakte – -0,82 % (28. Februar 2023: -1,08 %)</b>					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-2.359	-0,82			

### Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tausend)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000 % – Verkauf	20. Jun. 2028	1.625	\$ 45
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20. Jun. 2028	6.779	105
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tausend): 155\$)				\$ 150
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tausend): – USD)				–
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tausend): 155\$)				\$ 150

### Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Prozentsatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tausend)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay variabel MXN TIIE Banxico, receive fest 7,450 %	18. Juli 2029	80.214	\$ -290
JP Morgan	Pay variabel BRL CDI, receive fest 10,230 %	02. Jan. 2029	23.600	-63
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tausend): – USD)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-756)				-353
Netto-Wertminderung der Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-756)				\$ -353

### Aufstellung der Indexswaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tausend)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fest 2,600 %, Receive Variabel USD SOFR Compound	15. Feb. 2048	663	\$ 112
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fest 3,050 %, Receive Variabel USD SOFR Compound	15. Feb. 2048	2.529	244
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fest 3,150 %, Receive Variabel USD SOFR Compound	15. May 2048	2.739	219
Nicht realisierte Wertsteigerung von Indexswaps (28. Februar 2023 (in Tausend): 878\$)				\$ 575
Nicht realisierte Wertminderung von Indexswaps (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-5)				–
Nettowertsteigerung der Indexswaps (28. Februar 2023 (in Tausend): 873\$)				\$ 575

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Swaptions

Gegenpartei	Beschreibung	Stichtag:	Nominalbetrag (in Tausend)	Wert (in Tsd.)
JP Morgan	Ausübungspreis Swaption Receiver 0,70 %	21. Sep. 2023	27.567	\$ -73
JP Morgan	Ausübungspreis Swaption Receiver 1,02 %	21. Sep. 2023	5.513	47
Nicht realisierte Wertsteigerung von Swaptions (28. Februar 2023 (in Tausend): – USD)				\$ 47
Nicht realisierte Wertminderung von Swaptions (28. Februar 2023 (in Tausend): – USD)				-73
Nettowertminderung von Swaptions (28. Februar 2023 (in Tausend): – USD)				\$ -26

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)		
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	5	Verkauf	GBP	4	\$ –
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	1	Verkauf	USD	2	–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	2.541	Verkauf	USD	1.878	3
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1.878	Verkauf	CAD	2.541	-3
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	45	Verkauf	CHF	40	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	438	Verkauf	EUR	402	1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	10	Verkauf	GBP	8	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	905	Verkauf	GBP	712	4
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	852	Verkauf	USD	1.073	6
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	144.755	Verkauf	USD	184.348	-960
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	55.940	Verkauf	USD	61.545	-844
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CHF	3.846	Verkauf	USD	4.403	-42
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	24.361	Verkauf	USD	18.145	-111
16. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf	GBP	682	Verkauf	USD	886	-22
18. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf	USD	784	Verkauf	CAD	1.061	-2
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf	USD	659	Verkauf	AUD	960	36
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf	USD	3.042	Verkauf	CAD	4.123	-11
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf	USD	1.138	Verkauf	CAD	1.508	21
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf	USD	741	Verkauf	EUR	680	2
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf	USD	2.498	Verkauf	NOK	25.330	112
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf	AUD	8.320	Verkauf	USD	5.553	-151
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf	CAD	4.350	Verkauf	USD	3.208	14
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf	EUR	2.400	Verkauf	USD	2.628	-19
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf	NOK	36.768	Verkauf	USD	3.460	3
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf	AUD	1.730	Verkauf	USD	1.122	1
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf	CAD	1.770	Verkauf	USD	1.319	-7
20. Okt. 2023	Citi	Kauf	USD	8	Verkauf	AUD	12	–
20. Okt. 2023	Citi	Kauf	USD	387	Verkauf	GBP	295	13
20. Okt. 2023	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.569	Verkauf	MXN	27.260	-16
20. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf	USD	960	Verkauf	AUD	1.420	38
20. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf	USD	778	Verkauf	IDR	11.746.964	7
20. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf	USD	564	Verkauf	NOK	5.720	25
20. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf	USD	–	Verkauf	NZD	–	–
20. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf	AUD	1.030	Verkauf	USD	680	-11
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	5	Verkauf	BRL	23	–
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	711	Verkauf	CNH	5.070	13
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	7.955	Verkauf	EUR	7.228	99
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	8.264	Verkauf	GBP	6.436	110
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	388	Verkauf	MXN	6.740	-4
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	GBP	128	Verkauf	USD	166	-4
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	EUR	1.580	Verkauf	USD	1.712	5
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	GBP	1.830	Verkauf	USD	2.307	10
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	CNH	5.073	Verkauf	USD	705	-6
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	CAD	3.348	Verkauf	USD	2.499	-19
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	NOK	6.170	Verkauf	USD	608	-27
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	MXN	6.740	Verkauf	USD	383	9
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	JPY	404.154	Verkauf	USD	2.900	-100
09. Nov. 2023	BNP Paribas	Kauf	USD	1.127	Verkauf	CAD	1.516	\$ 4
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 536\$)							\$ 536	
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-2.965)							-2.359	
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-2.429)							\$ -1.823	

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
3-Monats-SOFR-Index Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-91	USD -21.522	\$ 128
3-Monats-SOFR-Index Dezember 2024	Bank of America Merrill Lynch.	49	11.739	-101
3-Monats-SOFR-Index Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch.	49	11.608	-33
Australische 10-jährige Anleihe September 2023	Bank of America Merrill Lynch.	20	1.505	-18
Euro-Buxl 30-jährige Anleihe Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-1	-145	-2
ICE 3-Monats-SONIA Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	37	11.049	51
ICE 3-Monats-SONIA Dezember 2024	Bank of America Merrill Lynch.	1	300	-
ICE 3-Monats-SONIA Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch.	22	6.613	-57
ICE 3-Monats-SONIA Juni 2024	Bank of America Merrill Lynch.	38	11.360	2
ICE 3-Monats-SONIA September 2023	Bank of America Merrill Lynch.	117	35.005	-293
Long Gilt Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	24	2.906	52
US-10-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	468	51.963	539
US 10 Jahre Ultra Note Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	10	1.161	14
US-2-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	180	36.685	89
US-5-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	121	12.938	80
US Long Bond (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	18	2.190	40
US Ultra Bond (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	166	21.492	453
Nicht realisierte Wertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): 53\$)				\$ 1448
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-890)				-504
Nettowertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-837)				\$ 944

# FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Forderungenbesicherte Wertpapiere – 12,13 % (28. Februar 2023: 12,60 %)</b>			<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 79,99 % (28. Februar 2023: 80,10 %)</b>		
1.190			449		
Accredited Mortgage Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Klasse M5, 5,460 %, fällig 25.04.2035 *	1.196	0,23	Alternative Loan Trust 2005-56, Serie 2005 56, Klasse 4A1, 6,049 %, fällig 25.11.2035 *	404	0,08
2.390			1.135		
BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust, Serie 1996 1, Klasse B1, 7,875 %, fällig 10.10.2026	75	0,02	Alternative Loan Trust 2005-80CB, Serie 2005 80CB, Klasse 2A1, 6,000 %, fällig 25.02.2036	1.058	0,20
642			2.116		
Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Serie 2007 B, Klasse 1A2, 7,331 %, fällig 28.08.2047	534	0,10	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A14, 6,000 %, fällig 25.08.2036	1.279	0,25
1.244			538		
Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Serie 2007 B, Klasse 1A3, 7,719 %, fällig 28.08.2047	333	0,06	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A15, 6,000 %, fällig 25.08.2036	325	0,06
73			551		
Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-CL1, Serie 2005 CL1, Klasse A1, 3,646 %, fällig 25.09.2034 *	71	0,01	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A16, 6,000 %, fällig 25.08.2036	333	0,06
3.660			624		
Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd 2016-1, Serie 2016 1A, Klasse B, 144A, 5,682 %, fällig 16.12.2041	2.614	0,51	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A20, 4,623 %, fällig 25.08.2036 *	405	0,08
5.526			603		
Conseco Finance Securitizations Corp, Serie 2000 3, Klasse A, 144A, 8,260 %, fällig 01.12.2030 *	1.397	0,27	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A24, 6,000 %, fällig 25.08.2036	365	0,07
803			767		
Landesweite Asset-Backed-Zertifikate, Serie 2007 SD1, Klasse A1, 144A, 6,329 %, fällig 25.03.2047 *	605	0,12	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A3, 6,000 %, fällig 25.08.2036 *	464	0,09
764			82		
Credit-Based Asset Servicing and Securitization LLC, Serie 2007 MX1, Klasse A4, 144A, 6,231 %, fällig 25.12.2036	756	0,15	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A7, 6,000 %, fällig 25.08.2036	49	0,01
1.888			366		
CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2004-9, Serie 2004 9, Klasse MF2, 5,572 %, fällig 25.11.2034 *	1.736	0,34	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Klasse A8, 6,000 %, fällig 25.08.2036	221	0,04
1.489			4.706		
Dividend Solar Loans 2018-1 LLC, Serie 2018 1, Klasse D, 144A, 6,390 %, fällig 20.07.2038	1.227	0,24	Alternative Loan Trust 2006-28CB, Serie 2006 28CB, Klasse A12, 0,471 %, fällig 25.10.2036 *†	482	0,09
3.092			936		
Dividend Solar Loans 2018-2 LLC, Serie 2018 2, Klasse D, 144A, 5,910 %, fällig 20.12.2038	2.381	0,46	Alternative Loan Trust 2007-23CB, Serie 2007 23CB, Klasse A8, 6,682 %, fällig 25.09.2037 *	737	0,14
4.869			6.297		
Fieldstone Mortgage Investment Trust Serie 2005-2, Serie 2005 2, Klasse M3, 6,209 %, fällig 25.12.2035 *	4.215	0,82	Alternative Loan Trust 2007-5CB, Serie 2007 5CB, Klasse 1A20, 0,031 %, fällig 25.04.2037 *†	557	0,11
3			2.477		
First Franklin Mortgage Loan Trust 2002-FF1, Serie 2002 FF1, Klasse 1A2, 6,558 %, fällig 25.04.2032 *	3	–	BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RGG10, Serie 2016 GG10, Klasse AJA, 144A, 5,810 %, fällig 10.08.2045 *	539	0,10
6.593			374		
Fremont Home Loan Trust 2006-B, Serie 2006 B, Klasse 1A, 5,729 %, fällig 25.08.2036 *	2.750	0,53	Banc of America Funding 2015-R4 Trust, Serie 2015 R4, Klasse 4A2, 144A, 4,500 %, fällig 27.01.2030 *	371	0,07
2.311			4.147		
GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, Serie 2021 4GS, Klasse C, 144A, 3,500 %, fällig 20.07.2048	1.658	0,32	Banc of America Funding 2015-R4 Trust, Serie 2015 R4, Klasse 4A3, 144A, 7,382 %, fällig 27.01.2030 *	1.468	0,28
2.868			6.000		
GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2022-1, Serie 2022 1GS, Klasse C, 144A, 3,500 %, fällig 20.01.2049	1.901	0,37	BCCRE Trust 2015-GTP, Serie 2015 GTP, Klasse F, 144A, 4,715 %, fällig 10.08.2033 *	4.169	0,81
2.827			5.404		
HERO Funding Trust 2016-1, Serie 2016 1A, Klasse R, 144A, 0,000 %, fällig 20.09.2041	378	0,07	BCAP LLC 2014-RR2, Serie 2014 RR2, Klasse 10A2, 144A, 4,336 %, fällig 26.07.2046 *	4.444	0,86
500			819		
HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Serie 2021 FL1, Klasse E, 144A, 8,377 %, fällig 16.06.2036 *	458	0,09	BCAP LLC Trust 2007-AA3, Serie 2007 AA3, Klasse 1A2, 5,969 %, fällig 25.04.2037 *	1.089	0,21
3.322			1.248		
Home Partners of America 2021-2 Trust, Serie 2021 2, Klasse F, 144A, 3,799 %, fällig 17.12.2026	2.870	0,56	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2004-AC6, Serie 2004 AC6, Klasse A1, 5,750 %, fällig 25.11.2034	1.066	0,21
1.373			1.036		
Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, Serie 2021 1GS, Klasse C, 144A, 3,500 %, fällig 20.01.2048	914	0,18	Bellemeade Re 2018-1 Ltd, Serie 2018 1A, Klasse M2, 144A, 8,329 %, fällig 25.04.2028 *	1.040	0,20
2.331			10.010		
Loanpal Solar Loan 2021-2 Ltd, Serie 2021 2GS, Klasse C, 144A, 3,500 %, fällig 20.03.2048	1.476	0,28	BHMS 2018-MZB, Serie 2018 MZB, Klasse MZB, 144A, 12,244 %, fällig 15.07.2025 *	8.970	1,74
1.176			3.500		
Loanpal Solar Loan Ltd, Serie 2020 3GS, Klasse C, 144A, 3,500 %, fällig 20.12.2047	744	0,14	BX Trust 2018-GW MZ, Serie 2018 GWMZ, Klasse MC, 144A, 11,095 %, fällig 15.05.2037 *	3.446	0,67
30			1.750		
Long Beach Mortgage Loan Trust 2002-2, Serie 2002 2, Klasse M2, 5,964 %, fällig 25.07.2032 *	29	0,01	BX Trust 2018-GW, Serie 2018 GW, Klasse G, 144A, 8,528 %, fällig 15.05.2035 *	1.707	0,33
4.648			870		
Magnolia Finance, 8,205 %, fällig 09.08.2024	4.493	0,87	BX Trust 2021-VIEW, Serie 2021 VIEW, Klasse E, 144A, 9,024 %, fällig 15.06.2036 *	782	0,15
73			3.431		
Mastr Specialized Loan Trust, Serie 2006 2, Klasse A, 144A, 5,949 %, fällig 25.02.2036 *	70	0,01	Chase Mortgage Finance Trust Serie 2007-A1, Serie 2007 A1, Klasse 11M1, 4,081 %, fällig 25.03.2037 *	3.202	0,62
3			869		
Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust Serie 2003-SD1, Serie 2003 SD1, Klasse A1, 6,429 %, fällig 25.03.2033 *	3	–	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Serie 2004-4, Serie 2004 4A, Class B1, 144A, 4,491 %, fällig 25.10.2035 *	643	0,12
1.244			267		
Mosaik Solar Loan Trust 2018-1, Serie 2018 1A, Klasse CERT, 144A, 0,000 %, fällig 22.06.2043 ∞	809	0,16	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Serie 2005-1, Serie 2005 1A, Class A2, 144A, 5,629 %, fällig 25.01.2036 *	240	0,05
3.000			454		
National Collegiate II Commutation Trust, Serie 2005 AR15, Klasse AR15, 0,000 %, fällig 01.06.2045	337	0,07	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Serie 2005-B, Serie 2005 BA, Klasse B1, 144A, 5,829 %, fällig 25.06.2036 *	370	0,07
7.796			401		
National Collegiate Student Loan Trust 2005-3, Serie 2005 3, Klasse B, 5,929 %, fällig 27.07.2037 *	5.804	1,12	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2004-25, Serie 2004 25, Klasse 2A1, 6,109 %, fällig 25.02.2035 *	338	0,07
5.987			346		
National Collegiate V Commutation Trust, Serie 2007 33A5, Klasse 10, 144A, 0,000 %, fällig 25.03.2038 *	1.551	0,30	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-11, Serie 2005 11, Klasse 3A3, 3,562 %, fällig 25.04.2035 *	256	0,05
6.140			214		
National Collegiate V Commutation Trust, Serie 2007 33A6, Klasse 10, 144A, 0,000 %, fällig 25.03.2038 *	1.460	0,28	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-25, Serie 2005 25, Klasse A15, 2,713 %, fällig 25.11.2035 *	118	0,02
3.402			771		
NRZ Excess Spread-Collateralized Notes, Serie 2021 FHT1, Klasse A, 144A, 3,104 %, fällig 25.07.2026	3.039	0,59	Citicorp Mortgage Securities Trust Serie 2007-3, Serie 2007 3, Klasse 1A4, 6,000 %, fällig 25.04.2037	706	0,14
2.543			2.990		
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-2, Serie 2005 2, Klasse M2, 5,717 %, fällig 25.04.2035	1.884	0,37	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, Serie 2014 GC23, Klasse C, 4,572 %, fällig 10.07.2047 *	2.772	0,54
2.352			9.200		
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-5, Serie 2005 5, Klasse MV2, 3,273 %, fällig 25.11.2035 *	2.082	0,40	Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-AR6, Serie 2006 AR6, Klasse 2A4, 5,869 %, fällig 25.09.2036 *	2.884	0,56
120			761		
SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM 2017-F LLC, Serie 2017 F, Klasse R1, 144A, 0,000 %, fällig 25.01.2041	1.452	0,28	Citigroup Mortgage Loan Trust 2008-3, Serie 2008 3, Klasse A3, 144A, 6,100 %, fällig 25.04.2037	342	0,07
–			3.529		
Southern Pacific Secured Assets Corp, Serie 1998 1, Klasse A7, 6,510 %, fällig 25.12.2027 *	–	–	Citigroup Mortgage Loan Trust 2014-J2, Serie 2014 J2, Klasse B5, 144A, 3,808 %, fällig 25.11.2044 *	1.956	0,38
569			3.250		
Stonepeak 2021-1 ABS, Serie 2021 1A, Klasse A, 144A, 2,675 %, fällig 28.02.2033	507	0,10	COLT 2021-RPL1 Trust, Serie 2021 RPL1, Klasse B1, 144A, 4,796 %, fällig 25.09.2061 *	2.510	0,49
2.996			1.908		
Stonepeak 2021-1 ABS, Serie 2021 1A, Klasse B, 144A, 3,821 %, fällig 28.02.2033	2.541	0,49	Comm 2014-UBS2 Mortgage Trust, Serie 2014 UBS2, Klasse E, 144A, 5,149 %, fällig 10.03.2047 *	1.595	0,31
3.363			5.060		
Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2005-9XS, Serie 2005 9XS, Klasse M2, 6,404 %, fällig 25.06.2035 *	3.298	0,64	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Serie 2019 R05, Klasse 1B1, 144A, 9,502 %, fällig 25.07.2039 *	5.216	1,01
1.397					
Structured Asset Securities Corp Trust 2005-SC1, Serie 2005 SC1, Klasse 1A1, 144A, 5,699 %, fällig 25.05.2031 *	1.006	0,20			
2.375					
Sunnova Sol Issuer LLC, Serie 2020 1A, Klasse B, 144A, 5,540 %, fällig 01.02.2055	1.926	0,37			
<b>Summe forderungsbesicherten Wertpapiere (Anschaffungskosten 84.570 USD)</b>	<b>62.583</b>	<b>12,13</b>			

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventar	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventar		
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)</b>							
8.330	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Serie 2019 R07, Klasse 1B1, 144A, 8,802 %, fällig 25.10.2039 *	8.461	1,64	3.100	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Serie 2019 DNA3, Klasse B2, 144A, 13,552 %, fällig 25.07.2049 *	3.394	0,66
5.760	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Klasse 1B1, 144A, 8,388 %, fällig 25.10.2041 *	5.742	1,11	5.550	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA4, Serie 2019 DNA4, Klasse B2, 144A, 11,652 %, fällig 25.10.2049 *	5.805	1,12
67	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, Serie 2005 C2, Klasse AMFX, 4,877 %, fällig 15.04.2037	66	0,01	4.000	Freddie Mac Stacr Trust 2019-FTR4, Serie 2019 FTR4, Klasse B2, 144A, 10,402 %, fällig 25.11.2047 *	3.863	0,75
310	CSFB Mortgage-Backed Pass-Through-Zertifikate Serie 2004-AR5, Serie 2004 AR5, Klasse CB2, 4,542 %, fällig 25.06.2034 *	248	0,05	4.925	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2016 DNA1, Klasse B, 15,402 %, fällig 25.07.2028 *	5.485	1,06
9.700	CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Klasse E, 144A, 4,373 %, fällig 15.09.2037	5.089	0,99	2.507	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2016 DNA2, Klasse B, 15,902 %, fällig 25.10.2028 *	2.821	0,55
9.200	CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Klasse F, 144A, 4,373 %, fällig 15.09.2037	3.618	0,70	2.541	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2016 DNA3, Klasse B, 16,652 %, fällig 25.12.2028 *	2.912	0,56
4.373	CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Klasse B1, 144A, 2,963 %, fällig 25.07.2057 *	2.861	0,55	5.482	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2016 DNA4, Klasse B, 14,002 %, fällig 25.03.2029 *	5.916	1,15
5.017	CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Klasse B2, 144A, 2,963 %, fällig 25.07.2057 *	3.188	0,62	3.943	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2017 DNA2, Klasse B2, 16,652 %, fällig 25.10.2029 *	4.578	0,89
4.266	CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Klasse B3, 144A, 2,963 %, fällig 25.07.2057 *	2.360	0,46	6.304	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2017 HRP1, Klasse B2D, 8,402 %, fällig 25.12.2042 *	4.615	0,89
4.329	CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Klasse B4, 144A, 2,963 %, fällig 25.07.2057 *	806	0,16	3.995	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2018 SPI1, Klasse B, 144A, 3,784 %, fällig 25.02.2048 *	2.410	0,47
2.143	CSMC 2017-RPL3 Trust, Serie 2017 RPL3, Klasse B3, 144A, 4,464 %, fällig 01.08.2057 *	1.964	0,38	5.873	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2018 SPI2, Klasse B, 144A, 3,836 %, fällig 25.05.2048 *	3.715	0,72
5.782	CSMC 2017-RPL3 Trust, Serie 2017 RPL3, Klasse B4, 144A, 4,464 %, fällig 01.08.2057 *	5.246	1,02	6.859	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2018 SPI3, Klasse B, 144A, 4,159 %, fällig 25.08.2048 *	4.720	0,91
7.888	CSMC Mortgage-Backed Trust 2006-7, Serie 2006 7, Klasse 11A2, 1,071 %, fällig 25.08.2036 *†	1.046	0,20	25.814	FRESB 2018-SB48 Mortgage Trust, Serie 2018 SB48, Klasse B, 144A, 4,285 %, fällig 25.02.2038 *	20.068	3,89
98	CSMC Resecuritization Trust 2006-1R, Serie 2006 1R, Klasse 1A2, 144A, 4,580 %, fällig 27.07.2036 *	125	0,02	713	Government National Mortgage Association, Serie 2010 102, Klasse IO, 0,010 %, fällig 16.06.2052 *	–	–
4.374	CSMC Serie 2015-2R, Serie 2015 2R, Klasse 7A2, 144A, 4,259 %, fällig 27.08.2036 *	3.386	0,66	3.851	Government National Mortgage Association, Serie 2010 13, Klasse IO, 0,000 %, fällig 16.11.2051 *	–	–
4.307	CSMC Trust 2013-IVR5, Serie 2013 IVR5, Klasse B5, 144A, 3,622 %, fällig 25.10.2043 *	2.840	0,55	497	Government National Mortgage Association, Serie 2011 127, Klasse IO, 0,143 %, fällig 16.03.2047 *	–	–
2.000	CSMC Trust 2017-CHOP, Serie 2017 CHOP, Klasse H, 144A, 12,794 %, fällig 15.07.2032 *	1.838	0,36	12.609	Government National Mortgage Association, Serie 2011 95, Klasse IO, 0,007 %, fällig 16.04.2051 *	1	–
307.495	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Klasse AX1, 144A, 0,086 %, fällig 25.02.2048 *	747	0,14	8.089	Government National Mortgage Association, Serie 2012 114, Klasse IO, 0,620 %, fällig 16.01.2053 *	126	0,02
4.225	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Klasse B5, 144A, 3,586 %, fällig 25.02.2048 *	2.883	0,56	3.206	Government National Mortgage Association, Serie 2013 163, Klasse IO, 1,012 %, fällig 16.02.2046 *	47	0,01
8.649	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Klasse B6, 144A, 3,586 %, fällig 25.02.2048 *	4.331	0,84	5.581	Government National Mortgage Association, Serie 2014 16, Klasse IO, 0,450 %, fällig 16.06.2055 *	77	0,01
–	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Klasse SA, 144A, 0,000 %, fällig 25.02.2048	–	–	7.212	Government National Mortgage Association, Serie 2014 171, Klasse IO, 0,414 %, fällig 16.11.2055 *	64	0,01
4.000	CSWF 2018-TOP, Serie 2018 TOP, Klasse H, 144A, 8,970 %, fällig 15.08.2035 *	3.634	0,70	732	Government National Mortgage Association, Serie 2014 47, Klasse IA, 0,148 %, fällig 16.02.2048 *	3	–
581	DSLA Mortgage Loan Trust 2004-AR4, Serie 2004 AR4, Klasse 2A2B, 6,268 %, fällig 19.01.2045 *	389	0,08	3.538	Government National Mortgage Association, Serie 2014 50, Klasse IO, 0,628 %, fällig 16.09.2055 *	89	0,02
1.324	DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR3, Serie 2005 AR3, Klasse 2A1B, 5,908 %, fällig 19.07.2045 *	1.235	0,24	688	Government National Mortgage Association, Serie 2016 135, Klasse SB, 0,673 %, fällig 16.10.2046 *	90	0,02
2.350	DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR5, Serie 2005 AR5, Klasse 2A1B, 6,108 %, fällig 19.09.2045 *	1.731	0,34	653	Government National Mortgage Association, Serie 2016 51, Klasse NS, 0,622 %, fällig 20.04.2046 *	65	0,01
468	DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Serie 2007 AR1, Klasse 2A1B, 5,608 %, fällig 19.04.2047 *	497	0,10	3.316	Government National Mortgage Association, Serie 2018 125, Klasse HS, 0,822 %, fällig 20.09.2048 *	276	0,05
5.323	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C01, Klasse 1B, 17,152 %, fällig 25.08.2028 *	6.020	1,17	4.456	Government National Mortgage Association, Serie 2022 202, Klasse Z, 3,000 %, fällig 16.10.2063 *	2.569	0,50
3.661	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C02, Klasse 1B, 17,652 %, fällig 25.09.2028 *	4.249	0,82	2.620	Government National Mortgage Association, Serie 2023 16, Klasse Z, 3,500 %, fällig 16.07.2063 *	1.644	0,32
2.937	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C03, Klasse 1B, 17,152 %, fällig 25.10.2028 *	3.361	0,65	25.698	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Klasse D, 144A, 11,925 %, fällig 15.09.2031 *	4.870	0,94
4.874	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C04, Klasse 1B, 15,652 %, fällig 25.01.2029 *	5.374	1,04	1.250	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC26, Serie 2014 GC26, Klasse D, 144A, 4,662 %, fällig 10.11.2047 *	821	0,16
7.163	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C06, Klasse 1B, 14,652 %, fällig 25.04.2029 *	7.720	1,50	3.200	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC28, Serie 2015 GC28, Klasse D, 144A, 4,452 %, fällig 10.02.2048 *	2.725	0,53
3.875	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C06, Klasse 1B1, 9,152 %, fällig 25.03.2031 *	4.139	0,80	1.500	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC32, Serie 2015 GC32, Klasse D, 3,345 %, fällig 10.07.2048	1.261	0,24
1.613	Fannie Mae REMICS, Serie 2017 85, Klasse SC, 0,798 %, fällig 25.11.2047 *	131	0,03	4.871	GSR Mortgage Loan Trust 2006-1F, Serie 2006 1F, Klasse 6A1, 5,829 %, fällig 25.02.2036 *	501	0,10
3.590	Freddie Mac Multifamily Structured Credit Risk, Serie 2021 MN2, Klasse M2, 144A, 8,638 %, fällig 25.07.2041 *	3.273	0,63	78	HarborView Mortgage Loan Trust 2004-11, Serie 2004 11, Klasse 3A3, 6,188 %, fällig 19.01.2035 *	71	0,01
6.605	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K038, Klasse X3, 2,568 %, fällig 25.06.2042 *	93	0,02	47	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Klasse 2A1A, 5,968 %, fällig 19.03.2035 *	46	0,01
19.370	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K052, Klasse X3, 1,671 %, fällig 25.01.2044 *	590	0,11	123	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-10, Serie 2005 10, Klasse 2A1A, 6,048 %, fällig 19.11.2035 *	87	0,02
6.000	Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-DNA1, Serie 2020 DNA1, Klasse B2, 144A, 10,652 %, fällig 25.01.2050 *	6.023	1,17	415	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-2, Serie 2005 2, Klasse 2A1A, 5,868 %, fällig 19.05.2035 *	378	0,07
8.000	Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, Serie 2020 DNA2, Klasse B2, 144A, 10,202 %, fällig 25.02.2050 *	7.856	1,52	180	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-3, Serie 2005 3, Klasse 2A1A, 5,908 %, fällig 19.06.2035 *	171	0,03
530	Freddie Mac STACR Remic Trust 2021-DNA5, Serie 2021 DNA5, Klasse B2, 144A, 10,788 %, fällig 25.01.2034 *	499	0,10	1.880	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-8, Serie 2005 8, Klasse 2A2, 5,930 %, fällig 19.09.2035 *	1.666	0,32
5.020	Freddie Mac STACR Remic Trust 2021-DNA6, Serie 2021 DNA6, Klasse B2, 144A, 12,788 %, fällig 25.10.2041 *	5.150	1,00	448	HarborView Mortgage Loan Trust 2006-10, Serie 2006 10, Klasse 2A1A, 5,608 %, fällig 19.11.2036 *	395	0,08
4.620	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA1, Serie 2019 DNA1, Klasse B2, 144A, 16,152 %, fällig 25.01.2049 *	5.604	1,09	744	Impac CMB Trust Serie 2005-1, Serie 2005 1, Klasse M1, 6,119 %, fällig 25.04.2035 *	685	0,13
4.600	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Serie 2019 DNA3, Klasse B1, 144A, 8,652 %, fällig 25.07.2049 *	4.789	0,93	1.587	Impac CMB Trust Serie 2005-3, Serie 2005 3, Klasse A2, 6,029 %, fällig 25.08.2035 *	1.464	0,28

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventar	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventar
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)</b>					
649			3.481		
Impac CMB Trust Serie 2005-4, Serie 2005 4, Klasse 1M1, 6,074 %, fällig 25.05.2035 *	587	0,11	PMT Credit Risk Transfer Trust 2021-1R, Serie 2021 1R, Klasse A, 144A, 8,343 %, fällig 27.02.2024 *	3.464	0,67
996			2.910		
Impac CMB Trust Serie 2005-7, Serie 2005 7, Klasse A1, 5,949 %, fällig 25.11.2035 *	870	0,17	PMT Credit Risk Transfer Trust, 144A, 8,883 %, fällig 29.10.2024 *	2.866	0,56
1.268			3.191		
Impac Secured Assets Trust 2006-2, Serie 2006 2, Klasse 2B, 7,079 %, fällig 25.08.2036 *	1.256	0,24	PMT Credit Risk Transfer Trust, 144A, 8,533 %, fällig 27.02.2025 *	3.103	0,60
33			599		
Impac Secured Assets Trust 2006-2, Serie 2006 2, Klasse 2M3, 7,079 %, fällig 25.08.2036 *	33	0,01	RALI Serie 2006-QA2 Trust, Serie 2006 QA2, Klasse 1A1, 5,679 %, fällig 25.02.2036 *	385	0,07
623			12.658		
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR13, Serie 2005 AR13, Klasse 1A1, 3,921 %, fällig 25.08.2035 *	315	0,06	Redwood Funding Trust 2019-1, Serie 2019 1, Klasse PT, 144A, 4,968 %, fällig 27.09.2024 *	12.373	2,40
628			1.024		
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR2, Serie 2005 AR2, Klasse 2A1B, 6,209 %, fällig 25.02.2035 *	449	0,09	Reperforming-Darlehen REMIC Trust 2006-R2, Serie 2006 R2, Klasse AF1, 144A, 5,849 %, fällig 25.07.2036 *	932	0,18
1.853			3.449		
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR6, Serie 2005 AR6, Klasse 2A2, 6,089 %, fällig 25.04.2035 *	1.447	0,28	Residential Asset Securitization Trust 2006-A7CB, Serie 2006 A7CB, Klasse 1A3, 6,250 %, fällig 25.07.2036 *	2.637	0,51
2.395			12.928		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, Serie 2017 FL11, Klasse E, 144A, 9,464 %, fällig 15.10.2032 *	2.392	0,46	Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, Serie 2017 4, Klasse B, 144A, 0,000 %, fällig 25.06.2057 †	1.624	0,31
2.250			19.478		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, Serie 2017 FL11, Klasse F, 144A, 10,764 %, fällig 15.10.2032 *	2.238	0,43	Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, Serie 2017 4, Klasse BIO, 144A, 1,677 %, fällig 25.06.2057 †	2.868	0,56
28.545			4.397		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Serie 2018 PHMZ, Klasse M, 144A, 13,933 %, fällig 15.06.2035 *te	-	-	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2016-1, Serie 2016 1, Klasse B, 144A, 0,000 %, fällig 25.09.2055 †	399	0,08
4.022			7.814		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-FL7, Serie 2015 FL7, Klasse D, 144A, 9,193 %, fällig 15.05.2028 *	3.583	0,69	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2016-1, Serie 2016 1, Klasse BIO, 144A, 0,809 %, fällig 25.09.2055 †	913	0,18
3.600			3.394		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1, Serie 2015 JP1, Klasse C, 4,881 %, fällig 15.01.2049 *	3.029	0,59	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2016-1, Serie 2016 1, Klasse M2, 144A, 3,750 %, fällig 25.09.2055 *	3.037	0,59
1.800			50.342		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Serie 2018 WPT, Klasse GFL, 144A, 9,205 %, fällig 05.07.2033 *	1.342	0,26	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2016-1, Serie 2016 1, Klasse XSIO, 144A, 0,075 %, fällig 25.09.2055 †	222	0,04
6.574			12.909		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Serie 2020 MKST, Klasse G, 144A, 9,924 %, fällig 15.12.2036 *	1.139	0,22	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-2, Serie 2017 2, Klasse B, 144A, 0,000 %, fällig 25.08.2056 †	1.076	0,21
6.867			20.889		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Serie 2020 MKST, Klasse H, 144A, 12,424 %, fällig 15.12.2036 *	727	0,14	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-2, Serie 2017 2, Klasse BIO, 144A, 1,218 %, fällig 25.08.2056 †	2.315	0,45
4.000			410.106		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2021-NYMZ, Serie 2021 NYMZ, Klasse M, 144A, 12,675 %, fällig 15.06.2026 *	3.880	0,75	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-2, Serie 2017 2, Klasse XSIO, 144A, 0,075 %, fällig 25.08.2056 †	1.785	0,35
9.436			2.539		
JP Morgan Mortgage Trust 2018-4, Serie 2018 4, Klasse AX1, 144A, 0,214 %, fällig 25.10.2048 *†	43	0,01	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-1, Serie 2018 1, Klasse M, 4,750 %, fällig 25.05.2057 *	2.356	0,46
10.471			11.444		
JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Serie 2018 5, Klasse AX1, 144A, 0,228 %, fällig 25.10.2048 *†	64	0,01	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-2, Serie 2018 2, Klasse BX, 2,708 %, fällig 25.11.2057 *	3.360	0,65
1.952			16.035		
JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Serie 2018 5, Klasse B5, 144A, 3,728 %, fällig 25.10.2048 *	1.147	0,22	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-3, Serie 2018 3, Klasse BX, 144A, 1,151 %, fällig 25.08.2057 *	4.864	0,94
2.632			2.630		
JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Serie 2018 5, Klasse B6, 144A, 3,728 %, fällig 25.10.2048 *	1.303	0,25	STACR Trust 2018-DNA3, Serie 2018 DNA3, Klasse B1, 144A, 9,302 %, fällig 25.09.2048 *	2.818	0,55
5.420			3.000		
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C25, Serie 2014 C25, Klasse D, 144A, 4,082 %, fällig 15.11.2047 *	2.290	0,44	STACR Trust 2018-DNA3, Serie 2018 DNA3, Klasse B2, 144A, 13,152 %, fällig 25.09.2048 *	3.329	0,65
11			650		
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-15, Serie 2004 15, Klasse 6A1, 5,759 %, fällig 25.12.2034 *	10	-	Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Klasse D, 144A, 8,500 %, fällig 15.11.2027 *	26	0,01
1.657			14.332		
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-6, Serie 2004 6, Klasse B1, 5,252 %, fällig 25.07.2034 *	1.516	0,29	Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Klasse E, 144A, 8,500 %, fällig 15.11.2027 *†	72	0,01
1.206			307		
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-8, Serie 2004 8, Klasse B1, 5,292 %, fällig 25.09.2034 *	1.067	0,21	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust, Serie 2004 2, Klasse 1A1, 4,953 %, fällig 25.03.2034 *	278	0,05
698			49		
MASTR Reperforming Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Klasse 1A1, 144A, 6,000 %, fällig 25.08.2034	447	0,09	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR6, Serie 2006 AR6, Klasse 1A1, 5,789 %, fällig 25.07.2046 *	40	0,01
825			3.900		
MASTR Reperforming Loan Trust 2005-2, Serie 2005 2, Klasse 1A1F, 144A, 5,779 %, fällig 25.05.2035 *	437	0,08	Towd Point Mortgage Trust 2018-2, Serie 2018 2, Klasse B2, 144A, 3,602 %, fällig 25.03.2058 *	2.968	0,58
377			7.118		
ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Klasse AJ, 5,450 %, fällig 12.08.2048 *	95	0,02	Towd Point Mortgage Trust 2018-4, Serie 2018 4, Klasse B2, 144A, 3,288 %, fällig 25.06.2058 *	4.509	0,87
186			4.000		
ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Klasse AJFL, 144A, 5,450 %, fällig 12.08.2048 *	47	0,01	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-NYCH, Serie 2018 NYCH, Klasse F, 144A, 9,179 %, fällig 15.02.2032 *	3.813	0,74
5.000			3.432		
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32, Serie 2016 C32, Klasse D, 144A, 3,396 %, fällig 15.12.2049 *	3.294	0,64	Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Klasse A3, 144A, 6,319 %, fällig 25.05.2068	3.396	0,66
1.532			2.770		
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2004-11AR, Serie 2004 11AR, Klasse 1B1, 6,029 %, fällig 25.01.2035 *	1.233	0,24	Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Klasse B1, 144A, 8,239 %, fällig 25.05.2068 *	2.681	0,52
3.310			3.326		
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2006-8AR, Serie 2006 8AR, Klasse 1A3, 5,749 %, fällig 25.06.2036 *	703	0,14	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR11 Trust, Serie 2005 AR11, Klasse B1, 6,344 %, fällig 25.08.2045 *	2.790	0,54
515			983		
Multifamily Trust 2016-1, Serie 2016 1, Klasse B, 144A, 2,446 %, fällig 25.04.2046 *	515	0,10	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR9 Trust, Serie 2005 AR9, Klasse B1, 6,374 %, fällig 25.07.2045 *	761	0,15
5.308			1.343		
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Klasse D, 144A, 4,544 %, fällig 15.08.2036 *	3.404	0,66	Waterfall Commercial Mortgage Trust 2015-SBC5, Serie 2015 SBC5, Klasse B, 144A, 6,400 %, fällig 14.09.2022 *	1.162	0,23
4.870			2.500		
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Klasse E, 144A, 4,544 %, fällig 15.08.2036 *	2.614	0,51	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28, Serie 2015 C28, Klasse D, 4,216 %, fällig 15.05.2048 *	1.982	0,38
3.000			1.252		
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2022-JER1, Serie 2022 JER1, Klasse G, 144A, 12,768 %, fällig 15.01.2039 *	2.474	0,48	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C22, Serie 2014 C22, Klasse D, 144A, 4,054 %, fällig 15.09.2057 *	819	0,16
3.539			<b>Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 560.346 USD)</b>		
New Residential Mortgage Loan Trust 2016-4, Serie 2016 4A, Klasse B5, 144A, 4,844 %, fällig 25.11.2056 *	3.154	0,61		412.814	79,99
3.000			<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 0,72 % (28. Februar 2023: 0,48 %)</b>		
New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM3, Serie 2021 NQM3, Klasse B2, 144A, 4,051 %, fällig 27.11.2056 *	1.935	0,37	<b>USA – 0,72 % (28. Februar 2023: 0,48 %)</b>		
480			4.000 Two Harbors Investment Corp, 6,250 %, fällig 15.01.2026		
Opteum Mortgage Acceptance Corp Trust 2006-1, Serie 2006 1, Klasse M1, 5,984 %, fällig 25.04.2036 *	1.098	0,21	<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 3.587 USD)</b>		
			3.720		
			<b>Schuldscheine – 3,49 % (28. Februar 2023: 3,29 %)</b>		
			30.000 American Dream, –%, fällig 29.06.2024 *†∞		
			1.613 Freehand Hotel, 9,267 %, fällig 17.12.2024 *∞		
			2.935 Freehand Hotel, 9,267 %, fällig 17.12.2024 *∞		
			5.452 Freehand Hotel, 9,267 %, fällig 17.12.2024 *∞		
			5.551 Sono Retail Loan, 8,696 %, fällig 06.06.2024 *∞		
			<b>Summe Schuldscheine (Anschaffungskosten 45.454 USD)</b>		
			17.995		

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,08 % (28. Februar 2023: 3,08 %)</b>		
15.887 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	15.887	3,08
<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 15.887\$)</b>	<b>15.887</b>	<b>3,08</b>
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 709.844\$)</b>		
	512.999	99,41
<b>Devisenterminkontrakte – 0,11 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	577	0,11
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>513.576</b>	<b>99,52</b>
<b>Devisenterminkontrakte – -0,13 % (28. Februar 2023: -0,30 %)</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-664	-0,13
<b>Futures – -0,10 % (28. Februar 2023: -0,01 %)</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-538	-0,10
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>-1.202</b>	<b>-0,23</b>
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>512.374</b>	<b>99,29</b>
<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>	<b>3.692</b>	<b>0,71</b>
<b>Gesamtnettovermögen</b>	<b>516.066\$</b>	<b>100,00</b>

- 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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 324.155.000\$ und machten 62,83 % des Nettovermögens aus.
- \* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.
- † Nicht liquide.
- ∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.
- ε Die Sicherheit ist zum 31. August 2023 notleidend (Kapital und/oder Zinsen).

### ABKÜRZUNGEN:

REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit.

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,55
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	3,48
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,07
Finanzderivate	0,11
Sonstige Vermögenswerte	0,79
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 1	Verkauf USD 1	\$ –
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 10	Verkauf EUR 9	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 38.993	Verkauf JPY 5.575.971	577
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf CHF 282	Verkauf USD 323	-3
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf JPY 5.575.971	Verkauf USD 38.998	-581
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 9	Verkauf USD 11	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 5.242	Verkauf USD 5.767	-80
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP –	Verkauf USD –	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 8\$)				\$ 577
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-1.683)				-664
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-1.675)				\$ -87

### Aufstellung der Terminkontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
3-Monats-SOFR-Index Dezember 2024	Bank of America Merrill Lynch	-206	\$ -49.353
3-Monats-SOFR-Index September 2024	Bank of America Merrill Lynch.	-204	-48.697
US-10-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-42	-4.663
US 10 Jahre Ultra Note Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	-84	-9.753
US Long Bond (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-112	-13.629
Nicht realisierte Wertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): 317\$)			\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-73)			-538
Nettowertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): 244\$)			\$ -538

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD		Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	
		% vom Nettoinventarwert			% vom Nettoinventarwert
<b>Forderungenbesicherte Wertpapiere – 1,93 % (28. Februar 2023: 1,53 %)</b>					
1.208 DB Master Finance LLC, Serie 2021 1A, Klasse A23, 144A, 2,791 %, fällig 20.11.2051	960	0,09	446 Fannie Mae Pool „836398“, 6,089 %, fällig 01.10.2035 *	440	0,04
5.000 Goodleap Sustainable Home Solutions Trust 2023-3, Serie 2023 3C, Klasse A, 144A, 6,500 %, fällig 20.07.2055	5.002	0,44	6 Fannie Mae Pool „836852“, 5,986 %, fällig 01.10.2035 *	6	–
2.681 Hardee's Funding LLC, Serie 2020 1A, Klasse A2, 144A, 3,981 %, fällig 20.12.2050	2.285	0,20	7 Fannie Mae Pool „843823“, 6,144 %, fällig 01.11.2035 *	7	–
1.536 HGI CRE CLO 2021-FL2 Ltd, Serie 2021 FL2, Klasse A, 144A, 6,427 %, fällig 17.09.2036 *	1.503	0,13	80 Fannie Mae Pool „843997“, 6,018 %, fällig 01.11.2035 *	78	0,01
2.689 Home Partners of America 2021-3 Trust, Serie 2021 3, Klasse A, 144A, 2,200 %, fällig 17.01.2041	2.301	0,20	19 Fannie Mae Pool „865915“, 6,247 %, fällig 01.03.2036 *	19	–
2.212 Loanplan Solar Loan 2021-2 Ltd, Serie 2021 2GS, Klasse B, 144A, 2,790 %, fällig 20.03.2048	1.506	0,13	538 Fannie Mae Pool „890604“, 4,500 %, fällig 01.10.2044	521	0,05
1.487 MF1 2021-FL6 Ltd, Serie 2021 FL6, Klasse A, 144A, 6,526 %, fällig 16.07.2036 *	1.459	0,13	15 Fannie Mae Pool „902663“, 6,000 %, fällig 01.11.2036	15	–
2.570 MF1 2021-FL7 Ltd, Serie 2021 FL7, Klasse A, 144A, 6,506 %, fällig 16.10.2036 *	2.522	0,23	3 Fannie Mae Pool „909856“, 6,000 %, fällig 01.03.2037	3	–
541 SBA Small Business Investment Cos, Serie 2018 10B, Klasse 1, 3,548 %, fällig 10.09.2028	504	0,05	1 Fannie Mae Pool „974763“, 4,500 %, fällig 01.04.2038	1	–
2.000 SBA Small Business Investment Cos, Serie 2023 10A, Klasse 1, 5,168 %, fällig 10.03.2033	1.982	0,18	15 Fannie Mae Pool „981766“, 4,500 %, fällig 01.04.2038	14	–
500 SMB Private Education Loan Trust 2023-C, Serie 2023 C, Klasse B, 144A, 6,360 %, fällig 15.11.2052	500	0,04	4 Fannie Mae Pool „995072“, 5,500 %, fällig 01.08.2038	4	–
1.484 Store Master Funding I-VII XIV XIX XX, Serie 2021 1A, Klasse A3, 144A, 2,860 %, fällig 20.06.2051	1.229	0,11	58 Fannie Mae Pool „AA8438“, 4,500 %, fällig 06.01.2039	57	–
<b>Summe forderungenbesicherten Wertpapiere (Anschaffungskosten: 23.988 USD)</b>	<b>21.753</b>	<b>1,93</b>	26 Fannie Mae Pool „AB2725“, 5,500 %, fällig 04.01.2041	26	–
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 97,30 % (28. Februar 2023: 98,53 %)</b>					
54.020 BANK 2017-BNK8, Serie 2017 BNK8, Klasse XA, 0,848 %, fällig 15.11.2050 *	1.291	0,11	984 Fannie Mae Pool „AB3882“, 4,500 %, fällig 11.01.2041	959	0,08
2.400 BANK 2018-BNK10, Serie 2018 BN10, Klasse A5, 3,688 %, fällig 15.02.2061	2.221	0,20	375 Fannie Mae Pool „AB5692“, 4,000 %, fällig 06.01.2042	355	0,03
2.210 Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, Serie 2018 B1, Klasse A5, 3,666 %, fällig 15.01.2051 *	2.022	0,18	30 Fannie Mae Pool „AB7668“, 3,000 %, fällig 01.01.2043	27	–
4.050 BHMS 2018-ATLS, Serie 2018 ATLS, Klasse A, 144A, 6,857 %, fällig 15.07.2035 *	3.982	0,35	195 Fannie Mae Pool „AB9107“, 3,500 %, fällig 04.01.2033	186	0,02
1.275 BXMT 2020-FL2 Ltd, Serie 2020 FL2, Klasse A, 144A, 6,328 %, fällig 15.02.2038 *	1.232	0,11	11 Fannie Mae Pool „AD3336“, 5,500 %, fällig 04.01.2040	11	–
33.468 CD 2017-CD6 Mortgage Trust, Serie 2017 CD6, Klasse XA, 1,015 %, fällig 13.11.2050 *	792	0,07	3 Fannie Mae Pool „AD4567“, 5,500 %, fällig 04.01.2040	3	–
1.000 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Serie 2017 P8, Klasse A3, 3,203 %, fällig 15.09.2050	917	0,08	5 Fannie Mae Pool „AD4598“, 5,500 %, fällig 05.01.2040	5	–
1.470 COMM 2015-PC1 Mortgage Trust, Serie 2015 PC1, Klasse A5, 3,902 %, fällig 10.07.2050	1.414	0,13	10 Fannie Mae Pool „AD4614“, 5,500 %, fällig 06.01.2040	10	–
2.063 CSMC 2021-NQMB, Serie 2021 NQMB, Klasse A1, 144A, 1,841 %, fällig 25.10.2066 *	1.713	0,15	6 Fannie Mae Pool „AD8281“, 5,500 %, fällig 07.01.2040	6	–
1.148 Fannie Mae Interest Strip 406, Klasse 2, 4,000 %, fällig 25.02.2041	195	0,02	20 Fannie Mae Pool „AD8326“, 5,500 %, fällig 07.01.2040	20	–
268 Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse 9, 5,000 %, fällig 25.02.2041 *	44	–	74 Fannie Mae Pool „AD8642“, 5,500 %, fällig 08.01.2040	75	0,01
587 Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse C10, 5,000 %, fällig 25.01.2038	99	0,01	63 Fannie Mae Pool „AD9893“, 5,500 %, fällig 07.01.2040	63	0,01
378 Fannie Mae Interest Strip 409, Klasse C13, 3,500 %, fällig 25.11.2041	58	–	10 Fannie Mae Pool „AE0758“, 7,000 %, fällig 02.01.2039	11	–
2.105 Fannie Mae Interest Strip 417, Klasse C5, 3,500 %, fällig 25.02.2043	346	0,03	32 Fannie Mae Pool „AH5036“, 5,500 %, fällig 04.01.2041	32	–
4.944 Fannie Mae Interest Strip 418, Klasse C15, 3,500 %, fällig 25.08.2043	834	0,07	15 Fannie Mae Pool „AH9785“, 5,500 %, fällig 04.01.2041	15	–
16.933 Fannie Mae Interest Strip 427, Klasse C73, 3,000 %, fällig 25.12.2048	2.726	0,24	25 Fannie Mae Pool „AI9532“, 5,500 %, fällig 09.01.2041	25	–
3.900 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 % ±	3.232	0,29	15 Fannie Mae Pool „AJ2033“, 5,500 %, fällig 10.01.2041	15	–
7.000 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 % ±	6.032	0,54	27 Fannie Mae Pool „AJ4713“, 4,500 %, fällig 11.01.2041	26	–
3.100 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,500 % ±	2.771	0,25	84 Fannie Mae Pool „AL1051“, 4,500 %, fällig 09.01.2041	82	0,01
– Fannie Mae Pool „252875“, 8,000 %, fällig 01.11.2029	–	–	526 Fannie Mae Pool „AL1469“, 7,000 %, fällig 02.01.2039	557	0,05
– Fannie Mae Pool „253184“, 8,000 %, fällig 01.04.2030	–	–	223 Fannie Mae Pool „AL1470“, 7,000 %, fällig 04.01.2037	233	0,02
– Fannie Mae Pool „253399“, 8,500 %, fällig 01.08.2030	–	–	3.514 Fannie Mae Pool „AL3024“, 3,500 %, fällig 01.01.2043	3.214	0,29
– Fannie Mae Pool „253438“, 8,500 %, fällig 01.09.2030	–	–	31 Fannie Mae Pool „AL3026“, 3,500 %, fällig 12.01.2042	29	–
1 Fannie Mae Pool „253598“, 8,500 %, fällig 01.12.2030	1	–	1.234 Fannie Mae Pool „AL4324“, 6,500 %, fällig 05.01.2040	1.287	0,11
5.310 Fannie Mae Pool „387771“, 3,790 %, fällig 01.08.2028	5.026	0,45	112 Fannie Mae Pool „AL4741“, 4,500 %, fällig 01.01.2044	108	0,01
– Fannie Mae Pool „535270“, 8,500 %, fällig 01.04.2030	–	–	4.665 Fannie Mae Pool „AL7093“, 4,000 %, fällig 05.01.2045	4.434	0,39
6 Fannie Mae Pool „535299“, 7,500 %, fällig 01.05.2030	7	–	846 Fannie Mae Pool „AL7877“, 4,000 %, fällig 12.01.2045	797	0,07
1 Fannie Mae Pool „535332“, 8,500 %, fällig 01.04.2030	1	–	800 Fannie Mae Pool „AL8991“, 3,000 %, fällig 08.01.2035	775	0,07
– Fannie Mae Pool „535351“, 8,000 %, fällig 01.06.2030	–	–	100 Fannie Mae Pool „AL9546“, 3,500 %, fällig 11.01.2046	91	0,01
– Fannie Mae Pool „535435“, 8,500 %, fällig 01.08.2030	–	–	469 Fannie Mae Pool „AM8700“, 2,930 %, fällig 02.01.2030	422	0,04
– Fannie Mae Pool „535608“, 9,500 %, fällig 01.04.2030	–	–	178 Fannie Mae Pool „AN4677“, 3,200 %, fällig 02.01.2029	165	0,01
3 Fannie Mae Pool „535996“, 7,500 %, fällig 01.06.2031	3	–	322 Fannie Mae Pool „AN4927“, 3,450 %, fällig 03.01.2029	302	0,03
– Fannie Mae Pool „537715“, 8,500 %, fällig 01.09.2030	–	–	328 Fannie Mae Pool „AN5386“, 3,250 %, fällig 05.01.2029	304	0,03
19 Fannie Mae Pool „545189“, 7,500 %, fällig 01.08.2031	19	–	97 Fannie Mae Pool „AO4102“, 4,000 %, fällig 06.01.2042	92	0,01
15 Fannie Mae Pool „545190“, 7,500 %, fällig 01.08.2031	15	–	329 Fannie Mae Pool „AP9766“, 4,000 %, fällig 10.01.2042	311	0,03
1 Fannie Mae Pool „545612“, 8,000 %, fällig 01.04.2032	1	–	994 Fannie Mae Pool „AQ6295“, 3,500 %, fällig 12.01.2032	940	0,08
2 Fannie Mae Pool „545990“, 7,500 %, fällig 01.04.2031	2	–	62 Fannie Mae Pool „AQ7130“, 3,500 %, fällig 12.01.2032	59	0,01
– Fannie Mae Pool „546591“, 8,500 %, fällig 01.06.2030	–	–	238 Fannie Mae Pool „AQ7270“, 3,500 %, fällig 12.01.2032	225	0,02
1 Fannie Mae Pool „548965“, 8,500 %, fällig 01.07.2030	1	–	281 Fannie Mae Pool „AQ7306“, 3,000 %, fällig 01.01.2043	250	0,02
8 Fannie Mae Pool „555676“, 7,500 %, fällig 01.12.2032	8	–	291 Fannie Mae Pool „AQ7864“, 3,500 %, fällig 12.01.2032	276	0,02
13 Fannie Mae Pool „745248“, 7,500 %, fällig 01.08.2034	13	–	46 Fannie Mae Pool „AQ7869“, 3,500 %, fällig 11.01.2032	44	–
109 Fannie Mae Pool „745802“, 6,000 %, fällig 01.07.2036	112	0,01	129 Fannie Mae Pool „AQ7913“, 3,500 %, fällig 12.01.2032	122	0,01
9 Fannie Mae Pool „745959“, 5,500 %, fällig 01.11.2036	9	–	131 Fannie Mae Pool „AQ8677“, 3,500 %, fällig 12.01.2032	124	0,01
			85 Fannie Mae Pool „AR1198“, 3,000 %, fällig 01.01.2043	75	0,01
			283 Fannie Mae Pool „AR1202“, 3,000 %, fällig 01.01.2043	252	0,02
			145 Fannie Mae Pool „AR7399“, 3,000 %, fällig 06.01.2043	128	0,01
			339 Fannie Mae Pool „AS0038“, 3,000 %, fällig 07.01.2043	301	0,03
			536 Fannie Mae Pool „AS0462“, 3,500 %, fällig 09.01.2033	506	0,04
			188 Fannie Mae Pool „AS0469“, 4,000 %, fällig 09.01.2033	181	0,02
			103 Fannie Mae Pool „AS1281“, 3,500 %, fällig 12.01.2033	98	0,01
			3.299 Fannie Mae Pool „AS4347“, 4,000 %, fällig 01.01.2045	3.133	0,28
			1.467 Fannie Mae Pool „AS4363“, 4,500 %, fällig 02.01.2045	1.421	0,13
			402 Fannie Mae Pool „AS6340“, 3,500 %, fällig 12.01.2045	367	0,03
			269 Fannie Mae Pool „AS6541“, 3,500 %, fällig 01.01.2046	246	0,02
			219 Fannie Mae Pool „AS6562“, 3,500 %, fällig 01.01.2046	199	0,02
			239 Fannie Mae Pool „AS9453“, 4,000 %, fällig 04.01.2047	225	0,02
			153 Fannie Mae Pool „AS9760“, 4,500 %, fällig 06.01.2047	148	0,01
			207 Fannie Mae Pool „AT2486“, 3,500 %, fällig 06.01.2033	195	0,02
			3.129 Fannie Mae Pool „AT3070“, 3,500 %, fällig 04.01.2043	2.890	0,26
			69 Fannie Mae Pool „AU4395“, 4,000 %, fällig 10.01.2033	67	0,01
			32 Fannie Mae Pool „AU4397“, 4,000 %, fällig 10.01.2033	31	–
			325 Fannie Mae Pool „AU6735“, 3,000 %, fällig 01.01.2043	288	0,03
			72 Fannie Mae Pool „AU7248“, 4,000 %, fällig 10.01.2033	69	0,01
			80 Fannie Mae Pool „AU9562“, 4,000 %, fällig 10.01.2033	77	0,01
			107 Fannie Mae Pool „AU9567“, 4,000 %, fällig 10.01.2033	103	0,01
			81 Fannie Mae Pool „AU9570“, 4,000 %, fällig 10.01.2033	78	0,01
			21 Fannie Mae Pool „AV7116“, 4,500 %, fällig 03.01.2044	21	–
			74 Fannie Mae Pool „AV7681“, 3,500 %, fällig 01.01.2034	70	0,01
			165 Fannie Mae Pool „AV7683“, 3,500 %, fällig 01.01.2034	157	0,01
			207 Fannie Mae Pool „AV7694“, 3,500 %, fällig 01.01.2034	195	0,02

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventar	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventar
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)</b>					
284 Fannie Mae Pool „AV7696“, 3,500 %, fällig 01.01.2034	270	0,02	5.098 Fannie Mae Pool „CA0917“, 3,500 %, fällig 12.01.2047	4.637	0,41
2.203 Fannie Mae Pool „AZ9645“, 4,000 %, fällig 09.01.2035	2.101	0,19	1.209 Fannie Mae Pool „CA1902“, 4,500 %, fällig 06.01.2048	1.168	0,10
2.460 Fannie Mae Pool „BF0144“, 3,500 %, fällig 10.01.2056	2.215	0,20	919 Fannie Mae Pool „CA6000“, 3,000 %, fällig 06.01.2050	798	0,07
684 Fannie Mae Pool „BF0145“, 3,500 %, fällig 03.01.2057	616	0,05	481 Fannie Mae Pool „CA6053“, 3,000 %, fällig 06.01.2050	418	0,04
1.887 Fannie Mae Pool „BF0161“, 5,000 %, fällig 10.01.2046	1.887	0,17	3.682 Fannie Mae Pool „CA7257“, 2,500 %, fällig 10.01.2050	3.097	0,27
3.892 Fannie Mae Pool „BF0162“, 5,000 %, fällig 11.01.2045	3.892	0,35	69 Fannie Mae Pool „CA8955“, 2,500 %, fällig 02.01.2051	58	–
897 Fannie Mae Pool „BF0191“, 4,000 %, fällig 06.01.2057	840	0,07	1.798 Fannie Mae Pool „CB1878“, 3,000 %, fällig 10.01.2051	1.558	0,14
1.676 Fannie Mae Pool „BF0222“, 4,500 %, fällig 09.01.2057	1.599	0,14	4.670 Fannie Mae Pool „CB2164“, 3,000 %, fällig 11.01.2051	4.063	0,36
1.114 Fannie Mae Pool „BF0263“, 3,500 %, fällig 05.01.2058	1.003	0,09	2.923 Fannie Mae Pool „CB2292“, 3,000 %, fällig 11.01.2051	2.553	0,23
2.051 Fannie Mae Pool „BF0301“, 4,500 %, fällig 08.01.2058	1.957	0,17	2.227 Fannie Mae Pool „CB3044“, 2,500 %, fällig 03.01.2052	1.866	0,17
700 Fannie Mae Pool „BF0338“, 4,500 %, fällig 01.01.2059	668	0,06	370 Fannie Mae Pool „CB3833“, 3,000 %, fällig 06.01.2052	320	0,03
1.965 Fannie Mae Pool „BF0531“, 2,500 %, fällig 05.01.2055	1.640	0,15	7.227 Fannie Mae Pool „CB4898“, 5,000 %, fällig 10.01.2052	7.017	0,62
177 Fannie Mae Pool „BH6684“, 4,000 %, fällig 08.01.2047	167	0,01	931 Fannie Mae Pool „CB5156“, 6,500 %, fällig 11.01.2052	953	0,08
84 Fannie Mae Pool „BJ0685“, 4,000 %, fällig 04.01.2048	79	0,01	1.305 Fannie Mae Pool „CB5497“, 6,500 %, fällig 01.01.2053	1.337	0,12
1.106 Fannie Mae Pool „BJ2544“, 3,000 %, fällig 12.01.2037	1.002	0,09	1.704 Fannie Mae Pool „FM1002“, 3,500 %, fällig 01.01.2048	1.549	0,14
293 Fannie Mae Pool „BJ2763“, 4,500 %, fällig 05.01.2048	284	0,03	69 Fannie Mae Pool „FM1159“, 4,500 %, fällig 02.01.2048	67	0,01
28 Fannie Mae Pool „BK0751“, 3,500 %, fällig 03.01.2048	25	–	864 Fannie Mae Pool „FM1349“, 3,500 %, fällig 03.01.2047	789	0,07
765 Fannie Mae Pool „BK4770“, 4,500 %, fällig 08.01.2048	736	0,07	64 Fannie Mae Pool „FM1458“, 4,500 %, fällig 04.01.2049	61	0,01
382 Fannie Mae Pool „BM1660“, 4,000 %, fällig 08.01.2047	359	0,03	6.337 Fannie Mae Pool „FM1625“, 4,000 %, fällig 09.01.2049	5.962	0,53
1.293 Fannie Mae Pool „BM3928“, 3,500 %, fällig 07.01.2032	1.230	0,11	1.033 Fannie Mae Pool „FM1637“, 4,500 %, fällig 05.01.2049	997	0,09
1.041 Fannie Mae Pool „BM4696“, 3,000 %, fällig 03.01.2047	923	0,08	2.001 Fannie Mae Pool „FM2173“, 4,000 %, fällig 09.01.2048	188	0,02
178 Fannie Mae Pool „BM4751“, 3,500 %, fällig 03.01.2043	165	0,01	1.980 Fannie Mae Pool „FM2256“, 4,500 %, fällig 10.01.2044	1.918	0,17
93 Fannie Mae Pool „BM4781“, 4,500 %, fällig 10.01.2048	90	0,01	431 Fannie Mae Pool „FM2745“, 4,500 %, fällig 03.01.2050	414	0,04
249 Fannie Mae Pool „BM4897“, 3,500 %, fällig 12.01.2046	230	0,02	70 Fannie Mae Pool „FM3083“, 4,500 %, fällig 10.01.2049	68	0,01
1.885 Fannie Mae Pool „BM4951“, 4,500 %, fällig 09.01.2048	1.825	0,16	256 Fannie Mae Pool „FM3158“, 4,000 %, fällig 11.01.2048	240	0,02
782 Fannie Mae Pool „BM5073“, 3,000 %, fällig 04.01.2048	687	0,06	1.933 Fannie Mae Pool „FM3445“, 4,000 %, fällig 09.01.2048	1.816	0,16
117 Fannie Mae Pool „BM5119“, 4,500 %, fällig 12.01.2048	113	0,01	74 Fannie Mae Pool „FM3542“, 4,000 %, fällig 05.01.2049	70	0,01
1.393 Fannie Mae Pool „BM6898“, 2,149 %, fällig 01.02.2032 *	1.139	0,10	190 Fannie Mae Pool „FM3830“, 3,000 %, fällig 04.01.2050	166	0,01
645 Fannie Mae Pool „BM6912“, 2,500 %, fällig 01.01.2052	520	0,05	97 Fannie Mae Pool „FM4532“, 3,000 %, fällig 09.01.2050	84	0,01
104 Fannie Mae Pool „BO2878“, 3,000 %, fällig 11.01.2049	90	0,01	643 Fannie Mae Pool „FM4577“, 2,500 %, fällig 10.01.2050	539	0,05
144 Fannie Mae Pool „BO8932“, 3,000 %, fällig 01.01.2050	126	0,01	364 Fannie Mae Pool „FM5018“, 2,500 %, fällig 12.01.2050	303	0,03
810 Fannie Mae Pool „BP2319“, 3,000 %, fällig 02.01.2050	705	0,06	1.194 Fannie Mae Pool „FM5423“, 2,500 %, fällig 01.01.2051	1.003	0,09
631 Fannie Mae Pool „BP3484“, 2,500 %, fällig 06.01.2051	530	0,05	3.030 Fannie Mae Pool „FM5592“, 4,000 %, fällig 12.01.2050	2.825	0,25
951 Fannie Mae Pool „BP6171“, 3,500 %, fällig 04.01.2050	866	0,08	62 Fannie Mae Pool „FM5743“, 2,500 %, fällig 02.01.2051	52	–
3.695 Fannie Mae Pool „BP7395“, 1,500 %, fällig 10.01.2040	3.004	0,27	117 Fannie Mae Pool „FM5904“, 2,500 %, fällig 02.01.2051	98	0,01
662 Fannie Mae Pool „BP8713“, 3,000 %, fällig 08.01.2050	573	0,05	284 Fannie Mae Pool „FM5931“, 2,500 %, fällig 02.01.2051	237	0,02
614 Fannie Mae Pool „BQ1150“, 2,500 %, fällig 10.01.2050	516	0,05	269 Fannie Mae Pool „FM6117“, 3,000 %, fällig 11.01.2048	236	0,02
947 Fannie Mae Pool „BQ5815“, 2,500 %, fällig 11.01.2050	793	0,07	152 Fannie Mae Pool „FM6460“, 2,500 %, fällig 03.01.2051	128	0,01
730 Fannie Mae Pool „BQ5876“, 2,500 %, fällig 11.01.2050	269	0,02	249 Fannie Mae Pool „FM6816“, 2,500 %, fällig 04.01.2051	208	0,02
323 Fannie Mae Pool „BR0001“, 2,500 %, fällig 12.01.2050	62	0,01	2.506 Fannie Mae Pool „FM7167“, 4,500 %, fällig 08.01.2050	2.403	0,21
724 Fannie Mae Pool „BR1001“, 2,500 %, fällig 05.01.2051	613	0,05	15.118 Fannie Mae Pool „FM7382“, 3,000 %, fällig 05.01.2051	13.145	1,17
82 Fannie Mae Pool „BR1823“, 2,000 %, fällig 01.01.2051	66	0,01	6.838 Fannie Mae Pool „FM7518“, 2,500 %, fällig 06.01.2051	5.726	0,51
83 Fannie Mae Pool „BR2303“, 3,000 %, fällig 08.01.2051	72	0,01	244 Fannie Mae Pool „FM7529“, 3,000 %, fällig 05.01.2051	212	0,02
150 Fannie Mae Pool „BR2641“, 2,000 %, fällig 02.01.2051	121	0,01	274 Fannie Mae Pool „FM7675“, 2,500 %, fällig 06.01.2051	230	0,02
146 Fannie Mae Pool „BR2643“, 2,000 %, fällig 02.01.2051	118	0,01	85 Fannie Mae Pool „FM7676“, 2,500 %, fällig 06.01.2051	71	0,01
71 Fannie Mae Pool „BR2644“, 2,000 %, fällig 02.01.2051	57	–	79 Fannie Mae Pool „FM7694“, 3,000 %, fällig 06.01.2051	68	0,01
71 Fannie Mae Pool „BR3256“, 2,000 %, fällig 02.01.2051	59	–	240 Fannie Mae Pool „FM7727“, 2,500 %, fällig 06.01.2051	204	0,02
227 Fannie Mae Pool „BR3257“, 2,000 %, fällig 02.01.2051	186	0,02	864 Fannie Mae Pool „FM7869“, 2,500 %, fällig 01.01.2051	727	0,06
379 Fannie Mae Pool „BR3286“, 2,000 %, fällig 03.01.2051	307	0,03	1.054 Fannie Mae Pool „FM7900“, 2,500 %, fällig 07.01.2051	885	0,08
161 Fannie Mae Pool „BR4035“, 2,000 %, fällig 02.01.2051	129	0,01	845 Fannie Mae Pool „FM7910“, 2,500 %, fällig 07.01.2051	714	0,06
4.321 Fannie Mae Pool „BR4393“, 2,000 %, fällig 03.01.2051	3.458	0,31	750 Fannie Mae Pool „FM8025“, 2,500 %, fällig 07.01.2051	634	0,06
364 Fannie Mae Pool „BR4722“, 2,000 %, fällig 03.01.2051	294	0,03	304 Fannie Mae Pool „FM8166“, 3,000 %, fällig 06.01.2051	268	0,02
322 Fannie Mae Pool „BR4753“, 2,000 %, fällig 03.01.2051	261	0,02	1.614 Fannie Mae Pool „FM8188“, 3,000 %, fällig 03.01.2040	1.472	0,13
639 Fannie Mae Pool „BR4756“, 2,000 %, fällig 03.01.2051	516	0,05	3.125 Fannie Mae Pool „FM8189“, 3,000 %, fällig 08.01.2038	2.883	0,26
316 Fannie Mae Pool „BR5487“, 2,000 %, fällig 03.01.2051	255	0,02	1.253 Fannie Mae Pool „FM8210“, 3,000 %, fällig 04.01.2050	1.095	0,10
563 Fannie Mae Pool „BR5587“, 2,000 %, fällig 03.01.2051	455	0,04	9.967 Fannie Mae Pool „FM8415“, 2,000 %, fällig 08.01.2051	7.946	0,71
896 Fannie Mae Pool „BR5633“, 2,000 %, fällig 03.01.2051	724	0,06	1.481 Fannie Mae Pool „FM8576“, 3,000 %, fällig 02.01.2050	1.304	0,12
154 Fannie Mae Pool „BR6515“, 2,000 %, fällig 04.01.2051	126	0,01	14.193 Fannie Mae Pool „FM8685“, 3,000 %, fällig 09.01.2051	12.311	1,09
412 Fannie Mae Pool „BR6768“, 2,500 %, fällig 06.01.2051	344	0,03	2.834 Fannie Mae Pool „FM8786“, 2,500 %, fällig 10.01.2051	2.377	0,21
76 Fannie Mae Pool „BR7744“, 2,000 %, fällig 04.01.2051	62	0,01	411 Fannie Mae Pool „FM8864“, 2,500 %, fällig 10.01.2051	345	0,03
74 Fannie Mae Pool „BR7745“, 2,000 %, fällig 04.01.2051	60	0,01	81 Fannie Mae Pool „FM8977“, 2,500 %, fällig 09.01.2051	69	0,01
203 Fannie Mae Pool „BR8276“, 2,500 %, fällig 04.01.2051	171	0,01	476 Fannie Mae Pool „FM9044“, 3,000 %, fällig 10.01.2051	414	0,04
80 Fannie Mae Pool „BR8478“, 2,000 %, fällig 04.01.2051	65	0,01	2.593 Fannie Mae Pool „FM9264“, 2,000 %, fällig 10.01.2041	2.158	0,19
76 Fannie Mae Pool „BR8518“, 2,000 %, fällig 04.01.2051	62	0,01	1.795 Fannie Mae Pool „FM9292“, 3,000 %, fällig 11.01.2051	1.566	0,14
284 Fannie Mae Pool „BR9104“, 2,500 %, fällig 05.01.2051	240	0,02	2.621 Fannie Mae Pool „FM9362“, 3,000 %, fällig 06.01.2038	2.446	0,22
927 Fannie Mae Pool „BT0122“, 2,500 %, fällig 06.01.2051	774	0,07	161 Fannie Mae Pool „FM9412“, 2,500 %, fällig 11.01.2051	135	0,01
497 Fannie Mae Pool „BT0846“, 2,500 %, fällig 07.01.2051	416	0,04	16.036 Fannie Mae Pool „FM9434“, 2,000 %, fällig 11.01.2051	12.962	1,15
689 Fannie Mae Pool „BT3244“, 2,500 %, fällig 07.01.2051	578	0,05	5.318 Fannie Mae Pool „FM9456“, 3,500 %, fällig 11.01.2051	4.834	0,43
600 Fannie Mae Pool „BT3270“, 2,500 %, fällig 08.01.2051	502	0,04	3.280 Fannie Mae Pool „FM9507“, 3,000 %, fällig 03.01.2037	5.898	0,52
353 Fannie Mae Pool „BT3290“, 2,500 %, fällig 08.01.2051	295	0,03	15.287 Fannie Mae Pool „FM9579“, 2,000 %, fällig 07.01.2051	12.237	1,09
247 Fannie Mae Pool „BT3303“, 2,500 %, fällig 08.01.2051	206	0,02	7.828 Fannie Mae Pool „FM9733“, 2,500 %, fällig 10.01.2051	6.553	0,58
3.019 Fannie Mae Pool „BT9482“, 2,500 %, fällig 12.01.2051	2.527	0,22	324 Fannie Mae Pool „FM9867“, 2,500 %, fällig 12.01.2051	272	0,02
15.894 Fannie Mae Pool „BU0971“, 2,000 %, fällig 11.01.2051	12.830	1,14	1.041 Fannie Mae Pool „FS0028“, 2,500 %, fällig 09.01.2051	873	0,08
879 Fannie Mae Pool „BU2599“, 2,000 %, fällig 01.01.2052	738	0,07	223 Fannie Mae Pool „FS0041“, 3,000 %, fällig 11.01.2050	196	0,02
3.163 Fannie Mae Pool „BU2838“, 2,500 %, fällig 11.01.2051	2.643	0,23	1.334 Fannie Mae Pool „FS0316“, 1,500 %, fällig 11.01.2041	1.071	0,09
75 Fannie Mae Pool „BU3608“, 3,000 %, fällig 11.01.2051	65	0,01	4.099 Fannie Mae Pool „FS0331“, 3,000 %, fällig 01.01.2052	3.545	0,31
81 Fannie Mae Pool „BU5925“, 3,000 %, fällig 12.01.2051	71	0,01	3.503 Fannie Mae Pool „FS0352“, 2,000 %, fällig 01.01.2052	2.809	0,25
1.583 Fannie Mae Pool „BU8670“, 4,500 %, fällig 05.01.2052	1.502	0,13	347 Fannie Mae Pool „FS0408“, 3,000 %, fällig 01.01.2052	305	0,03
3.790 Fannie Mae Pool „BW5810“, 5,000 %, fällig 08.01.2052	3.679	0,33	257 Fannie Mae Pool „FS0464“, 2,000 %, fällig 01.01.2052	205	0,02
84 Fannie Mae Pool „BX6441“, 6,500 %, fällig 02.01.2053	86	0,01	2.267 Fannie Mae Pool „FS0520“, 3,000 %, fällig 02.01.2052	1.971	0,17
1.028 Fannie Mae Pool „BX7702“, 6,500 %, fällig 02.01.2053	1.046	0,09	445 Fannie Mae Pool „FS0534“, 2,500 %, fällig 07.01.2051	374	0,03
133 Fannie Mae Pool „CA0907“, 3,500 %, fällig 12.01.2047	121	0,01	2.331 Fannie Mae Pool „FS0551“, 2,500 %, fällig 02.01.2052	1.957	0,17
			1.609 Fannie Mae Pool „FS0582“, 2,500 %, fällig 02.01.2052	1.349	0,12

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)</b>					
1.409 Fannie Mae Pool „FS0584“, 2,000 %, fällig 02.01.2052	1.135	0,10	2.895 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 59, Klasse SH, 0,598 %, fällig 25.10.2049 *	319	0,03
820 Fannie Mae Pool „FS0612“, 2,000 %, fällig 02.01.2052	662	0,06	1.219 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 26, Klasse SA, 0,548 %, fällig 25.05.2050 *	119	0,01
5.927 Fannie Mae Pool „FS1107“, 2,500 %, fällig 12.01.2051	4.971	0,44	959 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 47, Klasse GZ, 2,000 %, fällig 25.07.2050	558	0,05
530 Fannie Mae Pool „FS1289“, 3,000 %, fällig 03.01.2052	466	0,04	1.651 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 62, Klasse BI, 2,000 %, fällig 25.09.2050	198	0,02
336 Fannie Mae Pool „FS1403“, 3,000 %, fällig 01.01.2045	297	0,03	2.472 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 67, Klasse IH, 2,000 %, fällig 25.09.2050	318	0,03
433 Fannie Mae Pool „FS1539“, 3,000 %, fällig 11.01.2048	383	0,03	151 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 74, Klasse EI, 2,500 %, fällig 25.10.2050	24	–
787 Fannie Mae Pool „FS1553“, 2,500 %, fällig 11.01.2050	662	0,06	13.235 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 88, Klasse GI, 2,500 %, fällig 25.12.2050	1.973	0,17
1.281 Fannie Mae Pool „FS1628“, 2,500 %, fällig 04.01.2052	1.084	0,10	1.055 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 89, Klasse DI, 2,500 %, fällig 25.12.2050	159	0,01
726 Fannie Mae Pool „FS1938“, 2,500 %, fällig 02.01.2052	606	0,05	8.668 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 91, Klasse IO, 2,500 %, fällig 25.12.2050	1.323	0,12
6.813 Fannie Mae Pool „FS2740“, 3,500 %, fällig 06.01.2049	6.196	0,55	6.250 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 93, Klasse LI, 2,500 %, fällig 25.01.2051	891	0,08
656 Fannie Mae Pool „FS3009“, 2,000 %, fällig 05.01.2042	547	0,05	24.912 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 42, Klasse NI, 2,500 %, fällig 25.11.2048	3.235	0,29
5.482 Fannie Mae Pool „FS3191“, 5,500 %, fällig 10.01.2052	5.415	0,48	7.755 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 46, Klasse BI, 2,500 %, fällig 25.12.2048	1.066	0,09
1.738 Fannie Mae Pool „FS3411“, 6,000 %, fällig 01.01.2053	1.753	0,16	5.153 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 49, Klasse GI, 2,500 %, fällig 25.10.2048	677	0,06
1.289 Fannie Mae Pool „FS3589“, 4,500 %, fällig 01.01.2050	1.257	0,11	1.185 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 54, Klasse KI, 2,500 %, fällig 25.05.2049	164	0,01
7.086 Fannie Mae Pool „FS4269“, 2,000 %, fällig 10.01.2051	5.723	0,51	9.457 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 59, Klasse TI, 2,500 %, fällig 25.09.2051	1.432	0,13
6.596 Fannie Mae Pool „FS4270“, 2,000 %, fällig 03.01.2052	5.298	0,47	1.508 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 61, Klasse KI, 2,500 %, fällig 25.04.2049	210	0,02
2.465 Fannie Mae Pool „FS4570“, 5,000 %, fällig 12.01.2047	2.465	0,22	5.825 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 85, Klasse IN, 2,500 %, fällig 25.02.2050	946	0,08
988 Fannie Mae Pool „FS4933“, 6,000 %, fällig 06.01.2053	991	0,09	13.174 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 91, Klasse IG, 2,500 %, fällig 25.01.2052	1.937	0,17
2.643 Fannie Mae Pool „FS5059“, 3,500 %, fällig 11.01.2048	2.409	0,21	11.514 Fannie Mae REMICS, Serie 2022 29, Klasse KZ, 1,500 %, fällig 25.06.2042	7.975	0,71
9 Fannie Mae Pool „MA0440“, 5,500 %, fällig 05.01.2040	9	–	732 Fannie Mae REMICS, Serie 2022 57, Klasse BC, 4,000 %, fällig 25.09.2052	689	0,06
26 Fannie Mae Pool „MA0619“, 2,000 %, fällig 11.01.2040	26	–	286 Fannie Mae-Aces, Serie 2016 M11, Klasse AL, 2,944 %, fällig 25.07.2039	254	0,02
4 Fannie Mae Pool „MA0706“, 4,500 %, fällig 04.01.2031	4	–	15.530 Fannie Mae-Aces, Serie 2019 M11, Klasse X1, 1,187 %, fällig 25.06.2029 *	705	0,06
10 Fannie Mae Pool „MA0734“, 4,500 %, fällig 05.01.2031	10	–	14.864 Fannie Mae-Aces, Serie 2019 M13, Klasse X1, 0,940 %, fällig 25.06.2034 *	603	0,05
14 Fannie Mae Pool „MA0766“, 4,500 %, fällig 05.01.2041	14	–	37.401 Fannie Mae-Aces, Serie 2019 M14, Klasse X1, 0,671 %, fällig 25.06.2029 *	946	0,08
5 Fannie Mae Pool „MA0776“, 4,500 %, fällig 06.01.2031	5	–	5.450 Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M11, Klasse IO, 1,872 %, fällig 25.01.2029 *	397	0,04
133 Fannie Mae Pool „MA0823“, 5,500 %, fällig 07.01.2041	135	0,01	33.662 Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M16, Klasse X1, 0,538 %, fällig 25.04.2032 *	897	0,08
64 Fannie Mae Pool „MA0867“, 5,500 %, fällig 09.01.2041	64	0,01	4.471 Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M24, Klasse X1, 1,703 %, fällig 25.01.2037 *	412	0,04
131 Fannie Mae Pool „MA0913“, 4,500 %, fällig 11.01.2031	128	0,01	15.192 Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M31, Klasse X2, 1,333 %, fällig 25.12.2032 *	899	0,08
144 Fannie Mae Pool „MA0939“, 4,500 %, fällig 12.01.2031	140	0,01	36 Freddie Mac Gold Pool „A29586“, 5,000 %, fällig 01.01.2035	36	–
29 Fannie Mae Pool „MA0968“, 4,500 %, fällig 12.01.2031	28	–	9 Freddie Mac Gold Pool „A30703“, 5,500 %, fällig 12.01.2034	9	–
176 Fannie Mae Pool „MA1177“, 3,500 %, fällig 09.01.2042	161	0,01	96 Freddie Mac Gold Pool „A35950“, 5,000 %, fällig 07.01.2035	96	0,01
10 Fannie Mae Pool „MA1221“, 4,500 %, fällig 09.01.2042	10	–	12 Freddie Mac Gold Pool „A36526“, 5,000 %, fällig 08.01.2035	12	–
43 Fannie Mae Pool „MA1363“, 3,000 %, fällig 02.01.2043	38	–	37 Freddie Mac Gold Pool „A39036“, 5,000 %, fällig 05.01.2035	37	–
1.334 Fannie Mae Pool „MA1393“, 4,000 %, fällig 03.01.2043	1.265	0,11	6 Freddie Mac Gold Pool „A39302“, 5,500 %, fällig 11.01.2035	6	–
297 Fannie Mae Pool „MA1591“, 4,500 %, fällig 09.01.2043	288	0,03	– Freddie Mac Gold Pool „A84166“, 6,500 %, fällig 01.01.2039	–	–
226 Fannie Mae Pool „MA1629“, 4,500 %, fällig 10.01.2043	219	0,02	1 Freddie Mac Gold Pool „C00556“, 8,000 %, fällig 10.01.2027	1	–
144 Fannie Mae Pool „MA1664“, 4,500 %, fällig 11.01.2043	139	0,01	– Freddie Mac Gold Pool „C01025“, 8,000 %, fällig 07.01.2030	–	–
201 Fannie Mae Pool „MA1711“, 4,500 %, fällig 12.01.2043	194	0,02	– Freddie Mac Gold Pool „C01051“, 8,000 %, fällig 09.01.2030	–	–
410 Fannie Mae Pool „MA2672“, 3,000 %, fällig 07.01.2036	379	0,03	1 Freddie Mac Gold Pool „C46047“, 8,000 %, fällig 12.01.2030	1	–
396 Fannie Mae Pool „MA2832“, 3,000 %, fällig 12.01.2036	364	0,03	3 Freddie Mac Gold Pool „C55319“, 8,000 %, fällig 08.01.2031	3	–
225 Fannie Mae Pool „MA4175“, 1,500 %, fällig 11.01.2040	183	0,02	– Freddie Mac Gold Pool „C57324“, 8,000 %, fällig 09.01.2031	–	–
649 Fannie Mae Pool „MA4204“, 2,000 %, fällig 12.01.2040	546	0,05	2 Freddie Mac Gold Pool „C91046“, 6,500 %, fällig 05.01.2027	2	–
5.448 Fannie Mae Pool „MA4208“, 2,000 %, fällig 12.01.2050	4.367	0,39	1.014 Freddie Mac Gold Pool „C91981“, 3,000 %, fällig 02.01.2038	920	0,08
7.728 Fannie Mae Pool „MA4325“, 2,000 %, fällig 05.01.2051	6.163	0,55	– Freddie Mac Gold Pool „G00556“, 8,000 %, fällig 09.01.2026	–	–
464 Fannie Mae Pool „MA4342“, 1,500 %, fällig 05.01.2041	373	0,03	1 Freddie Mac Gold Pool „G00726“, 8,000 %, fällig 06.01.2027	1	–
420 Fannie Mae Pool „MA4387“, 2,000 %, fällig 07.01.2041	353	0,03	– Freddie Mac Gold Pool „G00931“, 8,000 %, fällig 11.01.2026	–	–
1.328 Fannie Mae Pool „MA4500“, 1,500 %, fällig 12.01.2041	1.066	0,09	5 Freddie Mac Gold Pool „G02427“, 5,500 %, fällig 12.01.2036	5	–
2.788 Fannie Mae Pool „MA4570“, 2,000 %, fällig 03.01.2042	2.318	0,21	26 Freddie Mac Gold Pool „G04581“, 6,500 %, fällig 08.01.2038	26	–
876 Fannie Mae REMICS, Serie 2010 2, Klasse AI, 5,500 %, fällig 25.02.2040	147	0,01	1 Freddie Mac Gold Pool „G04947“, 6,500 %, fällig 04.01.2038	1	–
910 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 124, Klasse SD, 0,748 %, fällig 25.11.2042 *	93	0,01	4 Freddie Mac Gold Pool „G06669“, 6,500 %, fällig 09.01.2039	4	–
1.280 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 22, Klasse SM, 1,098 %, fällig 25.03.2042 *	138	0,01	94 Freddie Mac Gold Pool „G07335“, 7,000 %, fällig 03.01.2039	100	0,01
587 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 9, Klasse PT, 11,414 %, fällig 25.07.2036 *	694	0,06	213 Freddie Mac Gold Pool „G07509“, 6,500 %, fällig 09.01.2039	219	0,02
735 Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Klasse BC, 6,500 %, fällig 25.07.2042	775	0,07	903 Freddie Mac Gold Pool „G08700“, 4,500 %, fällig 03.01.2046	876	0,08
3.451 Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Klasse CB, 5,500 %, fällig 25.04.2042	3.487	0,31	151 Freddie Mac Gold Pool „G16672“, 3,000 %, fällig 03.01.2033	143	0,01
134 Fannie Mae REMICS, Serie 2015 39, Klasse LZ, 3,000 %, fällig 25.06.2045	116	0,01	1.179 Freddie Mac Gold Pool „G60329“, 5,500 %, fällig 06.01.2040	1.203	0,11
5.604 Fannie Mae REMICS, Serie 2016 48, Klasse IA, 4,500 %, fällig 25.06.2038	806	0,07	3.502 Freddie Mac Gold Pool „G60344“, 4,000 %, fällig 12.01.2045	3.328	0,30
2.091 Fannie Mae REMICS, Serie 2017 74, Klasse PZ, 3,500 %, fällig 25.10.2047	1.647	0,15	4.856 Freddie Mac Gold Pool „G61814“, 3,500 %, fällig 09.01.2048	4.426	0,39
3.527 Fannie Mae REMICS, Serie 2018 3, Klasse IO, 4,000 %, fällig 25.02.2048	680	0,06	8.558 Freddie Mac Gold Pool „G67701“, 3,000 %, fällig 10.01.2046	7.559	0,67
1.145 Fannie Mae REMICS, Serie 2018 74, Klasse AB, 3,500 %, fällig 25.10.2048	1.040	0,09	1 Freddie Mac Gold Pool „H00790“, 5,500 %, fällig 05.01.2037	1	–
896 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 25, Klasse PI, 5,000 %, fällig 25.05.2048	174	0,02			
3.882 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 38, Klasse SH, 0,867 %, fällig 25.07.2049 *	357	0,03			
1.944 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 44, Klasse SM, 0,648 %, fällig 25.08.2049 *	249	0,02			
2.106 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 45, Klasse BS, 0,648 %, fällig 25.08.2049 *	228	0,02			
3.741 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 5, Klasse IO, 4,500 %, fällig 25.03.2049	720	0,06			
1.155 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 57, Klasse NS, 0,598 %, fällig 25.10.2049 *	121	0,01			
1.414 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 58, Klasse HS, 0,598 %, fällig 25.10.2049 *	144	0,01			

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert		
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)</b>							
43	Freddie Mac Gold Pool „H02425“, 5,500 %, fällig 02.01.2038	43	84	Freddie Mac Pool „QB9961“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	67	0,01	
1	Freddie Mac Gold Pool „H09170“, 5,500 %, fällig 01.01.2038	–	66	Freddie Mac Pool „QC0160“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	53	–	
279	Freddie Mac Gold Pool „J39722“, 3,000 %, fällig 10.01.2033	261	0,02	78	Freddie Mac Pool „QC0161“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	63	0,01
169	Freddie Mac Gold Pool „J39962“, 3,000 %, fällig 12.01.2033	158	0,01	82	Freddie Mac Pool „QC0885“, 2,000 %, fällig 01.04.2051	67	0,01
164	Freddie Mac Gold Pool „Q26702“, 4,000 %, fällig 06.01.2044	156	0,01	73	Freddie Mac Pool „QC1164“, 2,000 %, fällig 01.04.2051	59	0,01
1.298	Freddie Mac Gold Pool „U69040“, 4,000 %, fällig 05.01.2045	1.228	0,11	160	Freddie Mac Pool „QC2044“, 2,500 %, fällig 01.05.2051	136	0,01
59	Freddie Mac Gold Pool „U90316“, 4,000 %, fällig 10.01.2042	56	–	551	Freddie Mac Pool „QC3242“, 3,000 %, fällig 01.06.2051	481	0,04
360	Freddie Mac Gold Pool „U90378“, 4,000 %, fällig 11.01.2042	341	0,03	424	Freddie Mac Pool „QC3690“, 2,500 %, fällig 01.07.2051	356	0,03
306	Freddie Mac Gold Pool „U90436“, 4,000 %, fällig 11.01.2042	289	0,03	423	Freddie Mac Pool „QC4689“, 2,500 %, fällig 01.08.2051	355	0,03
32	Freddie Mac Gold Pool „U90598“, 3,500 %, fällig 12.01.2042	30	–	446	Freddie Mac Pool „QC4690“, 2,500 %, fällig 01.08.2051	374	0,03
79	Freddie Mac Gold Pool „U90608“, 3,500 %, fällig 12.01.2042	72	0,01	351	Freddie Mac Pool „QC4818“, 2,500 %, fällig 01.08.2051	294	0,03
31	Freddie Mac Gold Pool „U90768“, 3,500 %, fällig 01.01.2043	28	–	521	Freddie Mac Pool „QC4824“, 2,500 %, fällig 01.08.2051	437	0,04
63	Freddie Mac Gold Pool „U90778“, 3,500 %, fällig 01.01.2043	58	–	3.871	Freddie Mac Pool „QC5830“, 2,500 %, fällig 01.08.2051	3.250	0,29
78	Freddie Mac Gold Pool „U90794“, 3,500 %, fällig 01.01.2043	72	0,01	1.861	Freddie Mac Pool „QC7411“, 2,500 %, fällig 01.09.2051	1.562	0,14
143	Freddie Mac Gold Pool „U90828“, 3,500 %, fällig 01.02.2043	131	0,01	3.690	Freddie Mac Pool „QC8573“, 2,500 %, fällig 01.10.2051	3.095	0,27
107	Freddie Mac Gold Pool „U90879“, 3,500 %, fällig 01.02.2043	98	0,01	944	Freddie Mac Pool „QD1347“, 2,500 %, fällig 01.11.2051	792	0,07
112	Freddie Mac Gold Pool „U90903“, 3,500 %, fällig 01.02.2043	103	0,01	3.998	Freddie Mac Pool „QD1596“, 2,000 %, fällig 01.12.2051	3.237	0,29
127	Freddie Mac Gold Pool „U91027“, 3,500 %, fällig 01.02.2043	116	0,01	89	Freddie Mac Pool „QD1954“, 3,000 %, fällig 01.11.2051	78	0,01
3.658	Freddie Mac Gold Pool „U99124“, 3,500 %, fällig 01.03.2045	3.349	0,30	84	Freddie Mac Pool „QD2260“, 3,000 %, fällig 01.12.2051	73	0,01
1.795	Freddie Mac Gold Pool „U99135“, 3,500 %, fällig 01.02.2044	1.700	0,15	7.056	Freddie Mac Pool „QD2419“, 3,000 %, fällig 01.12.2051	6.175	0,55
57.021	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K065, Klasse X1, 0,804 %, fällig 25.04.2027 *	1.143	0,10	254	Freddie Mac Pool „QD4146“, 2,500 %, fällig 01.01.2052	214	0,02
82.417	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K069, Klasse X1, 0,473 %, fällig 25.09.2027 *	1.024	0,09	548	Freddie Mac Pool „QD5620“, 2,000 %, fällig 01.02.2052	439	0,04
54.532	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K079, Klasse XAM, 0,221 %, fällig 25.06.2028 *	301	0,03	654	Freddie Mac Pool „QD5628“, 2,000 %, fällig 01.02.2052	523	0,05
57.720	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K081, Klasse XAM, 0,215 %, fällig 25.08.2028 *	298	0,03	92	Freddie Mac Pool „QD5827“, 2,000 %, fällig 01.02.2052	74	0,01
881	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K091, Klasse X1, 0,706 %, fällig 25.03.2029 *	23	–	842	Freddie Mac Pool „QD5960“, 2,000 %, fällig 01.02.2052	674	0,06
6.975	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K105, Klasse X1, 1,644 %, fällig 25.01.2030 *	533	0,05	527	Freddie Mac Pool „QD5961“, 2,000 %, fällig 01.02.2052	421	0,04
1.200	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K109, Klasse A2, 1,558 %, fällig 25.04.2030	984	0,09	3.315	Freddie Mac Pool „QD6079“, 2,500 %, fällig 01.02.2052	2.783	0,25
9.945	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K110, Klasse X1, 1,813 %, fällig 25.04.2030	841	0,07	277	Freddie Mac Pool „QD6142“, 2,500 %, fällig 01.02.2052	233	0,02
3.984	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K115, Klasse X1, 1,428 %, fällig 25.06.2030 *	279	0,02	181	Freddie Mac Pool „QD6216“, 3,000 %, fällig 01.02.2052	156	0,01
7.951	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K116, Klasse X1, 1,528 %, fällig 25.07.2030 *	588	0,05	272	Freddie Mac Pool „QD7365“, 2,000 %, fällig 01.02.2052	220	0,02
987	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K121, Klasse X1, 1,119 %, fällig 25.10.2030 *	54	–	195	Freddie Mac Pool „QE5811“, 4,000 %, fällig 01.07.2052	180	0,02
85.160	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K123, Klasse X1, 0,863 %, fällig 25.12.2030 *	3.670	0,33	2.766	Freddie Mac Pool „QE8530“, 5,500 %, fällig 01.08.2052	2.770	0,25
2.989	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K124, Klasse X1, 0,810 %, fällig 25.12.2030 *	122	0,01	2.810	Freddie Mac Pool „QE8532“, 5,500 %, fällig 01.08.2052	2.799	0,25
12.496	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K132, Klasse X1, 0,608 %, fällig 25.08.2031 *	405	0,04	5.719	Freddie Mac Pool „QE8537“, 5,000 %, fällig 01.08.2052	5.549	0,49
63.985	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K141, Klasse X1, 0,407 %, fällig 25.02.2032 *	1.410	0,12	1.968	Freddie Mac Pool „QF3429“, 5,500 %, fällig 01.11.2052	1.964	0,17
61.465	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K142, Klasse X1, 0,403 %, fällig 25.03.2032 *	1.313	0,12	839	Freddie Mac Pool „QF4924“, 6,000 %, fällig 01.12.2052	849	0,08
85.311	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K143, Klasse X1, 0,450 %, fällig 25.04.2055 *	2.131	0,19	178	Freddie Mac Pool „QF6516“, 6,500 %, fällig 01.01.2053	182	0,02
17.889	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate K148, Klasse X1, 0,391 %, fällig 25.07.2032 *	374	0,03	173	Freddie Mac Pool „QF6690“, 6,500 %, fällig 01.01.2053	176	0,02
28.473	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate KG06, Klasse X1, 0,626 %, fällig 25.10.2031 *	947	0,08	192	Freddie Mac Pool „QF8222“, 6,500 %, fällig 01.02.2053	195	0,02
4.173	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate, Serie K 1515, Klasse X1, 1,636 %, fällig 25.02.2035 *	469	0,04	299	Freddie Mac Pool „QF8298“, 6,500 %, fällig 01.03.2053	304	0,03
6.499	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through-Zertifikate, Serie K 154, Klasse X1, 0,527 %, fällig 25.01.2033 *	194	0,02	3.786	Freddie Mac Pool „QF9586“, 6,500 %, fällig 01.03.2053	3.850	0,34
1.300	Freddie Mac Multifamily WI-Zertifikate Serie WI-K159 K159, Klasse A2, 4,500 %, fällig 25.11.2033	1.267	0,11	1.039	Freddie Mac Pool „QG2834“, 5,000 %, fällig 01.04.2053	1.009	0,09
5.243	Freddie Mac Non Gold Pool „841.075“, 3,265 %, fällig 01.01.2049 *	4.916	0,44	1.175	Freddie Mac Pool „RA1293“, 3,000 %, fällig 01.09.2049	1.032	0,09
2.428	Freddie Mac Non Gold Pool „841.076“, 3,008 %, fällig 01.11.2048 *	2.273	0,20	6.693	Freddie Mac Pool „RA2194“, 3,000 %, fällig 01.02.2050	5.874	0,52
475	Freddie Mac Non Gold Pool „841.077“, 2,871 %, fällig 01.11.2047 *	450	0,04	367	Freddie Mac Pool „RA2729“, 2,500 %, fällig 01.06.2050	307	0,03
825	Freddie Mac Non Gold Pool „841.081“, 3,099 %, fällig 01.02.2050 *	782	0,07	394	Freddie Mac Pool „RA3882“, 2,000 %, fällig 01.11.2050	318	0,03
89	Freddie Mac Pool „QA5770“, 3,000 %, fällig 01.01.2050	78	0,01	5.594	Freddie Mac Pool „RA3913“, 2,500 %, fällig 01.11.2050	4.711	0,42
319	Freddie Mac Pool „QA7238“, 3,500 %, fällig 01.02.2050	289	0,03	18.153	Freddie Mac Pool „RA4142“, 2,500 %, fällig 01.12.2050	15.282	1,36
2.972	Freddie Mac Pool „QA7256“, 3,000 %, fällig 01.02.2050	2.587	0,23	1.757	Freddie Mac Pool „RA4175“, 2,500 %, fällig 01.12.2050	1.475	0,13
118	Freddie Mac Pool „QA9685“, 3,000 %, fällig 01.05.2050	104	0,01	66	Freddie Mac Pool „RA4349“, 2,500 %, fällig 01.01.2051	55	–
190	Freddie Mac Pool „QA9686“, 3,000 %, fällig 01.05.2050	168	0,01	441	Freddie Mac Pool „RA4414“, 2,500 %, fällig 01.01.2051	369	0,03
444	Freddie Mac Pool „QB5092“, 2,500 %, fällig 01.11.2050	374	0,03	2.169	Freddie Mac Pool „RA4526“, 3,000 %, fällig 01.02.2051	1.892	0,17
303	Freddie Mac Pool „QB5093“, 2,500 %, fällig 01.11.2050	254	0,02	72	Freddie Mac Pool „RA4532“, 2,500 %, fällig 01.02.2051	60	0,01
75	Freddie Mac Pool „QB8602“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	61	0,01	552	Freddie Mac Pool „RA4703“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	445	0,04
139	Freddie Mac Pool „QB8604“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	113	0,01	1.485	Freddie Mac Pool „RA5117“, 2,000 %, fällig 01.05.2051	1.193	0,11
71	Freddie Mac Pool „QB8773“, 2,000 %, fällig 01.02.2051	58	–	171	Freddie Mac Pool „RA5373“, 2,000 %, fällig 01.06.2051	137	0,01
76	Freddie Mac Pool „QB9482“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	61	0,01	3.428	Freddie Mac Pool „RA6685“, 4,000 %, fällig 01.01.2052	3.171	0,28
223	Freddie Mac Pool „QB9484“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	181	0,02	2.748	Freddie Mac Pool „RA7184“, 4,000 %, fällig 01.04.2052	2.545	0,23
152	Freddie Mac Pool „QB9485“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	124	0,01	8.267	Freddie Mac Pool „RB5125“, 2,000 %, fällig 01.09.2041	6.903	0,61
				2.209	Freddie Mac Pool „RB5130“, 1,500 %, fällig 01.10.2041	1.774	0,16
				281	Freddie Mac Pool „RB5134“, 1,500 %, fällig 01.11.2041	226	0,02
				3.412	Freddie Mac Pool „RB5138“, 2,000 %, fällig 01.12.2041	2.827	0,25
				10.777	Freddie Mac Pool „SC0190“, 2,500 %, fällig 01.09.2041	9.300	0,83
				1.592	Freddie Mac Pool „SC0319“, 2,000 %, fällig 01.04.2042	1.329	0,12
				3.155	Freddie Mac Pool „SC0399“, 2,000 %, fällig 01.05.2042	2.644	0,23
				144	Freddie Mac Pool „SD0247“, 4,000 %, fällig 01.07.2047	136	0,01
				228	Freddie Mac Pool „SD0422“, 4,500 %, fällig 01.07.2047	217	0,02
				143	Freddie Mac Pool „SD0573“, 2,000 %, fällig 01.04.2051	117	0,01
				336	Freddie Mac Pool „SD0618“, 3,000 %, fällig 01.02.2051	292	0,03
				4.744	Freddie Mac Pool „SD0630“, 4,000 %, fällig 01.02.2050	4.451	0,40
				2.504	Freddie Mac Pool „SD0731“, 2,000 %, fällig 01.05.2051	2.006	0,18
				7.055	Freddie Mac Pool „SD0777“, 2,500 %, fällig 01.11.2051	5.889	0,52
				3.684	Freddie Mac Pool „SD0809“, 3,000 %, fällig 01.01.2052	3.182	0,28
				877	Freddie Mac Pool „SD0849“, 2,500 %, fällig 01.01.2052	736	0,07
				376	Freddie Mac Pool „SD0952“, 3,000 %, fällig 01.04.2052	327	0,03
				6.579	Freddie Mac Pool „SD1070“, 3,500 %, fällig 01.04.2052	5.954	0,53
				15.539	Freddie Mac Pool „SD1143“, 4,500 %, fällig 01.09.2050	14.955	1,33
				13.668	Freddie Mac Pool „SD1218“, 4,000 %, fällig 01.07.2049	12.802	1,14
				3.718	Freddie Mac Pool „SD1586“, 3,500 %, fällig 01.08.2052	3.372	0,30
				4.473	Freddie Mac Pool „SD1876“, 5,500 %, fällig 01.11.2052	4.435	0,39
				17.561	Freddie Mac Pool „SD2245“, 5,500 %, fällig 01.12.2052	17.371	1,54
				6.913	Freddie Mac Pool „SD2284“, 6,000 %, fällig 01.12.2052	6.961	0,62
				954	Freddie Mac Pool „SD2981“, 6,500 %, fällig 01.05.2053	971	0,09

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert		
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)</b>			2.233	Freddie Mac REMICS 5058, Klasse IL, 2,500 %, fällig 25.01.2051	390	0,03	
4.072	Freddie Mac Pool „SD3171“, 5,500 %, fällig 01.06.2053	4.027	0,36	675	Freddie Mac REMICS 5059, Klasse IB, 2,500 %, fällig 25.01.2051	107	0,01
3.960	Freddie Mac Pool „SD3305“, 1,500 %, fällig 01.08.2051	2.998	0,27	5.069	Freddie Mac REMICS 5070, Klasse NI, 2,000 %, fällig 25.02.2051	704	0,06
6.991	Freddie Mac Pool „SD3382“, 5,000 %, fällig 01.06.2053	6.786	0,60	8.953	Freddie Mac REMICS 5078, Klasse EI, 1,500 %, fällig 25.01.2051	881	0,08
2.986	Freddie Mac Pool „SD3400“, 4,500 %, fällig 01.10.2052	2.833	0,25	20.786	Freddie Mac REMICS 5085, Klasse IK, 2,500 %, fällig 25.03.2051	3.361	0,30
606	Freddie Mac Pool „SD7509“, 3,000 %, fällig 01.11.2049	531	0,05	10.866	Freddie Mac REMICS 5092, Klasse IU, 2,500 %, fällig 25.02.2051	1.274	0,11
4.412	Freddie Mac Pool „SD7523“, 2,500 %, fällig 01.08.2050	3.711	0,33	3.533	Freddie Mac REMICS 5113, Klasse NI, 2,500 %, fällig 25.06.2051	437	0,04
211	Freddie Mac Pool „SD7525“, 2,500 %, fällig 01.10.2050	177	0,02	11.609	Freddie Mac REMICS 5134, Klasse KI, 2,500 %, fällig 25.07.2048	1.545	0,14
3.743	Freddie Mac Pool „SD7526“, 2,500 %, fällig 01.10.2050	3.149	0,28	10.811	Freddie Mac REMICS 5135, Klasse DI, 2,500 %, fällig 25.05.2048	1.412	0,13
671	Freddie Mac Pool „SD7534“, 2,500 %, fällig 01.02.2051	569	0,05	1.432	Freddie Mac REMICS 5149, Klasse NI, 2,500 %, fällig 25.01.2051	208	0,02
23.062	Freddie Mac Pool „SD7548“, 2,500 %, fällig 01.11.2051	19.365	1,72	9.330	Freddie Mac REMICS 5160, Klasse IU, 2,500 %, fällig 25.11.2050	1.275	0,11
4.735	Freddie Mac Pool „SD8146“, 2,000 %, fällig 01.05.2051	3.788	0,34	9.576	Freddie Mac REMICS 5162, Klasse DI, 2,500 %, fällig 25.11.2051	1.284	0,11
9.957	Freddie Mac Pool „SI2048“, 2,500 %, fällig 01.07.2050	8.333	0,74	7.700	Freddie Mac REMICS 5169, Klasse PW, 2,000 %, fällig 25.09.2051	5.015	0,45
1.132	Freddie Mac Pool „ZA2343“, 3,500 %, fällig 01.05.2034	1.076	0,10	7.200	Freddie Mac REMICS 5178, Klasse CY, 2,000 %, fällig 25.01.2042	4.791	0,43
1.528	Freddie Mac Pool „ZA2415“, 3,000 %, fällig 01.06.2036	1.409	0,12	4.900	Freddie Mac REMICS 5209, Klasse EQ, 3,000 %, fällig 25.04.2052	3.576	0,32
251	Freddie Mac Pool „ZA5297“, 4,000 %, fällig 01.03.2048	236	0,02	1.901	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA5, Serie 2022 DNA5, Klasse M1A, 144A, 8,238 %, fällig 25.06.2042 *	1.944	0,17
229	Freddie Mac Pool „Z19993“, 5,000 %, fällig 01.05.2040	228	0,02	1.124	Freddie Mac Strips 312, Klasse S1, 0,647 %, fällig 15.09.2043 *	109	0,01
2.093	Freddie Mac Pool „ZM1466“, 3,500 %, fällig 01.07.2046	1.907	0,17	3.743	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2021 DNA2, Klasse M2, 144A, 7,588 %, fällig 25.08.2033 *	3.753	0,33
363	Freddie Mac Pool „ZN0480“, 3,500 %, fällig 01.10.2042	332	0,03	–	Ginnie Mae I Pool „410304“, 7,500 %, fällig 15.12.2025	–	–
796	Freddie Mac Pool „ZN0538“, 3,500 %, fällig 01.11.2042	728	0,06	–	Ginnie Mae I Pool „417463“, 7,000 %, fällig 15.09.2025	–	–
2.042	Freddie Mac Pool „ZN0608“, 3,500 %, fällig 01.02.2043	1.868	0,17	–	Ginnie Mae I Pool „430208“, 7,000 %, fällig 15.09.2027	–	–
88	Freddie Mac Pool „ZN0614“, 3,500 %, fällig 01.02.2043	81	0,01	–	Ginnie Mae I Pool „462669“, 7,000 %, fällig 15.04.2028	–	–
83	Freddie Mac Pool „ZN0628“, 3,500 %, fällig 01.02.2043	76	0,01	–	Ginnie Mae I Pool „486470“, 6,500 %, fällig 15.08.2028	–	–
55	Freddie Mac Pool „ZN2185“, 4,500 %, fällig 01.12.2048	53	–	–	Ginnie Mae I Pool „486516“, 6,500 %, fällig 15.09.2028	–	–
10	Freddie Mac Pool „ZS0823“, 5,000 %, fällig 01.12.2034	10	–	–	Ginnie Mae I Pool „519569“, 8,000 %, fällig 15.05.2030	–	–
310	Freddie Mac Pool „ZS1355“, 6,000 %, fällig 01.03.2037	320	0,03	23	Ginnie Mae I Pool „646044“, 6,500 %, fällig 15.10.2037	23	–
5	Freddie Mac Pool „ZS1530“, 5,500 %, fällig 01.07.2037	6	–	1	Ginnie Mae I Pool „652203“, 5,000 %, fällig 15.03.2036	1	–
8	Freddie Mac Pool „ZS1821“, 5,500 %, fällig 01.11.2037	8	–	3	Ginnie Mae I Pool „658182“, 6,000 %, fällig 15.11.2036	3	–
128	Freddie Mac Pool „ZS3059“, 5,500 %, fällig 01.12.2038	130	0,01	1	Ginnie Mae I Pool „675375“, 5,000 %, fällig 15.05.2038	1	–
9.787	Freddie Mac Pool „ZS4751“, 3,500 %, fällig 01.01.2048	8.903	0,79	1	Ginnie Mae I Pool „676940“, 5,000 %, fällig 15.04.2038	1	–
141	Freddie Mac Pool „ZS8673“, 3,000 %, fällig 01.10.2032	134	0,01	4	Ginnie Mae I Pool „683926“, 5,000 %, fällig 15.02.2038	4	–
220	Freddie Mac Pool „ZS9826“, 3,000 %, fällig 01.10.2046	193	0,02	6	Ginnie Mae I Pool „684334“, 5,000 %, fällig 15.02.2038	6	–
37	Freddie Mac Pool „ZT0474“, 4,500 %, fällig 01.08.2048	36	–	2	Ginnie Mae I Pool „684754“, 5,000 %, fällig 15.04.2038	2	–
2.106	Freddie Mac Pool „ZT1101“, 3,000 %, fällig 01.01.2043	1.872	0,17	1	Ginnie Mae I Pool „684848“, 5,000 %, fällig 15.04.2038	1	–
743	Freddie Mac Pool „ZT1107“, 3,500 %, fällig 01.03.2043	680	0,06	2	Ginnie Mae I Pool „686062“, 5,000 %, fällig 15.05.2038	2	–
132	Freddie Mac Pool „ZT1159“, 3,500 %, fällig 01.02.2044	121	0,01	51	Ginnie Mae I Pool „698086“, 6,000 %, fällig 15.04.2039	52	–
137	Freddie Mac Pool „ZT1257“, 3,000 %, fällig 01.01.2046	122	0,01	9	Ginnie Mae I Pool „701501“, 5,000 %, fällig 15.12.2038	9	–
34	Freddie Mac Pool „ZT1854“, 4,500 %, fällig 01.03.2049	33	–	257	Ginnie Mae I Pool „701947“, 5,000 %, fällig 15.06.2039	256	0,02
137	Freddie Mac Pool „ZT1970“, 3,500 %, fällig 01.04.2033	131	0,01	113	Ginnie Mae I Pool „733600“, 5,000 %, fällig 15.04.2040	112	0,01
1.732	Freddie Mac Pool „ZT2228“, 3,500 %, fällig 01.06.2049	1.575	0,14	250	Ginnie Mae I Pool „733627“, 5,000 %, fällig 15.05.2040	248	0,02
4.600	Freddie Mac REMICS 3810, Klasse WA, 5,405 %, fällig 15.06.2040 *	4.567	0,41	1	Ginnie Mae I Pool „780732“, 7,000 %, fällig 15.03.2028	1	–
2.806	Freddie Mac REMICS 3998, Klasse DS, 1,197 %, fällig 15.02.2042 *	314	0,03	1	Ginnie Mae I Pool „78100“, 7,500 %, fällig 15.03.2029	1	–
2.085	Freddie Mac REMICS 4134, Klasse IM, 3,500 %, fällig 15.11.2042	342	0,03	46	Ginnie Mae I Pool „781590“, 5,500 %, fällig 15.04.2033	46	–
607	Freddie Mac REMICS 4280, Klasse AI, 3,000 %, fällig 15.02.2028	10	–	312	Ginnie Mae I Pool „781994“, 5,500 %, fällig 15.11.2033	314	0,03
4.800	Freddie Mac REMICS 4377, Klasse UZ, 3,000 %, fällig 15.08.2044	3.740	0,33	2	Ginnie Mae I Pool „782198“, 6,000 %, fällig 15.10.2037	2	–
208	Freddie Mac REMICS 4403, Klasse IG, 3,500 %, fällig 15.07.2032	6	–	279	Ginnie Mae I Pool „784571“, 3,500 %, fällig 15.06.2048	260	0,02
1.140	Freddie Mac REMICS 4715, Klasse JS, 0,847 %, fällig 15.08.2047 *	129	0,01	122	Ginnie Mae I Pool „AA5649“, 3,000 %, fällig 15.09.2042	110	0,01
284	Freddie Mac REMICS 4759, Klasse MI, 4,000 %, fällig 15.09.2045	19	–	144	Ginnie Mae I Pool „AB2892“, 3,000 %, fällig 15.09.2042	130	0,01
1.234	Freddie Mac REMICS 4808, Klasse SB, 0,897 %, fällig 15.07.2048 *	147	0,01	43	Ginnie Mae I Pool „AB9108“, 3,000 %, fällig 15.10.2042	39	–
181	Freddie Mac REMICS 4813, Klasse CJ, 3,000 %, fällig 15.08.2048	158	0,01	232	Ginnie Mae I Pool „AB9109“, 3,000 %, fällig 15.10.2042	206	0,02
1.513	Freddie Mac REMICS 4856, Klasse IO, 5,000 %, fällig 15.01.2049	276	0,02	201	Ginnie Mae I Pool „AB9207“, 3,000 %, fällig 15.11.2042	179	0,02
807	Freddie Mac REMICS 4870, Klasse ES, 0,697 %, fällig 15.04.2049 *	82	0,01	1.635	Ginnie Mae I Pool „BS8462“, 3,500 %, fällig 15.06.2050	1.511	0,13
1.656	Freddie Mac REMICS 4882, Klasse S, 0,747 %, fällig 15.05.2049 *	171	0,02	7	Ginnie Mae II Pool „4040“, 6,500 %, fällig 20.10.2037	7	–
2.376	Freddie Mac REMICS 4921, Klasse SN, 0,648 %, fällig 25.10.2049 *	254	0,02	9	Ginnie Mae II Pool „4170“, 6,000 %, fällig 20.06.2038	9	–
1.098	Freddie Mac REMICS 4936, Klasse YZ, 2,500 %, fällig 25.12.2049	879	0,08	633	Ginnie Mae II Pool „4245“, 6,000 %, fällig 20.09.2038	665	0,06
1.278	Freddie Mac REMICS 4962, Klasse SP, 0,648 %, fällig 25.03.2050 *	132	0,01	101	Ginnie Mae II Pool „4602“, 6,000 %, fällig 20.12.2039	105	0,01
2.876	Freddie Mac REMICS 4988, Klasse AZ, 2,000 %, fällig 25.07.2050	1.678	0,15	106	Ginnie Mae II Pool „4617“, 4,500 %, fällig 20.01.2040	103	0,01
2.226	Freddie Mac REMICS 4995, Klasse IQ, 2,500 %, fällig 25.07.2050	327	0,03	54	Ginnie Mae II Pool „4696“, 4,500 %, fällig 20.05.2040	52	–
9.646	Freddie Mac REMICS 4995, Klasse QI, 2,500 %, fällig 25.07.2050	1.497	0,13	33	Ginnie Mae II Pool „4747“, 5,000 %, fällig 20.07.2040	33	–
4.900	Freddie Mac REMICS 5000, Klasse IB, 2,500 %, fällig 25.07.2050	607	0,05	38	Ginnie Mae II Pool „4772“, 5,000 %, fällig 20.08.2040	38	–
3.879	Freddie Mac REMICS 5000, Klasse UI, 2,500 %, fällig 25.07.2050	672	0,06	4	Ginnie Mae II Pool „4774“, 6,000 %, fällig 20.08.2040	4	–
1.625	Freddie Mac REMICS 5027, Klasse HI, 2,000 %, fällig 25.10.2050	218	0,02	80	Ginnie Mae II Pool „4802“, 5,000 %, fällig 20.09.2040	80	0,01
3.069	Freddie Mac REMICS 5038, Klasse PJ, 0,750 %, fällig 25.10.2050	2.164	0,19	34	Ginnie Mae II Pool „4855“, 5,000 %, fällig 20.11.2040	34	–
142	Freddie Mac REMICS 5040, Klasse IB, 2,500 %, fällig 25.11.2050	25	–	13	Ginnie Mae II Pool „4923“, 4,500 %, fällig 20.01.2041	12	–
				8	Ginnie Mae II Pool „4928“, 6,000 %, fällig 20.01.2041	8	–
				429	Ginnie Mae II Pool „4978“, 4,500 %, fällig 20.03.2041	419	0,04
				943	Ginnie Mae II Pool „783.050“, 5,000 %, fällig 20.07.2040	940	0,08
				696	Ginnie Mae II Pool „783298“, 4,500 %, fällig 20.04.2041	681	0,06

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)</b>						
65	Ginnie Mae II Pool „784106“, 3,500 %, fällig 20.01.2046	60	116	Ginnie Mae II Pool „MA6412“, 4,500 %, fällig 20.01.2050	112	0,01
1.986	Ginnie Mae II Pool „784577“, 4,000 %, fällig 20.07.2047	1.876	81	Ginnie Mae II Pool „MA6542“, 3,500 %, fällig 20.03.2050	75	0,01
60	Ginnie Mae II Pool „784905“, 3,000 %, fällig 20.01.2050	53	119	Ginnie Mae II Pool „MA6602“, 4,500 %, fällig 20.04.2050	115	0,01
507	Ginnie Mae II Pool „785360“, 2,000 %, fällig 20.03.2051	406	4.646	Ginnie Mae II Pool „MA6657“, 3,500 %, fällig 20.05.2050	4.262	0,38
8.814	Ginnie Mae II Pool „785944“, 3,000 %, fällig 20.02.2052	7.783	3.936	Ginnie Mae II Pool „MA6658“, 4,000 %, fällig 20.05.2050	3.726	0,33
2.107	Ginnie Mae II Pool „786077“, 3,000 %, fällig 20.03.2052	1.856	1.925	Ginnie Mae II Pool „MA6869“, 4,500 %, fällig 20.09.2050	1.859	0,16
2.934	Ginnie Mae II Pool „786082“, 3,000 %, fällig 20.11.2051	2.594	2.473	Ginnie Mae II Pool „MA6935“, 4,500 %, fällig 20.10.2050	2.389	0,21
279	Ginnie Mae II Pool „786095“, 3,000 %, fällig 20.04.2052	240	104	Ginnie Mae II Pool „MA7194“, 3,000 %, fällig 20.02.2051	93	0,01
1.493	Ginnie Mae II Pool „786107“, 3,000 %, fällig 20.03.2052	1.319	15.743	Ginnie Mae II Pool „MA7312“, 2,500 %, fällig 20.04.2051	13.416	1,19
1.335	Ginnie Mae II Pool „786108“, 3,500 %, fällig 20.03.2052	1.200	2.195	Ginnie Mae II Pool „MA7314“, 3,500 %, fällig 20.04.2051	2.002	0,18
418	Ginnie Mae II Pool „786134“, 3,000 %, fällig 20.04.2052	361	4.723	Ginnie Mae II Pool „MA7316“, 4,500 %, fällig 20.04.2051	4.565	0,41
286	Ginnie Mae II Pool „786335“, 4,500 %, fällig 20.09.2052	275	4.625	Ginnie Mae II Pool „MA7420“, 3,500 %, fällig 20.06.2051	4.218	0,37
8.783	Ginnie Mae II Pool „786348“, 4,500 %, fällig 20.08.2052	8.391	3.769	Ginnie Mae II Pool „MA7475“, 4,000 %, fällig 20.07.2051	3.552	0,32
679	Ginnie Mae II Pool „786474“, 5,000 %, fällig 20.01.2053	666	5.426	Ginnie Mae II Pool „MA7590“, 3,000 %, fällig 20.09.2051	4.793	0,43
1.549	Ginnie Mae II Pool „892346“, 7,833 %, fällig 20.08.2059 *	1.567	18.018	Ginnie Mae II Pool „MA7768“, 3,000 %, fällig 20.12.2051	15.888	1,41
214	Ginnie Mae II Pool „892614“, 7,225 %, fällig 20.08.2060 *	217	3.777	Ginnie Mae II Pool „MA7883“, 3,500 %, fällig 20.02.2052	3.431	0,30
863	Ginnie Mae II Pool „AV0243“, 3,500 %, fällig 20.08.2046	796	3.286	Ginnie Mae II Pool „MA8045“, 4,000 %, fällig 20.05.2052	3.063	0,27
1.048	Ginnie Mae II Pool „AV8311“, 3,500 %, fällig 20.08.2046	967	2.887	Ginnie Mae II Pool „MA8046“, 4,500 %, fällig 20.05.2052	2.753	0,24
1.215	Ginnie Mae II Pool „AV8312“, 3,500 %, fällig 20.08.2046	1.121	1.130	Ginnie Mae II Pool „MA8100“, 4,000 %, fällig 20.06.2052	1.053	0,09
406	Ginnie Mae II Pool „AZ3074“, 4,000 %, fällig 20.02.2047	383	15.557	Ginnie Mae II Pool „MA8197“, 2,500 %, fällig 20.08.2052	13.255	1,18
496	Ginnie Mae II Pool „BC5293“, 3,500 %, fällig 20.08.2047	457	118	Ginnie Mae II Pool „MA8263“, 2,000 %, fällig 20.09.2052	97	0,01
3.174	Ginnie Mae II Pool „BC5429“, 3,500 %, fällig 20.10.2047	2.924	671	Ginnie Mae II Pool „MA8348“, 5,000 %, fällig 20.10.2052	654	0,06
252	Ginnie Mae II Pool „BD3554“, 3,500 %, fällig 20.10.2047	232	620	Ginnie Mae II Pool „MA8422“, 2,000 %, fällig 20.11.2052	512	0,05
1.308	Ginnie Mae II Pool „BD3636“, 3,500 %, fällig 20.10.2047	1.205	1.836	Ginnie Mae II Pool „MA8428“, 5,000 %, fällig 20.11.2052	1.789	0,16
31	Ginnie Mae II Pool „BG9751“, 4,500 %, fällig 20.06.2048	29	1.340	Ginnie Mae II Pool „MA8429“, 5,500 %, fällig 20.11.2052	1.327	0,12
718	Ginnie Mae II Pool „BH1521“, 3,500 %, fällig 20.07.2048	689	2.592	Ginnie Mae II Pool „MA8484“, 2,000 %, fällig 20.12.2052	2.142	0,19
888	Ginnie Mae II Pool „BH1870“, 4,500 %, fällig 20.08.2048	857	2.894	Ginnie Mae II Pool „MA8492“, 6,000 %, fällig 20.12.2052	2.906	0,26
632	Ginnie Mae II Pool „BM7534“, 3,500 %, fällig 20.02.2050	574	4.711	Ginnie Mae II Pool „MA8647“, 5,000 %, fällig 20.02.2053	4.586	0,41
123	Ginnie Mae II Pool „BM9734“, 4,000 %, fällig 20.10.2049	117	3.353	Ginnie Mae II Pool „MA8725“, 5,000 %, fällig 20.03.2053	3.265	0,29
494	Ginnie Mae II Pool „BS1728“, 4,000 %, fällig 20.01.2050	473	1.180	Ginnie Mae II Pool „MA8727“, 6,000 %, fällig 20.03.2053	1.185	0,11
407	Ginnie Mae II Pool „BS1742“, 4,000 %, fällig 20.02.2050	389	2.154	Ginnie Mae II Pool „MA8794“, 2,000 %, fällig 20.03.2053	1.781	0,16
72	Ginnie Mae II Pool „BS8546“, 2,500 %, fällig 20.12.2050	60	98	Ginnie Mae II Pool „MA8798“, 4,000 %, fällig 20.04.2053	92	0,01
476	Ginnie Mae II Pool „BT1888“, 2,500 %, fällig 20.12.2050	405	1.925	Ginnie Mae II Pool „MA8800“, 5,000 %, fällig 20.04.2053	1.874	0,17
924	Ginnie Mae II Pool „BT9472“, 4,000 %, fällig 20.05.2050	876	6.300	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,000 % ±	5.198	0,46
2.310	Ginnie Mae II Pool „BU3196“, 4,000 %, fällig 20.05.2050	2.154	100	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 4,500 % ±	95	0,01
776	Ginnie Mae II Pool „BW7380“, 4,500 %, fällig 20.07.2050	744	5.000	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,500 % ±	4.950	0,44
939	Ginnie Mae II Pool „BW7384“, 4,000 %, fällig 20.08.2050	880	1.000	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 6,000 % ±	1.003	0,09
1.348	Ginnie Mae II Pool „BX2423“, 3,000 %, fällig 20.10.2050	1.189	645	Government National Mortgage Association, Serie 2004 81, Klasse SK, 0,773 %, fällig 16.10.2034 *	23	–
93	Ginnie Mae II Pool „CK9592“, 4,000 %, fällig 20.06.2052	87	1.115	Government National Mortgage Association, Serie 2008 40, Klasse SC, 0,923 %, fällig 16.05.2038 *	62	0,01
88	Ginnie Mae II Pool „CL5523“, 3,000 %, fällig 20.04.2052	77	1.386	Government National Mortgage Association, Serie 2008 79, Klassen-ID, 1,372 %, fällig 20.06.2035 *	82	0,01
153	Ginnie Mae II Pool „MA3597“, 3,500 %, fällig 20.04.2046	141	264	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H02, Klasse FA, 6,110 %, fällig 20.02.2060 *	264	0,02
84	Ginnie Mae II Pool „MA3663“, 3,500 %, fällig 20.05.2046	78	599	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H20, Klasse AF, 5,585 %, fällig 20.10.2060 *	595	0,05
144	Ginnie Mae II Pool „MA3736“, 3,500 %, fällig 20.06.2046	133	232	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H22, Klasse FE, 5,605 %, fällig 20.05.2059 *	230	0,02
87	Ginnie Mae II Pool „MA3803“, 3,500 %, fällig 20.07.2046	80	287	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H28, Klasse FE, 5,655 %, fällig 20.12.2060 *	286	0,03
5.296	Ginnie Mae II Pool „MA4003“, 3,000 %, fällig 20.10.2046	4.736	637	Government National Mortgage Association, Serie 2011 146, Klasse KS, 0,673 %, fällig 16.11.2041 *	57	–
744	Ginnie Mae II Pool „MA4261“, 3,000 %, fällig 20.02.2047	665	856	Government National Mortgage Association, Serie 2011 79, Klasse KS, 0,000 %, fällig 20.05.2041 *	55	–
369	Ginnie Mae II Pool „MA4511“, 4,000 %, fällig 20.06.2047	350	2.616	Government National Mortgage Association, Serie 2012 H21, Klasse FA, 5,755 %, fällig 20.07.2062 *	2.603	0,23
2.107	Ginnie Mae II Pool „MA4586“, 3,500 %, fällig 20.07.2047	1.944	9.389	Government National Mortgage Association, Serie 2013 93, Klasse SA, 0,773 %, fällig 16.06.2043 *	1.003	0,09
76	Ginnie Mae II Pool „MA4587“, 4,000 %, fällig 20.07.2047	72	514	Government National Mortgage Association, Serie 2014 118, Klasse HS, 0,772 %, fällig 20.08.2044 *	53	–
112	Ginnie Mae II Pool „MA4654“, 4,500 %, fällig 20.08.2047	109	825	Government National Mortgage Association, Serie 2014 2, Klasse CI, 4,500 %, fällig 20.01.2044	172	0,02
151	Ginnie Mae II Pool „MA4781“, 5,000 %, fällig 20.10.2047	150	2.367	Government National Mortgage Association, Serie 2014 60, Klasse SA, 0,673 %, fällig 16.04.2044 *	201	0,02
186	Ginnie Mae II Pool „MA4838“, 4,000 %, fällig 20.11.2047	176	8.046	Government National Mortgage Association, Serie 2015 136, Klasse IO, 0,409 %, fällig 16.08.2055 *	121	0,01
169	Ginnie Mae II Pool „MA4901“, 4,000 %, fällig 20.12.2047	160	3.666	Government National Mortgage Association, Serie 2015 177, Klasse MI, 5,000 %, fällig 20.10.2044	746	0,07
14.538	Ginnie Mae II Pool „MA4961“, 3,000 %, fällig 20.01.2048	12.973	26.319	Government National Mortgage Association, Serie 2017 111, Klasse IO, 0,526 %, fällig 16.02.2059 *	813	0,07
52	Ginnie Mae II Pool „MA5020“, 4,000 %, fällig 20.02.2048	50	1.843	Government National Mortgage Association, Serie 2017 19, Klasse SE, 0,723 %, fällig 16.02.2047 *	159	0,01
83	Ginnie Mae II Pool „MA5078“, 4,000 %, fällig 20.03.2048	78	3.695	Government National Mortgage Association, Serie 2017 26, Klasse IQ, 5,000 %, fällig 20.02.2040	749	0,07
168	Ginnie Mae II Pool „MA5138“, 4,500 %, fällig 20.04.2048	163	6.944	Government National Mortgage Association, Serie 2017 8, Klasse IO, 0,448 %, fällig 16.08.2058 *	170	0,01
124	Ginnie Mae II Pool „MA5193“, 4,500 %, fällig 20.05.2048	119	508	Government National Mortgage Association, Serie 2017 H22, Klasse JF, 3,925 %, fällig 20.10.2067 *	502	0,04
96	Ginnie Mae II Pool „MA5194“, 5,000 %, fällig 20.05.2048	95	1.760	Government National Mortgage Association, Serie 2018 125, Klasse HS, 0,822 %, fällig 20.09.2048 *	147	0,01
17	Ginnie Mae II Pool „MA5265“, 4,500 %, fällig 20.06.2048	17	2.739	Government National Mortgage Association, Serie 2018 134, Klasse SM, 0,772 %, fällig 20.10.2048 *	241	0,02
131	Ginnie Mae II Pool „MA5331“, 4,500 %, fällig 20.07.2048	126	789	Government National Mortgage Association, Serie 2018 168, Klasse PA, 4,000 %, fällig 20.08.2048	745	0,07
1.761	Ginnie Mae II Pool „MA5399“, 4,500 %, fällig 20.08.2048	1.700				
39	Ginnie Mae II Pool „MA5467“, 4,500 %, fällig 20.09.2048	38				
6.359	Ginnie Mae II Pool „MA5530“, 5,000 %, fällig 20.10.2048	6.281				
212	Ginnie Mae II Pool „MA5597“, 5,000 %, fällig 20.11.2048	209				
61	Ginnie Mae II Pool „MA5652“, 4,500 %, fällig 20.12.2048	59				
285	Ginnie Mae II Pool „MA5653“, 5,000 %, fällig 20.12.2048	281				
194	Ginnie Mae II Pool „MA5711“, 4,500 %, fällig 20.01.2049	187				
202	Ginnie Mae II Pool „MA5712“, 5,000 %, fällig 20.01.2049	199				
201	Ginnie Mae II Pool „MA5713“, 5,500 %, fällig 20.01.2049	202				
93	Ginnie Mae II Pool „MA5764“, 4,500 %, fällig 20.02.2049	90				
2.344	Ginnie Mae II Pool „MA5766“, 5,500 %, fällig 20.02.2049	2.360				
126	Ginnie Mae II Pool „MA5818“, 4,500 %, fällig 20.03.2049	122				
513	Ginnie Mae II Pool „MA5820“, 5,500 %, fällig 20.03.2049	516				
11	Ginnie Mae II Pool „MA5877“, 4,500 %, fällig 20.04.2049	11				
135	Ginnie Mae II Pool „MA5878“, 5,000 %, fällig 20.04.2049	133				
494	Ginnie Mae II Pool „MA5879“, 5,500 %, fällig 20.04.2049	498				
375	Ginnie Mae II Pool „MA5934“, 5,500 %, fällig 20.05.2049	378				
3.372	Ginnie Mae II Pool „MA5989“, 5,500 %, fällig 20.06.2049	3.396				
3.693	Ginnie Mae II Pool „MA6157“, 5,000 %, fällig 20.09.2049	3.651				
202	Ginnie Mae II Pool „MA6217“, 2,500 %, fällig 20.10.2049	173				

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)</b>					
643			600		
Government National Mortgage Association, Serie 2018 37, Klasse QA, 2,750 %, fällig 20.03.2048	564	0,05	Government National Mortgage Association, Serie 2021 8, Klasse AQ, 5,000 %, fällig 20.01.2051	603	0,05
550			5.400		
Government National Mortgage Association, Serie 2018 H09, Klasse FE, 5,495 %, fällig 20.06.2068 *	543	0,05	Government National Mortgage Association, Serie 2022 102, Klasse CB, 2,250 %, fällig 16.06.2064 *	3.167	0,28
580			1.100		
Government National Mortgage Association, Serie 2018 H13, Klasse DF, 5,401 %, fällig 20.07.2068 *	574	0,05	Government National Mortgage Association, Serie 2022 139, Klasse AL, 4,000 %, fällig 20.07.2051	992	0,09
500			9.200		
Government National Mortgage Association, Serie 2019 128, Klasse AL, 2,500 %, fällig 20.10.2049	343	0,03	Government National Mortgage Association, Serie 2022 147, Klasse B, 2,200 %, fällig 16.10.2063	6.748	0,60
566			9.426		
Government National Mortgage Association, Serie 2019 18, Klasse TP, 3,500 %, fällig 20.02.2049	513	0,05	Government National Mortgage Association, Serie 2022 158, Klasse AL, 2,100 %, fällig 16.08.2064	7.086	0,63
12.641			4.369		
Government National Mortgage Association, Serie 2019 85, Klasse LS, 0,000 %, fällig 20.07.2049 *	247	0,02	Government National Mortgage Association, Serie 2022 3, Klasse IO, 0,640 %, fällig 16.02.2061 *	221	0,02
244			3.189		
Government National Mortgage Association, Serie 2019 H01, Klasse FT, 5,618 %, fällig 20.10.2068 *	243	0,02	Government National Mortgage Association, Serie 2022 54, Klasse Z, 2,000 %, fällig 16.10.2063 *	1.421	0,13
271			39.048		
Government National Mortgage Association, Serie 2019 H08, Klasse FE, 3,869 %, fällig 20.01.2069 *	261	0,02	Government National Mortgage Association, Serie 2022 55, Klasse IO, 0,567 %, fällig 16.01.2063 *	1.786	0,16
302			1.900		
Government National Mortgage Association, Serie 2019 H10, Klasse FB, 4,874 %, fällig 20.06.2069 *	290	0,03	Government National Mortgage Association, Serie 2022 63, Klasse LM, 3,500 %, fällig 20.10.2050	1.580	0,14
5.198			1.300		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 116, Klasse GI, 2,500 %, fällig 20.08.2050	707	0,06	Government National Mortgage Association, Serie 2022 86, Klasse C, 2,250 %, fällig 16.10.2063 *	669	0,06
1.807			6.235		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 122, Klasse IM, 2,500 %, fällig 20.08.2050	247	0,02	Government National Mortgage Association, Serie 2023 8, Klasse AZ, 3,750 %, fällig 16.01.2065	4.763	0,42
3.839			6.600		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 123, Klasse EI, 2,500 %, fällig 20.08.2050	522	0,05	Government National Mortgage Association, Serie 2023 92, Klasse IO, 2,000 %, fällig 16.06.2064	5.037	0,45
466			6.000		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 129, Klasse IE, 2,500 %, fällig 20.09.2050	64	0,01	Government National Mortgage Association, Serie 2023 92, Klasse IA, 0,611 %, fällig 16.06.2064 *	373	0,03
160			3.351		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Klasse IH, 2,500 %, fällig 20.10.2050	22	–	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Klasse A, 144A, 7,225 %, fällig 15.09.2031 *	2.781	0,25
5.357			3.477		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Klasse QI, 2,500 %, fällig 20.10.2050	900	0,08	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Klasse B, 144A, 8,425 %, fällig 15.09.2031 *	1.879	0,17
232			1.450		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Klasse VI, 2,500 %, fällig 20.10.2050	33	–	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20, Serie 2014 GC20, Klasse A5, 3,998 %, fällig 10.04.2047	1.433	0,13
705			2.120		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Klasse YI, 2,500 %, fällig 20.10.2050	94	0,01	GS Mortgage Securities Trust 2017-GS8, Serie 2017 GS8, Klasse AA, 3,469 %, fällig 10.11.2050	1.937	0,17
4.249			7.659		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 181, Klasse WI, 2,000 %, fällig 20.12.2050	462	0,04	JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Serie 2018 5, Klasse AX1, 144A, 0,228 %, fällig 25.10.2048 *†	47	–
3.994			1.885		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 191, Klasse IX, 2,500 %, fällig 20.12.2050	675	0,06	JP MDB Commercial Mortgage Securities Trust 2018-C8, Serie 2018 C8, Klasse A4, 4,211 %, fällig 15.06.2051	1.748	0,16
4.606			1.059		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 36, Klasse GS, 0,672 %, fällig 20.03.2050 *	577	0,05	New Residential Mortgage Loan Trust 2018-3, Serie 2018 3A, Klasse A1, 144A, 4,500 %, fällig 25.05.2058 *	1.012	0,09
506			1.469		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 47, Klasse MI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	86	0,01	New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM3, Serie 2021 NQM3, Klasse A1, 144A, 1,156 %, fällig 27.11.2056 *	1.201	0,11
1.385			<b>Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 1.206.105 USD)</b>		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 47, Klasse NI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	230	0,02		1.095.793	97,30
968			<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 0,17 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 61, Klasse CI, 4,000 %, fällig 20.03.2050	170	0,01	<b>USA – 0,17 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
828			2.000		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 85, Klasse CI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	137	0,01	PG&E Wildfire Recovery Funding LLC, Serie A-4, 5,212 %, fällig 01.12.2047	1.929	0,17
5.874			<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 2.038 USD)</b>		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 H08, Klasse BI, 0,026 %, fällig 01.04.2070 *	189	0,02		1.929	0,17
1.298			<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 1,00 % (28. Februar 2023: 2,42 %)</b>		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 H09, Klasse FL, 4,850 %, fällig 20.05.2070 *	1.302	0,12	<b>USA – 1,00 % (28. Februar 2023: 2,42 %)</b>		
145			7.300		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 H12, Klasse F, 5,530 %, fällig 20.07.2070 *	143	0,01	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 21.09.2023	7.279	0,65
1.086			60		
Government National Mortgage Association, Serie 2020 H13, Klasse FA, 4,989 %, fällig 20.07.2070 *	1.062	0,09	60 United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 28.02.2025	57	–
28.431			4.320		
Government National Mortgage Association, Serie 2021 110, Klasse IO, 0,873 %, fällig 16.11.2063 *	1.837	0,16	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30.04.2026	3.907	0,35
1.088				11.243	1,00
Government National Mortgage Association, Serie 2021 14, Klasse AB, 1,340 %, fällig 16.06.2063	815	0,07	<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 11.648 USD)</b>		
6.567				11.243	1,00
Government National Mortgage Association, Serie 2021 156, Klasse IE, 2,500 %, fällig 20.09.2051	937	0,08	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,33 % (28. Februar 2023: 0,10 %)</b>		
13.466			3.712		
Government National Mortgage Association, Serie 2021 158, Klasse IN, 2,500 %, fällig 20.09.2051	1.851	0,16	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	3.712	0,33
3.508			<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 3.712\$)</b>		
Government National Mortgage Association, Serie 2021 180, Klasse IO, 0,911 %, fällig 16.11.2063 *	241	0,02			
16.081			<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 1.247.491\$)</b>		
Government National Mortgage Association, Serie 2021 191, Klasse NI, 3,000 %, fällig 20.10.2051	2.727	0,24		1.134.430	100,73
2.795			<b>Futures – 0,10 % (28. Februar 2023: 0,03 %)</b>		
Government National Mortgage Association, Serie 2021 21, Klasse AH, 1,400 %, fällig 16.06.2063	2.118	0,19	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
7.496				1.098	0,10
Government National Mortgage Association, Serie 2021 216, Klasse NI, 3,000 %, fällig 20.12.2051	1.155	0,10	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
903				1.135.528	100,83
Government National Mortgage Association, Serie 2021 29, Klasse AG, 5,000 %, fällig 20.02.2051	888	0,08	<b>Futures – –0,01 % (28. Februar 2023: –0,06 %)</b>		
49.556			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
Government National Mortgage Association, Serie 2021 37, Klasse IO, 0,805 %, fällig 16.01.2061 *	2.898	0,26		-94	-0,01
6.417			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>		
Government National Mortgage Association, Serie 2021 46, Klasse NI, 2,500 %, fällig 20.03.2051	1.008	0,09		-94	-0,01
21.408			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
Government National Mortgage Association, Serie 2021 5, Klasse IO, 1,112 %, fällig 16.01.2061 *	1.574	0,14		1.135.434	100,82
29.005			<b>Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten</b>		
Government National Mortgage Association, Serie 2021 60, Klasse IO, 0,826 %, fällig 16.05.2063 *	1.724	0,15		-9.255	-0,82
5.217			<b>Gesamtneuvermögen</b>		
Government National Mortgage Association, Serie 2021 7, Klasse TI, 2,500 %, fällig 16.01.2051	884	0,08		1.126.179\$	100,00

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

- Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.
- 144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 38.811.000\$ und machten 3,43 % des Nettovermögens aus.
- \* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.
- † Nicht liquide.
- ± Auf Basis ausstehender Bekanntgabe erworbene Wertpapiere.

### ABKÜRZUNGEN:

- REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit.  
TBA – wird noch bekannt gegeben.

	% des Gesamtver- mögens
<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	88,79
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,29
Finanzderivate	0,09
Sonstige Vermögenswerte	10,83
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

## Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
3-Monats-SOFR-Index Dezember 2024	Bank of America Merrill Lynch	-138	\$ -33.061	\$ 53
3-Monats-SOFR-Index März 2024	Bank of America Merrill Lynch.	-276	-65.412	28
3-Monats-SOFR-Index September 2024	Bank of America Merrill Lynch.	-223	-53.233	-9
US-10-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-90	-9.993	-85
US-5-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	543	58.058	359
US Long Bond (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	305	37.115	658
Nicht realisierte Wertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): 353\$)				\$ 1098
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-731)				-94
Nettowertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-378)				\$ 1004

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinventarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% des Nettoinventarwerts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 92,45 % (28. Februar 2023: 94,04 %)</b>			<b>Schweden – 2,09 % (28. Februar 2023: 2,10 %)</b>		
<b>Australien – 1,00 % (28. Februar 2023: 0,98 %)</b>			340 Svenska Handelsbanken AB, 4,625 %, fällig 23.08.2032 *		
160	128	0,29	350	299	0,67
380	320	0,71	410	328	0,73
	448	1,00		937	2,09
<b>Belgien – 0,56 % (28. Februar 2023: 0,56 %)</b>			<b>Schweiz – 3,09 % (28. Februar 2023: 2,89 %)</b>		
166	161	0,36	350 UBS Group AG, 2,250 %, fällig 09.06.2028 *		
USD 110	91	0,20	130 UBS Group AG, 7,750 %, fällig 01.03.2029 *		
	252	0,56	650 UBS Group AG, 1,875 %, fällig 03.11.2029 *		
<b>Kanada – 1,32 % (28. Februar 2023: 1,29 %)</b>			380 UBS Group AG, 2,125 %, fällig 15.11.2029 *		
340	321	0,72	130 Zurich Finance Ireland Designated Activity Co, 5,125 %, fällig 23.11.2052 *		
300	270	0,60		115	0,26
	591	1,32		1.388	3,09
<b>Dänemark – 1,57 % (28. Februar 2023: 1,57 %)</b>			<b>Vereinigtes Königreich – 40,79 % (28. Februar 2023: 42,05 %)</b>		
220	212	0,47	160 Anglian Water Osprey Financing Plc, 2,000 %, fällig 31.07.2028		
350	302	0,68	220 Anglian Water Services Financing Plc, 1,625 %, fällig 10.08.2025		
250	190	0,42	210 Annington Funding Plc, 2,308 %, fällig 06.10.2032		
	704	1,57	520 Annington Funding Plc, 4,750 %, fällig 09.08.2033		
<b>Finnland – 0,71 % (28. Februar 2023: 0,71 %)</b>			355 Aspire Defence Finance Plc, Serie A, 4,674 %, fällig 31.03.2040		
400	319	0,71	230 Associated British Foods Plc, 2,500 %, fällig 16.06.2034		
<b>Frankreich – 5,76 % (28. Februar 2023: 5,69 %)</b>			280 Assura Financing Plc, 3,000 %, fällig 19.07.2028		
290	272	0,61	270 Assura Financing Plc, 1,625 %, fällig 30.06.2033		
300	258	0,58	117 Aviva Plc, 5,125 %, fällig 04.06.2050 *		
100	96	0,21	190 Aviva Plc, 6,875 %, fällig 20.05.2058 *		
500	408	0,91	260 Barclays Plc, 1,700 %, fällig 03.11.2026 *		
400	378	0,84	493 Barclays Plc, 3,250 %, fällig 12.02.2027		
220	209	0,46	200 BP Capital Markets Plc, 2,274 %, fällig 03.07.2026		
300	190	0,42	570 British Land Co Plc/The, 2,375 %, fällig 14.09.2029		
100	90	0,20	240 British Telecommunications Plc, 3,125 %, fällig 21.11.2031		
100	88	0,20	130 Burberry Group Plc, 1,125 %, fällig 21.09.2025		
100	86	0,19	150 Cadent Finance Plc, 5,750 %, fällig 14.03.2034		
300	287	0,64	250 Cadent Finance Plc, 2,625 %, fällig 22.09.2038		
300	225	0,50	100 Chancellor Masters & Scholars der University of Cambridge/The, 2,350 %, fällig 27.06.2078		
	2.587	5,76	300 Clarion Funding Plc, 1,250 %, fällig 13.11.2032		
<b>Deutschland – 5,01 % (28. Februar 2023: 5,43 %)</b>			200 Clarion Funding Plc, 1,875 %, fällig 22.01.2035		
190	156	0,35	150 Clarion Funding Plc, 3,125 %, fällig 19.04.2048		
400	404	0,90	300 Coventry Building Society, 2,000 %, fällig 20.12.2030		
940	989	2,20	190 CPMK Finance Ltd, 5,876 %, fällig 28.08.2027		
200	194	0,43	115 Crh Finance UK Plc, 4,125 %, fällig 02.12.2029		
400	368	0,82	540 Derwent London Plc, 1,875 %, fällig 17.11.2031		
EUR 200	139	0,31	92 Eastern Power Networks Plc, 6,250 %, fällig 12.11.2036		
	2.250	5,01	220 Folio Residential Finance NO 1 Plc, 1,246 %, fällig 31.10.2027		
<b>Italien – 1,81 % (28. Februar 2023: 1,73 %)</b>			278 Gatwick Funding Ltd, 6,125 %, fällig 02.03.2026		
341	327	0,73	100 Gatwick Funding Ltd, 2,500 %, fällig 15.04.2030		
360	346	0,77	100 Gatwick Funding Ltd, 3,250 %, fällig 26.02.2048		
210	138	0,31	190 GlaxoSmithKline Capital Plc, 6,375 %, fällig 09.03.2039		
	811	1,81	100 Grainger Plc, 3,375 %, fällig 24.04.2028		
<b>Luxemburg – 1,20 % (28. Februar 2023: 1,21 %)</b>			190 Grainger Plc, 3,000 %, fällig 03.07.2030		
240	184	0,41	149 Greene King Finance Plc, Serie A2, 5,318 %, fällig 15.09.2031		
190	147	0,33	110 Greene King Finance Plc, Serie B1, 6,903 %, fällig 15.12.2034 *		
260	207	0,46	210 Guinness Partnership Ltd/The, 2,000 %, fällig 22.04.2055		
	538	1,20	127 HSBC Holdings Plc, 6,000 %, fällig 29.03.2040		
<b>Niederlande – 2,39 % (28. Februar 2023: 1,95 %)</b>			200 HSBC Holdings Plc, 6,332 %, fällig 09.03.2044 *		
200	197	0,44	50 Hutchison Whampoa Finance UK Plc, Serie B, 5,625 %, fällig 24.11.2026		
400	361	0,80	210 Land Securities Capital Markets Plc, 2,399 %, fällig 08.02.2029		
300	279	0,62	100 Land Securities Capital Markets Plc, 2,625 %, fällig 22.09.2037		
240	236	0,53	190 Leeds Building Society, 1,375 %, fällig 06.10.2027		
	1.073	2,39	520 Leeds Building Society, 3,750 %, fällig 25.04.2029 *		
<b>Norwegen – 1,50 % (28. Februar 2023: 1,49 %)</b>			120 Legal & General Group Plc, 3,750 %, fällig 26.11.2049 *		
240	226	0,50	190 Legal & General Group Plc, 4,500 %, fällig 01.11.2050 *		
480	449	1,00	230 Liberty Living Finance Plc, 3,375 %, fällig 28.11.2029		
	675	1,50	120 LiveWest Treasury Plc, 2,250 %, fällig 10.10.2043		
<b>Südafrika – 0,33 % (28. Februar 2023: 0,33 %)</b>			510 Lloyds Bank Plc, 7,625 %, fällig 22.04.2025		
170	148	0,33	230 Lloyds Banking Group Plc, 6,625 %, fällig 02.06.2033 *		
<b>Spanien – 2,10 % (28. Februar 2023: 2,08 %)</b>			340 Lloyds Banking Group Plc, 5,125 %, unbefristet *		
800	652	1,45	350 Logisor 2019-1 UK Plc, 1,875 %, fällig 17.11.2026		
100	95	0,21	180 London Stock Exchange Group Plc, 1,625 %, fällig 06.04.2030		
200	195	0,44	177 Manchester Airport Group Funding Plc, 4,125 %, fällig 02.04.2024		
	942	2,10	240 Manchester Airport Group Funding Plc, 4,750 %, fällig 31.03.2034		
<b>Supranational – 3,15 % (28. Februar 2023: 3,11 %)</b>			160 Manchester Airport Group Funding Plc, 2,875 %, fällig 30.09.2044		
810	765	1,70	185 Marston's Issuer Plc, Serie A3, 5,177 %, fällig 15.07.2032 *		
680	649	1,45	108 Marston's Issuer Plc, Serie B1, 7,819 %, fällig 16.07.2035 *		
	1.414	3,15	85 Mitchells & Butlers Finance Plc, Serie B2, 6,013 %, fällig 15.12.2028		
			78		

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) GBP	% des Nettoinven- tarwerts	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) GBP	% des Nettoinven- tarwerts
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>Vereinigtes Königreich – (Fortsetzung)</b>					
360			590		
Motability Operations Group Plc, Serie EMtN, 4,875 %, fällig 17.01.2043	336	0,75	110	458	1,02
310			26	88	0,20
National Gas Transmission Plc, 1,375 %, fällig 07.02.2031	225	0,50	410	26	0,06
100			650	369	0,82
National Gas Transmission Plc, 5,750 %, fällig 05.04.2035	97	0,22	556	556	1,24
275				8.115	18,07
National Grid Electricity Distribution East Midlands Plc, 6,250 %, fällig 10.12.2040	283	0,63	<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 49.272 GBP)</b>		
250				41.509	92,45
National Grid Electricity Transmission Plc, 2,000 %, fällig 17.04.2040	149	0,33	<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 3,42 % (28. Februar 2023: 1,62 %)</b>		
100			<b>Vereinigtes Königreich – 3,38 % (28. Februar 2023: 0,87 %)</b>		
Nationwide Building Society, 3,000 %, fällig 06.05.2026	93	0,21	210	193	0,43
150			230	202	0,45
Bundesweite Bausparkasse, 6,178 %, fällig 07.12.2027 *	148	0,33	270	267	0,59
206			160	133	0,30
Nationwide Building Society, 3,250 %, fällig 20.01.2028	186	0,41	140	122	0,27
230			220	178	0,40
NatWest Group Plc, 3,125 %, fällig 28.03.2027 *	211	0,47	190	182	0,40
270			620	243	0,54
NatWest Group Plc, 3,619 %, fällig 29.03.2029 *	238	0,53		1.520	3,38
190			<b>USA – 0,04 % (28. Februar 2023: 0,75 %)</b>		
NatWest Group Plc, 2,105 %, fällig 28.11.2031 *	161	0,36	USD	30	0,04
190			<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 1.589 GBP)</b>		
NatWest Markets Plc, 6,375 %, fällig 08.11.2027	191	0,42		1.537	3,42
180			<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 50.861£)</b>		
Northern Gas Networks Finance Plc, 6,125 %, fällig 02.06.2033	181	0,40	<b>Devisenterminkontrakte – 0,02 % (28. Februar 2023: 0,06 %)</b>		
110			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
Northern Powergrid Northeast Plc, 3,250 %, fällig 01.04.2052	74	0,17	<b>Futures – 0,20 % (28. Februar 2023: 0,10 %)</b>		
200			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
Notting Hill Genesis, 2,875 %, fällig 31.01.2029	104	0,23	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
140			43.144		
Onward Homes Ltd, 2,125 %, fällig 25.03.2053	70	0,16	<b>Devisenterminkontrakte – -0,03 % (28. Februar 2023: -0,02 %)</b>		
240			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
Paragon Treasury Plc, 2,000 %, fällig 07.05.2036	157	0,35	<b>Futures – -0,05 % (28. Februar 2023: -0,07 %)</b>		
170			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
Rentokil Initial Plc, 5,000 %, fällig 27.06.2032	160	0,36	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>		
190			-35		
Sanctuary Capital Plc, 2,375 %, fällig 14.04.2050	107	0,24	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
440			43.109		
Santander UK Group Holdings Plc, 2,920 %, fällig 08.05.2026 *	411	0,92	<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>		
170			1.792		
Santander UK Plc, 5,750 %, fällig 02.03.2026	171	0,38	<b>Gesamtvermögen</b>		
198			44.901£		
Scottish Widows Ltd, 7,000 %, fällig 16.06.2043	193	0,43	100,00		
350					
Segro Plc, 2,875 %, fällig 11.10.2037	250	0,56			
140					
Severn Trent Utilities Finance Plc, 2,625 %, fällig 22.02.2033	108	0,24			
120					
Severn Trent Utilities Finance Plc, 4,625 %, fällig 30.11.2034	108	0,24			
180					
Severn Trent Utilities Finance Plc, 2,000 %, fällig 02.06.2040	105	0,23			
191					
Southern Gas Networks Plc, 2,500 %, fällig 03.02.2025	182	0,41			
430					
Tesco Corporate Treasury Services Plc, 1,875 %, fällig 02.11.2028	354	0,79			
170					
Tesco Corporate Treasury Services Plc, 5,500 %, fällig 27.02.2035	159	0,35			
199					
Tesco Property Finance 3 Plc, 5,744 %, fällig 13.04.2040	186	0,41			
324					
Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, fällig 13.07.2044	292	0,65			
190					
UNITE Group Plc/The, 3,500 %, fällig 15.10.2028	166	0,37			
250					
UNITE USAF II Plc, 3,921 %, fällig 30.06.2025	238	0,53			
140					
United Utilities Water Finance Plc, 5,125 %, fällig 06.10.2038	129	0,29			
170					
Universität Oxford, 2,544 %, fällig 08.12.2117	86	0,19			
210					
Vodafone Group Plc, 5,125 %, fällig 02.12.2052	178	0,40			
110					
Weir Group Plc/The, 6,875 %, fällig 14.06.2028	111	0,25			
160					
Wellcome Trust Ltd/The, 2,517 %, fällig 07.02.2118	81	0,18			
470					
Whitbread Group Plc, 2,375 %, fällig 31.05.2027	403	0,90			
180					
Yorkshire Building Society, 3,500 %, fällig 21.04.2026	169	0,38			
140					
Yorkshire Building Society, 3,511 %, fällig 11.10.2030 *	117	0,26			
	18.317	40,79			
<b>USA – 18,07 % (28. Februar 2023: 18,87 %)</b>					
USD					
100			100	60	0,13
Apache Corp, 4,750 %, fällig 15.04.2043	60	0,13	383	290	0,65
383			450	348	0,78
AT&T Inc, 4,250 %, fällig 01.06.2043	290	0,65	360	310	0,69
USD			180	172	0,38
Bank of America Corp, 4,948 %, fällig 22.07.2028 *	348	0,78	260	150	0,33
360			329	380	0,85
Bank of America Corp, 3,584 %, fällig 27.04.2031 *	310	0,69	170	140	0,31
180			60	39	0,09
Becton Dickinson & Co, 3,020 %, fällig 24.05.2025	172	0,38	220	198	0,44
260			170	144	0,32
Berkshire Hathaway Finance Corp, 2,625 %, fällig 19.06.2059	150	0,33	240	237	0,53
329			400	371	0,83
Citigroup Inc, 7,375 %, fällig 01.09.2039	380	0,85	309	314	0,70
170			280	240	0,54
Comcast Corp, 1,500 %, fällig 20.02.2029	140	0,31	110	110	0,24
USD			210	161	0,36
CVS Health Corp, 4,125 %, fällig 01.04.2040	39	0,09	110	110	0,24
220			110	161	0,36
Experian Finance Plc, 0,739 %, fällig 29.10.2025	198	0,44	310	236	0,52
170			100	80	0,18
Experian Finance Plc, 3,250 %, fällig 07.04.2032	144	0,32	180	145	0,32
240			92	91	0,20
GE Capital UK Funding Unlimited Co, 5,875 %, fällig 18.01.2033	237	0,53	230	222	0,49
400			120	104	0,23
General Motors Financial Co Inc, 2,350 %, fällig 03.09.2025	371	0,83	320	242	0,54
309			250	243	0,54
Goldman Sachs Group Inc/The, 7,125 %, fällig 07.08.2025	314	0,70	280	237	0,53
280			290	281	0,63
Goldman Sachs Group Inc/The, 3,125 %, fällig 25.07.2029	240	0,54	210	212	0,47
110			210	189	0,42
Goldman Sachs Group Inc/The, 6,875 %, fällig 18.01.2038	110	0,24	100	87	0,19
210			190	165	0,37
Haleon UK Capital Plc, 3,375 %, fällig 29.03.2038	161	0,36	265	247	0,55
USD			200	173	0,38
JPMorgan Chase & Co, 4,912 %, fällig 25.07.2033 *	236	0,52			
100					
McDonald's Corp, 2,950 %, fällig 15.03.2034	80	0,18			
180					
McDonald's Corp, Serie gmtn, 3,750 %, fällig 31.05.2038	145	0,32			
92					
MetLife Inc, 5,375 %, fällig 09.12.2024	91	0,20			
230					
Metropolitan Life Global Funding I, 5,000 %, fällig 10.01.2030	222	0,49			
120					
Mondelez International Inc, 4,500 %, fällig 03.12.2035	104	0,23			
USD					
320					
Morgan Stanley, 4,210 %, fällig 20.04.2028 *	242	0,54			
250					
Morgan Stanley, 5,789 %, fällig 18.11.2033 *	243	0,54			
EUR					
280					
Netflix Inc, 3,875 %, fällig 15.11.2029	237	0,53			
290					
New York Life Global Funding, 4,350 %, fällig 16.09.2025	281	0,63			
290					
Omnicom Capital Holdings Plc, 2,250 %, fällig 22.11.2033	212	0,47			
210					
PepsiCo Inc, 3,200 %, fällig 22.07.2029	189	0,42			
100					
PepsiCo Inc, 3,550 %, fällig 22.07.2034	87	0,19			
190					
Realty Income Corp, 1,875 %, fällig 14.01.2027	165	0,37			
265					
Time Warner Cable LLC, 5,750 %, fällig 02.06.2031	247	0,55			
200					
Toyota Motor Credit Corp, 0,750 %, fällig 19.11.2026	173	0,38			

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
16. Nov. 2023	Citi	Kauf	GBP	99	Verkauf	JPY	17.754	£ 2
16. Nov. 2023	Citi	Kauf	GBP	62	Verkauf	USD	80	–
16. Nov. 2023	Goldman Sachs	Kauf	GBP	1.195	Verkauf	USD	1.525	-9
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	GBP	204	Verkauf	USD	260	-2
16. Nov. 2023	UBS	Kauf	GBP	831	Verkauf	EUR	960	6
16. Nov. 2023	UBS	Kauf	GBP	24	Verkauf	USD	30	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 27£)								£ 8
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): £-7)								-11
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 20£)								£ -3

## Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bund Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	10	£	1.135	£ 11
Japanische 10-jährige Anleihe (OSE) September 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-2		-1.593	12
Long Gilt Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	19		1.816	33
US-10-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-23		-2.016	-17
US-5-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	44		3.714	22
US Long Bond (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	7		672	12
US Ultra Bond (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-3		-306	-7
Nicht realisierte Wertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): 45£)					£ 90
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): £-29)					-24
Nettowertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): 16£)					£ 66

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere – 0,70 % (28. Februar 2023: 0,19 %)</b>			<b>Deutschland – 1,52 % (28. Februar 2023: 0,89 %)</b>		
175 SMB Private Education Loan Trust 2020-A, Serie 2020 A, Klasse A2A, 144A, 2,230 %, fällig 15.09.2037	161	0,29	20 Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750 %, fällig 15.06.2030	24	0,04
230 Texas Natural Gas Securitization Finance Corp, Serie 2023 1, Klasse A1, 5,102 %, fällig 01.04.2035	229	0,41	840 ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750 %, fällig 29.04.2025	818	1,48
				842	1,52
<b>Gesamtbetrag der forderungsbesicherten Wertpapiere (Anschaffungskosten 410 USD)</b>	<b>390</b>	<b>0,70</b>	<b>Irland – 0,62 % (28. Februar 2023: 1,18 %)</b>		
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 102,56 % (28. Februar 2023: 96,16 %)</b>			<b>150 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,500 %, fällig 15.09.2023</b>		
<b>Australien – 0,35 % (28. Februar 2023: 0,59 %)</b>			<b>180 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,850 %, fällig 29.10.2041</b>		
60 CSL Finance Plc, 144A, 4,050 %, fällig 27.04.2029	57	0,10	<b>60 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 5,125 %, fällig 01.10.2023</b>		
40 Westpac Banking Corp, 2,668 %, fällig 15.11.2035 *	31	0,06			
60 Westpac Banking Corp, 3,020 %, fällig 18.11.2036 *	46	0,08			
90 Westpac Banking Corp, 3,133 %, fällig 18.11.2041	58	0,11			
	192	0,35	<b>Israel – 0,10 % (28. Februar 2023: 0,15 %)</b>		
<b>Belgien – 0,40 % (28. Februar 2023: 0,22 %)</b>			<b>60 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026</b>		
240 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, fällig 15.04.2048	214	0,38			
10 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, fällig 23.01.2049	10	0,02	<b>Italien – 1,64 % (28. Februar 2023: 1,76 %)</b>		
	224	0,40	<b>240 Enel Finance International NV, 144A, 6,800 %, fällig 14.10.2025</b>		
<b>Bermudas – 0,55 % (28. Februar 2023: 0,49 %)</b>			<b>260 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, fällig 26.06.2024</b>		
290 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, fällig 15.10.2025	275	0,50	<b>200 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 7,000 %, fällig 21.11.2025</b>		
30 RenaissanceRe Holdings Ltd, 5,750 %, fällig 05.06.2033	29	0,05	<b>310 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,950 %, fällig 01.06.2042 *</b>		
	304	0,55			
<b>Brazilien – 0,13 % (28. Februar 2023: 0,16 %)</b>			<b>Japan – 1,32 % (28. Februar 2023: 1,86 %)</b>		
90 Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125 %, fällig 15.01.2032	71	0,13	<b>550 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,043 %, fällig 15.09.2023</b>		
<b>Kanada – 2,79 % (28. Februar 2023: 2,80 %)</b>			<b>200 NTT Finance Corp, 144A, 1,162 %, fällig 03.04.2026</b>		
59 Air Canada 2015-2 Klasse B Pass Through Trust, 144A, 5,000 %, fällig 15.12.2023	59	0,11			
100 Bank of Nova Scotia/The, 3,450 %, fällig 11.04.2025	97	0,17	<b>Kasachstan – 0,27 % (28. Februar 2023: 0,16 %)</b>		
20 Bank of Nova Scotia/The, 4,588 %, fällig 04.05.2037 *	17	0,03	<b>200 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 3,500 %, fällig 14.04.2033</b>		
200 Bank of Nova Scotia/The, 8,625 %, fällig 27.10.2082 *	203	0,37			
80 Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, fällig 30.05.2041	79	0,14	<b>Luxemburg – 0,17 % (28. Februar 2023: 0,15 %)</b>		
70 Canadian Pacific Railway Co, 3,100 %, fällig 02.12.2051	47	0,08	<b>60 ArcelorMittal SA, 6,550 %, fällig 29.11.2027</b>		
320 CI Financial Corp, 3,200 %, fällig 17.12.2030	246	0,44	<b>30 ArcelorMittal SA, 7,000 %, fällig 15.10.2039</b>		
60 Element Fleet Management Corp, 144A, 1,600 %, fällig 06.04.2024	58	0,11			
40 GFL Environmental Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.12.2026	39	0,07	<b>Macau – 2,35 % (28. Februar 2023: 2,59 %)</b>		
30 MEG Energy Corp, 144A, 7,125 %, fällig 01.02.2027	30	0,06	<b>200 Sands China Ltd, 4,300 %, fällig 08.01.2026</b>		
300 Royal Bank of Canada, 1,150 %, fällig 14.07.2026	267	0,48	<b>200 Sands China Ltd, 5,650 %, fällig 08.08.2028</b>		
30 Teck Resources Ltd, 3,900 %, fällig 15.07.2030	27	0,05	<b>270 Sands China Ltd, 3,100 %, fällig 08.03.2029</b>		
120 Teck Resources Ltd, 6,250 %, fällig 15.07.2041	116	0,21	<b>200 Sands China Ltd, 4,875 %, fällig 18.06.2030</b>		
20 TransAlta Corp, 6,500 %, fällig 15.03.2040	19	0,03	<b>200 Sands China Ltd, 4,875 %, fällig 18.06.2030</b>		
140 Yamana Gold Inc, 4,625 %, fällig 15.12.2027	132	0,24	<b>350 Wynn Macau Ltd, 144A, 4,875 %, fällig 01.10.2024</b>		
140 Yamana Gold Inc, 2,630 %, fällig 15.08.2031	110	0,20			
	1.546	2,79			
<b>China – 1,00 % (28. Februar 2023: 0,77 %)</b>			<b>Mexiko – 0,68 % (28. Februar 2023: 0,62 %)</b>		
240 Alibaba Group Holding Ltd, 3,150 %, fällig 09.02.2051	144	0,26	<b>200 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 8,375 %, unbefristet *</b>		
240 BOC Aviation USA Corp, 144A, 1,625 %, fällig 29.04.2024	233	0,42	<b>220 Fresnillo Plc, 144A, 4,250 %, fällig 02.10.2050</b>		
260 Tencent Holdings Ltd, 144A, 3,840 %, fällig 22.04.2051	176	0,32	<b>20 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042</b>		
	553	1,00			
<b>Dänemark – 2,08 % (28. Februar 2023: 1,82 %)</b>			<b>Niederlande – 1,22 % (28. Februar 2023: 1,13 %)</b>		
200 Danske Bank A/S, 144A, 0,976 %, fällig 10.09.2025 *	189	0,34	<b>250 Cooperatieve Rabobank UA, 4,375 %, fällig 04.08.2025</b>		
200 Danske Bank A/S, 144A, 3,244 %, fällig 20.12.2025 *	191	0,35	<b>440 Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 3,758 %, fällig 06.04.2033 *</b>		
200 Danske Bank A/S, 144A, 6,466 %, fällig 09.01.2026 *	200	0,36	<b>50 Shell International Finance BV, 4,375 %, fällig 11.05.2045</b>		
200 Danske Bank A/S, 144A, 1,549 %, fällig 10.09.2027 *	176	0,32	<b>20 Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06.04.2050</b>		
420 Danske Bank A/S, 144A, 4,298 %, fällig 01.04.2028 *	395	0,71			
	1.151	2,08			
<b>Frankreich – 6,58 % (28. Februar 2023: 4,69 %)</b>			<b>Südafrika – 1,12 % (28. Februar 2023: 0,44 %)</b>		
200 BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, fällig 09.06.2026 *	187	0,34	<b>200 Anglo American Capital Plc, 144A, 3,625 %, fällig 11.09.2024</b>		
370 BNP Paribas SA, 144A, 1,675 %, fällig 30.06.2027 *	330	0,60	<b>240 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,500 %, fällig 15.03.2028</b>		
340 BNP Paribas SA, 144A, 2,159 %, fällig 15.09.2029 *	284	0,51	<b>200 Sasol Financing USA LLC, 144A, 8,750 %, fällig 03.05.2029</b>		
200 BNP Paribas SA, 144A, 8,500 %, unbefristet *	200	0,36			
520 BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, unbefristet *	504	0,91	<b>Spanien – 1,01 % (28. Februar 2023: 0,56 %)</b>		
200 BNP Paribas SA, 144A, 9,250 %, unbefristet *	206	0,37	<b>200 Banco Santander SA, 1,722 %, fällig 14.09.2027 *</b>		
200 BPCE SA, 144A, 5,700 %, fällig 22.10.2023	199	0,36	<b>200 Banco Santander SA, 4,175 %, fällig 24.03.2028 *</b>		
370 BPCE SA, 144A, 3,116 %, fällig 19.10.2032 *	285	0,52	<b>200 Banco Santander SA, 6,921 %, fällig 08.08.2033</b>		
250 Credit Agricole SA, 144A, 5,589 %, fällig 05.07.2026	250	0,45			
250 Credit Agricole SA, 144A, 5,514 %, fällig 05.07.2033	247	0,45	<b>Supranational – 0,33 % (28. Februar 2023: 0,19 %)</b>		
400 Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, unbefristet *	400	0,72	<b>200 African Export-Import Bank/The, 144A, 2,634 %, fällig 17.05.2026</b>		
430 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 3,750 %, fällig 17.09.2024	410	0,74			
200 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 4,750 %, fällig 17.09.2044	135	0,25	<b>Schweden – 0,44 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
	3.637	6,58	<b>250 Svenska Handelsbanken AB, 144A, 3,650 %, fällig 10.06.2025</b>		
			<b>Schweiz – 1,61 % (28. Februar 2023: 5,06 %)</b>		
			<b>300 UBS Group AG, 144A, 4,751 %, fällig 12.05.2028 *</b>		
			<b>250 UBS Group AG, 144A, 9,016 %, fällig 15.11.2033 *</b>		
			<b>200 UBS Group AG, 144A, 3,179 %, fällig 11.02.2043 *</b>		
			<b>200 UBS Group AG, 144A, 4,875 %, unbefristet *</b>		
			<b>893</b>		
			<b>1,61</b>		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>Taiwan – 0,42 % (28. Februar 2023: 0,41 %)</b>					
280 TSMC Arizona Corp, 2,500 %, fällig 25.10.2031	232	0,42			
<b>Vereinigte Arabische Emirate – 0,50 % (28. Februar 2023: 0,29 %)</b>					
290 DAE Funding LLC, 144A, 1,550 %, fällig 01.08.2024	276	0,50			
<b>Vereinigtes Königreich – 2,66 % (28. Februar 2023: 2,38 %)</b>					
60 British Airways 2019-1 Klasse A Pass Through Trust, 144A, 3,350 %, fällig 15.06.2029	54	0,10	10 Bank of New York Mellon Corp/The, 4,706 %, fällig 01.02.2034 *	9	0,02
30 British Telecommunications Plc, 9,625 %, fällig 15.12.2030	36	0,07	100 Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	96	0,17
210 HSBC Holdings Plc, 1,589 %, fällig 24.05.2027 *	187	0,34	170 Blackstone Holdings Finance Co LLC, 144A, 6,200 %, fällig 22.04.2033	174	0,31
60 HSBC Holdings Plc, 7,625 %, fällig 17.05.2032	64	0,12	90 Blackstone Holdings Finance Co LLC, 144A, 3,200 %, fällig 30.01.2052	57	0,10
200 HSBC Holdings Plc, 6,254 %, fällig 09.03.2034 *	202	0,36	90 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, fällig 15.12.2025	90	0,16
200 Lloyds Banking Group Plc, 3,511 %, fällig 18.03.2026 *	192	0,35	80 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15.07.2026	79	0,14
200 Lloyds Banking Group Plc, 4,375 %, fällig 22.03.2028	189	0,34	50 Bon Secours Mercy Health Inc, 3,464 %, fällig 01.06.2030	45	0,08
210 Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, unbefristet *	191	0,34	50 BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, fällig 24.02.2050	33	0,06
340 NatWest Group Plc, 3,754 %, fällig 01.11.2029 *	324	0,59	80 Bristol-Myers Squibb Co, 2,350 %, fällig 13.11.2040	53	0,10
30 Vodafone Group Plc, 6,150 %, fällig 27.02.2037	30	0,05	30 Bristol-Myers Squibb Co, 4,250 %, fällig 26.10.2049	25	0,05
	1.469	2,66	144 Broadcom Inc, 144A, 3,187 %, fällig 15.11.2036	107	0,19
			50 Burlington Northern Santa Fe LLC, 4,400 %, fällig 15.03.2042	44	0,08
<b>USA – 70,33 % (28. Februar 2023: 63,41 %)</b>					
310 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21.11.2029	279	0,50	60 California Institute of Technology, 3,650 %, fällig 01.09.2119	38	0,07
200 AbbVie Inc, 4,550 %, fällig 15.03.2035	19	0,03	20 Cameron LNG LLC, 144A, 3,701 %, fällig 15.01.2039	16	0,03
210 AbbVie Inc, 4,050 %, fällig 21.11.2039	178	0,32	50 Carlyle Finance LLC, 144A, 5,650 %, fällig 15.09.2048	43	0,08
60 AbbVie Inc, 4,250 %, fällig 21.11.2049	50	0,09	120 Centene Corp, 3,000 %, fällig 15.10.2030	100	0,18
70 Air Lease Corp, 1,875 %, fällig 15.08.2026	63	0,11	50 CenterPoint Energy Houston Electric LLC, 4,950 %, fällig 01.04.2033	49	0,09
240 Air Lease Corp, 5,850 %, fällig 15.12.2027	240	0,43	90 Charles Schwab Corp/The, 5,643 %, fällig 19.05.2029 *	90	0,16
252 Alaska Airlines 2020-1 Klasse A Pass Through Trust, 144A, 4,800 %, fällig 15.08.2027	244	0,44	70 Charles Schwab Corp/The, 5,853 %, fällig 19.05.2034 *	70	0,13
200 Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 5,500 %, fällig 15.12.2027	194	0,35	130 Charles Schwab Corp/The, 6,136 %, fällig 24.08.2034 *	131	0,24
90 Alexandria Real Estate Equities Inc, 2,000 %, fällig 18.05.2032	68	0,12	160 Charles Schwab Corp/The, Serie H, 4,000 %, unbefristet *	120	0,22
110 Alexandria Real Estate Equities Inc, 3,000 %, fällig 18.05.2051	66	0,12	110 Charles Schwab Corp/The, Serie G, 5,375 %, unbefristet *	107	0,19
40 Amazon.com Inc, 2,100 %, fällig 12.05.2031	33	0,06	50 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	46	0,08
60 Amazon.com Inc, 3,600 %, fällig 13.04.2032	55	0,10	60 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 2,250 %, fällig 15.01.2029	50	0,09
50 Amazon.com Inc, 3,875 %, fällig 22.08.2037	45	0,08	190 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01.06.2041	124	0,22
40 Amazon.com Inc, 3,100 %, fällig 12.05.2051	28	0,05	40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01.03.2042	26	0,05
50 Amazon.com Inc, 3,950 %, fällig 13.04.2052	41	0,07	80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,850 %, fällig 01.04.2061	47	0,09
12 American Airlines 2015-1 Klasse A Pass Through Trust, 3,375 %, fällig 01.05.2027	11	0,02	20 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,950 %, fällig 30.06.2062	12	0,02
145 American Airlines 2017-1 Klasse B Pass Through Trust, Serie B, 4,950 %, fällig 15.02.2025	140	0,25	200 Chesapeake Energy Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.02.2026	196	0,35
240 American Airlines Inc, 144A, 11,750 %, fällig 15.07.2025	263	0,48	90 Chesapeake Energy Corp, 144A, 6,750 %, fällig 15.04.2029	90	0,16
90 American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2028	88	0,16	30 Cigna Group/The, 4,375 %, fällig 15.10.2028	29	0,05
55 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 20.04.2026	54	0,10	160 Cigna Group/The, 2,400 %, fällig 15.03.2030	134	0,24
40 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.04.2029	38	0,07	60 Cigna Group/The, 3,200 %, fällig 15.03.2040	44	0,08
130 American Express Co, 4,050 %, fällig 03.05.2029	123	0,22	50 Cimarex Energy Co, 4,375 %, fällig 15.03.2029	121	0,22
70 American Express Co, 3,550 %, unbefristet *	58	0,11	480 Citigroup Inc, 0,981 %, fällig 01.05.2025 *	464	0,84
60 American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, fällig 15.01.2032	49	0,09	50 Citigroup Inc, 3,980 %, fällig 20.03.2030 *	46	0,08
60 Americo Life Inc, 144A, 3,450 %, fällig 15.04.2031	44	0,08	230 Citigroup Inc, 2,976 %, fällig 05.11.2030 *	197	0,36
150 Ameriprise Financial Inc, 5,150 %, fällig 15.05.2033	146	0,26	150 Citigroup Inc, 2,561 %, fällig 01.05.2032 *	120	0,22
60 AmFam Holdings Inc, 144A, 2,805 %, fällig 11.03.2031	45	0,08	190 Citigroup Inc, 3,785 %, fällig 17.03.2033 *	164	0,30
90 AmFam Holdings Inc, 144A, 3,833 %, fällig 11.03.2051	53	0,10	50 Citigroup Inc, 6,174 %, fällig 25.05.2034 *	50	0,09
30 Amgen Inc, 4,400 %, fällig 01.05.2045	25	0,05	160 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	198	0,36
50 Amgen Inc, 4,663 %, fällig 15.06.2051	43	0,08	30 Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 23.07.2048	26	0,05
40 Amgen Inc, 5,650 %, fällig 02.03.2053	39	0,07	50 Clorox Co/The, 1,800 %, fällig 15.05.2030	40	0,07
20 Amgen Inc, 5,750 %, fällig 02.03.2063	19	0,04	30 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 01.06.2040	21	0,04
70 Apple Inc, 2,650 %, fällig 11.05.2050	46	0,08	20 Columbia Pipelines Holding Co LLC, 144A, 6,055 %, fällig 15.08.2026	20	0,04
500 AT&T Inc, 6,950 %, fällig 15.01.2028	505	0,91	80 Columbia Pipelines Holding Co LLC, 144A, 6,042 %, fällig 15.08.2028	81	0,15
80 AT&T Inc, 4,300 %, fällig 15.02.2030	74	0,13	90 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,036 %, fällig 15.11.2033	90	0,16
100 AT&T Inc, 2,550 %, fällig 01.12.2033	76	0,14	40 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,544 %, fällig 15.11.2053	40	0,07
100 AT&T Inc, 4,500 %, fällig 15.05.2035	88	0,16	10 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,714 %, fällig 15.08.2063	10	0,02
50 AT&T Inc, 6,375 %, fällig 01.03.2041	51	0,09	80 Comcast Corp, 4,250 %, fällig 15.10.2030	76	0,14
63 AT&T Inc, 3,550 %, fällig 15.09.2055	40	0,07	230 Comcast Corp, 4,650 %, fällig 15.02.2033	223	0,40
100 AT&T Inc, 3,800 %, fällig 01.12.2057	66	0,12	40 Comcast Corp, 7,050 %, fällig 15.03.2033	45	0,08
50 Aviation Capital Group LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15.12.2024	49	0,09	91 Comcast Corp, 6,500 %, fällig 15.11.2035	100	0,18
550 Bank of America Corp, 0,981 %, fällig 25.09.2025 *	521	0,94	30 Comcast Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2040	24	0,04
50 Bank of America Corp, 4,376 %, fällig 27.04.2028 *	48	0,09	30 Comcast Corp, 3,969 %, fällig 01.11.2047	24	0,04
132 Bank of America Corp, 3,419 %, fällig 20.12.2028 *	121	0,22	122 Comcast Corp, 2,887 %, fällig 01.11.2051	77	0,14
70 Bank of America Corp, 3,974 %, fällig 07.02.2030 *	64	0,12	60 Comcast Corp, 4,950 %, fällig 15.10.2058	55	0,10
80 Bank of America Corp, 2,884 %, fällig 22.10.2030 *	68	0,12	50 CommonSpirit Health, 2,782 %, fällig 01.10.2030	42	0,08
200 Bank of America Corp, 2,687 %, fällig 22.04.2032 *	163	0,29	60 CommonSpirit Health, 3,910 %, fällig 01.10.2050	45	0,08
130 Bank of America Corp, 2,572 %, fällig 20.10.2032 *	104	0,19	170 ConocoPhillips Co, 5,050 %, fällig 15.09.2033	168	0,30
310 Bank of America Corp, 2,972 %, fällig 04.02.2033 *	254	0,46	70 Continental Resources Inc/OK, 144A, 2,268 %, fällig 15.11.2026	62	0,11
240 Bank of America Corp, 4,571 %, fällig 27.04.2033 *	221	0,40	140 Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, fällig 15.01.2028	131	0,24
250 Bank of America Corp, 2,482 %, fällig 21.09.2036 *	189	0,34	60 Continental Resources Inc/OK, 144A, 2,875 %, fällig 01.04.2032	46	0,08
40 Bank of America Corp, 2,676 %, fällig 19.06.2041 *	27	0,05	70 CVS Health Corp, 3,250 %, fällig 15.08.2029	62	0,11
70 Bank of America Corp, 3,311 %, fällig 22.04.2042 *	52	0,09	70 CVS Health Corp, 5,250 %, fällig 30.01.2031	69	0,12
20 Bank of America Corp, 4,443 %, fällig 20.01.2048 *	17	0,03	130 CVS Health Corp, 2,125 %, fällig 15.09.2031	102	0,18
10 Bank of America Corp, 4,330 %, fällig 15.03.2050 *	8	0,02	10 CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25.03.2038	9	0,02
30 Bank of America Corp, 2,831 %, fällig 24.10.2051 *	19	0,03			
30 Bank of New York Mellon Corp/The, 5,834 %, fällig 25.10.2033 *	31	0,06			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert		
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>							
<b>USA – (Fortsetzung)</b>							
170	CVS Health Corp, 2,700 %, fällig 21.08.2040	113	0,20	100	Humana Inc, 5,875 %, fällig 01.03.2033	103	0,19
150	CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048	130	0,24	50	Humana Inc, 4,950 %, fällig 01.10.2044	44	0,08
100	DCP Midstream Operating LP, 3,250 %, fällig 15.02.2032	83	0,15	110	Huntington Bancshares Inc/OH, 6,208 %, fällig 21.08.2029 *	110	0,20
30	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig 03.11.2036	31	0,06	190	ILFC E-Capital Trust I, 144A, 7,064 %, fällig 21.12.2065 *	138	0,25
62	Dell International LLC / EMC Corp, 8,100 %, fällig 15.07.2036	71	0,13	100	ILFC E-Capital Trust II, 144A, 7,314 %, fällig 21.12.2065 *	74	0,13
10	Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	10	0,02	40	Ingersoll Rand Inc, 5,400 %, fällig 14.08.2028	40	0,07
210	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 20.10.2025	205	0,37	110	Ingersoll Rand Inc, 5,700 %, fällig 14.08.2033	111	0,20
210	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 20.10.2028	202	0,36	60	Intel Corp, 2,800 %, fällig 12.08.2041	41	0,07
60	Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15.12.2025	60	0,11	30	Intel Corp, 4,900 %, fällig 05.08.2052	27	0,05
62	Devon Energy Corp, 5,875 %, fällig 15.06.2028	62	0,11	60	Intel Corp, 3,200 %, fällig 12.08.2061	37	0,07
114	Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig 15.01.2030	106	0,19	110	Intercontinental Exchange Inc, 4,600 %, fällig 15.03.2033	105	0,19
50	Devon Energy Corp, 7,950 %, fällig 15.04.2032	57	0,10	10	Intercontinental Exchange Inc, 4,950 %, fällig 15.06.2052	9	0,02
50	Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15.07.2041	46	0,08	33	Invitation Homes Operating Partnership LP, 4,150 %, fällig 15.04.2032	29	0,05
90	Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	76	0,14	60	Jabil Inc, 5,450 %, fällig 01.02.2029	59	0,11
260	Devon OEI Operating LLC, 7,500 %, fällig 15.09.2027	275	0,50	40	Jersey Central Power & Light Co, 144A, 4,300 %, fällig 15.01.2026	39	0,07
150	Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01.12.2029	135	0,24	20	Johnson & Johnson, 2,100 %, fällig 01.09.2040	14	0,02
60	Diamondback Energy Inc, 4,400 %, fällig 24.03.2051	46	0,08	30	Johnson & Johnson, 2,450 %, fällig 01.09.2060	18	0,03
100	Diamondback Energy Inc, 6,250 %, fällig 15.03.2053	98	0,18	150	JPMorgan Chase & Co, 2,005 %, fällig 13.03.2026 *	142	0,26
90	DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15.11.2024	84	0,15	70	JPMorgan Chase & Co, 2,739 %, fällig 15.10.2030 *	60	0,11
120	DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	93	0,17	20	JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	17	0,03
90	Duke Energy Carolinas LLC, 4,950 %, fällig 15.01.2033	88	0,16	170	JPMorgan Chase & Co, 2,956 %, fällig 13.05.2031 *	144	0,26
100	Edison International, 4,950 %, fällig 15.04.2025	98	0,18	260	JPMorgan Chase & Co, 2,580 %, fällig 22.04.2032 *	211	0,38
70	Edison International, Serie A, 5,375 %, unbefristet *	62	0,11	50	JPMorgan Chase & Co, 2,545 %, fällig 08.11.2032 *	40	0,07
130	Edison International, Serie B, 5,000 %, unbefristet *	111	0,20	170	JPMorgan Chase & Co, 4,586 %, fällig 26.04.2033 *	158	0,29
280	El Paso Natural Gas Co LLC, 7,500 %, fällig 15.11.2026	297	0,54	80	JPMorgan Chase & Co, 4,260 %, fällig 22.02.2048 *	66	0,12
20	Elevance Health Inc, 4,100 %, fällig 15.05.2032	18	0,03	50	JPMorgan Chase & Co, 3,897 %, fällig 23.01.2049 *	39	0,07
240	Elevance Health Inc, 5,500 %, fällig 15.10.2032	243	0,44	10	JPMorgan Chase & Co, 3,328 %, fällig 22.04.2052 *	7	0,01
50	Elevance Health Inc, 4,375 %, fällig 01.12.2047	42	0,08	90	JPMorgan Chase & Co, Serie KK, 3,650 %, unbefristet *	80	0,15
30	Eli Lilly & Co, 4,950 %, fällig 27.02.2063	29	0,05	60	Kaiser Foundation Hospitals, Reihe 2021, 2,810 %, fällig 01.06.2041	42	0,08
40	Endeavour Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 5,750 %, fällig 30.01.2028	39	0,07	70	Kaiser Foundation Hospitals, Reihe 2019, 3,266 %, fällig 01.11.2049	50	0,09
50	Enterprise Products Operating LLC, Serie D, 6,875 %, fällig 01.03.2033	55	0,10	20	Kaiser Foundation Hospitals, Reihe 2021, 3,002 %, fällig 01.06.2051	13	0,02
190	Enterprise Products Operating LLC, 4,250 %, fällig 15.02.2048	153	0,28	30	Kenvue Inc, 144A, 5,050 %, fällig 22.03.2053	29	0,05
80	Enterprise Products Operating LLC, 3,300 %, fällig 15.02.2053	54	0,10	30	Kenvue Inc, 144A, 5,200 %, fällig 22.03.2063	29	0,05
50	Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, fällig 31.01.2060	36	0,07	110	Kimco Realty OP LLC, 2,250 %, fällig 01.12.2031	85	0,15
230	Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15.02.2078 *	191	0,35	20	Kinder Morgan Energy Partners LP, 7,300 %, fällig 15.08.2033	22	0,04
90	EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	87	0,16	40	Kinder Morgan Inc, 5,300 %, fällig 01.12.2034	38	0,07
60	EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500 %, fällig 01.06.2027	61	0,11	30	Kinder Morgan Inc, 5,200 %, fällig 01.03.2048	26	0,05
66	EQT Corp, 6,125 %, fällig 01.02.2025	66	0,12	70	KKR Group Finance Co III LLC, 144A, 5,125 %, fällig 01.06.2044	60	0,11
30	EQT Corp, 144A, 3,125 %, fällig 15.05.2026	28	0,05	60	KLA Corp, 4,650 %, fällig 15.07.2032	59	0,11
60	EQT Corp, 3,900 %, fällig 01.10.2027	56	0,10	20	KLA Corp, 4,950 %, fällig 15.07.2052	19	0,03
20	EQT Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15.05.2031	17	0,03	160	Kyndryl Holdings Inc, 3,150 %, fällig 15.10.2031	124	0,22
30	Equifax Inc, 2,350 %, fällig 15.09.2031	23	0,04	110	Kyndryl Holdings Inc, 4,100 %, fällig 15.10.2041	75	0,14
30	Extra Space Storage LP, 3,900 %, fällig 01.04.2029	27	0,05	50	Lam Research Corp, 1,900 %, fällig 15.06.2030	41	0,07
20	Exxon Mobil Corp, 2,995 %, fällig 16.08.2039	15	0,03	40	Lennox International Inc, 1,700 %, fällig 01.08.2027	35	0,06
100	Fifth Third Bancorp, 6,339 %, fällig 27.07.2029 *	101	0,18	30	Lithia Motors Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.12.2027	28	0,05
30	FirstEnergy Corp, Serie C, 5,100 %, fällig 15.07.2047	26	0,05	50	Lowes's Cos Inc, 2,800 %, fällig 15.09.2041	34	0,06
260	Florida Gas Transmission Co LLC, 144A, 2,300 %, fällig 01.10.2031	203	0,37	60	Lowes's Cos Inc, 3,000 %, fällig 15.10.2050	38	0,07
20	Ford Motor Co, 4,750 %, fällig 15.01.2043	15	0,03	80	Mars Inc, 144A, 2,375 %, fällig 16.07.2040	53	0,10
200	Ford Motor Credit Co LLC, 2,300 %, fällig 10.02.2025	188	0,34	110	Marsh & McLennan Cos Inc, 2,375 %, fällig 15.12.2031	89	0,16
200	Ford Motor Credit Co LLC, 6,950 %, fällig 06.03.2026	201	0,36	30	Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 3,375 %, fällig 15.04.2050	20	0,04
300	Ford Motor Credit Co LLC, 2,700 %, fällig 10.08.2026	269	0,49	100	Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 4,900 %, fällig 01.04.2077	81	0,15
120	Freeport-McMoRan Inc, 4,550 %, fällig 14.11.2024	118	0,21	60	Mastercard Inc, 3,350 %, fällig 26.03.2030	55	0,10
200	Freeport-McMoRan Inc, 5,400 %, fällig 14.11.2034	189	0,34	30	Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26.03.2050	24	0,04
EUR	40 GE Capital European Funding Unlimited Co, 6,025 %, fällig 01.03.2038	51	0,09	50	McDonald's Corp, 4,450 %, fällig 01.03.2047	43	0,08
GBP	20 GE Capital UK Funding Unlimited Co, 8,000 %, fällig 14.01.2039	29	0,05	30	McDonald's Corp, 4,450 %, fällig 01.09.2048	26	0,05
300	General Electric Co, 6,750 %, fällig 15.03.2032	333	0,60	100	McKesson Corp, 4,900 %, fällig 15.07.2028	99	0,18
170	General Motors Co, 6,125 %, fällig 01.10.2025	171	0,31	80	MDC Holdings Inc, 2,500 %, fällig 15.01.2031	62	0,11
40	General Motors Co, 5,600 %, fällig 15.10.2032	38	0,07	30	MDC Holdings Inc, 6,000 %, fällig 15.01.2043	26	0,05
60	General Motors Co, 6,600 %, fällig 01.04.2036	60	0,11	40	Merck & Co Inc, 2,350 %, fällig 24.06.2040	28	0,05
40	General Motors Co, 5,950 %, fällig 01.04.2049	35	0,06	110	Metropolitan Edison Co, 144A, 5,200 %, fällig 01.04.2028	108	0,20
630	Genting New York LLC / GENNY Capital Inc, 144A, 3,300 %, fällig 15.02.2026	562	1,02	240	Metropolitan Life Global Funding I, 144A, 5,150 %, fällig 28.03.2033	233	0,42
40	Gilead Sciences Inc, 4,000 %, fällig 01.09.2036	35	0,06	110	Micron Technology Inc, 2,703 %, fällig 15.04.2032	86	0,16
630	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, fällig 12.02.2026 *	585	1,06	40	Micron Technology Inc, 5,875 %, fällig 09.02.2033	39	0,07
280	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 16.11.2026	263	0,48	44	Microsoft Corp, 3,450 %, fällig 08.08.2036	39	0,07
350	Goldman Sachs Group Inc/The, Serie VAR, 1,093 %, fällig 09.12.2026 *	314	0,57	39	Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17.03.2052	27	0,05
130	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,615 %, fällig 15.03.2028 *	121	0,22	184	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	183	0,33
70	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,800 %, fällig 15.03.2030	63	0,11	20	Molson Coors Beverage Co, 3,000 %, fällig 15.07.2026	19	0,03
150	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,650 %, fällig 21.10.2032 *	120	0,22	30	Molson Coors Beverage Co, 4,200 %, fällig 15.07.2046	23	0,04
30	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	27	0,05	20	Mondelez International Inc, 2,625 %, fällig 04.09.2050	12	0,02
70	Goldman Sachs Group Inc/The, Serie W, 7,500 %, unbefristet *	71	0,13	570	Morgan Stanley, Serie I, 0,864 %, fällig 21.10.2025 *	536	0,97
60	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.01.2026	55	0,10	130	Morgan Stanley, 2,188 %, fällig 28.04.2026 *	123	0,22
240	HCA Inc, 5,500 %, fällig 01.06.2033	234	0,42	390	Morgan Stanley, 0,985 %, fällig 10.12.2026 *	350	0,63
40	HCA Inc, 5,125 %, fällig 15.06.2039	36	0,07	30	Morgan Stanley, 1,593 %, fällig 04.05.2027 *	27	0,05
270	HEICO Corp, 5,250 %, fällig 01.08.2028	267	0,48				

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventar	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventar
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
150 Morgan Stanley, 5,449 %, fällig 20.07.2029 *	149	0,27	80 Range Resources Corp, 8,250 %, fällig 15.01.2029	83	0,15
50 Morgan Stanley, 1,794 %, fällig 13.02.2032 *	38	0,07	50 Raymond James Financial Inc, 4,950 %, fällig 15.07.2046	43	0,08
90 Morgan Stanley, 2,239 %, fällig 21.07.2032 *	70	0,13	350 Regal Rexnord Corp, 144A, 6,050 %, fällig 15.02.2026	348	0,63
50 Morgan Stanley, 6,342 %, fällig 18.10.2033 *	52	0,09	50 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 2,875 %, fällig 15.10.2026	45	0,08
100 Morgan Stanley, 2,484 %, fällig 16.09.2036 *	75	0,14	30 S&P Global Inc, 1,250 %, fällig 15.08.2030	23	0,04
110 Morgan Stanley, 5,297 %, fällig 20.04.2037 *	102	0,18	20 S&P Global Inc, 3,250 %, fällig 01.12.2049	14	0,03
100 Morgan Stanley, 5,948 %, fällig 19.01.2038 *	97	0,18	60 Salesforce Inc, 1,500 %, fällig 15.07.2028	52	0,09
20 MPLX LP, 4,800 %, fällig 15.02.2029	19	0,03	80 San Diego Gas & Electric Co, Serie VVV, 1,700 %, fällig 01.10.2030	63	0,11
120 MPLX LP, 5,000 %, fällig 01.03.2033	112	0,20	80 San Diego Gas & Electric Co, Serie RRR, 3,750 %, fällig 01.06.2047	60	0,11
170 MPLX LP, 4,500 %, fällig 15.04.2038	143	0,26	170 SCE Recovery Funding LLC, Serie A-1, 4,697 %, fällig 15.06.2040	163	0,30
290 National General Holdings Corp, Serie 0000, 144A, 6,750 %, fällig 15.05.2024	289	0,52	90 Southern California Edison Co, 2,250 %, fällig 01.06.2030	74	0,13
60 New York Life Global Funding, 144A, 4,550 %, fällig 28.01.2033	57	0,10	90 Southern California Edison Co, Serie G, 2,500 %, fällig 01.06.2031	74	0,13
60 New York Life Insurance Co, 144A, 3,750 %, fällig 15.05.2050	44	0,08	10 Southern California Edison Co, 4,000 %, fällig 01.04.2047	8	0,01
140 Newell Brands Inc, 4,000 %, fällig 01.12.2024	136	0,25	180 Southern California Edison Co, Serie C, 4,125 %, fällig 01.03.2048	140	0,25
30 NextEra Energy Operating Partners LP, 144A, 4,250 %, fällig 15.07.2024	29	0,05	70 Southern California Edison Co, 3,650 %, fällig 01.02.2050	50	0,09
170 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 1,050 %, fällig 08.03.2024	165	0,30	40 Southwestern Energy Co, 8,375 %, fällig 15.09.2028	42	0,08
60 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 2,750 %, fällig 09.03.2028	51	0,09	150 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025	150	0,27
180 Nordstrom Inc, 2,300 %, fällig 08.04.2024	175	0,32	110 Targa Resources Corp, 5,200 %, fällig 01.07.2027	109	0,20
120 Norfolk Southern Railway Co, 7,875 %, fällig 15.05.2043	143	0,26	70 Targa Resources Corp, 4,200 %, fällig 01.02.2033	61	0,11
80 Northwest Pipeline LLC, 7,125 %, fällig 01.12.2025	82	0,15	90 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 6,875 %, fällig 15.01.2029	91	0,16
260 Northwest Pipeline LLC, 4,000 %, fällig 01.04.2027	247	0,45	70 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig 01.02.2031	64	0,12
60 Northwestern Mutual Life Insurance Co/The, 144A, 3,850 %, fällig 30.09.2047	45	0,08	120 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, fällig 15.01.2032	104	0,19
10 Northwestern Mutual Life Insurance Co/The, 144A, 3,625 %, fällig 30.09.2059	7	0,01	260 TD SYNEX Corp, 1,250 %, fällig 09.08.2024	248	0,45
90 Nuveen LLC, 144A, 4,000 %, fällig 01.11.2028	84	0,15	70 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 4,270 %, fällig 15.05.2047	56	0,10
20 NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2040	16	0,03	190 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 7,000 %, fällig 15.03.2027	198	0,36
20 NVIDIA Corp, 3,700 %, fällig 01.04.2060	16	0,03	240 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 7,000 %, fällig 15.10.2028	254	0,46
50 Occidental Petroleum Corp, 3,400 %, fällig 15.04.2026	47	0,09	20 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, fällig 01.03.2030	17	0,03
90 Occidental Petroleum Corp, 7,875 %, fällig 15.09.2031	99	0,18	40 Texas Instruments Inc, 2,250 %, fällig 04.09.2029	35	0,06
50 Occidental Petroleum Corp, 7,950 %, fällig 15.06.2039	56	0,10	120 Texas Instruments Inc, 3,875 %, fällig 15.03.2039	103	0,19
30 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.04.2046	23	0,04	144 Time Warner Cable Enterprises LLC, 8,375 %, fällig 15.07.2033	160	0,29
100 Ohio Edison Co, 144A, 5,500 %, fällig 15.01.2033	98	0,18	150 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig 01.07.2038	151	0,27
110 Ohio Edison Co, 6,875 %, fällig 15.07.2036	119	0,22	90 Time Warner Cable LLC, 6,750 %, fällig 15.06.2039	86	0,16
30 Oncor Electric Delivery Co LLC, 4,150 %, fällig 01.06.2032	28	0,05	20 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.02.2029	17	0,03
10 Oncor Electric Delivery Co LLC, 3,100 %, fällig 15.09.2049	7	0,01	110 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15.02.2031	90	0,16
190 ONEOK Inc, 6,050 %, fällig 01.09.2033	191	0,34	70 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15.11.2031	55	0,10
150 ONEOK Inc, 6,625 %, fällig 01.09.2053	150	0,27	280 T-Mobile USA Inc, 2,700 %, fällig 15.03.2032	226	0,41
160 Oracle Corp, 6,250 %, fällig 09.11.2032	166	0,30	20 T-Mobile USA Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2040	17	0,03
140 Oracle Corp, 4,000 %, fällig 15.07.2046	104	0,19	80 T-Mobile USA Inc, 3,000 %, fällig 15.02.2041	56	0,10
40 Oracle Corp, 6,900 %, fällig 09.11.2052	43	0,08	60 T-Mobile USA Inc, 3,300 %, fällig 15.02.2051	40	0,07
140 Oracle Corp, 5,550 %, fällig 06.02.2053	129	0,23	270 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,250 %, fällig 01.12.2026	277	0,50
210 Pacific Gas and Electric Co, 3,150 %, fällig 01.01.2026	196	0,35	30 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 4,450 %, fällig 01.08.2042	25	0,04
70 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, fällig 01.08.2027	60	0,11	60 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,950 %, fällig 15.05.2050	44	0,08
100 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig 01.12.2027	89	0,16	130 Truist Financial Corp, 1,267 %, fällig 02.03.2027 *	116	0,21
30 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig 01.02.2031	23	0,04	70 Truist Financial Corp, 6,047 %, fällig 08.06.2027 *	70	0,13
10 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig 01.08.2040	7	0,01	60 Truist Financial Corp, 5,867 %, fällig 08.06.2034 *	59	0,11
60 Pacific Gas and Electric Co, 4,750 %, fällig 15.02.2044	45	0,08	40 Union Pacific Corp, 2,973 %, fällig 16.09.2062	24	0,04
40 Pacific Gas and Electric Co, 4,950 %, fällig 01.07.2050	31	0,06	30 Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 05.02.2070	22	0,04
80 Pacific Gas and Electric Co, 6,700 %, fällig 01.04.2053	77	0,14	129 United Airlines 2020-1 Klasse B Pass Through Trust, 4,875 %, fällig 15.01.2026	126	0,23
170 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2028	159	0,29	230 United Airlines 2023-1 Klasse A Pass Through Trust, 5,800 %, fällig 15.01.2036	229	0,41
120 PayPal Holdings Inc, 2,300 %, fällig 01.06.2030	100	0,18	50 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15.05.2030	41	0,08
10 PayPal Holdings Inc, 4,400 %, fällig 01.06.2032	9	0,02	310 UnitedHealth Group Inc, 5,350 %, fällig 15.02.2033	316	0,57
10 PayPal Holdings Inc, 3,250 %, fällig 01.06.2050	7	0,01	90 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, fällig 15.05.2040	64	0,12
20 PayPal Holdings Inc, 5,250 %, fällig 01.06.2062	19	0,03	40 UnitedHealth Group Inc, 4,750 %, fällig 15.07.2045	37	0,07
40 Pennsylvania Electric Co, 144A, 5,150 %, fällig 30.03.2026	39	0,07	30 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15.12.2048	26	0,05
40 Pfizer Inc, 2,550 %, fällig 28.05.2040	28	0,05	40 UnitedHealth Group Inc, 5,875 %, fällig 15.02.2053	42	0,08
30 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,450 %, fällig 19.05.2028	29	0,05	171 US Airways 2012-2 Klasse A Pass Through Trust, 4,625 %, fällig 03.06.2025	165	0,30
60 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,650 %, fällig 19.05.2030	59	0,11	80 US Bancorp, 5,775 %, fällig 12.06.2029 *	80	0,14
220 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,750 %, fällig 19.05.2033	215	0,39	90 Verizon Communications Inc, 1,500 %, fällig 18.09.2030	70	0,13
190 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 5,110 %, fällig 19.05.2043	183	0,33	30 Verizon Communications Inc, 2,650 %, fällig 20.11.2040	20	0,04
100 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 5,300 %, fällig 19.05.2053	99	0,18	40 Verizon Communications Inc, 6,550 %, fällig 15.09.2043	44	0,08
20 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 5,340 %, fällig 19.05.2063	19	0,04	30 Verizon Communications Inc, 4,000 %, fällig 22.03.2050	23	0,04
90 Pilgrim's Pride Corp, 144A, 5,875 %, fällig 30.09.2027	89	0,16	30 Verizon Communications Inc, 2,987 %, fällig 30.10.2056	18	0,03
50 Pioneer Natural Resources Co, 5,100 %, fällig 29.03.2026	50	0,09	30 Visa Inc, 2,700 %, fällig 15.04.2040	22	0,04
60 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, fällig 15.01.2031	48	0,09	90 Vontier Corp, 1,800 %, fällig 01.04.2026	81	0,15
50 Plains All American Pipeline LP, Serie B, 9,736 %, unbefristet *	46	0,08	180 Vontier Corp, 2,400 %, fällig 01.04.2028	150	0,27
40 Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 6,700 %, fällig 15.05.2036	39	0,07	60 Walmart Inc, 2,650 %, fällig 22.09.2051	40	0,07
120 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,812 %, fällig 12.06.2026 *	120	0,22	20 Walt Disney Co/The, 6,200 %, fällig 15.12.2034	22	0,04
30 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,582 %, fällig 12.06.2029 *	30	0,05	23 Walt Disney Co/The, 6,400 %, fällig 15.12.2035	25	0,05
110 PNC Financial Services Group Inc/The, Serie W, 6,250 %, unbefristet *	97	0,18	20 Walt Disney Co/The, 6,650 %, fällig 15.11.2037	22	0,04
70 Prologis LP, 1,250 %, fällig 15.10.2030	54	0,10			
10 Prudential Financial Inc, 6,750 %, fällig 01.03.2053 *	10	0,02			
30 QUALCOMM Inc, 4,500 %, fällig 20.05.2052	26	0,05			
210 QVC Inc, 4,850 %, fällig 01.04.2024	204	0,37			
61 Range Resources Corp, 4,875 %, fällig 15.05.2025	60	0,11			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>			<b>Vorzugsaktien – 0,35 % (28. Februar 2023: 0,27 %)</b>		
<b>USA – (Fortsetzung)</b>			<b>USA – 0,35 % (28. Februar 2023: 0,27 %)</b>		
30 Walt Disney Co/The, 5,400 %, fällig 01.10.2043	30	0,05	8 KeyCorp	165	0,30
10 Walt Disney Co/The, 4,950 %, fällig 15.10.2045	9	0,02	1 Prudential Financial Inc	27	0,05
20 Warnermedia Holdings Inc, 4,279 %, fällig 15.03.2032	17	0,03		192	0,35
100 Warnermedia Holdings Inc, 5,050 %, fällig 15.03.2042	81	0,15			
80 Warnermedia Holdings Inc, 5,141 %, fällig 15.03.2052	62	0,11			
110 Wells Fargo & Co, 2,406 %, fällig 30.10.2025 *	106	0,19			
120 Wells Fargo & Co, 4,540 %, fällig 15.08.2026 *	117	0,21			
10 Wells Fargo & Co, 3,000 %, fällig 23.10.2026	9	0,02			
10 Wells Fargo & Co, 3,196 %, fällig 17.06.2027 *	9	0,02			
80 Wells Fargo & Co, 3,584 %, fällig 22.05.2028 *	74	0,13			
50 Wells Fargo & Co, 5,574 %, fällig 25.07.2029 *	50	0,09			
151 Wells Fargo & Co, 5,389 %, fällig 24.04.2034 *	146	0,26			
90 Wells Fargo & Co, 5,557 %, fällig 25.07.2034 *	88	0,16			
60 Wells Fargo & Co, 3,068 %, fällig 30.04.2041 *	43	0,08			
120 Wells Fargo & Co, 4,750 %, fällig 07.12.2046	99	0,18			
170 Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	152	0,27			
130 Wells Fargo & Co, 4,611 %, fällig 25.04.2053 *	108	0,20			
210 Wells Fargo & Co, Serie S, 5,900 %, unbefristet *	208	0,38			
10 Welltower OP LLC, 3,850 %, fällig 15.06.2032	9	0,02			
150 Western Midstream Operating LP, 3,100 %, fällig 01.02.2025	144	0,26			
60 Western Midstream Operating LP, 3,950 %, fällig 01.06.2025	58	0,10			
50 Western Midstream Operating LP, 4,050 %, fällig 01.02.2030	44	0,08			
80 Western Midstream Operating LP, 6,150 %, fällig 01.04.2033	79	0,14			
30 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig 15.08.2048	25	0,04			
10 Williams Cos Inc/The, 3,500 %, fällig 15.10.2051	7	0,01			
30 Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2025	30	0,05			
	38.887	70,33			
<b>Sambia – 0,37 % (28. Februar 2023: 0,43 %)</b>			<b>Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 2325)</b>		
200 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig 01.06.2031	204	0,37			
<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 62.933 USD)</b>			<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 66.4715)</b>		
	56.708	102,56		60.019	108,55
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 1,86 % (28. Februar 2023: 1,69 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – 0,27 % (28. Februar 2023: 0,04 %)</b>		
<b>Chile – 0,29 % (28. Februar 2023: 0,17 %)</b>			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
200 Internationale Staatsanleihe von Chile, 2,550 %, fällig 27.07.2033	160	0,29		147	0,27
<b>Mexiko – 1,19 % (28. Februar 2023: 1,20 %)</b>			<b>Futures – 0,09 % (28. Februar 2023: 0,01 %)</b>		
MXN 6.940 Mexikanische Bonos, Serie M, 8,500 %, fällig 18.11.2038	377	0,68	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
350 Internationale Anleihe der mexikanischen Regierung, 4,280 %, fällig 14.08.2041	280	0,51		50	0,09
	657	1,19	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
<b>Peru – 0,11 % (28. Februar 2023: 0,06 %)</b>			60.216		
70 Internationale Staatsanleihe von Peru, 2,783 %, fällig 23.01.2031	59	0,11	<b>Credit Default Swaps – -0,09 % (28. Februar 2023: -0,08 %)</b>		
<b>USA – 0,27 % (28. Februar 2023: 0,05 %)</b>			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
110 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2033	107	0,19		-51	-0,09
50 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.05.2053	45	0,08	<b>Devisenterminkontrakte – -1,50 % (28. Februar 2023: -0,43 %)</b>		
	152	0,27	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 1.145 USD)</b>			-827		
	1.028	1,86	-1,50		
<b>Schuldscheine – 0,49 % (28. Februar 2023: 0,34 %)</b>			<b>Futures – -0,03 % (28. Februar 2023: -0,11 %)</b>		
128 SkyMiles IP Ltd, 9,076 %, fällig 16.09.2027 *	133	0,24	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
140 United Airlines Inc, 9,292 %, fällig 14.04.2028 *	140	0,25		-17	-0,03
	273	0,49	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>		
<b>Summe Schuldscheine (Anschaffungskosten 266 USD)</b>			-895		
<b>Kommunalanleihen – 1,23 % (28. Februar 2023: 0,74 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
50 Alabama Economic Settlement Authority, 3,163 %, fällig 15.09.2025	49	0,09	59.321		
150 American Municipal Power Inc, 7,834 %, fällig 15.02.2041	183	0,33	<b>Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten</b>		
150 Port Authority of New York & New Jersey, 4,458 %, fällig 01.10.2062	132	0,24	-4.031		
160 Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue, 4,132 %, fällig 15.05.2032	149	0,27	<b>Gesamtnettvermögen</b>		
100 State of California, 7,300 %, fällig 01.10.2039	117	0,21	55.290\$		
50 State of Illinois, 5,100 %, fällig 01.06.2033	48	0,09	100,00		
	678	1,23			
<b>Summe Kommunalanleihen (Anschaffungskosten 735 USD)</b>					
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,36 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
750 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	750	1,36			
<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 7505)</b>					
	750	1,36			
<b>Stammaktien – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
<b>Schweiz – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
1.570 Credit Suisse Group AG Escrow †	–	–			
<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten –\$)</b>					
	–	–			

– 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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 18.877.000 USD und machten 34,13 % des Nettovermögens aus.

\* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.

† Nicht liquide.

### ABKÜRZUNGEN:

Unbefristet – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Unbefristete Anleihen sind nicht kündbar, zahlen aber einen stetigen Zinsstrom.

EUR – Euro  
GBP – Britisches Pfund  
MXN – Mexikanischer Peso

### Verteilung des Gesamtvermögens

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	61,09
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	0,28
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,78
Finanzderivate	0,20
Sonstige Vermögenswerte	37,65
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>



# FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tausend)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000 % – Kauf	20. Jun. 2028	870	\$ -25
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % – Kauf	20. Jun. 2028	1.673	-26
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tausend): – USD)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-74)				-51
Nettowertverlust von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-74)				\$ -51

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)		
06. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	31.800	Verkauf	USD	40.285	\$ -120
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	42.061	Verkauf	GBP	33.194	135
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	64.458	Verkauf	USD	82.087	-669
20. Okt. 2023	Goldman Sachs	Kauf	MXN	3.333	Verkauf	USD	192	1
20. Okt. 2023	Goldman Sachs	Kauf	JPY	35.284	Verkauf	USD	249	-6
20. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf	BRL	388	Verkauf	USD	79	-1
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	191	Verkauf	BRL	951	-1
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	298	Verkauf	EUR	274	1
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	450	Verkauf	GBP	350	7
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	289	Verkauf	JPY	41.766	2
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	146	Verkauf	MXN	2.507	1
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	JPY	64.420	Verkauf	USD	462	-19
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	EUR	417	Verkauf	USD	460	-9
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	BRL	1.950	Verkauf	USD	394	-2
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 35\$)							\$	147
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-404)								-827
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-369)							\$	-680

## Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
US-10-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	6	\$ 664	\$ 4
US 10 Jahre Ultra Note Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-8	-923	-9
US-2-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	-16	-3.260	-8
US-5-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	46	4.909	25
US Long Bond (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	20	2.407	16
US Ultra Bond (CBT) Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch.	27	3.450	5
Nicht realisierte Wertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): 4\$)				\$ 50
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-103)				-17
Nettowertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-99)				\$ 33

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Forderungsbesicherte Wertpapiere – 0,42 % (28. Februar 2023: 2,61 %)</b>			<b>Kanada – 1,00 % (28. Februar 2023: 1,11 %)</b>		
80			30		
Soundview Home Loan Trust 2006-2, Serie 2006 2, Klasse M2, 5,954 %, fällig 25.03.2036 *	78	0,42	Bank of Montreal, 1,850 %, fällig 01.05.2025	28	0,15
<b>Gesamtbetrag der forderungsbesicherten Wertpapiere (Anschaffungskosten 78 USD)</b>			20		
	78	0,42	Bank of Nova Scotia/The, 1,300 %, fällig 11.06.2025	18	0,10
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 20,74 % (28. Februar 2023: 19,86 %)</b>			20		
100			Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, fällig 30.05.2041	20	0,10
BANK 2017-BNK7, Serie 2017 BNK7, Klasse C, 4,145 %, fällig 15.09.2060 *	81	0,43	10		
Benchmark 2018-B7 Mortgage Trust, Serie 2018 B7, Klasse XA, 0,565 %, fällig 15.05.2053 *	116	0,62	MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01.02.2029	10	0,05
100			Royal Bank of Canada, 1,150 %, fällig 10.06.2025	37	0,20
Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Klasse 1B1, 144A, 8,388 %, fällig 25.10.2041 *	100	0,53	10		
100			Teck Resources Ltd, 3,900 %, fällig 15.07.2030	9	0,05
Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Serie 2021 R03, Klasse 1B1, 144A, 8,038 %, fällig 25.12.2041 *	99	0,53	70		
121			Toronto-Dominion Bank/The, 1,150 %, fällig 12.06.2025	65	0,35
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2015 C03, Klasse 1M2, 10,402 %, fällig 25.07.2025 *	127	0,68		187	1,00
19			<b>Kolumbien – 0,38 % (28. Februar 2023: 0,36 %)</b>		
Fannie Mae Pool „AM8700“, 2,930 %, fällig 01.06.2030	17	0,09	100		
19			Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	71	0,38
Fannie Mae Pool „AN5386“, 3,250 %, fällig 01.05.2029	18	0,10	<b>Frankreich – 1,02 % (28. Februar 2023: 1,03 %)</b>		
20			200		
Fannie Mae Pool „AS0038“, 3,000 %, fällig 01.07.2043	18	0,10	BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, fällig 14.08.2028	189	1,02
40			<b>Irland – 0,31 % (28. Februar 2023: 0,32 %)</b>		
Fannie Mae Pool „BM6898“, 2,149 %, fällig 01.02.2032 *	32	0,17	59		
83			Avolon TLB Borrower 1 (US) LLC, 7,664 %, fällig 01.12.2027 *	58	0,31
Fannie Mae Pool „BR4393“, 2,000 %, fällig 01.03.2051	66	0,36	<b>Israel – 0,58 % (28. Februar 2023: 1,21 %)</b>		
126			120		
Fannie Mae Pool „CA5220“, 3,000 %, fällig 01.02.2050	109	0,59	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	109	0,58
86			<b>Macau – 0,95 % (28. Februar 2023: 0,93 %)</b>		
Fannie Mae Pool „CB1878“, 3,000 %, fällig 01.10.2051	74	0,40	200		
173			Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 26.08.2028	177	0,95
Fannie Mae Pool „CB2164“, 3,000 %, fällig 01.11.2051	150	0,81	<b>Mexiko – 0,50 % (28. Februar 2023: 0,51 %)</b>		
89			100		
Fannie Mae Pool „CB2375“, 2,500 %, fällig 01.12.2051	75	0,40	Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	92	0,50
276			<b>Vereinigtes Königreich – 1,11 % (28. Februar 2023: 1,25 %)</b>		
Fannie Mae Pool „FM3445“, 4,000 %, fällig 01.09.2048	259	1,39	11		
86			BAT Capital Corp, 3,557 %, fällig 15.08.2027	10	0,05
Fannie Mae Pool „FM9195“, 2,500 %, fällig 01.10.2051	72	0,39	40		
85			BAT Capital Corp, 4,540 %, fällig 15.08.2047	29	0,16
Fannie Mae Pool „FM9292“, 3,000 %, fällig 01.11.2051	75	0,40	200		
87			Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	168	0,90
Fannie Mae Pool „FM9579“, 2,000 %, fällig 01.07.2051	69	0,37		207	1,11
88			<b>USA – 23,01 % (28. Februar 2023: 22,39 %)</b>		
Fannie Mae Pool „FS0584“, 2,000 %, fällig 01.02.2052	71	0,38	10		
86			Abbott Laboratories, 3,750 %, fällig 30.11.2026	10	0,05
Fannie Mae Pool „FS1107“, 2,500 %, fällig 01.12.2051	72	0,39	10		
179			Abbott Laboratories, 4,750 %, fällig 30.11.2036	10	0,05
Fannie Mae Pool „FS2740“, 3,500 %, fällig 01.06.2049	163	0,87	20		
73			Abbott Laboratories, 4,900 %, fällig 30.11.2046	20	0,11
Fannie Mae Pool „MA4158“, 2,000 %, fällig 01.10.2050	58	0,31	100		
82			AbbVie Inc, 3,600 %, fällig 14.05.2025	97	0,52
Fannie Mae Pool „MA4305“, 2,000 %, fällig 01.04.2051	66	0,35	80		
73			AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21.11.2029	72	0,39
Freddie Mac Pool „RA3913“, 2,500 %, fällig 11.01.2050	61	0,33	20		
83			AbbVie Inc, 4,250 %, fällig 21.11.2049	17	0,09
Freddie Mac Pool „RA5921“, 2,500 %, fällig 01.09.2051	69	0,37	10		
70			Air Lease Corp, 5,300 %, fällig 01.02.2028	10	0,05
Freddie Mac Pool „RB5130“, 1,500 %, fällig 01.10.2041	56	0,30	20		
18			Alphabet Inc, 1,100 %, fällig 15.08.2030	16	0,09
Freddie Mac Pool „RB5134“, 1,500 %, fällig 01.11.2041	14	0,08	20		
329			Alphabet Inc, 2,050 %, fällig 15.08.2050	12	0,06
Freddie Mac Pool „SD0176“, 3,500 %, fällig 01.12.2049	298	1,60	32		
88			Altria Group Inc, 4,400 %, fällig 14.02.2026	31	0,17
Freddie Mac Pool „SD0777“, 2,500 %, fällig 01.11.2051	74	0,40	8		
82			Altria Group Inc, 4,800 %, fällig 14.02.2029	8	0,04
Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, Serie 2020 DNA2, Klasse M2, 144A, 7,252 %, fällig 25.02.2050 *	82	0,44	20		
90			Altria Group Inc, 5,800 %, fällig 14.02.2039	20	0,11
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Serie 2021 DNA5, Klasse M2, 144A, 6,938 %, fällig 25.01.2034 *	90	0,48	30		
100			Altria Group Inc, 5,950 %, fällig 14.02.2049	28	0,15
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, Serie 2022 DNA3, Klasse B1, 144A, 10,938 %, fällig 25.04.2042 *	105	0,57	40		
135			Amazon.com Inc, 1,500 %, fällig 03.06.2030	33	0,18
Ginnie Mae II Pool „MA6658“, 4,000 %, fällig 20.05.2050	128	0,68	50		
221			Amazon.com Inc, 2,500 %, fällig 03.06.2050	32	0,17
Ginnie Mae II Pool „MA7473“, 3,000 %, fällig 20.07.2051	196	1,05	50		
236			AT&T Inc, 1,650 %, fällig 01.02.2028	43	0,23
Ginnie Mae II Pool „MA7590“, 3,000 %, fällig 20.09.2051	208	1,12	10		
90			Ball Corp, 3,125 %, fällig 15.09.2031	8	0,04
Ginnie Mae II Pool „MA7883“, 3,500 %, fällig 20.02.2052	82	0,44	20		
100			Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2049	18	0,09
97			Boeing Co/The, 4,875 %, fällig 01.05.2025	39	0,21
Government National Mortgage Association, Serie 2022 3, Klasse IO, 0,640 %, fällig 16.02.2061 *	5	0,03	50		
31			Boeing Co/The, 5,150 %, fällig 01.05.2030	49	0,26
New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Serie 2021 NQM2R, Klasse A3, 144A, 1,353 %, fällig 25.10.2058 *	28	0,15	40		
250			Boeing Co/The, 5,705 %, fällig 01.05.2040	39	0,21
Towd Point Mortgage Trust 2017-4, Serie 2017 4, Klasse B2, 144A, 3,574 %, fällig 25.06.2057 *	191	1,02	50		
95			Boeing Co/The, 5,805 %, fällig 01.05.2050	49	0,26
Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Klasse A1, 144A, 5,811 %, fällig 25.05.2068	94	0,50	38		
<b>Gesamtbetrag der hypothekenbesicherten Wertpapiere (Anschaffungskosten 4.319 USD)</b>			260		
	3.865	20,74	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	211	1,13
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 30,95 % (28. Februar 2023: 31,20 %)</b>			10		
<b>Australien – 0,41 % (28. Februar 2023: 0,42 %)</b>			Centene Corp, 4,250 %, fällig 15.12.2027	9	0,05
20			10		
BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000 %, fällig 30.09.2043	20	0,10	Centene Corp, 4,625 %, fällig 15.12.2029	9	0,05
20			20		
Glencore Finance Canada Ltd, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2041	19	0,10	Charles Schwab Corp/The, 5,875 %, fällig 24.08.2026	20	0,11
40			10		
Glencore Funding LLC, 144A, 4,000 %, fällig 27.03.2027	38	0,21	Charles Schwab Corp/The, 6,136 %, fällig 24.08.2034 *	10	0,06
	77	0,41	40		
<b>Belgien – 0,29 % (28. Februar 2023: 0,29 %)</b>			Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23.07.2025	39	0,21
40			80		
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 3,500 %, fällig 01.06.2030	37	0,20	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	75	0,40
20			40		
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4,350 %, fällig 01.06.2040	18	0,09	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	34	0,18
	55	0,29	10		
<b>Brasilien – 1,39 % (28. Februar 2023: 1,38 %)</b>			Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, fällig 01.07.2049	8	0,04
110			40		
Petrobras Global Finance BV 5,750 %, fällig 01.02.2029	107	0,58	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, fällig 01.03.2050	30	0,16
60			10		
Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125 %, fällig 15.01.2032	48	0,25	Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, fällig 31.01.2032	8	0,04
100			40		
Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 21.11.2036	104	0,56	Cigna Group/The, 4,375 %, fällig 15.10.2028	39	0,21
	259	1,39			

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>USA – (Fortsetzung)</b>					
20 Cigna Group/The, 4,800 %, fällig 15.08.2038	18	0,10	20 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	18	0,10
20 Cigna Group/The, 4,900 %, fällig 15.12.2048	18	0,10	40 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15.05.2030	33	0,18
150 Citigroup Inc, 5,500 %, fällig 13.09.2025	149	0,80	20 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, fällig 15.05.2040	14	0,08
200 Citigroup Inc, 2,572 %, fällig 03.06.2031 *	165	0,89	20 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, fällig 15.08.2049	16	0,08
10 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	12	0,07	40 US Bancorp, 1,450 %, fällig 12.05.2025	37	0,20
50 Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 23.07.2048	43	0,23	10 US Bancorp, 5,775 %, fällig 12.06.2029 *	10	0,05
50 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 15.03.2051	32	0,17	10 US Bancorp, 5,836 %, fällig 12.06.2034 *	10	0,05
30 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,036 %, fällig 15.11.2033	30	0,16	10 Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig 10.08.2033	9	0,05
40 Comcast Corp, 4,150 %, fällig 15.10.2028	39	0,21	20 Visa Inc, 2,050 %, fällig 15.04.2030	17	0,09
10 Consolidated Edison Co of New York Inc, Serie 20A, 3,350 %, fällig 01.04.2030	9	0,05	30 Visa Inc, 4,300 %, fällig 14.12.2045	27	0,15
60 Coterra Energy Inc, 4,375 %, fällig 15.03.2029	57	0,30	10 Warnermedia Holdings Inc, 6,412 %, fällig 15.03.2026	10	0,05
30 Deere & Co, 3,750 %, fällig 15.04.2050	26	0,14	140 Western Midstream Operating LP, 5,250 %, fällig 01.02.2050	113	0,61
150 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	155	0,83	20 Williams Cos Inc/The, 4,850 %, fällig 01.03.2048	17	0,09
160 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 20.10.2028	154	0,83		4.288	23,01
40 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15.12.2025	40	0,22	<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 6.911 USD)</b>		
40 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	34	0,18		5.769	30,95
20 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01.12.2029	18	0,10	<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 40,39 % (28. Februar 2023: 27,36 %)</b>		
10 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, fällig 01.12.2026	8	0,05	<b>Brasilien – 1,43 % (28. Februar 2023: 1,33 %)</b>		
30 Elevance Health Inc, 3,650 %, fällig 01.12.2027	28	0,15	BRL 579 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, fällig 01.01.2033	110	0,59
20 Energy Transfer LP, 5,250 %, fällig 15.04.2029	20	0,11	200 Internationale Anleihe der brasilianischen Regierung, 5,000 %, fällig 27.01.2045	156	0,84
20 Energy Transfer LP, 6,250 %, fällig 15.04.2049	19	0,10		266	1,43
10 Energy Transfer LP, Series G, 7,125 %, unbefristet *	9	0,05	<b>Indonesien – 2,35 % (28. Februar 2023: 2,35 %)</b>		
20 EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	19	0,10	200 Internationale Anleihe der indonesischen Regierung, 4,625 %, fällig 15.04.2043	184	0,99
20 EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig 15.04.2050	19	0,10	IDR 1.145.000 Indonesische Staatsanleihe, Serie FR59, 7,000 %, fällig 15.05.2027	77	0,41
150 EQT Corp, 5,000 %, fällig 15.01.2029	142	0,76	IDR 2.677.000 Indonesische Staatsanleihe, Serie FR87, 6,500 %, fällig 15.02.2031	177	0,95
10 Exelon Corp, 5,625 %, fällig 15.06.2035	10	0,05		438	2,35
10 Ford Motor Co, 6,100 %, fällig 19.08.2032	10	0,05	<b>Mexiko – 7,80 % (28. Februar 2023: 7,42 %)</b>		
230 Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, fällig 28.05.2027	216	1,16	MXN 25.890 Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	1.298	6,96
220 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13.11.2030	186	1,00	200 Internationale Anleihe der mexikanischen Regierung, 4,350 %, fällig 15.01.2047	156	0,84
20 General Motors Co, 5,950 %, fällig 01.04.2049	18	0,10		1.454	7,80
20 Home Depot Inc/The, 3,250 %, fällig 15.04.2032	18	0,10	<b>Peru – 0,18 % (28. Februar 2023: 0,17 %)</b>		
40 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	32	0,17	30 Internationale Anleihe der peruanischen Regierung, 6,550 %, fällig 14.03.2037	33	0,18
20 Humana Inc, 3,700 %, fällig 23.03.2029	19	0,10	<b>Russland – 0,57 % (28. Februar 2023: 0,12 %)</b>		
10 Intel Corp, 5,125 %, fällig 10.02.2030	10	0,05	RUB 33.741 Russische Föderale Anleihe – OFZ, 0,000 %, fällig 23.05.2029ty	106	0,57
10 JPMorgan Chase & Co, 3,897 %, fällig 23.01.2049 *	8	0,04	<b>USA – 28,06 % (28. Februar 2023: 15,97 %)</b>		
10 Kenvue Inc, 144A, 4,900 %, fällig 22.03.2033	10	0,05	490 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125 %, fällig 15.01.2033 β	468	2,51
20 Kinder Morgan Inc, 5,200 %, fällig 01.03.2048	17	0,09	60 United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31.12.2025	54	0,29
40 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08.08.2024	39	0,21	10 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 30.04.2027	9	0,05
10 MDC Holdings Inc, 6,000 %, fällig 15.01.2043	9	0,05	280 United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 31.12.2027	239	1,28
30 Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig 24.06.2030	24	0,13	210 United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 29.02.2028	183	0,98
88 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	88	0,47	280 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.03.2028	272	1,46
40 Mondelez International Inc, 1,500 %, fällig 04.05.2025	37	0,20	250 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.03.2030	242	1,30
110 Morgan Stanley, 2,188 %, fällig 28.04.2026 *	104	0,56	120 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 31.07.2030	119	0,64
70 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	62	0,33	690 United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.08.2030	687	3,69
20 MPLX LP, 4,800 %, fällig 15.02.2029	19	0,10	10 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2032	8	0,05
20 MPLX LP, 5,500 %, fällig 15.02.2049	18	0,10	230 United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 15.08.2041	155	0,83
20 NIKE Inc, 3,375 %, fällig 27.03.2050	15	0,08	10 United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.02.2042	8	0,04
40 Northrop Grumman Corp, 3,250 %, fällig 15.01.2028	37	0,20	90 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2042	85	0,46
20 Northrop Grumman Corp, 5,250 %, fällig 01.05.2050	20	0,11	80 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.05.2043	74	0,40
10 ONEOK Inc, 5,550 %, fällig 01.11.2026	10	0,05	160 United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 15.08.2043	160	0,86
20 ONEOK Inc, 5,650 %, fällig 01.11.2028	20	0,11	110 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2049	87	0,47
20 PepsiCo Inc, 1,625 %, fällig 01.05.2030	17	0,09	50 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2049	39	0,21
20 Philip Morris International Inc, 2,100 %, fällig 01.05.2030	16	0,09	50 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.08.2049	34	0,18
20 Philip Morris International Inc, 4,500 %, fällig 20.03.2042	17	0,09	200 United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	108	0,58
10 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,812 %, fällig 12.06.2026 *	10	0,05	230 United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.11.2050	133	0,71
10 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,582 %, fällig 12.06.2029 *	10	0,05	230 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	142	0,76
40 RTX Corp, 2,250 %, fällig 01.07.2030	33	0,18	710 United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.05.2051	494	2,65
10 RTX Corp, 4,500 %, fällig 01.06.2042	9	0,05	50 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.08.2051	32	0,17
60 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025	60	0,32	370 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051	227	1,22
10 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig 01.02.2031	9	0,05	152 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	103	0,55
10 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15.02.2026	9	0,05	257 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	200	1,07
10 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.02.2029	9	0,05	160 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	128	0,68
10 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030	9	0,05	40 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2052	39	0,21
70 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15.02.2031	58	0,31	158 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.02.2053	142	0,76
10 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, fällig 15.02.2031	8	0,05	610 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.05.2053	550	2,95
20 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2031	18	0,09	10 United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.08.2053	10	0,05
20 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig 01.02.2026	21	0,11		5.231	28,06
10 Truist Financial Corp, 6,047 %, fällig 08.06.2027 *	10	0,05	<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 9.165 USD)</b>		
50 Union Pacific Corp, 2,891 %, fällig 06.04.2036	40	0,21		7.528	40,39
40 Union Pacific Corp, 3,839 %, fällig 20.03.2060	31	0,17			
10 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2026	9	0,05			

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>					
<b>Schuldscheine – 5,19 % (28 Februar 2023: 5,39 %)</b>					
51 1011778 BC ULC, 7,196 %, fällig 14.11.2026 *	51	0,27			
59 Allied Universal Holdco LLC, 9,181 %, fällig 14.05.2028 *	57	0,31			
10 AmWINS Group, Inc., 7,696 %, fällig 17.02.2028 *	10	0,05			
20 Brown Group Holding LLC, 7,820 %, fällig 07.06.2028 *	19	0,10			
68 Charter Communications Operating LLC, 7,116 %, fällig 30.04.2025 *	68	0,37			
49 Citadel Securities, 7,888 %, fällig 25.07.2030 *	49	0,26			
10 DCert Buyer, Inc., 9,331 %, fällig 16.10.2026 *	10	0,05			
41 Energizer Holdings, Inc., 7,679 %, fällig 16.12.2027 *	41	0,22			
20 Gainwell Acquisition Corp, 9,342 %, fällig 01.10.2027 *	19	0,10			
68 Genesee & Wyoming Inc, 7,342 %, fällig 30.12.2026 *	68	0,37			
65 Grifols Worldwide Operations USA Inc, 7,414 %, fällig 15.11.2027 *	65	0,35			
10 GVC Holdings Gibraltar Ltd, 7,437 %, fällig 16.03.2027 *	10	0,05			
58 Harbor Freight Tools USA Inc, 8,183 %, fällig 19.10.2027 *	58	0,31			
50 Hunter Douglas Inc, 8,891 %, fällig 09.02.2029 *	48	0,26			
22 ICON Luxembourg S,a,r,l., 7,753 %, fällig 01.07.2028 *	22	0,12			
5 Indigo Merger Sub, Inc., 7,753 %, fällig 01.07.2028 *	5	0,03			
35 Jazz Financing Lux S,a,r,l., 8,946 %, fällig 22.04.2028 *	35	0,19			
35 Nexstar Broadcasting Inc, 7,946 %, fällig 19.09.2026 *	36	0,19			
20 Quikrete Holdings, Inc., 8,320 %, fällig 11.06.2028 *	20	0,11			
8 Rackspace Technology Global, Inc, 8,177 %, fällig 09.02.2028 *	4	0,02			
60 Sotera Health, 8,196 %, fällig 13.12.2026 *	60	0,32			
29 Station Casinos LLC, 7,681 %, fällig 08.02.2027 *	29	0,16			
18 UFC Holdings LLC, 8,369 %, fällig 29.04.2026 *	18	0,09			
23 United Airlines Inc, 9,292 %, fällig 14.04.2028 *	23	0,13			
68 Versend Holding Corp., 9,446 %, fällig 27.08.2025 *	69	0,37			
60 Virgin Media Bristol LLC, 7,925 %, fällig 04.01.2028 *	58	0,31			
15 Zebra Buyer LLC, 8,753 %, fällig 22.04.2028 *	15	0,08			
<b>Gesamtsumme Schuldscheine (Anschaffungskosten 978 USD)</b>	<b>967</b>	<b>5,19</b>			
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,70 % (28. Februar 2023: 7,28 %)</b>					
130 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	130	0,70			
<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 1305)</b>	<b>130</b>	<b>0,70</b>			
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 21.5815)</b>	<b>1.8337</b>	<b>98,39</b>			
<b>Kontrakte</b>					
<b>(in Tsd.)</b>	<b>Wert (in Tsd.) USD</b>	<b>% vom Nettoinventarwert</b>			
<b>Gekaufte Optionen – 0,47 % (28. Februar 2023: 0,11 %)</b>					
– 1-Jahr Mid-Curve 3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Put 95,8750, fällig 15.12.2023 – Morgan Stanley	6	0,03			
– 1-Jahr Mid-Curve 3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Put 96,00, fällig 15.12.2023 – Morgan Stanley	18	0,10			
– 1-Jahr Mid-Curve 3-Monats-SOFR-Futures, Oktober 2023, Put 97,00, fällig 13.10.2023 – Morgan Stanley	50	0,27			
– US 10 Jahre W1 September 2023 Call 109,75, fällig 01.09.2023 – Morgan Stanley	4	0,02			
– US 10 Jahre W1 September 2023 Call 110,25, fällig 01.09.2023 – Morgan Stanley	1	–			
– US 5 Jahre, Oktober 2023, Call 106,25, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	4	0,02			
– US 5 Jahre, Oktober 2023, Call 106,75, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	2	0,01			
– US 5 Jahre W1 September 2023 Call 106,25, fällig 01.09.2023 – Morgan Stanley	1	0,01			
210 USD Put/AUD Call 0,67, fällig 03.11.2023 – JP Morgan	1	0,01			
<b>Gesamtbetrag gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 50 USD)</b>	<b>87</b>	<b>0,47</b>			
<b>Credit Default Swaps – 0,39 % (28. Februar 2023: 0,31 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	72	0,39			
<b>Index Swaps – 2,37 % (28 Februar 2023: 4,56 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	441	2,37			
<b>Devisenterminkontrakte – 0,10 % (28. Februar 2023: 0,06 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	18	0,10			
<b>Futures – 1,15 % (28 Februar 2023: 0,85 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	215	1,15			
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>19.170</b>	<b>102,87</b>			
<b>Kontrakte</b>					
<b>(in Tsd.)</b>	<b>Wert (in Tsd.) USD</b>	<b>% vom Nettoinventarwert</b>			
<b>Geschriebene Optionen – -0,53 % (28. Februar 2023: -0,21 %)</b>					
– 1-Jahr Mid-Curve 3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Put 95,25, fällig 15.12.2023 – Morgan Stanley	-4	-0,02			
– 1-Jahr Mid-Curve 3-Monats-SOFR-Futures, Dezember 2023, Put 95,3750, fällig 15.12.2023 – Morgan Stanley	-11	-0,06			
			– 1-Jahr Mid-Curve 3-Monats-SOFR-Futures, Oktober 2023, Put 96,25, fällig 13.10.2023 – Morgan Stanley	-21	-0,11
			– 1-Jahr Mid-Curve 3-Monats-SOFR-Futures, Oktober 2023, Put 96,50, fällig 13.10.2023 – Morgan Stanley	-30	-0,16
			– US 10 Jahre November 2023 Call 111,00, fällig 27.10.2023 – Morgan Stanley	-1	-0,01
			– US 10 Jahre November 2023 Call 112,50, fällig 27.10.2023 – Morgan Stanley	-1	–
			– US 10 Jahre November 2023 Call 113,00, fällig 27.10.2023 – Morgan Stanley	–	–
			– US 10 Jahre, Oktober 2023, Call 111,75, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-1	-0,01
			– US 10 Jahre, Oktober 2023, Call 112,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-1	–
			– US 10 Jahre, Oktober 2023, Call 112,50, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-1	-0,01
			– US 10 Jahre, Oktober 2023, Call 113,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-1	-0,01
			– US 10 Jahre Oktober 2023 Put 110,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-1	–
			– US 10 Jahre Oktober 2023 Put 111,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-1	–
			– US 10 Jahre W1 September 2023 Call 110,00, fällig 01.09.2023 – Morgan Stanley	-2	-0,01
			– US 5 Jahre November 2023 Call 107,50, fällig 27.10.2023 – Morgan Stanley	-1	-0,01
			– US 5 Jahre, Oktober 2023, Call 108,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-1	–
			– US 5 Jahre, Oktober 2023, Call 109,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	–	–
			– US 5 Jahre Oktober 2023 Put 105,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	–	–
			– US 5 Jahre Oktober 2023 Put 106,50, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-3	-0,02
			– US 5 Jahre W1 September 2023 Call 106,00, fällig 01.09.2023 – Morgan Stanley	-8	-0,05
			– US-Anleihe Oktober 2023 Call 123,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-3	-0,02
			– US-Anleihe Oktober 2023 Call 124,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-1	–
			– US-Anleihe Oktober 2023 Call 125,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-1	-0,01
			– US-Anleihe, Oktober 2023, Put 118,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-1	–
			– US-Anleihe, Oktober 2023, Put 120,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-1	-0,01
			– US-Anleihe, Oktober 2023, Put 121,00, fällig 22.09.2023 – Morgan Stanley	-2	-0,01
			<b>Gesamtbetrag Geschriebene Optionen (Anschaffungskosten 74 USD)</b>	<b>-98</b>	<b>-0,53</b>
<b>Zinsswaps – -0,05 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-9	-0,05
<b>Devisenterminkontrakte – -0,35 % (28. Februar 2023: -0,31 %)</b>					
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-64	-0,35
<b>Futures – -0,40 % (28 Februar 2023: -0,65 %)</b>					
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-74	-0,40
			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>-245</b>	<b>-1,33</b>
			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>18.925</b>	<b>101,54</b>
			<b>Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten</b>	<b>-288</b>	<b>-1,54</b>
			<b>Gesamtvermögen</b>	<b>18.6375</b>	<b>100,00</b>
			– 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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.767.000 USD und machten 9,48 % des Nettovermögens aus.		
			* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.		
			† Nicht liquide.		
			± Auf Basis ausstehender Bekanntgabe erworbene Wertpapiere.		
			β Der Zinssatz für diese Art von Wertpapier ist an den Verbraucherpreisindex (VPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Kuponsatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.		
			γ Aufgrund der Unsicherheit der Zinszahlungen fallen während und/oder nach dem zum 31. August 2023 endenden Finanzzeitraum keine Erträge mehr an.		

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

### ABKÜRZUNGEN:

Unbefristet	– Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Anleihen ohne Laufzeitbegrenzung sind nicht kündbar, liefern aber stetige Zinserträge.
REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit.
TBA	– Wird noch bekannt gegeben.
BRL	– Brasilianischer Real
IDR	– Indonesische Rupiah
MXN	– Mexikanischer Peso
RUB	– Russischer Rubel

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	86,34
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	4,84
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,65
Finanzderivate	4,17
Sonstige Vermögenswerte	4,00
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

### Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	CDX.NA.HY, 5,000 % – Verkaufen	20. Jun. 2028	490	\$ 14
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkaufen	20. Jun. 2028	3.776	58
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tausend): 57\$)				\$ 72
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tausend): – USD)				–
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tausend): 57\$)				\$ 72

### Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Prozentsatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 10,230 %	02. Jan. 2029	3.440	\$ -9
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tausend): – USD)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tausend): – USD)				-9
Nettowertverlust der Zinsswaps (28. Februar 2023 (in Tausend): – USD)				\$ -9

### Aufstellung der Indexswaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Feb. 2047	325	\$ 109
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,500 %, Receive Floating USD SOFR Compound	21. Apr. 2052	150	28
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,600 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Feb. 2048	285	48
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,850 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Feb. 2029	377	21
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,050 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Feb. 2048	1.466	141
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,250 %, Receive Floating USD SOFR Compound	30. Sep. 2029	568	21
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,270 %, Receive Floating USD SOFR Compound	30. Apr. 2029	1.901	67
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,850 %, Receive Floating USD SOFR Compound	30. Jun. 2029	1.002	5
Morgan Stanley	Pay Fixed 5,410 %, Receive Floating USD Fed Funds Rate	31. Jan. 2024	4.468	–
Morgan Stanley	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 4,000 %	29. Feb. 2028	2.170	1
Nicht realisierte Wertsteigerung von Indexswaps (28. Februar 2023 (in Tausend): 842\$)				\$ 441
Nicht realisierte Wertminderung von Indexswaps (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-2)				–
Nettowertsteigerung von Indexswaps (28. Februar 2023 (in Tausend): 840\$)				\$ 441

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf NOK 1.919	Verkauf EUR 166	\$ 1
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf CAD 1.012	Verkauf USD 764	-14
20. Okt. 2023	BNP Paribas	Kauf AUD 971	Verkauf USD 648	-18
20. Okt. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 197	Verkauf MXN 3.418	-2
20. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf USD 258	Verkauf CNH 1.846	4
20. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf IDR 439.327	Verkauf USD 29	–
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 436	Verkauf CNH 3.125	4
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 189	Verkauf EUR 171	3
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 352	Verkauf GBP 274	5
20. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf JPY 119.577	Verkauf USD 858	-29
06. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf USD 79	Verkauf AUD 120	1
06. Nov. 2023	Morgan Stanley	Kauf AUD 120	Verkauf USD 79	-1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 11\$)				\$ 18
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-58)				-64
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-47)				\$ -46

<sup>^</sup> 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<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
3-Monats-SOFR-Index Dezember 2023	Morgan Stanley	-40	\$ -9.460	\$ 88
3-Monats-SOFR-Index Dezember 2024	Morgan Stanley	20	4.792	-2
3-Monats-SOFR-Index Dezember 2025	Morgan Stanley	4	964	-
3-Monats-SOFR-Index Juni 2023	Morgan Stanley	-1	-237	-
3-Monats-SOFR-Index September 2023	Morgan Stanley	-19	-4.493	12
Australische 10-jährige Anleihe, September 2023	Morgan Stanley	5	376	-5
Australische Dollar-Währung September 2023	Morgan Stanley	3	194	-7
Euro-Bund Dezember 2023	Morgan Stanley	1	144	2
Euro-Buxl 30-jährige Anleihe, Dezember 2023	Morgan Stanley	-1	-145	-2
Euro-OAT Dezember 2023	Morgan Stanley	2	276	3
Fed Fund 30 Tage August 2023	Morgan Stanley	-5	-1.972	-
Fed Fund 30 Tage September 2023	Morgan Stanley	-14	-5.522	-
Währung japanischer Yen September 2023	Morgan Stanley	6	517	-25
Long Gilt Dezember 2023	Morgan Stanley	2	242	4
Währung mexikanischer Peso September 2023	Morgan Stanley	7	206	7
US-10-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Morgan Stanley	8	888	8
US 10 -Jahres-Ultra Note Dezember 2023	Morgan Stanley	-10	-1.161	-16
US-2-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Morgan Stanley	-16	-3.261	-6
US-5-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Morgan Stanley	72	7.698	47
US Long Bond (CBT) Dezember 2023	Morgan Stanley	-7	-852	-11
US Ultra Bond (CBT) Dezember 2023	Morgan Stanley	16	2.072	44
Nicht realisierte Wertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): 156\$)				\$ 215
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-120)				-74
Netto-Wertzuwachs von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): 36\$)				\$ 141

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert		
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 85,78 % (28. Februar 2023: 86,70 %)</b>			<b>USA – 30,15 % (28. Februar 2023: 27,59 %)</b>				
<b>Australien – 1,19 % (28. Februar 2023: 1,16 %)</b>							
EUR	100	AusNet Services Holdings Pty Ltd, 1,625 %, fällig 11.03.2081 *	45	0,49			
	20	Westpac Banking Corp, 2,668 %, fällig 15.11.2035 *	55	0,60			
			100	Air Lease Corp, 1,875 %, fällig 15.08.2026	90	0,97	
			10	Air Lease Corp, 5,300 %, fällig 01.02.2028	10	0,11	
			20	Amgen Inc, 5,250 %, fällig 02.03.2033	20	0,22	
			20	Amgen Inc, 5,650 %, fällig 02.03.2053	20	0,22	
			40	AT&T Inc, 3,500 %, fällig 15.09.2053	40	0,43	
			EUR	100	Bank of America Corp, 1,662 %, fällig 25.04.2028 *	99	1,08
			80	Bank of America Corp, 2,676 %, fällig 19.06.2041 *	55	0,60	
			19	Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029	18	0,19	
			40	Centene Corp, 4,625 %, fällig 15.12.2029	37	0,40	
			60	Cigna Group/The, 2,400 %, fällig 15.03.2030	51	0,55	
			60	Cigna Group/The, 3,400 %, fällig 15.03.2050	42	0,46	
			30	Citigroup Inc, 6,174 %, fällig 25.05.2034 *	30	0,32	
			60	Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	75	0,81	
			50	Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 15.03.2051	32	0,35	
			90	Comcast Corp, 4,150 %, fällig 15.10.2028	87	0,94	
			80	CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048	70	0,76	
			20	Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	17	0,19	
			30	Elevance Health Inc, 3,650 %, fällig 01.12.2027	28	0,31	
			70	Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15.02.2078 *	58	0,63	
			30	Exelon Corp, 3,400 %, fällig 15.04.2026	29	0,31	
			EUR	70	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,375 %, fällig 27.03.2025	75	0,82
			80	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	74	0,80	
			80	HCA Inc, 3,500 %, fällig 01.09.2030	70	0,76	
			30	Humana Inc, 3,125 %, fällig 15.08.2029	27	0,29	
			10	Humana Inc, 5,875 %, fällig 01.03.2033	10	0,11	
			EUR	100	JPMorgan Chase & Co, 1,090 %, fällig 11.03.2027 *	101	1,09
			50	Lowe's Cos Inc, 3,000 %, fällig 15.10.2050	32	0,35	
			70	McDonald's Corp, 3,700 %, fällig 30.01.2026	68	0,74	
			130	McDonald's Corp, 5,450 %, fällig 14.08.2053	130	1,41	
			120	Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17.03.2052	85	0,92	
			EUR	100	Morgan Stanley, 4,656 %, fällig 02.03.2029 *	110	1,19
			100	Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	89	0,97	
			10	Morgan Stanley, 5,948 %, fällig 19.01.2038 *	10	0,11	
			30	MPLX LP, 4,500 %, fällig 15.04.2038	25	0,28	
			50	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,750 %, fällig 19.05.2033	49	0,53	
			50	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 5,300 %, fällig 19.05.2053	50	0,54	
			EUR	100	Prologis Euro Finance LLC, 3,875 %, fällig 31.01.2030	106	1,15
			30	Prudential Financial Inc, 3,000 %, fällig 10.03.2040	22	0,24	
			EUR	100	Schneider Electric SE, 3,375 %, fällig 13.04.2034	106	1,15
			80	Texas Instruments Inc, 3,875 %, fällig 15.03.2039	69	0,75	
			90	UnitedHealth Group Inc, 4,000 %, fällig 15.05.2029	86	0,93	
			90	Visa Inc, 4,300 %, fällig 14.12.2045	81	0,88	
			20	Warnermedia Holdings Inc, 5,050 %, fällig 15.03.2042	17	0,18	
			EUR	100	Wells Fargo & Co, 1,000 %, fällig 02.02.2027	97	1,06
			40	Wells Fargo & Co, 5,389 %, fällig 24.04.2034 *	39	0,42	
			60	Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	54	0,59	
			130	Williams Cos Inc/The, 3,500 %, fällig 15.10.2051	87	0,95	
					2.777	30,15	
<b>Irland – 1,33 % (28. Februar 2023: 1,33 %)</b>			<b>Gesamtbetrag Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 9.039 USD)</b>				
	150	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30.01.2032	7.900	85,78			
			122	1,33			
<b>Italien – 2,58 % (28. Februar 2023: 4,25 %)</b>			<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 6,91 % (28. Februar 2023: 8,26 %)</b>				
	150	Enel Finance International NV, 144A, 6,000 %, fällig 07.10.2039	144	1,56			
	EUR	100	Terna – Rete Elettrica Nazionale, 2,375 %, unbefristet *	93	1,02		
			237	2,58			
<b>Netherlands – 4,04 % (28. Februar 2023: 4,04 %)</b>			<b>Deutschland – 2,07 % (28. Februar 2023: 3,90 %)</b>				
EUR	80	ABN AMRO Bank NV, 1,000 %, fällig 16.04.2025	EUR	110	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2031		
EUR	200	Coöperatieve Rabobank UA, 3,250 %, unbefristet *	182	1,98			
EUR	100	ING Groep NV, 2,500 %, fällig 15.02.2029 *	107	1,16			
			372	4,04			
<b>Portugal – 1,05 % (28. Februar 2023: 1,02 %)</b>			<b>USA – 4,84 % (28. Februar 2023: 4,36 %)</b>				
EUR	100	EDP – Energias de Portugal SA, 1,875 %, fällig 02.08.2081 *	97	1,05			
<b>Südafrika – 2,11 % (28. Februar 2023: 2,16 %)</b>							
	200	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig 10.04.2027	194	2,11			
<b>Spain – 0,70 % (28. Februar 2023: 1,67 %)</b>			<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 679 USD)</b>				
	60	Telefonica Emisiones SA, 7,045 %, fällig 20.06.2036	64	0,70			
<b>Supranational – 7,58 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,96 % (28. Februar 2023: 0,33 %)</b>				
EUR	440	European Investment Bank, 0,050 %, fällig 15.11.2029	399	4,34			
	310	European Investment Bank, 3,750 %, fällig 14.02.2033	299	3,24			
			698	7,58			
<b>Schweiz – 2,33 % (28. Februar 2023: 3,93 %)</b>			<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 365\$)</b>				
EUR	200	UBS Group AG, 1,500 %, fällig 30.11.2024	214	2,33			
<b>Vereinigtes Königreich – 11,07 % (28. Februar 2023: 13,16 %)</b>			<b>Stammaktien – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>				
EUR	100	Annington Funding Plc, 1,650 %, fällig 12.07.2024	105	1,14			
GBP	100	Associated British Foods Plc, 2,500 %, fällig 16.06.2034	98	1,06			
EUR	100	Barclays Plc, 3,375 %, fällig 02.04.2025 *	108	1,17			
GBP	100	Barclays Plc, 1,700 %, fällig 03.11.2026 *	114	1,24			
GBP	100	Lloyds Banking Group Plc, 1,985 %, fällig 15.12.2031 *	108	1,17			
EUR	100	Segro Capital Sarl, 1,875 %, fällig 23.03.2030	93	1,02			
EUR	100	SSE Plc, 4,000 %, unbefristet *	100	1,09			
	200	Standard Chartered Plc, 144A, 2,608 %, fällig 12.01.2028 *	179	1,94			
GBP	110	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 1,875 %, fällig 02.11.2028	115	1,24			
			1.020	11,07			
			<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten –\$)</b>				
			–				
			<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 10.083\$)</b>				
			8.902				
			96,65				

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	
<b>Devisenterminkontrakte – 0,83 % (28. Februar 2023: 1,02 %)</b>			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	77	0,83	
<b>Futures – 0,29 % (28. Februar 2023: 0,66 %)</b>			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	26	0,29	
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>			
	9.005	97,77	
<b>Devisenterminkontrakte – -1,74 % (28. Februar 2023: -1,18 %)</b>			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-161	-1,74	
<b>Futures – -0,14 % (28. Februar 2023: -0,05 %)</b>			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-13	-0,14	
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>			
	-174	-1,88	
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>			
	8.831	95,89	
<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>			
	380	4,11	
<b>Gesamtnettovermögen</b>			
	9.211\$	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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 517.000 USD und machten 5,61 % des Nettovermögens aus.
*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.
†	Nicht liquide.

  

**ABKÜRZUNGEN:**

Unbefristet	– Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Anleihen ohne Laufzeitbegrenzung sind nicht kündbar, liefern aber stetige Zinserträge.
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund

  

	% des Gesamtvermögens
<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	90,29
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,86
Finanzderivate	1,09
Sonstige Vermögenswerte	4,76
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 36	Verkauf BRL 178	\$ –
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 2.779	Verkauf BRL 13.605	33
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf BRL 13.782	Verkauf USD 2.904	-124
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 2	Verkauf EUR 2	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD –	Verkauf GBP –	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP –	Verkauf USD –	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 32	Verkauf USD 40	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 74	Verkauf USD 82	-2
03. Okt. 2023	BNY Mellon	Kauf BRL 13.529	Verkauf USD 2.752	-34
16. Nov. 2023	BNP Paribas	Kauf USD 207	Verkauf EUR 191	-1
16. Nov. 2023	BNP Paribas	Kauf USD 155	Verkauf EUR 141	2
16. Nov. 2023	BNP Paribas	Kauf USD 6	Verkauf GBP 5	–
16. Nov. 2023	Citi	Kauf USD 1.948	Verkauf EUR 1.773	19
16. Nov. 2023	Citi	Kauf USD 468	Verkauf GBP 368	1
16. Nov. 2023	Citi	Kauf EUR 14	Verkauf USD 15	–
16. Nov. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 2.027	Verkauf EUR 1.844	20
16. Nov. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 4	Verkauf GBP 3	–
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf USD 100	Verkauf EUR 91	1
16. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf GBP 4	Verkauf USD 5	–
16. Nov. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 113	Verkauf EUR 103	1
16. Nov. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 30	Verkauf GBP 24	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 92\$)				\$ 77
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-107)				-161
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-15)				\$ -84

### Aufstellung der Terminkontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bobl Dezember 2023	Morgan Stanley	\$ -1.019	\$ -6
Euro-BTP Dezember 2023	Morgan Stanley	-250	-2
Euro-Bund Dezember 2023	Morgan Stanley	288	3
Euro-Buxl 30-jährige Anleihe, Dezember 2023	Morgan Stanley	-145	-2
Long Gilt Dezember 2023	Morgan Stanley	242	4
US-10-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Morgan Stanley	444	5
US-5-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Morgan Stanley	855	5
US Long Bond (CBT) Dezember 2023	Morgan Stanley	487	9
US Ultra Bond (CBT) Dezember 2023	Morgan Stanley	-130	-3
Nicht realisierte Wertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): 59\$)			\$ 26
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-5)			-13
Netto-Wertzuwachs von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): 54\$)			\$ 13

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)		
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	33	Verkauf	GBP	25	\$ –
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	30	Verkauf	USD	33	–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	USD	–	–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–	–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	24	Verkauf	USD	33	–
11. Sep. 2023	Barclays	Kauf	INR	306.000	Verkauf	USD	3.715	-18
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	467	Verkauf	AUD	708	8
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	299	Verkauf	AUD	497	1
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	AUD	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	82	Verkauf	AUD	158	2
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	AUD	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	110	Verkauf	CAD	189	2
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	638	Verkauf	CAD	850	8
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	CAD	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	CAD	1	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	408	Verkauf	CAD	598	1
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	340	Verkauf	CNY	3.093	4
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.130	Verkauf	CNY	8.854	6
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	CNY	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	107	Verkauf	CNY	859	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1.936	Verkauf	CNY	13.811	33
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	DKK	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	68	Verkauf	DKK	495	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	18	Verkauf	DKK	159	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	104	Verkauf	DKK	707	1
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	4	Verkauf	EUR	4	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NOK	14	Verkauf	EUR	1	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	32	Verkauf	EUR	38	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.830	Verkauf	EUR	2.122	15
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	–	Verkauf	EUR	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	2	Verkauf	EUR	1	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	3	Verkauf	EUR	1	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	JPY	1.713	Verkauf	EUR	10	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	4	Verkauf	EUR	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	17	Verkauf	EUR	1	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NOK	2	Verkauf	EUR	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	JPY	16.065	Verkauf	EUR	103	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	ILS	–	Verkauf	EUR	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	MXN	13	Verkauf	EUR	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	MXN	153	Verkauf	EUR	8	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	ILS	10	Verkauf	EUR	1	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	5	Verkauf	EUR	4	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	PLN	4	Verkauf	EUR	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CNY	361	Verkauf	EUR	46	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	10.817	Verkauf	EUR	9.855	124
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	EUR	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	DKK	–	Verkauf	EUR	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CNY	52	Verkauf	EUR	7	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	DKK	21	Verkauf	EUR	2	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	3	Verkauf	EUR	1	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	4	Verkauf	EUR	2	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	2	Verkauf	EUR	1	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	PLN	6	Verkauf	EUR	2	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CNY	16	Verkauf	GBP	1	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	GBP	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	–	Verkauf	GBP	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	–	Verkauf	GBP	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	PLN	–	Verkauf	GBP	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	–	Verkauf	GBP	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NOK	–	Verkauf	GBP	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	ILS	–	Verkauf	GBP	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	5	Verkauf	GBP	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	–	Verkauf	GBP	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.024	Verkauf	GBP	883	-7
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	38	Verkauf	GBP	32	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	MXN	2	Verkauf	GBP	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NOK	4	Verkauf	GBP	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	MXN	50	Verkauf	GBP	2	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	–	Verkauf	GBP	–	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)			
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	2	Verkauf	GBP	–	\$	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CNY	115	Verkauf	GBP	12		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	DKK	–	Verkauf	GBP	–		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	ILS	2	Verkauf	GBP	–		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	–	Verkauf	GBP	–		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1.721	Verkauf	GBP	1.349		9
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	–	Verkauf	GBP	–		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	DKK	5	Verkauf	GBP	–		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	PLN	4	Verkauf	GBP	1		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	JPY	746	Verkauf	GBP	4		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	JPY	5.493	Verkauf	GBP	30		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	ILS	–		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	ILS	–		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	64	Verkauf	ILS	250		1
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	97	Verkauf	ILS	356		3
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	15	Verkauf	ILS	79		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	4.514	Verkauf	JPY	640.363		105
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	3	Verkauf	JPY	352		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.887	Verkauf	JPY	449.408		38
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	789	Verkauf	JPY	142.727		19
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	2	Verkauf	JPY	476		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	56	Verkauf	MXN	1.255		-2
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	208	Verkauf	MXN	3.954		-7
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	323	Verkauf	MXN	5.633		-6
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	MXN	2		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	MXN	3		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	NOK	–		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	54	Verkauf	NOK	550		2
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	35	Verkauf	NOK	386		1
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	9	Verkauf	NOK	122		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	NOK	–		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	NZD	–		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	72	Verkauf	NZD	118		2
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	47	Verkauf	NZD	84		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	NZD	–		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	12	Verkauf	NZD	27		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	162	Verkauf	PLN	658		2
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	102	Verkauf	PLN	454		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	27	Verkauf	PLN	146		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	PLN	–		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	PLN	–		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	SEK	–		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	65	Verkauf	SEK	687		2
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	42	Verkauf	SEK	484		1
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	11	Verkauf	SEK	153		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	SEK	–		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	144	Verkauf	SGD	192		2
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	SGD	–		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	SGD	–		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	25	Verkauf	SGD	44		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	93	Verkauf	SGD	136		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	43	Verkauf	USD	54		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	11	Verkauf	USD	9		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	7	Verkauf	USD	4		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CNY	828	Verkauf	USD	115		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NOK	18	Verkauf	USD	2		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	DKK	22	Verkauf	USD	3		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	24	Verkauf	USD	18		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	JPY	39.306	Verkauf	USD	270		2
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	MXN	324	Verkauf	USD	19		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	9.708	Verkauf	USD	10.658		-125
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	2.695	Verkauf	USD	3.429		-19
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	PLN	40	Verkauf	USD	10		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	21	Verkauf	USD	13		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NOK	16	Verkauf	USD	2		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	268	Verkauf	USD	291		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	DKK	20	Verkauf	USD	3		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	ILS	22	Verkauf	USD	6		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	42	Verkauf	USD	4		–
13. Sep. 2023	Citi	Kauf	USD	154	Verkauf	KRW	200.000		3
13. Sep. 2023	Citi	Kauf	USD	7.706	Verkauf	KRW	10.300.000		-83
13. Sep. 2023	Citi	Kauf	KRW	10.500.000	Verkauf	USD	8.094		-153

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	7	Verkauf	AUD	10	\$ –
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf	EUR	1	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	104	Verkauf	EUR	95	1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	60	Verkauf	GBP	48	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	561	Verkauf	GBP	441	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.635	Verkauf	USD	2.898	-40
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	1	Verkauf	USD	1	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	288	Verkauf	USD	188	-2
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	9.125	Verkauf	USD	11.620	-61
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	9	Verkauf	USD	11	–
19. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf	JPY	4.729.000	Verkauf	USD	34.400	-1.798
19. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	802	Verkauf	JPY	113.000	23
19. Sep. 2023	UBS	Kauf	USD	332	Verkauf	JPY	47.000	8
22. Sep. 2023	Citi	Kauf	USD	795	Verkauf	NOK	8.000	43
22. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf	NOK	40.200	Verkauf	USD	3.800	-17
22. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf	NOK	26.600	Verkauf	USD	2.474	30
22. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	168	Verkauf	NOK	1.800	-1
22. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	2.563	Verkauf	NOK	25.600	153
26. Sep. 2023	Barclays	Kauf	USD	2.060	Verkauf	NZD	3.390	39
26. Sep. 2023	Barclays	Kauf	NZD	1.040	Verkauf	USD	645	-25
26. Sep. 2023	UBS	Kauf	USD	160	Verkauf	NZD	260	5
17. Okt. 2023	Goldman Sachs	Kauf	MYR	29.500	Verkauf	USD	6.529	-147
19. Okt. 2023	HSBC	Kauf	USD	6.626	Verkauf	BRL	32.300	151
25. Okt. 2023	Citi	Kauf	USD	3.987	Verkauf	CAD	5.240	106
27. Okt. 2023	Citi	Kauf	USD	21.376	Verkauf	MXN	365.200	181
27. Okt. 2023	Goldman Sachs	Kauf	MXN	5.300	Verkauf	USD	309	-1
27. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	MXN	49.100	Verkauf	USD	2.867	-17
30. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf	USD	1.915	Verkauf	COP	7.820.000	36
30. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf	USD	4.473	Verkauf	COP	18.960.000	-82
07. Nov. 2023	HSBC	Kauf	EUR	3.400	Verkauf	USD	3.696	3
07. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	EUR	20.460	Verkauf	USD	22.634	-374
07. Nov. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	621	Verkauf	EUR	560	12
10. Nov. 2023	HSBC	Kauf	USD	1.254	Verkauf	THB	44.400	-23
10. Nov. 2023	HSBC	Kauf	THB	44.400	Verkauf	USD	1.292	-15
15. Nov. 2023	HSBC	Kauf	USD	8.503	Verkauf	ZAR	162.900	-65
17. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	CNH	15.530	Verkauf	USD	2.157	-13
06. Dez. 2023	JP Morgan	Kauf	AUD	1.530	Verkauf	USD	987	8
08. Dez. 2023	JP Morgan	Kauf	USD	13.705	Verkauf	GBP	10.900	-105
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 3.132\$)								\$ 1.454
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-3.966)								-3.353
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-834)								\$ -1.899

# FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 22,12 % (28. Februar 2023: 21,89 %)</b>			17.130 Variabel verzinsliche US-Schatzanweisung – Wenn emittiert, 5,418 %, fällig 30.04.2025 *		
4.950 COMM 2017-PANW Mortgage Trust, Serie 2017 PANW, Klasse D, 144A, 4,343 %, fällig 10.10.2029 *	4.347	1,70	17.138	17.138	6,70
5.039 Fannie Mae Pool „MA4733“, 4,500 %, fällig 01.09.2052	4.781	1,87	83.550 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032	75.009	29,30
2.618 Fannie Mae Pool „MA4785“, 5,000 %, fällig 01.10.2052	2.541	0,99		97.405	38,05
4.797 Fannie Mae Pool „MA4841“, 5,000 %, fällig 01.12.2052	4.655	1,82	<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 175.791 USD)</b>	174.669	68,23
4.957 Fannie Mae Pool „MA4842“, 5,500 %, fällig 01.12.2052	4.901	1,91	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,01 % (28. Februar 2023: 5,67 %)</b>		
2.201 Freddie Mac Pool „RA7790“, 5,000 %, fällig 01.08.2052	2.137	0,83	7.710 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	7.710	3,01
3.679 Freddie Mac Pool „SD8245“, 4,500 %, fällig 01.09.2052	3.490	1,36	<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 7.710\$)</b>	7.710	3,01
3.269 Freddie Mac Pool „SD8257“, 4,500 %, fällig 01.10.2052	3.102	1,21	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 263.137\$)</b>	260.160	101,62
2.735 Freddie Mac Pool „SD8267“, 5,000 %, fällig 01.11.2052	2.654	1,04	<b>Devisenterminkontrakte – 2,94 % (28. Februar 2023: 2,41 %)</b>		
7.021 Freddie Mac Pool „SD8277“, 5,500 %, fällig 01.12.2052	6.941	2,71	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	7.522	2,94
2.598 Ginnie Mae II Pool „MA8648“, 5,500 %, fällig 20.02.2053	2.573	1,01	<b>Futures – 0,20 % (28. Februar 2023: 0,41 %)</b>		
4.899 Ginnie Mae II Pool „MA8801“, 5,500 %, fällig 20.04.2053	4.852	1,90	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	512	0,20
3.356 Ginnie Mae II Pool „MA8879“, 5,500 %, fällig 20.05.2053	3.324	1,30	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	268.194	104,76
3.845 Ginnie Mae II Pool „MA8947“, 5,000 %, fällig 20.06.2053	3.743	1,46	<b>Devisenterminkontrakte – -6,46 % (28. Februar 2023: -4,38 %)</b>		
2.608 Ginnie Mae II Pool „MA8948“, 5,500 %, fällig 20.06.2053	2.583	1,01	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-16.536	-6,46
<b>Gesamtbeitrag hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 58.067 USD)</b>	56.624	22,12	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	-16.536	-6,46
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 8,26 % (28. Februar 2023: 7,26 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	251.658	98,30
<b>Australien – 2,46 % (28. Februar 2023: 4,87 %)</b>			<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>	4.352	1,70
6.280 Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,955 %, fällig 14.03.2025 *	6.291	2,46	<b>Gesamtvermögen</b>	256.010\$	100,00
<b>Mexiko – 0,96 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
3.990 Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig 28.01.2060	2.472	0,96			
<b>USA – 4,84 % (28. Februar 2023: 2,39 %)</b>					
5.600 General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, fällig 06.04.2026	5.533	2,16			
1.905 Jabil Inc, 3,000 %, fällig 15.01.2031	1.593	0,62			
5.340 Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, fällig 18.05.2026	5.268	2,06			
	12.394	4,84			
<b>Gesamtbeitrag Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 21.569 USD)</b>	21.157	8,26			
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 68,23 % (28. Februar 2023: 65,08 %)</b>					
<b>Brasilien – 4,74 % (28. Februar 2023: 7,30 %)</b>					
BRL 64.000 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, fällig 01.01.2033	12.138	4,74			
<b>Kolumbien – 6,70 % (28. Februar 2023: 5,75 %)</b>					
COP 29.810.000 Kolumbianische TES, Serie B, 9,250 %, fällig 28.05.2042	6.333	2,47			
COP 64.550.000 Kolumbianische TES, Serie B, 7,250 %, fällig 26.10.2050	10.832	4,23			
	17.165	6,70			
<b>Mexiko – 6,13 % (28. Februar 2023: 5,75 %)</b>					
MXN 88.900 Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	4.537	1,77			
MXN 220.200 Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	11.144	4,36			
	15.681	6,13			
<b>Neuseeland – 2,44 % (28. Februar 2023: 2,68 %)</b>					
NZD 15.920 Neuseeländische Staatsanleihe, Serie 0551, 2,750 %, fällig 15.05.2051	6.251	2,44			
<b>Peru – 4,10 % (28. Februar 2023: 3,69 %)</b>					
PEN 39.970 Staatsanleihe von Peru, 6,150 %, fällig 12.08.2032	10.491	4,10			
<b>Südafrika – 3,74 % (28. Februar 2023: 2,91 %)</b>					
ZAR 250.300 Staatsanleihe der Republik Südafrika, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	9.578	3,74			
<b>Vereinigtes Königreich – 2,33 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
GBP 9.790 Vereinigtes Königreich Gilt, 1,250 %, fällig 31.07.2051	5.960	2,33			
<b>USA – 38,05 % (28. Februar 2023: 32,72 %)</b>					
5.250 Variabel verzinsliche US-Schatzanweisung – Wenn emittiert, 4,931 %, fällig 31.01.2025 *	5.258	2,05			

– 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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 10.638.000 USD und machten 4,16 % des Nettovermögens aus.

\* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.

**ABKÜRZUNGEN:**

BRL	–	Brasilianischer Real
COP	–	Kolumbianischer Peso
GBP	–	Britisches Pfund
MXN	–	Mexikanischer Peso
NZD	–	Neuseeland-Dollar
PEN	–	Peruanischer New 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	92,12
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,81
Finanzderivate	2,93
Sonstige Vermögenswerte	2,14
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

**Aufstellung der Devisenterminkontrakte**

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
01. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf USD 35.208	Verkauf GBP 27.410	\$ 485
01. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf GBP 10.570	Verkauf USD 13.537	-147
06. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf SGD 74	Verkauf USD 55	-
11. Sep. 2023	Barclays	Kauf USD 9.374	Verkauf CHF 8.420	-169
11. Sep. 2023	Barclays	Kauf USD 4.369	Verkauf INR 362.000	-4
11. Sep. 2023	Barclays	Kauf USD 5.385	Verkauf INR 444.000	20
11. Sep. 2023	Barclays	Kauf INR 1.903.000	Verkauf USD 23.102	-110
11. Sep. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 83.623	Verkauf CHF 74.550	-872
11. Sep. 2023	HSBC	Kauf CHF 1.050	Verkauf USD 1.200	-10
11. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf CHF 4.270	Verkauf USD 4.821	19
11. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf CHF 14.900	Verkauf USD 17.037	-149

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
11. Sep. 2023	National Australia Bank	Kauf CHF 15.500	Verkauf USD 17.958	\$ -390
13. Sep. 2023	Citi	Kauf USD 37.914	Verkauf KRW 48.640.000	1.130
13. Sep. 2023	Citi	Kauf USD 48.640.000	Verkauf USD 37.493	-709
14. Sep. 2023	Citi	Kauf USD 2.574	Verkauf THB 88.500	43
14. Sep. 2023	Citi	Kauf USD 8.402	Verkauf THB 296.800	-85
14. Sep. 2023	Citi	Kauf THB 475.500	Verkauf USD 14.097	-499
14. Sep. 2023	HSBC	Kauf USD 2.641	Verkauf THB 90.200	62
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 4.363	Verkauf EUR 3.994	28
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 22.237	Verkauf EUR 20.563	-77
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 481	Verkauf GBP 378	1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 118.427	Verkauf USD 130.296	-1.787
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 12.092	Verkauf USD 15.399	-80
19. Sep. 2023	Barclays	Kauf USD 20.334	Verkauf JPY 2.950.000	-3
19. Sep. 2023	Barclays	Kauf JPY 3.090.000	Verkauf USD 22.180	-878
19. Sep. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 22.475	Verkauf JPY 3.195.000	449
19. Sep. 2023	HSBC	Kauf JPY 768.000	Verkauf USD 5.285	10
19. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf JPY 12.552.000	Verkauf USD 91.306	-4.772
19. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf JPY 1.946.000	Verkauf USD 13.914	-499
19. Sep. 2023	National Australia Bank	Kauf USD 23.951	Verkauf JPY 3.338.000	939
19. Sep. 2023	UBS	Kauf USD 4.476	Verkauf JPY 654.000	-32
22. Sep. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 13.927	Verkauf NOK 141.200	636
22. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf USD 8.293	Verkauf NOK 87.300	76
22. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf NOK 252.300	Verkauf USD 23.465	283
22. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 2.235	Verkauf NOK 23.800	-5
26. Sep. 2023	Barclays	Kauf USD 11.767	Verkauf NZD 18.980	449
26. Sep. 2023	HSBC	Kauf NZD 700	Verkauf USD 412	5
26. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf NZD 3.620	Verkauf USD 2.202	-43
26. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf NZD 3.660	Verkauf USD 2.257	-75
29. Sep. 2023	Barclays	Kauf USD 21.649	Verkauf NOK 221.900	759
29. Sep. 2023	Citi	Kauf USD 1.529	Verkauf NOK 16.400	-15
29. Sep. 2023	Goldman Sachs	Kauf NOK 136.200	Verkauf USD 13.389	-567
29. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 6.105	Verkauf NOK 65.000	-14
29. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf NOK 355.700	Verkauf USD 34.034	-547
17. Okt. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 23.041	Verkauf MYR 105.700	176
17. Okt. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 9.557	Verkauf SEK 102.200	202
17. Okt. 2023	Goldman Sachs	Kauf MYR 105.700	Verkauf USD 23.392	-528
17. Okt. 2023	Goldman Sachs	Kauf SEK 239.000	Verkauf USD 23.457	-1.578
17. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 660	Verkauf SEK 7.300	-8
17. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 4.306	Verkauf SEK 45.000	186
19. Okt. 2023	HSBC	Kauf USD 35.511	Verkauf BRL 173.110	811
19. Okt. 2023	HSBC	Kauf BRL 150.010	Verkauf USD 30.949	-880
27. Okt. 2023	Citi	Kauf USD 29.155	Verkauf MXN 498.100	247
27. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf MXN 90.700	Verkauf USD 5.238	26
27. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf MXN 121.600	Verkauf USD 7.179	-121
30. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf USD 4.613	Verkauf COP 19.340.000	-34
30. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf USD 16.063	Verkauf COP 65.590.000	305
30. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf COP 7.200.000	Verkauf USD 1.731	-1
07. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf EUR 26.910	Verkauf USD 29.770	-492
07. Nov. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 1.687	Verkauf EUR 1.560	-10
07. Nov. 2023	Morgan Stanley	Kauf EUR 4.650	Verkauf USD 5.076	-17
07. Nov. 2023	UBS	Kauf USD 6.824	Verkauf EUR 6.210	67
08. Nov. 2023	HSBC	Kauf USD 764	Verkauf CLP 650.000	7
08. Nov. 2023	HSBC	Kauf USD 11.342	Verkauf PEN 42.310	-56
08. Nov. 2023	HSBC	Kauf PEN 3.800	Verkauf USD 1.026	-2
08. Nov. 2023	HSBC	Kauf CLP 7.370.000	Verkauf USD 8.578	6
14. Nov. 2023	Morgan Stanley	Kauf HUF 1.990.000	Verkauf USD 5.606	-28
14. Nov. 2023	UBS	Kauf USD 417	Verkauf HUF 150.000	-4
15. Nov. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 10.881	Verkauf ZAR 205.600	68
15. Nov. 2023	HSBC	Kauf ZAR 17.200	Verkauf USD 910	-6
17. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf USD 8.522	Verkauf CNH 61.650	12
17. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf CNH 61.650	Verkauf USD 8.561	-51
08. Dez. 2023	HSBC	Kauf GBP 1.470	Verkauf USD 1.848	15
08. Dez. 2023	JP Morgan	Kauf USD 21.174	Verkauf GBP 16.840	-162
08. Dez. 2023	JP Morgan	Kauf GBP 3.990	Verkauf USD 5.076	-20
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 13.024\$)				\$ 7.522
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-23.627)				-16.536
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-10.603)				\$ -9.014

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
Japanische 10-jährige Anleihe (OSE), September 2023	Morgan Stanley	-37	\$ -37.337	\$ 326
US-10-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Morgan Stanley	195	21.651	186
Nicht realisierte Wertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): 2.190\$)				\$ 512
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): – USD)				–
Netto-Wertzuwachs von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): 2.190\$)				\$ 512

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Brandywine Global High Yield Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 94,90 % (28. Februar 2023: 95,87 %)</b>					
<b>Österreich – 0,83 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
200 Benteler International AG, 144A, 10,500 %, fällig 15.05.2028	202	0,83			
<b>Kanada – 6,54 % (28. Februar 2023: 3,28 %)</b>					
576 Athabasca Oil Corp, 144A, 9,750 %, fällig 01.11.2026	594	2,44			
310 Baytex Energy Corp, 144A, 8,750 %, fällig 01.04.2027	318	1,31			
515 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	476	1,95			
220 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	204	0,84			
	1.592	6,54			
<b>Kolumbien – 1,10 % (28. Februar 2023: 1,29 %)</b>					
200 Ecopetrol SA, 8,625 %, fällig 19.01.2029	204	0,84			
80 Ecopetrol SA, 4,625 %, fällig 02.11.2031	63	0,26			
	267	1,10			
<b>Tschechische Republik – 2,62 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
EUR 575 Allwyn Entertainment Financing UK Plc, 7,250 %, fällig 30.04.2030	637	2,62			
<b>Finnland – 1,47 % (28. Februar 2023: 0,28 %)</b>					
374 Nokia Oyj, 6,625 %, fällig 15.05.2039	356	1,47			
<b>Frankreich – 0,36 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
EUR 100 Altice France SA/Frankreich, 5,875 %, fällig 01.02.2027	88	0,36			
<b>Israel – 7,58 % (28. Februar 2023: 3,42 %)</b>					
370 Delek Overriding Royalty Leviathan Ltd, 144A, 7,494 %, fällig 30.12.2023	368	1,51			
440 Energian Israel Finance Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 30.03.2024	436	1,79			
400 Energian Israel Finance Ltd, 144A, 4,875 %, fällig 30.03.2026	376	1,55			
150 Energian Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 30.03.2028	137	0,56			
150 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,125 %, fällig 30.06.2025	147	0,61			
160 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 30.06.2027	155	0,64			
239 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, fällig 30.06.2030	225	0,92			
	1.844	7,58			
<b>Italien – 0,42 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
EUR 100 Itelyum Regeneration Spa, 4,625 %, fällig 01.10.2026	102	0,42			
<b>Japan – 0,82 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
200 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,043 %, fällig 15.09.2023	200	0,82			
<b>Mexiko – 3,15 % (28. Februar 2023: 1,49 %)</b>					
370 Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, fällig 15.11.2029	235	0,97			
300 Petroleos Mexicanos, 5,950 %, fällig 28.01.2031	217	0,89			
415 Petroleos Mexicanos, 6,700 %, fällig 16.02.2032	314	1,29			
	766	3,15			
<b>Nigeria – 0,67 % (28. Februar 2023: 1,58 %)</b>					
200 IHS Holding Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 29.11.2028	162	0,67			
<b>Südkorea – 0,74 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
200 SK Hynix Inc, 144A, 1,500 %, fällig 19.01.2026	180	0,74			
<b>Vereinigtes Königreich – 1,74 % (28. Februar 2023: 2,55 %)</b>					
150 BAT Capital Corp, 7,079 %, fällig 02.08.2043	149	0,61			
138 British Airways 2019-1 Klasse AA Pass Through Trust, 144A, 3,300 %, fällig 15.12.2032	121	0,50			
160 Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 6,750 %, fällig 01.10.2026	152	0,63			
	422	1,74			
<b>USA – 65,22 % (28. Februar 2023: 77,01 %)</b>					
150 Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2028	140	0,57			
50 Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250 %, fällig 15.02.2026	50	0,21			
700 Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, fällig 15.12.2027	621	2,55			
275 Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, fällig 15.08.2027	269	1,11			
445 ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, fällig 15.08.2028	358	1,47			
250 Arko Corp, 144A, 5,125 %, fällig 15.11.2029	206	0,84			
240 Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 01.02.2026	231	0,95			
385 Burford Capital Finance LLC, 6,125 %, fällig 12.08.2025	371	1,53			
620 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2030	569	2,34			
200 Capital One Financial Corp, 1,343 %, fällig 06.12.2024 *	197	0,81			
150 Cargo Aircraft Management Inc, 144A, 4,750 %, fällig 01.02.2028	136	0,56			
475 Cimarex Energy Co, 3,900 %, fällig 15.05.2027	417	1,71			
280 Cimarex Energy Co, 4,375 %, fällig 15.03.2029	226	0,93			
175 Concentrix Corp, 6,850 %, fällig 02.08.2033	168	0,69			
200 Credit Acceptance Corp, 144A, 5,125 %, fällig 31.12.2024	195	0,80			
235 Credit Acceptance Corp, 6,625 %, fällig 15.03.2026	229	0,94			
150 Crocs Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.08.2031	119	0,49			
150 Dream Finders Homes Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.08.2028	152	0,63			
50 FirstCash Inc, 144A, 4,625 %, fällig 01.09.2028	45	0,18			
510 FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig 01.01.2030	464	1,91			
100 Freedom Mortgage Corp, 144A, 8,125 %, fällig 15.11.2024	100	0,41			
380 Freedom Mortgage Corp, 7,625 %, fällig 01.05.2026	350	1,44			
625 GrubHub Holdings Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.07.2027	433	1,78			
270 Home BancShares Inc/AR, 3,125 %, fällig 30.01.2032 *	223	0,92			
225 Horizon Therapeutics USA Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.08.2027	230	0,95			
375 IRB Holding Corp, 144A, 7,000 %, fällig 15.06.2025	375	1,54			
445 LCPR Senior Secured Financing DAC, 144A, 6,750 %, fällig 15.10.2027	419	1,72			
275 Liberty Interactive LLC, 8,250 %, fällig 01.02.2030	107	0,44			
165 Lindblad Expeditions LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.02.2027	159	0,66			
610 Motiv Holdings Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.10.2026	553	2,27			
425 Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp, 144A, 4,875 %, fällig 01.05.2029	370	1,52			
100 New York Community Bancorp Inc, 5,900 %, fällig 06.11.2028 *	96	0,40			
145 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 3,875 %, fällig 21.09.2023	145	0,60			
175 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2028	164	0,68			
320 PDC Energy Inc, 5,750 %, fällig 15.05.2026	319	1,31			
150 PennyMac Financial Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.02.2029	124	0,51			
70 PennyMac Financial Services Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.09.2031	59	0,24			
20 PRA Group Inc, 144A, 8,375 %, fällig 01.02.2028	18	0,07			
400 PRA Group Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.10.2029	302	1,24			
225 PROG Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2029	202	0,83			
145 QVC Inc, 4,750 %, fällig 15.02.2027	96	0,39			
405 QVC Inc, 4,375 %, fällig 01.09.2028	230	0,94			
70 Radian Group Inc, 4,500 %, fällig 01.10.2024	68	0,28			
95 Rocket Mortgage LLC, 144A, 5,250 %, fällig 15.01.2028	89	0,37			
440 Sabre Global Inc, 144A, 9,250 %, fällig 15.04.2025	434	1,78			
150 Signature Bank/New York NY, 4,000 %, fällig 15.10.2030 *	2	0,01			
50 Solaris Midstream Holdings LLC, 144A, 7,625 %, fällig 01.04.2026	49	0,20			
EUR 400 Standard Industries Inc/NJ, 2,250 %, fällig 21.11.2026	385	1,58			
405 Station Casinos LLC, 144A, 4,625 %, fällig 01.12.2031	334	1,37			
55 Synchrony Financial, 7,250 %, fällig 02.02.2033	51	0,21			
95 Texas Capital Bancshares Inc, 4,000 %, fällig 06.05.2031 *	79	0,32			
160 TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2026	159	0,65			
249 Turning Point Brands Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.02.2026	233	0,96			
515 Uber Technologies Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.05.2025	520	2,14			
376 Uber Technologies Inc, 144A, 8,000 %, fällig 01.11.2026	383	1,58			
100 United States Cellular Corp, 6,700 %, fällig 15.12.2033	98	0,40			
450 United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15.04.2029	391	1,61			
600 Valvoline Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.02.2030	590	2,43			
755 Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 01.02.2029	658	2,70			
200 Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125 %, fällig 01.06.2028	202	0,83			
325 Viking Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 15.05.2025	320	1,32			
200 WESCO Distribution Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15.06.2025	201	0,83			
150 Western Alliance Bancorp, 6,700 %, fällig 15.06.2031 *	119	0,49			
EUR 200 WMG Acquisition Corp, 2,250 %, fällig 15.08.2031	175	0,72			
100 World Acceptance Corp, 144A, 7,000 %, fällig 01.11.2026	87	0,36			
	15.864	65,22			
<b>Sambia – 1,64 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
400 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2025	400	1,64			
<b>Gesamtbetrag Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 23.138 USD)</b>					
	23.082	94,90			
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,48 % (28. Februar 2023: 3,81 %)</b>					
846 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	846	3,48			
<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 846\$)</b>					
	846	3,48			
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 23.984\$)</b>					
	23.928	98,38			
<b>Devisenterminkontrakte – 0,05 % (28. Februar 2023: 0,10 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	12	0,05			
<b>Futures – 0,17 % (28. Februar 2023: 0,01 %)</b>					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	42	0,17			
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					
	23.982	98,60			
<b>Devisenterminkontrakte: -1,01 % (28. Februar 2023: -1,94 %)</b>					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-245	-1,01			
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>					
	-245	-1,01			
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>					
	23.737	97,59			
<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>					
	585	2,41			
<b>Gesamtvermögen</b>					
	24.322\$	100,00			

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Brandywine Global High Yield Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

- Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.
- 144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 16.794.000 USD und machten 69,05 % des Nettovermögens aus.
- \* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.

### ABKÜRZUNGEN:

EUR – Euro

Verteilung des Gesamtvermögens		% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		92,00
Organismen für gemeinsame Anlagen		3,37
Finanzderivate		0,22
Sonstige Vermögenswerte		4,41
<b>Gesamtvermögen</b>		<b>100,00</b>

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)			
01. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf	GBP	330	Verkauf	USD	410	\$	8
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	1	Verkauf	CHF	2		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	3	Verkauf	CHF	2		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	CHF	–		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	2.456	Verkauf	EUR	1.678		-3
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	10	Verkauf	EUR	12		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	26	Verkauf	EUR	17		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	268	Verkauf	GBP	158		-2
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	146	Verkauf	GBP	125		-1
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	3	Verkauf	GBP	2		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	2	Verkauf	SEK	18		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	SEK	–		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	3	Verkauf	SEK	22		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	6.137	Verkauf	USD	6.737		-79
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	11.297	Verkauf	USD	8.474		-111
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	118	Verkauf	USD	87		–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	46	Verkauf	USD	60		–
07. Nov. 2023	HSBC	Kauf	EUR	60	Verkauf	USD	66		–
07. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	EUR	2.670	Verkauf	USD	2.954		-49
07. Nov. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	87	Verkauf	EUR	80		–
08. Dez. 2023	JP Morgan	Kauf	GBP	370	Verkauf	USD	465		4
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 10\$)							\$	12	
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-202)								-245	
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-192)							\$	-233	

## Aufstellung der Terminkontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
US-10-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Citi	44	\$ 4.885
Nicht realisierte Wertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): 2\$)			\$ 42
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): – USD)			–
Netto-Wertzuwachs von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): 2\$)			\$ 42

<sup>^</sup> 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 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 13,61 % (28. Februar 2023: 13,19 %)</b>			<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 4,27 % (28. Februar 2023: 1,99 %)</b>		
1.015 Fannie Mae Pool „MA4733“, 4,500 %, fällig 01.09.2052	963	0,46	8.871 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	8.871	4,27
1.561 Fannie Mae Pool „MA4785“, 5,000 %, fällig 01.10.2052	1.515	0,73	<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 8.871\$)</b>	<b>8.871</b>	<b>4,27</b>
3.312 Fannie Mae Pool „MA4841“, 5,000 %, fällig 01.12.2052	3.215	1,55	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 222.833\$)</b>	<b>207.895</b>	<b>100,06</b>
3.725 Fannie Mae Pool „MA4842“, 5,500 %, fällig 01.12.2052	3.682	1,77	<b>Devisenterminkontrakte – 0,56 % (28. Februar 2023: 0,71 %)</b>		
1.502 Freddie Mac Pool „RA7790“, 5,000 %, fällig 01.08.2052	1.459	0,70	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1.150	0,56
1.871 Freddie Mac Pool „SD8257“, 4,500 %, fällig 01.10.2052	1.775	0,85	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	<b>209.045</b>	<b>100,62</b>
1.845 Freddie Mac Pool „SD8267“, 5,000 %, fällig 01.11.2052	1.791	0,86	<b>Devisenterminkontrakte – -2,23 % (28. Februar 2023: -2,07 %)</b>		
4.493 Freddie Mac Pool „SD8277“, 5,500 %, fällig 01.12.2052	4.441	2,14	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-4.628	-2,23
9.137 Ginnie Mae II Pool „MA8348“, 5,000 %, fällig 20.10.2052	8.908	4,29	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>	<b>-4.628</b>	<b>-2,23</b>
546 Ginnie Mae II Pool „MA8879“, 5,500 %, fällig 20.05.2053	541	0,26	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	<b>204.417</b>	<b>98,39</b>
<b>Gesamtbetrag hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 28.546 USD)</b>	<b>28.290</b>	<b>13,61</b>	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>	<b>3.357</b>	<b>1,61</b>
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 0,93 % (28. Februar 2023: 6,05 %)</b>			<b>Gesamtnettvermögen</b>	<b>207.774\$</b>	<b>100,00</b>
<b>Mexiko – 0,93 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
3.110 Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig 28.01.2060	1.927	0,93			
<b>Gesamtbetrag Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 1.957 USD)</b>	<b>1.927</b>	<b>0,93</b>			
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 81,25 % (28. Februar 2023: 78,56 %)</b>					
<b>Australien – 3,97 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
AUD 12.830 Australische Staatsanleihe, Serie 137, 2,750 %, fällig 21.04.2024	8.247	3,97			
<b>Brasilien – 4,97 % (28. Februar 2023: 5,44 %)</b>					
BRL 17.220 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2027	3.443	1,66			
BRL 8.110 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2029	1.587	0,76			
BRL 9.230 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2031	1.776	0,85			
BRL 18.590 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2033	3.526	1,70			
	10.332	4,97			
<b>Kolumbien – 5,85 % (28. Februar 2023: 5,87 %)</b>					
COP 14.690.000 Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig 26.03.2031	2.981	1,43			
COP 37.980.000 Kolumbianische TES, Serie B, 9,250 %, fällig 28.05.2042	8.069	3,88			
COP 6.640.000 Kolumbianische TES, Serie B, 7,250 %, fällig 26.10.2050	1.114	0,54			
	12.164	5,85			
<b>Deutschland – 3,93 % (28. Februar 2023: 5,84 %)</b>					
EUR 7.540 Deutschland Schatzanweisung, Nullkupon, fällig 20.09.2023	8.163	3,93			
<b>Mexiko – 11,81 % (28. Februar 2023: 12,40 %)</b>					
MXN 120.200 Mexikanische Bonos, Serie M, 8,500 %, fällig 18.11.2038	6.549	3,15			
MXN 120.900 Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	6.060	2,92			
MXN 84.600 Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	4.317	2,08			
MXN 150.200 Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	7.602	3,66			
	24.528	11,81			
<b>Neuseeland – 0,73 % (28. Februar 2023: 0,82 %)</b>					
NZD 3.860 Neuseeländische Staatsanleihe, Serie 0551, 2,750 %, fällig 15.05.2051	1.516	0,73			
<b>Norwegen – 4,26 % (28. Februar 2023: 0,74 %)</b>					
NOK 94.800 Norwegische Staatsanleihe, Serie 476, 144A, 3,000 %, fällig 14.03.2024	8.860	4,26			
<b>Russland – 0,13 % (28. Februar 2023: 0,03 %)</b>					
RUB 83.000 Russische Föderale Anleihe – OFZ, 0,000 %, fällig 0/04/2030 <sup>†</sup>	260	0,13			
<b>Südafrika – 4,55 % (28. Februar 2023: 3,69 %)</b>					
ZAR 108.600 Staatsanleihe der Republik Südafrika, Serie R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	3.394	1,64			
ZAR 158.100 Staatsanleihe der Republik Südafrika, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	6.050	2,91			
	9.444	4,55			
<b>Vereinigtes Königreich – 10,14 % (28. Februar 2023: 0,76 %)</b>					
GBP 9.560 Vereinigtes Königreich Gilt, 3,250 %, fällig 31.01.2033	11.090	5,34			
GBP 16.390 Vereinigtes Königreich Gilt, 1,250 %, fällig 31.07.2051	9.978	4,80			
	21.068	10,14			
<b>USA – 30,91 % (28. Februar 2023: 28,57 %)</b>					
2.460 Variabel verzinsliche US-Schatzanweisung – Wenn emittiert, 4,931 %, fällig 31.01.2025 *	2.464	1,19			
4.840 Variabel verzinsliche US-Schatzanweisung – Wenn emittiert, 5,498 %, fällig 31.07.2025 *	4.836	2,33			
5.860 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2032	4.926	2,37			
26.690 United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 15.02.2033	25.422	12,24			
9.140 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051	5.618	2,70			
16.820 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	11.352	5,46			
12.050 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	9.607	4,62			
	64.225	30,91			
<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 183.459 USD)</b>	<b>168.807</b>	<b>81,25</b>			

– 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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 8.860.000 USD und machten 4,26 % des Nettovermögens aus.

\* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.

† Nicht liquide.

‡ Aufgrund der Unsicherheit der Zinszahlungen fallen während und/oder nach dem zum 31. August 2023 endenden Finanzzeitraum keine Erträge mehr an.

**ABKÜRZUNGEN:**

AUD	– Australischer Dollar
BRL	– Brasilianischer Real
COP	– Kolumbianischer Peso
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund
MXN	– Mexikanischer Peso
NOK	– Norwegische Krone
NZD	– Neuseeländischer Dollar
RUB	– Russischer Rubel
ZAR	– Südafrikanischer Rand

	% des Gesamtvermögens
<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	93,53
Organismen für gemeinsame Anlagen	4,17
Finanzderivate	0,54
Sonstige Vermögenswerte	1,76
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

# FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
01. Sep. 2023	HSBC	Kauf	USD	517	Verkauf	GBP	400	\$ 10
01. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf	USD	10.512	Verkauf	GBP	8.440	-180
01. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf	USD	18.481	Verkauf	GBP	14.430	202
01. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf	GBP	670	Verkauf	USD	852	-3
01. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf	GBP	3.560	Verkauf	USD	4.425	85
01. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf	GBP	3.350	Verkauf	USD	4.206	38
01. Sep. 2023	National Australia Bank	Kauf	USD	301	Verkauf	GBP	230	10
01. Sep. 2023	UBS	Kauf	GBP	370	Verkauf	USD	471	-3
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	-	Verkauf	GBP	-	-
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	15	Verkauf	USD	16	-
11. Sep. 2023	Barclays	Kauf	INR	527.000	Verkauf	USD	6.397	-30
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	31	Verkauf	AUD	60	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	329	Verkauf	AUD	304	-1
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	43	Verkauf	CAD	72	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	450	Verkauf	CAD	366	-3
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	1.365	Verkauf	CNY	5.941	-4
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	130	Verkauf	CNY	1.175	2
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	6	Verkauf	DKK	61	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	73	Verkauf	DKK	304	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	7.331	Verkauf	EUR	4.072	-46
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	694	Verkauf	EUR	805	6
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	ILS	1	Verkauf	GBP	-	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	5	Verkauf	GBP	3	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	ILS	3	Verkauf	GBP	1	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	71	Verkauf	GBP	61	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	1	Verkauf	GBP	-	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	MXN	50	Verkauf	GBP	2	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	JPY	5.933	Verkauf	GBP	33	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	7	Verkauf	GBP	-	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	1	Verkauf	GBP	1	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	DKK	7	Verkauf	GBP	1	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	PLN	-	Verkauf	GBP	-	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	1.112	Verkauf	GBP	532	-11
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NOK	1	Verkauf	GBP	-	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	113	Verkauf	GBP	89	1
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NOK	4	Verkauf	GBP	-	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CNY	127	Verkauf	GBP	14	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	PLN	6	Verkauf	GBP	1	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	6	Verkauf	GBP	3	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	6	Verkauf	ILS	30	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	68	Verkauf	ILS	153	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	301	Verkauf	JPY	54.393	7
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	3.180	Verkauf	JPY	275.031	2
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	22	Verkauf	MXN	479	-1
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	228	Verkauf	MXN	2.422	-6
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	3	Verkauf	NOK	46	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	38	Verkauf	NOK	237	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	DKK	50	Verkauf	NZD	12	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	87	Verkauf	NZD	186	-1
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	-	Verkauf	NZD	-	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	JPY	45.839	Verkauf	NZD	533	-2
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1.067	Verkauf	NZD	1.796	-3
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	43	Verkauf	NZD	46	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	55	Verkauf	NZD	70	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CNY	989	Verkauf	NZD	230	-1
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	MXN	392	Verkauf	NZD	38	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	PLN	46	Verkauf	NZD	19	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	JPY	234	Verkauf	NZD	3	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NOK	40	Verkauf	NZD	6	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	14	Verkauf	NZD	17	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	50	Verkauf	NZD	8	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	ILS	26	Verkauf	NZD	11	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	6	Verkauf	NZD	10	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	663	Verkauf	NZD	1.218	-8
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	-	Verkauf	NZD	-	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	114	Verkauf	PLN	283	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	11	Verkauf	PLN	56	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	46	Verkauf	SEK	296	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	4	Verkauf	SEK	58	-
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	9	Verkauf	SGD	15	-

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)			
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	101	Verkauf	SGD	82	\$	–
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	10.687	Verkauf	USD	6.517		-144
12. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.012	Verkauf	USD	1.288		-8
13. Sep. 2023	Citi	Kauf	USD	13.380	Verkauf	KRW	17.882.700		-145
13. Sep. 2023	Citi	Kauf	KRW	17.882.700	Verkauf	USD	13.781		-257
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	EUR	–		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	7	Verkauf	GBP	5		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	1	Verkauf	USD	1		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	36	Verkauf	USD	46		–
19. Sep. 2023	Goldman Sachs	Kauf	JPY	124.000	Verkauf	USD	892		-37
19. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf	JPY	6.546.000	Verkauf	USD	47.617		-2.489
19. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf	JPY	160.000	Verkauf	USD	1.164		-61
19. Sep. 2023	UBS	Kauf	JPY	122.000	Verkauf	USD	853		-12
22. Sep. 2023	HSBC	Kauf	USD	2.353	Verkauf	NOK	25.200		-18
22. Sep. 2023	HSBC	Kauf	USD	1.794	Verkauf	NOK	18.800		25
22. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf	NOK	43.600	Verkauf	USD	4.055		49
22. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf	NOK	66.300	Verkauf	USD	6.268		-27
22. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	4.690	Verkauf	NOK	46.900		276
22. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf	NOK	3.100	Verkauf	USD	300		-8
26. Sep. 2023	Barclays	Kauf	USD	3.756	Verkauf	NZD	6.180		70
26. Sep. 2023	Barclays	Kauf	NZD	4.490	Verkauf	USD	2.784		-106
29. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf	NOK	6.100	Verkauf	USD	567		8
29. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf	NOK	34.500	Verkauf	USD	3.321		-72
17. Okt. 2023	Goldman Sachs	Kauf	MYR	30.300	Verkauf	USD	6.706		-151
19. Okt. 2023	HSBC	Kauf	USD	4.938	Verkauf	BRL	24.070		113
19. Okt. 2023	HSBC	Kauf	BRL	12.330	Verkauf	USD	2.571		-99
27. Okt. 2023	Citi	Kauf	USD	22.072	Verkauf	MXN	377.100		187
27. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	MXN	62.400	Verkauf	USD	3.653		-32
30. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf	USD	2.532	Verkauf	COP	10.340.000		48
30. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf	USD	4.380	Verkauf	COP	18.570.000		-81
07. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	EUR	17.710	Verkauf	USD	19.592		-324
07. Nov. 2023	Standard Chartered Bank	Kauf	EUR	6.600	Verkauf	USD	7.202		-21
10. Nov. 2023	HSBC	Kauf	USD	2.310	Verkauf	THB	81.800		-42
10. Nov. 2023	HSBC	Kauf	THB	81.800	Verkauf	USD	2.380		-28
15. Nov. 2023	HSBC	Kauf	USD	1.065	Verkauf	ZAR	20.400		-8
06. Dez. 2023	JP Morgan	Kauf	AUD	2.100	Verkauf	USD	1.355		11
08. Dez. 2023	JP Morgan	Kauf	USD	20.281	Verkauf	GBP	16.130		-155
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 1.448\$)							\$	1.150	
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-4.239)								-4.628	
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-2.791)							\$	-3.478	

# FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 9,94 % (28. Februar 2023: 17,87 %)</b>			<b>Tschechische Republik – 0,42 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
1.945 Bellemeade Re 2020-3 Ltd, Serie 2020 3A, Klasse M1C, 144A, 9,129 %, fällig 25.10.2030 *	1.966	0,17	4.850 Allwyn Entertainment Financing UK Plc, 144A, 7,875 %, fällig 30.04.2029	4.947	0,42
6.100 Bellemeade Re 2020-3 Ltd, Serie 2020 3A, Klasse M2, 144A, 10,279 %, fällig 25.10.2030 *	6.363	0,54	<b>Deutschland – 6,81 % (28. Februar 2023: 0,35 %)</b>		
3.429 Bellemeade Re Ltd, Serie 2021 2A, Klasse M1A, 144A, 6,488 %, fällig 25.06.2031 *	3.422	0,29	19.300 Kreditanstalt für Wiederaufbau, 2,625 %, fällig 28.02.2024	19.036	1,61
220 COMM 2017-PANW Mortgage Trust, Serie 2017 PANW, Klasse D, 144A, 4,343 %, fällig 10.10.2029 *	193	0,02	20.000 Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,250 %, fällig 08.03.2024	19.481	1,64
11.135 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Serie 2020 SBT1, Klasse 1M2, 144A, 9,052 %, fällig 25.02.2040 *	11.529	0,97	41.200 Kreditanstalt für Wiederaufbau, 0,375 %, fällig 18.07.2025	37.870	3,19
12.085 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Serie 2020 SBT1, Klasse 2M2, 144A, 9,052 %, fällig 25.02.2040 *	12.522	1,06	4.485 Siemens Finanzierungsmaatschappij NV, 144A, 0,650 %, fällig 11.03.2024	4.372	0,37
227 Eagle RE 2021-1 Ltd, Serie 2021 1, Klasse M1C, 144A, 7,988 %, fällig 25.10.2033 *	228	0,02	80.759	6,81	
7.602 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C02, Klasse 2M2C, 9,052 %, fällig 25.09.2029 *	7.884	0,67	<b>Irland – 1,34 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
2.349 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C06, Klasse 2M2, 8,202 %, fällig 25.02.2030 *	2.413	0,20	4.670 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 4,250 %, fällig 15.04.2026	4.407	0,37
2.518 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA4, Serie 2020 HQA4, Klasse B1, 144A, 10,652 %, fällig 25.09.2050 *	2.700	0,23	2.540 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 6,375 %, fällig 04.05.2028	2.522	0,21
3.000 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-HQA2, Serie 2021 HQA2, Klasse B1, 144A, 8,438 %, fällig 25.12.2033 *	2.954	0,25	8.900 GGAM Finance Ltd, 144A, 7,750 %, fällig 15.05.2026	8.928	0,76
1.666 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Serie 2019 DNA3, Klasse M2, 144A, 7,452 %, fällig 25.07.2049 *	1.673	0,14	15.857	1,34	
5.855 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2020 HQA5, Klasse B1, 144A, 9,288 %, fällig 25.11.2050 *	6.098	0,51	<b>Israel – 1,35 % (28. Februar 2023: 0,76 %)</b>		
11.538 Ginnie Mae II Pool „MA8645“, 4,000 %, fällig 20.02.2053	10.755	0,91	6.120 Energian Israel Finance Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 30.03.2024	6.068	0,51
24.124 Ginnie Mae II Pool „MA8646“, 4,500 %, fällig 20.02.2053	23.001	1,94	6.925 Energian Israel Finance Ltd, 144A, 4,875 %, fällig 30.03.2026	6.512	0,55
20.742 Ginnie Mae II Pool „MA8801“, 5,500 %, fällig 20.04.2053	20.542	1,73	3.490 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,125 %, fällig 30.06.2025	3.425	0,29
29 Home RE 2021-1 Ltd, Serie 2021 1, Klasse M1B, 144A, 6,979 %, fällig 25.07.2033 *	29	-	16.005	1,35	
3.232 STACR Trust 2018-HRP2, Serie 2018 HRP2, Klasse B1, 144A, 9,602 %, fällig 25.02.2047 *	3.439	0,29	<b>Japan – 0,75 % (28. Februar 2023: 0,73 %)</b>		
<b>Gesamtbetrag hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 118.663 USD)</b>			117.711	9,94	
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 62,96 % (28. Februar 2023: 58,40 %)</b>			<b>Luxemburg – 0,57 % (28. Februar 2023: 0,79 %)</b>		
<b>Argentinien – 0,22 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			9.715 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 4,345 %, fällig 17.09.2027	8.908	0,75
2.662 YPF SA, 9,000 %, fällig 12.02.2026	2.627	0,22	<b>Mexiko – 0,20 % (28. Februar 2023: 0,24 %)</b>		
<b>Australien – 0,03 % (28. Februar 2023: 0,40 %)</b>			3.770 Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, fällig 15.11.2029	2.390	0,20
AUD 730 NBN Co Ltd, 2,200 %, fällig 16.12.2030	380	0,03	<b>Norwegen – 0,39 % (28. Februar 2023: 0,37 %)</b>		
<b>Bermudas – 0,20 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			1.410 Var Energi ASA, 144A, 7,500 %, fällig 15.01.2028	1.466	0,13
2.460 RenaissanceRe Holdings Ltd, 5,750 %, fällig 05.06.2033	2.392	0,20	2.915 Var Energi ASA, 144A, 8,000 %, fällig 15.11.2032	3.109	0,26
<b>Brasilien – 2,13 % (28. Februar 2023: 2,47 %)</b>			4.575	0,39	
1.880 Amaggi Luxembourg International Sarl, 5,250 %, fällig 28.01.2028	1.715	0,14	<b>Panama – 0,29 % (28. Februar 2023: 0,29 %)</b>		
4.710 Banco do Brasil SA/Cayman, 144A, 3,250 %, fällig 30.09.2026	4.340	0,37	3.920 AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig 31.05.2030	3.393	0,29
1.200 Banco do Brasil SA/Cayman, 144A, 6,250 %, fällig 18.04.2030	1.192	0,10	<b>Supranational – 0,53 % (28. Februar 2023: 1,11 %)</b>		
6.645 Rumo Luxembourg Sarl, 144A, 4,200 %, fällig 18.01.2032	5.401	0,46	61.000 International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, fällig 22.01.2026	3.117	0,26
13.775 XP Inc, 144A, 3,250 %, fällig 01.07.2026	12.544	1,06	17.100 International Bank for Reconstruction & Development, 5,000 %, fällig 22.01.2026	3.172	0,27
25.192	2,13		6.289	0,53	
<b>Kanada – 3,90 % (28. Februar 2023: 2,19 %)</b>			<b>Schweiz – 0,95 % (28. Februar 2023: 0,15 %)</b>		
3.479 Air Canada 2015-1 Klasse A Pass Through Trust, 144A, 3,600 %, fällig 15.03.2027	3.248	0,27	1.930 UBS AG/London, 144A, 0,700 %, fällig 09.08.2024	1.841	0,16
7.349 Air Canada 2020-2 Klasse A Pass Through Trust, 144A, 5,250 %, fällig 01.04.2029	7.162	0,61	9.040 UBS Group AG, 144A, 6,537 %, fällig 12.08.2033 *	9.393	0,79
5.590 Antares Holdings LP, 144A, 2,750 %, fällig 15.01.2027	4.741	0,40	11.234	0,95	
6.000 Baytex Energy Corp, 144A, 8,500 %, fällig 30.04.2030	6.089	0,51	<b>Vereinigtes Königreich – 1,15 % (28. Februar 2023: 1,17 %)</b>		
11.190 Hudbay Minerals Inc, 144A, 4,500 %, fällig 01.04.2026	10.573	0,89	2.220 Ashtead Capital Inc, 144A, 5,500 %, fällig 11.08.2032	2.117	0,18
8.930 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	8.245	0,70	5.610 HSBC Holdings Plc, 4,292 %, fällig 12.09.2026 *	5.413	0,46
6.600 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	6.134	0,52	1.075 Nationwide Building Society, 5,750 %, ohne Laufzeitbegrenzung*	1.178	0,10
46.192	3,90		3.625 NatWest Group Plc, 4,600 %, unbefristet *	2.477	0,21
<b>Chile – 0,79 % (28. Februar 2023: 0,99 %)</b>			2.900 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	2.427	0,20
6.680 ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig 27.04.2026	5.851	0,49	13.612	1,15	
4.219 Kenbourne Invest SA, 6,875 %, fällig 26.11.2024	3.551	0,30	<b>USA – 38,11 % (28. Februar 2023: 42,28 %)</b>		
9.402	0,79		3.665 Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250 %, fällig 15.02.2026	3.687	0,31
<b>China – 0,05 % (28. Februar 2023: 1,27 %)</b>			5.100 Air Lease Corp, 0,800 %, fällig 18.08.2024	4.853	0,41
705 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 3,400 %, fällig 01.05.2030	620	0,05	6.857 Alaska Airlines 2020-1 Klasse A Pass Through Trust, 144A, 4,800 %, fällig 15.08.2027	6.639	0,56
<b>Kolumbien – 1,00 % (28. Februar 2023: 0,95 %)</b>			5.515 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.08.2026	5.163	0,44
3.715 Ecopetrol SA, 4,125 %, fällig 16.01.2025	3.604	0,30	435 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	373	0,03
3.100 Ecopetrol SA, 8,875 %, fällig 13.01.2033	3.145	0,27	1.890 Ares Capital Corp, 3,250 %, fällig 15.07.2025	1.774	0,15
1.860 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	1.313	0,11	9.063 Ares Capital Corp, 2,150 %, fällig 15.07.2026	7.972	0,67
4.420 Geopark Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 17.01.2027	3.825	0,32	2.530 Ares Capital Corp, 2,875 %, fällig 15.06.2028	2.136	0,18
11.887	1,00		11.980 Athene Global Funding, 144A, 0,914 %, fällig 19.08.2024	11.384	0,96

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert		
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)</b>							
<b>USA – (Fortsetzung)</b>							
7.945	Bain Capital Specialty Finance Inc, 2,950 %, fällig 10.03.2026	7.118	0,60	987	Synchrony Financial, 4,250 %, fällig 15.08.2024	962	0,08
9.170	Blackstone Secured Lending Fund, 2,125 %, fällig 15.02.2027	7.785	0,66	4.515	Synchrony Financial, 4,875 %, fällig 13.06.2025	4.357	0,37
2.645	Blackstone Secured Lending Fund, 2,850 %, fällig 30.09.2028	2.188	0,19	4.065	Synchrony Financial, 7,250 %, fällig 02.02.2033	3.741	0,32
4.645	Block Financial LLC, 3,875 %, fällig 15.08.2030	4.106	0,35	2.282	Syneos Health Inc, 144A, 3,625 %, fällig 15.01.2029	2.278	0,19
1.160	Blue Owl Capital Corp, 4,000 %, fällig 30.03.2025	1.104	0,09	5.600	Talos Production Inc, 12,000 %, fällig 15.01.2026	5.844	0,49
4.330	Blue Owl Capital Corp, 2,625 %, fällig 15.01.2027	3.757	0,32	4.315	Travel + Leisure Co, 144A, 6,625 %, fällig 31.07.2026	4.286	0,36
5.515	Blue Owl Credit Income Corp, 3,125 %, fällig 23.09.2026	4.865	0,41	3.399	Uber Technologies Inc, 144A, 8,000 %, fällig 01.11.2026	3.464	0,29
2.550	Blue Owl Credit Income Corp, 7,750 %, fällig 16.09.2027	2.537	0,21	4.080	Univision Communications Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.06.2027	3.954	0,33
4.040	Blue Owl Technology Finance Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.12.2025	3.741	0,32	8.100	Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125 %, fällig 01.06.2028	8.178	0,69
10.861	Blue Owl Technology Finance Corp, 144A, 3,750 %, fällig 17.06.2026	9.617	0,81	7.940	Viasat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.04.2027	7.101	0,60
4.105	Broadcom Inc, 144A, 1,950 %, fällig 15.02.2028	3.563	0,30	4.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.06.2025	3.875	0,33
2.170	Capital One Financial Corp, 6,312 %, fällig 08.06.2029 *	2.170	0,18	7.500	Viking Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 15.05.2025	7.394	0,62
4.350	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 2,742 %, fällig 31.12.2039	3.373	0,29	5.955	Vontier Corp, 1,800 %, fällig 01.04.2026	5.354	0,45
7.540	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.03.2026	7.369	0,62	5.240	Vontier Corp, 2,400 %, fällig 01.04.2028	4.375	0,37
2.310	Citigroup Inc, 6,174 %, fällig 25.05.2034 *	2.303	0,19	13.920	Vontier Corp, 2,950 %, fällig 01.04.2031	11.044	0,93
4.900	Civitas Resources Inc, 144A, 8,375 %, fällig 01.07.2028	5.053	0,43	2.531	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2025	2.503	0,21
11.635	CommScope Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.07.2028	6.494	0,55			451.531	38,11
6.860	Consolidated Communications Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.10.2028	5.147	0,43	<b>Sambia – 1,78 % (28 February 2023: 1,50 %)</b>			
1.800	Credit Acceptance Corp, 144A, 5,125 %, fällig 31.12.2024	1.755	0,15	5.970	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 01.03.2026	5.890	0,50
10.105	Credit Acceptance Corp, 6,625 %, fällig 15.03.2026	9.847	0,83	15.590	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2027	15.198	1,28
813	Dell International LLC / EMC Corp, 6,020 %, fällig 15.06.2026	822	0,07			21.088	1,78
3.761	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 20.10.2025	3.678	0,31	<b>Gesamtbetrag Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 819.427 USD)</b>			
12.530	Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15.07.2041	11.650	0,98			746.054	62,96
27.582	DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026	16.825	1,42	<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 19,05 % (28. Februar 2023: 11,58 %)</b>			
2.670	Enviri Corp, 144A, 5,750 %, fällig 31.07.2027	2.318	0,20	<b>Brasilien – 4,88 % (28. Februar 2023: 3,45 %)</b>			
2.530	FedEx Corp, 0,450 %, fällig 04.05.2029	2.263	0,19	BRL 305.120	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2033	57.868	4,88
2.390	Ford Motor Credit Co LLC, 3,664 %, fällig 08.09.2024	2.321	0,20	<b>Kolumbien – 4,77 % (28. Februar 2023: 2,95 %)</b>			
3.411	Ford Motor Credit Co LLC, 2,300 %, fällig 10.02.2025	3.208	0,27	COP 278.653.000	Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig 26.03.2031	56.547	4,77
5.010	Ford Motor Credit Co LLC, 6,950 %, fällig 10.06.2026	5.021	0,42	<b>Peru – 1,92 % (28 Februar 2023: 0,00 %)</b>			
6.000	Freedom Mortgage Corp, 144A, 8,250 %, fällig 15.04.2025	5.919	0,50	PEN 86.490	Staatsanleihe von Peru, 6,150 %, fällig 12.08.2032	22.700	1,92
5.215	FS KKR Capital Corp, 3,125 %, fällig 12.10.2028	4.265	0,36	<b>USA – 7,48 % (28. Februar 2023: 0,56 %)</b>			
3.545	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, fällig 12.02.2026 *	3.291	0,28	53.100	Variabel verzinsliche US-Schatzanweisung – Wenn emittiert, 4,931 %, fällig 31.01.2025 *	53.183	4,49
7.270	Golub Capital BDC Inc, 2,500 %, fällig 24.08.2026	6.395	0,54	37.200	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 15.02.2033	35.433	2,99
6.560	Golub Capital BDC Inc, 2,050 %, fällig 15.02.2027	5.552	0,47			88.616	7,48
13.773	Graham Packaging Co Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15.08.2028	12.026	1,02	<b>Gesamtbetrag Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 207.635 USD)</b>			
4.090	HCA Inc, 5,000 %, fällig 15.03.2024	4.067	0,34			225.731	19,05
11.040	Hyundai Capital America, 144A, 2,000 %, fällig 15.06.2028	9.322	0,79	<b>Schuldscheine – 0,44 % (28 Februar 2023: 0,43 %)</b>			
2.247	IRB Holding Corp, 144A, 7,000 %, fällig 15.06.2025	2.249	0,19	5.211	Flutter Financing BV, 8,753 %, fällig 04.07.2028 *	5.221	0,44
7.470	KeyBank NA/Cleveland OH, Serie BKNT, 5,535 %, fällig 14.06.2024 *	7.320	0,62	<b>Gesamtbetrag Schuldscheine (Anschaffungskosten 5.109 USD)</b>			
6.580	Level 3 Financing Inc, 144A, 3,750 %, fällig 15.07.2029	3.932	0,33			5.221	0,44
1.025	Liberty Interactive LLC, 8,250 %, fällig 01.02.2030	399	0,03	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 5,18 % (28. Februar 2023: 7,05 %)</b>			
12.100	Main Street Capital Corp, 3,000 %, fällig 14.07.2026	10.741	0,91	61.400	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	61.400	5,18
4.633	MasTec Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.08.2028	4.232	0,36	<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 61.400\$)</b>			
6.945	MicroStrategy Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.06.2028	6.224	0,53			61.400	5,18
11.300	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	11.272	0,95	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 1.212.234\$)</b>			
8.820	Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 8,000 %, fällig 01.02.2026	8.222	0,69	<b>Devisenterminkontrakte – 0,22 % (28. Februar 2023: 0,29 %)</b>			
18.660	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.09.2025	18.054	1,52	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			
4.880	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, fällig 30.09.2026	4.540	0,38			2.658	0,22
3.830	Nexstar Media Inc, 144A, 4,750 %, fällig 01.11.2028	3.364	0,28	<b>Futures – 0,52 % (28 Februar 2023: 0,00 %)</b>			
1.705	Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 2,750 %, fällig 09.03.2028	1.442	0,12	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			
3.255	Nordstrom Inc, 2,300 %, fällig 08.04.2024	3.155	0,27			6.156	0,52
5.345	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC, 144A, 4,000 %, fällig 15.10.2027	4.812	0,41	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>			
7.265	PRA Group Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.10.2029	5.486	0,46			1.164.931	98,31
1.640	Regal Rexnord Corp, 144A, 6,300 %, fällig 15.02.2030	1.634	0,14	<b>Credit Default Swaps – -0,82 % (28. Februar 2023: -0,07 %)</b>			
1.640	Regal Rexnord Corp, 144A, 6,400 %, fällig 15.04.2033	1.626	0,14	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			
4.430	ROBLOX Corp, 144A, 3,875 %, fällig 01.05.2030	3.659	0,31			-9.769	-0,82
890	Seagate HDD Cayman, 4,125 %, fällig 15.01.2031	728	0,06	<b>Devisenterminkontrakte – -0,95 % (28. Februar 2023: -1,02 %)</b>			
12.350	Sealed Air Corp, 144A, 1,573 %, fällig 15.10.2026	10.861	0,92	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			
11.638	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC, 144A, 5,152 %, fällig 20.03.2028	11.541	0,97			-11.294	-0,95
4.870	Stellantis Finance US Inc, 144A, 6,375 %, fällig 12.09.2032	4.875	0,41	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>			
5.954	Synchrony Bank, 5,625 %, fällig 23.08.2027	5.637	0,48			-21.063	-1,77
				<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>			
						1.143.868	96,54
				<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>			
						41.085	3,46
				<b>Gesamtneuvermögen</b>			
						1.184.953\$	100,00

# FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

- Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.
- 144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 481.610.000 USD und machten 40,66 % des Nettovermögens aus.
- \* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.

### ABKÜRZUNGEN:

- Unbefristet – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Anleihen ohne Laufzeitbegrenzung sind nicht kündbar, liefern aber stetige Zinserträge.
- REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit.
- AUD – Australischer Dollar
- BRL – Brasilianischer Real
- COP – Kolumbianischer Peso
- EUR – Euro
- GBP – Britisches Pfund
- MXN – Mexikanischer Peso
- PEN – Peruanischer New Sol

### Verteilung des Gesamtvermögens

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	89,91
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	0,43
Organismen für gemeinsame Anlagen	5,07
Finanzderivate	0,73
Sonstige Vermögenswerte	3,86
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

### Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Citi	iTraxx Europe, 5,000 % – Kauf	20. Jun. 2028	104.320	\$ -4.546
JP Morgan	Altice France SA, 5,000 % – Verkauf	20. Jun. 2026	15.700	-2.211
JP Morgan	Altice France SA, 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2025	3.390	-379
JP Morgan	Altice France SA, 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2025	1.605	-179
JP Morgan	Altice Luxembourg SA, 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2025	1.605	-772
JP Morgan	Altice Luxembourg SA, 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2025	3.495	-1.682
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tausend): 1.309\$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-878)				-9.769
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tausend): 431\$)				\$ -9.769

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD 2.425	Verkauf	BRL 11.875	\$ 30
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD 64	Verkauf	EUR 59	–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD 204	Verkauf	GBP 160	1
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD 13	Verkauf	HKD 100	–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD 78	Verkauf	SGD 105	–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	HKD –	Verkauf	USD –	–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	BRL 11.875	Verkauf	USD 2.503	-107
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP 9	Verkauf	USD 12	–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR 18	Verkauf	USD 18	–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD 147	Verkauf	USD 109	–
06. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD 9	Verkauf	SGD 12	–
06. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD 51	Verkauf	USD 39	–
13. Sep. 2023	Citi	Kauf	USD 24.086	Verkauf	KRW 30.900.000	718
13. Sep. 2023	Citi	Kauf	KRW 30.900.000	Verkauf	USD 23.819	-451
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD 822	Verkauf	EUR 759	-3
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD 3.301	Verkauf	EUR 3.025	19
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD –	Verkauf	GBP –	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD 13	Verkauf	GBP 10	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD 516	Verkauf	SGD 700	-2
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD 466	Verkauf	SGD 626	1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD 461	Verkauf	USD 341	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CNH 10.176	Verkauf	USD 1.412	-12
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CZK 710	Verkauf	USD 32	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR 321	Verkauf	USD 347	1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD 8.711	Verkauf	USD 5.695	-48
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP 32.035	Verkauf	USD 40.791	-209
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD 82.168	Verkauf	USD 61.146	-304
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK 25.741	Verkauf	USD 2.414	-61
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR 385.707	Verkauf	USD 424.345	-5.799
19. Sep. 2023	Barclays	Kauf	JPY 5.335.000	Verkauf	USD 37.488	-708
19. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf	JPY 4.938.000	Verkauf	USD 35.920	-1.877

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
03. Okt. 2023	BNY Mellon	Kauf	BRL 11.655	Verkauf	USD 2.370	\$ -29
19. Okt. 2023	HSBC	Kauf	USD 62.800	Verkauf	BRL 307.530	1.156
19. Okt. 2023	HSBC	Kauf	BRL 110.290	Verkauf	USD 22.315	-207
27. Okt. 2023	Citi	Kauf	USD 3.149	Verkauf	MXN 53.800	27
27. Okt. 2023	HSBC	Kauf	USD 22.525	Verkauf	MXN 396.200	-469
27. Okt. 2023	HSBC	Kauf	USD 26.825	Verkauf	MXN 460.400	105
27. Okt. 2023	HSBC	Kauf	MXN 495.600	Verkauf	USD 28.892	-129
27. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf	MXN 414.800	Verkauf	USD 24.111	-38
30. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf	USD 12.971	Verkauf	COP 55.490.000	-360
30. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf	COP 55.490.000	Verkauf	USD 13.700	-369
07. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	USD 36.319	Verkauf	EUR 32.830	600
07. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	EUR 32.830	Verkauf	USD 35.831	-112
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 3.510\$)						\$ 2.658
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-12.389)						-11.294
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-8.879)						\$ -8.636

## Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
Japanische 10-jährige Anleihe (OSE), September 2023	Citi	-125	\$ (126.138)	\$ 1.104
US 10 -Jahres-Ultra Note Dezember 2023	Citi	1.933	224.439	2.591
US-5-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Citi	1.371	146.590	1.053
US Ultra Bond (CBT) Dezember 2023	Citi	831	107.588	1.408
Nicht realisierte Wertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): – USD)				\$ 6.156
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-3.704)				–
Netto-Wertzuwachs von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-3.704)				\$ 6.156

# FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 54,40 % (28. Februar 2023: 81,49 %)</b>			<b>USA – 17,40 % (28. Februar 2023: 0,81 %)</b>		
932	983	2,95	3.290	3.295	9,91
1.354	1.396	4,20	2.490	2.491	7,49
570	572	1,72	5.418	5.786	17,40
878	923	2,77	<b>Gesamtbetrag Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 6.384 USD)</b>		
1.439	1.423	4,28	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,89 % (28. Februar 2023: 4,74 %)</b>		
866	821	2,47	630 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		
1.428	1.433	4,31	<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 6305)</b>		
1.724	1.859	5,59	<b>Stammaktien – 0,05 % (28. Februar 2023: 0,05 %)</b>		
1.054	1.173	3,52	<b>USA – 0,05 % (28. Februar 2023: 0,05 %)</b>		
1.425	1.547	4,65	8 Danimer Scientific Inc.		
1.550	1.534	4,61	<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 5345)</b>		
29.940	711	2,14	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 32.9915)</b>		
EUR 600	335	1,01	<b>Credit Default Swaps – 0,20 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
EUR 874	887	2,66	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
316	317	0,95	<b>Devisenterminkontrakte – 0,47 % (28. Februar 2023: 0,86 %)</b>		
1.015	1.080	3,25	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
645	511	1,54	<b>Futures – 0,05 % (28. Februar 2023: 0,15 %)</b>		
49.589	592	1,78	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
<b>Gesamtbetrag hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 17.907 USD)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
	18.097	54,40	32.937 99,00		
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 22,68 % (28. Februar 2023: 7,23 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – -0,71 % (28. Februar 2023: -0,81 %)</b>		
<b>Kanada – 1,72 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
250	256	0,77	<b>Futures – -0,53 % (28. Februar 2023: -0,38 %)</b>		
340	314	0,95	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	570	1,72	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>		
<b>Kolumbien – 1,01 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			-413 -1,24		
330	337	1,01	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
<b>Mexiko – 0,95 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			32.524 97,76		
510	316	0,95	<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>		
<b>USA – 18,03 % (28. Februar 2023: 6,78 %)</b>			742 2,24		
270	239	0,72	<b>Gesamtvermögen</b>		
360	353	1,06	33.266\$ 100,00		
170	137	0,41	– 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 %.		
270	256	0,77	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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 15.042.000 USD und machten 45,22 % des Nettovermögens aus.		
250	244	0,73	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.		
410	417	1,25	<b>ABKÜRZUNGEN:</b>		
400	356	1,07	REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit		
350	348	1,05	BRL – Brasilianischer Real		
420	387	1,16	COP – Kolumbianischer Peso		
330	342	1,03	EUR – Euro		
170	170	0,51	<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>		
565	548	1,65	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
1.030	1.028	3,09	Organismen für gemeinsame Anlagen		
235	211	0,63	Finanzderivate		
290	303	0,91	Sonstige Vermögenswerte		
170	172	0,52	<b>Gesamtvermögen</b>		
190	165	0,50	100,00		
170	152	0,46			
170	171	0,51			
	5.999	18,03			
<b>Sambia – 0,97 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
330	322	0,97			
<b>Gesamtbetrag Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 7.536 USD)</b>					
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 19,26 % (28. Februar 2023: 4,43 %)</b>					
<b>Brasilien – 0,92 % (28. Februar 2023: 1,90 %)</b>					
BRL 1.620	307	0,92			
<b>Kolumbien – 0,94 % (28. Februar 2023: 1,72 %)</b>					
COP 1.870.000	314	0,94			

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Citi	iTraxx Europe, 1,000 % – Kauf	20. Jun. 2028	3.030	\$ 68
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tausend): – USD)				\$ 68
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-37)				–
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-37)				\$ 68

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
01. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf	USD 1.206	Verkauf	GBP 970	\$ -23
01. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD 51	Verkauf	GBP 40	–
01. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf	GBP 780	Verkauf	USD 994	-5
01. Sep. 2023	UBS	Kauf	GBP 230	Verkauf	USD 286	5
11. Sep. 2023	Goldman Sachs	Kauf	USD 460	Verkauf	CHF 410	-5
19. Sep. 2023	Barclays	Kauf	USD 1.655	Verkauf	JPY 231.000	62
19. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf	JPY 231.000	Verkauf	USD 1.680	-88
17. Okt. 2023	Goldman Sachs	Kauf	USD 795	Verkauf	SEK 8.500	17
17. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD 385	Verkauf	SEK 4.200	1
17. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	SEK 16.900	Verkauf	USD 1.657	-110
19. Okt. 2023	HSBC	Kauf	USD 603	Verkauf	BRL 2.940	14
19. Okt. 2023	HSBC	Kauf	BRL 1.390	Verkauf	USD 276	2
27. Okt. 2023	Citi	Kauf	USD 638	Verkauf	MXN 10.900	5
27. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	MXN 5.700	Verkauf	USD 331	-1
27. Okt. 2023	Morgan Stanley	Kauf	MXN 5.200	Verkauf	USD 301	1
30. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf	USD 659	Verkauf	COP 2.690.000	13
30. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf	COP 1.280.000	Verkauf	USD 307	1
07. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	USD 1.836	Verkauf	EUR 1.660	30
17. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf	USD 1.016	Verkauf	CNH 7.320	6
17. Nov. 2023	National Australia Bank	Kauf	USD 662	Verkauf	CNH 4.830	-4
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 403\$)						\$ 157
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-379)						-236
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 24\$)						\$ -79

## Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
E-Mini Nasdaq 100 Index September 2023	Citi	-11	\$ -3.419	\$ -97
Euro-Bobl September 2023	Citi	15	1.889	-10
Japanische 10-jährige Anleihe (OSE), September 2023	Citi	-2	-2.018	18
S&P 500 Index September 2023	Citi	-14	-3.161	-70
Nicht realisierte Wertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): 69\$)				\$ 18
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-175)				-177
Netto-Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-106)				\$ -159

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert				
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 21,15 % (28. Februar 2023: 13,31 %)</b>			<b>USA – 8,61 % (28. Februar 2023: 12,74 %)</b>						
1.551	Fannie Mae Pool „MA4733“, 4,500 %, fällig 01.09.2052	1.472	2,12	5.960	Variabel verzinsliche US-Schatzanweisung – Wenn emittiert, 4,931 %, fällig 31.01.2025 *	5.969	8,61		
477	Fannie Mae Pool „MA4785“, 5,000 %, fällig 01.10.2052	463	0,67	<b>Gesamtbetrag Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 43.849 USD)</b>			42.194	60,90	
1.142	Fannie Mae Pool „MA4841“, 5,000 %, fällig 01.12.2052	1.108	1,60	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 5,46 % (28. Februar 2023: 5,60 %)</b>					
1.289	Fannie Mae Pool „MA4842“, 5,500 %, fällig 01.12.2052	1.274	1,84	30 Franklin Templeton Global Funds Plc – FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund – LM Klasse US\$ thesaurierend			3.787	5,46	
548	Freddie Mac Pool „RA7790“, 5,000 %, fällig 01.08.2052	532	0,77	<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 3.500\$)</b>			3.787	5,46	
1.120	Freddie Mac Pool „SD8245“, 4,500 %, fällig 01.09.2052	1.062	1,53	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 68.855\$)</b>			67.273	97,09	
728	Freddie Mac Pool „SD8257“, 4,500 %, fällig 01.10.2052	690	1,00	<b>Devisenterminkontrakte – 0,38 % (28. Februar 2023: 0,36 %)</b>					
587	Freddie Mac Pool „SD8267“, 5,000 %, fällig 01.11.2052	569	0,82	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			266	0,38	
1.795	Freddie Mac Pool „SD8277“, 5,500 %, fällig 01.12.2052	1.775	2,56	<b>Futures – 0,08 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
882	Ginnie Mae II Pool „MA8648“, 5,500 %, fällig 20.02.2053	874	1,26	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			55	0,08	
1.590	Ginnie Mae II Pool „MA8801“, 5,500 %, fällig 20.04.2053	1.575	2,27	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>			67.594	97,55	
1.102	Ginnie Mae II Pool „MA8879“, 5,500 %, fällig 20.05.2053	1.092	1,58	<b>Devisenterminkontrakte – -3,67 % (28. Februar 2023: -5,02 %)</b>					
1.305	Ginnie Mae II Pool „MA8947“, 5,000 %, fällig 20.06.2053	1.270	1,83	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			-2.543	-3,67	
906	Ginnie Mae II Pool „MA8948“, 5,000 %, fällig 20.06.2053	897	1,30	<b>Futures – -0,19 % (28. Februar 2023: -0,41 %)</b>					
<b>Gesamtbetrag hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 14.820 USD)</b>			14.653	21,15	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			-130	-0,19
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 9,58 % (28. Februar 2023: 7,90 %)</b>					<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>			-2.673	-3,86
<b>Australien – 2,13 % (28. Februar 2023: 4,12 %)</b>					<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>			64.921	93,69
1.470	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,955 %, fällig 14.03.2025 *	1.473	2,13	<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>			4.366	6,31	
<b>Mexiko – 3,03 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					<b>Gesamtnettvermögen</b>			69.287\$	100,00
3.390	Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig 28.01.2060	2.100	3,03	– 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 %.					
<b>USA – 4,42 % (28. Februar 2023: 3,78 %)</b>					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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.843.000 USD und machten 2,66 % des Nettovermögens aus.				
1.420	General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, fällig 06.04.2026	1.403	2,02	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 31. August 2023.					
370	Jackson National Life Global Funding, 144A, 6,403 %, fällig 28.06.2024 *	370	0,53	<b>ABKÜRZUNGEN:</b>					
1.310	Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, fällig 18.05.2026	1.293	1,87	BRL – Brasilianischer Real					
<b>Gesamtbetrag Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 6.686 USD)</b>			6.639	9,58	COP – Kolumbianischer Peso				
<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 60,90 % (28. Februar 2023: 73,60 %)</b>					CZK – Tschechische Krone				
<b>Brasilien – 12,72 % (28. Februar 2023: 11,00 %)</b>					MXN – Mexikanischer Peso				
BRL	25.420	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN-F, 10,000 %, fällig 01.01.2029	4.976	7,18	ZAR – Südafrikanischer Rand				
BRL	19.930	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN-F, 10,000 %, fällig 01.01.2031	3.835	5,54	<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>				
<b>Kolumbien – 9,64 % (28. Februar 2023: 7,24 %)</b>			8.811	12,72	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden			87,35	
COP	11.660.000	Kolumbianische TES, Serie B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	2.442	3,53	Organismen für gemeinsame Anlagen			5,21	
COP	21.610.000	Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig 30.06.2032	4.235	6,11	Finanzderivate			0,44	
<b>Tschechische Republik – 5,01 % (28. Februar 2023: 4,84 %)</b>					Sonstige Vermögenswerte			7,00	
CZK	94.610	Staatsanleihe der tschechischen Republik, Serie 138, 1,750 %, fällig 23.06.2032	3.472	5,01	<b>Gesamtvermögen</b>			100,00	
<b>Mexiko – 17,35 % (28. Februar 2023: 20,07 %)</b>									
MXN	36.400	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,500 %, fällig 18.11.2038	1.983	2,86					
MXN	160.700	Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	8.055	11,63					
MXN	38.800	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	1.980	2,86					
<b>Südafrika – 7,57 % (28. Februar 2023: 8,58 %)</b>			12.018	17,35					
ZAR	33.800	Staatsanleihe der Republik Südafrika, Serie R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	1.056	1,52					
ZAR	109.500	Staatsanleihe der Republik Südafrika, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	4.191	6,05					
			5.247	7,57					

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)	
01. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf	GBP 5.650	Verkauf USD 7.023	\$ 134
11. Sep. 2023	Barclays	Kauf	USD 18.456	Verkauf CHF 16.610	-369
11. Sep. 2023	Barclays	Kauf	INR 182.000	Verkauf USD 2.210	-11
13. Sep. 2023	Citi	Kauf	KRW 3.060.000	Verkauf USD 2.359	-45
14. Sep. 2023	HSBC	Kauf	THB 80.700	Verkauf USD 2.338	-30
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD 2.387	Verkauf AUD 3.702	-13
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD –	Verkauf GBP –	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD 3	Verkauf SGD 4	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD 109.084	Verkauf USD 71.318	-598
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP 3	Verkauf USD 4	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD 103	Verkauf USD 76	–
19. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf	JPY 2.584.000	Verkauf USD 18.797	-982

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)	
25. Sep. 2023	Barclays	Kauf	MYR 7.900	Verkauf	USD 1.710	\$	-4
26. Sep. 2023	Barclays	Kauf	NZD 6.690	Verkauf	USD 4.148		-158
29. Sep. 2023	Morgan Stanley	Kauf	NOK 33.500	Verkauf	USD 3.205		-52
23. Okt. 2023	Citi	Kauf	MXN 34.800	Verkauf	USD 2.038		-17
25. Okt. 2023	Citi	Kauf	CAD 9.670	Verkauf	USD 7.357		-195
30. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf	USD 2.148	Verkauf	COP 8.770.000		41
08. Nov. 2023	HSBC	Kauf	CLP 5.440.000	Verkauf	USD 6.402		-65
15. Nov. 2023	HSBC	Kauf	USD 538	Verkauf	ZAR 10.300		-4
16. Nov. 2023	HSBC	Kauf	USD 3.389	Verkauf	CZK 74.900		25
06. Dez. 2023	JP Morgan	Kauf	AUD 2.460	Verkauf	USD 1.587		12
08. Dez. 2023	JP Morgan	Kauf	GBP 5.650	Verkauf	USD 7.104		54
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 249\$)						\$	266
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-3.482)							-2.543
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-3.233)						\$	-2.277

## Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Buxl 30-jährige Anleihe, September 2023	Morgan Stanley	70	\$ 10.156	\$ -130
Long Gilt Dezember 2023	Morgan Stanley	41	4.964	55
Nicht realisierte Wertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): – USD)				\$ 55
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-283)				-130
Netto-Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-283)				\$ -75

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
<b>Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 8,32 % (28. Februar 2023: 18,58 %)</b>					
329 Fannie Mae Pool „MA4733“, 4,500 %, fällig 01.09.2052	312	2,04	155 Ecopetrol SA, 4,125 %, fällig 16.01.2025	151	0,98
235 Freddie Mac Pool „SD8245“, 4,500 %, fällig 01.09.2052	223	1,46	120 Energian Israel Finance Ltd, 144A, 4,875 %, fällig 30.03.2026	113	0,74
161 Freddie Mac Pool „SD8257“, 4,500 %, fällig 01.10.2052	153	0,99	40 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,125 %, fällig 30.06.2025	39	0,26
600 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7, Serie 2021 DNA7, Klasse M2, 144A, 7,088 %, fällig 25.11.2041 *	587	3,83	140 Occidental Petroleum Corp, 6,125 %, fällig 01.01.2031	141	0,92
			140 Talos Production Inc, 12,000 %, fällig 15.01.2026	146	0,95
			165 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	153	1,00
<b>Gesamtbetrag hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 1.271 USD)</b>	1.275	8,32		1.106	7,22
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 46,48 % (28. Februar 2023: 59,55 %)</b>			<b>Verpackung u. Behälter – 2,02 % (28. Februar 2023: 2,04 %)</b>		
<b>Fluggesellschaften – 1,56 % (28. Februar 2023: 1,76 %)</b>			90 Graham Packaging Co Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15.08.2028		
122 Alaska Airlines 2020-1 Klasse A Pass Through Trust, 144A, 4,800 %, fällig 15.08.2027	118	0,78	85 Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC, 144A, 4,000 %, fällig 15.10.2027	76	0,50
120 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	120	0,78	175 Sealed Air Corp, 144A, 1,573 %, fällig 15.10.2026	154	1,01
	238	1,56		309	2,02
<b>Automobilhersteller – 3,47 % (28. Februar 2023: 4,84 %)</b>			<b>Pipelines – 1,91 % (28. Februar 2023: 1,98 %)</b>		
190 General Motors Co, 5,600 %, fällig 15.10.2032	183	1,20	55 Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 2,742 %, fällig 31.12.2039	43	0,28
185 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 2,750 %, fällig 09.03.2028	156	1,02	155 New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, fällig 30.09.2026	144	0,94
EUR 195 Volvo Car AB, 2,500 %, fällig 07.10.2027	192	1,25	105 Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125 %, fällig 01.06.2028	106	0,69
	531	3,47		293	1,91
<b>Banken – 7,45 % (28. Februar 2023: 7,54 %)</b>			<b>Halbleiter – 1,21 % (28. Februar 2023: 1,21 %)</b>		
200 Banco do Brasil SA/Cayman, 144A, 6,250 %, fällig 18.04.2030	199	1,30	235 Micron Technology Inc, 2,703 %, fällig 15.04.2032	186	1,21
155 Bank of America Corp, 2,456 %, fällig 22.10.2025 *	149	0,97	<b>Transport – 1,29 % (28. Februar 2023: 1,25 %)</b>		
EUR 200 BNP Paribas SA, 0,375 %, fällig 14.10.2027 *	193	1,26	EUR 220 FedEx Corp, 0,450 %, fällig 04.05.2029	197	1,29
220 Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, fällig 12.02.2026 *	204	1,34	<b>Wasser – 0,96 % (28. Februar 2023: 1,00 %)</b>		
200 JPMorgan Chase & Co, 0,768 %, fällig 09.08.2025 *	190	1,24	150 Solaris Midstream Holdings LLC, 144A, 7,625 %, fällig 01.04.2026	148	0,96
215 UBS AG/London, 144A, 0,700 %, fällig 09.08.2024	205	1,34			
	1.140	7,45	<b>Gesamtbetrag Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 7.101 USD)</b>		
<b>Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 2,33 % (28. Februar 2023: 3,70 %)</b>			<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 35,85 % (28. Februar 2023: 10,56 %)</b>		
160 Air Lease Corp, 0,800 %, fällig 18.08.2024	152	0,99	<b>Staatlich – 35,85 % (28. Februar 2023: 10,56 %)</b>		
225 XP Inc, 144A, 3,250 %, fällig 01.07.2026	205	1,34	BRL 640 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, fällig 01.01.2031	123	0,80
	357	2,33	BRL 3.370 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, fällig 01.01.2033	639	4,17
<b>Elektrik – 1,35 % (28. Februar 2023: 1,42 %)</b>			COP 3.623.000 Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig 26.03.2031	736	4,80
238 AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig 31.05.2030	206	1,35	200 Export-Import Bank of India, 144A, 5,500 %, fällig 18.01.2033	197	1,29
<b>Elektronik – 2,03 % (28. Februar 2023: 2,06 %)</b>			3.790 Variabel verzinsliche US-Schatzanweisung – Wenn emittiert, 4,931 %, fällig 31.01.2025 *	3.796	24,79
170 Jabil Inc, 3,600 %, fällig 15.01.2030	152	0,99		5.491	35,85
190 Vontier Corp, 2,400 %, fällig 01.04.2028	159	1,04	<b>Gesamtbetrag Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 5.238 USD)</b>		
	311	2,03	<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 6,08 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
<b>Energie – Alternative Quellen – 1,20 % (28. Februar 2023: 1,17 %)</b>			931 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		
EUR 205 Vestas Wind Systems Finance BV, 2,000 %, fällig 15.06.2034	184	1,20		931	6,08
<b>Hoch-/Tiefbau u. Bauwesen – 0,75 % (28. Februar 2023: 0,75 %)</b>			<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 9315)</b>		
120 Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 01.02.2026	115	0,75		931	6,08
<b>Nahrungsmittel – 2,09 % (28. Februar 2023: 3,42 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 14.5415)</b>		
GBP 135 Co-Operative Group Ltd, 5,125 %, fällig 17.05.2024	169	1,11		14.815	96,73
155 JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc, 5,125 %, fällig 01.02.2028	151	0,98	<b>Credit Default Swaps – 0,03 % (28. Februar 2023: 0,22 %)</b>		
	320	2,09	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
<b>Gesundheit – Dienstleistungen: 1,96 % (28. Februar 2023: 2,03 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – 0,25 % (28. Februar 2023: 0,58 %)</b>		
160 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.03.2026	156	1,02	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
145 HCA Inc, 5,000 %, fällig 15.03.2024	144	0,94		38	0,25
	300	1,96	<b>Futures – 0,43 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
<b>Anlagegesellschaften – 1,53 % (28. Februar 2023: 2,59 %)</b>			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
135 Ares Capital Corp, 2,150 %, fällig 15.07.2026	119	0,78		66	0,43
130 Main Street Capital Corp, 3,000 %, fällig 14.07.2026	115	0,75	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
	234	1,53		14.923	97,44
<b>Bergbau – 3,41 % (28. Februar 2023: 3,46 %)</b>			<b>Credit Default Swaps – -0,27 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
220 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2027	214	1,40	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
175 FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 144A, 4,375 %, fällig 01.04.2031	147	0,96		-41	-0,27
175 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	162	1,05	<b>Devisenterminkontrakte – -0,49 % (28. Februar 2023: -0,43 %)</b>		
	523	3,41	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
<b>Multi-National – 2,74 % (28. Februar 2023: 3,87 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>		
MXN 4.040 International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, fällig 22.01.2026	207	1,35		-115	-0,76
BRL 1.150 International Bank for Reconstruction & Development, 5,000 %, fällig 22.01.2026	213	1,39	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
	420	2,74		14.808	96,68
<b>Öl u. Gas – 7,22 % (28. Februar 2023: 8,11 %)</b>			<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>		
150 Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250 %, fällig 15.02.2026	151	0,99		508	3,32
60 Civitas Resources Inc, 144A, 8,375 %, fällig 01.07.2028	62	0,40	<b>Gesamtnettovermögen</b>		
150 CNX Resources Corp, 144A, 7,250 %, fällig 14.03.2027	150	0,98		15.316\$	100,00

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

### ABKÜRZUNGEN:

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

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	89,56
Organismen für gemeinsame Anlagen	6,01
Finanzderivate	0,70
Sonstige Vermögenswerte	3,73
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

### Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf-/Verkaufsschutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Citi	CDX.NA.HY, 5,000 % – Kauf	20. Jun. 2028	1.480	\$ -41
Citi	CDX.NA.HY, 5,000 % – Verkaufen	20. Dez. 2023	1.350	4
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tausend): 33\$)				\$ 4
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tausend): – USD)				-41
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2023 (in Tausend): 33\$)				\$ -37

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
01. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf USD 149	Verkauf GBP 120	\$ -3
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 98	Verkauf USD 108	-1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 20	Verkauf USD 26	–
19. Sep. 2023	Barclays	Kauf JPY 14.000	Verkauf USD 98	-2
19. Sep. 2023	Citi	Kauf JPY 53.000	Verkauf USD 388	-22
19. Sep. 2023	JP Morgan	Kauf JPY 64.000	Verkauf USD 466	-24
19. Okt. 2023	HSBC	Kauf USD 1.008	Verkauf BRL 4.930	19
19. Okt. 2023	HSBC	Kauf BRL 1.410	Verkauf USD 285	-3
27. Okt. 2023	Citi	Kauf USD 211	Verkauf MXN 3.600	2
27. Okt. 2023	HSBC	Kauf USD 344	Verkauf MXN 5.900	1
27. Okt. 2023	HSBC	Kauf USD 290	Verkauf MXN 5.100	-6
27. Okt. 2023	HSBC	Kauf MXN 6.200	Verkauf USD 361	-1
27. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf MXN 5.300	Verkauf USD 308	–
30. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf USD 171	Verkauf COP 730.000	-5
30. Okt. 2023	JP Morgan	Kauf COP 730.000	Verkauf USD 180	-5
07. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf USD 940	Verkauf EUR 850	16
07. Nov. 2023	JP Morgan	Kauf EUR 180	Verkauf USD 196	-1
08. Dez. 2023	JP Morgan	Kauf USD 138	Verkauf GBP 110	-1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 86\$)				\$ 38
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-64)				-74
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 22\$)				\$ -36

### Aufstellung der Terminkontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
US 10 -Jahres-Ultra Note Dezember 2023	Citi 29	\$ 3.367	\$ 34
US-5-Jahres-Anleihe (CBT), Dezember 2023	Citi 18	1.925	14
US Ultra Bond (CBT) Dezember 2023	Citi 11	1.424	18
Nicht realisierte Wertsteigerung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): – USD)			\$ 66
Nicht realisierte Wertminderung von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-123)			–
Netto-Wertzuwachs von Terminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tausend): \$-123)			\$ 66

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF ClearBridge Value Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Stammaktien – 93,83 % (28. Februar 2023: 99,17 %)</b>			<b>Fertigung diverse – 1,57 % (28. Februar 2023: 1,21 %)</b>		
<b>Fluggesellschaften – 1,29 % (28. Februar 2023: 0,82 %)</b>			EUR 100 Siemens AG 15,074 1,57		
248 United Airlines Holdings Inc	12.344	1,29	<b>Öl u. Gas – 10,54 % (28. Februar 2023: 9,97 %)</b>		
<b>Banken – 5,21 % (28. Februar 2023: 10,33 %)</b>			408 APA Corp 17,856 1,86		
1.210 First Horizon Corp	15.175	1,58	487 EQT Corp	21.055	2,20
51 Goldman Sachs Group Inc/The	16.768	1,75	497 Noble Corp Plc	26.220	2,73
437 Wells Fargo & Co	18.045	1,88	110 Pioneer Natural Resources Co	26.044	2,72
	49.988	5,21	157 TotalEnergies SE ADR	9.892	1,03
<b>Getränke – 1,32 % (28. Februar 2023: 1,17 %)</b>				101.067	10,54
48 Constellation Brands Inc „A“	12.631	1,32	<b>Öl- u. Gasdienstleistungen – 3,03 % (28. Februar 2023: 3,46 %)</b>		
<b>Biotechnologie – 4,38 % (28. Februar 2023: 5,57 %)</b>			481 Baker Hughes Co „A“ 17,401 1,81		
57 Biogen Inc	15.137	1,58	198 Schlumberger NV	11.682	1,22
100 BioNTech SE ADR	12.129	1,26		29.083	3,03
193 Gilead Sciences Inc	14.770	1,54	<b>Pharma – 6,26 % (28. Februar 2023: 4,16 %)</b>		
	42.036	4,38	74 AbbVie Inc 10,932 1,14		
<b>Chemie – 2,62 % (28. Februar 2023: 2,02 %)</b>			197 AstraZeneca Plc ADR 13,351 1,39		
EUR 51 Air Liquide SA	9.266	0,97	221 Johnson & Johnson	35.785	3,73
186 Eastman Chemical Co	15.816	1,65		60.068	6,26
	25.082	2,62	<b>Pipelines – 1,88 % (28. Februar 2023: 1,90 %)</b>		
<b>Kohle – 0,66 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			515 Enbridge Inc 18,070 1,88		
152 Teck Resources Ltd	6.298	0,66	<b>Immobilien – 0,79 % (28. Februar 2023: 0,86 %)</b>		
<b>Gewerbliche Dienstleistungen – 1,09 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			97 Howard Hughes Holdings Inc 7,596 0,79		
182 Block Inc	10.490	1,09	<b>Einzelhandel – 1,25 % (28. Februar 2023: 0,78 %)</b>		
<b>Kosmetik u. Körperpflege – 1,90 % (28. Februar 2023: 2,71 %)</b>			168 Bloomin' Brands Inc 4,725 0,49		
868 Coty Inc „A“	10.046	1,05	59 Ross Stores Inc	7.222	0,76
GBP 1.992 Haleon Plc	8.158	0,85		11.947	1,25
	18.204	1,90	<b>Halbleiter – 3,29 % (28. Februar 2023: 2,44 %)</b>		
<b>Distribution u. Großhandel – 1,36 % (28. Februar 2023: 1,10 %)</b>			252 Micron Technology Inc 17,640 1,84		
JPY 799 Marubeni Corp	13.023	1,36	149 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	13.957	1,45
<b>Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 3,43 % (28. Februar 2023: 2,60 %)</b>				31.597	3,29
200 Apollo Global Management Inc	17.473	1,82	<b>Software – 5,49 % (28. Februar 2023: 5,91 %)</b>		
151 Capital One Financial Corp	15.464	1,61	147 Fiserv Inc 17,853 1,86		
	32.937	3,43	34 Microsoft Corp 11,177 1,16		
<b>Elektrik – 6,89 % (28. Februar 2023: 6,47 %)</b>			197 Oracle Corp 23,658 2,47		
840 AES Corp/The	15.070	1,57		52.688	5,49
154 American Electric Power Co Inc	12.098	1,26	<b>Transport – 2,66 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
197 Constellation Energy Corp	20.555	2,14	140 Canadian Pacific Kansas City Ltd 11,100 1,16		
585 Vistra Corp	18.374	1,92	65 Union Pacific Corp	14.381	1,50
	66.097	6,89		25.481	2,66
<b>Elektronik – 0,95 % (28. Februar 2023: 1,32 %)</b>			<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 793.686\$)</b> 899.897 93,83		
242 Sensata Technologies Holding Plc	9.110	0,95	<b>Real Estate Investment Trusts – 1,48 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
<b>Energie – Alternative Quellen – 1,09 % (28. Februar 2023: 1,79 %)</b>			<b>REITs – 1,48 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
399 Fluence Energy Inc	10.502	1,09	78 American Tower Corp 14,176 1,48		
<b>Umweltschutz – 1,01 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			<b>Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 14.643\$)</b> 14,176 1,48		
57 Clean Harbors Inc	9.686	1,01	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 808.329\$)</b> 914.073 95,31		
<b>Gesundheit – Dienstleistungen – 2,42 % (28. Februar 2023: 2,09 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
49 UnitedHealth Group Inc	23.204	2,42	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 28 –		
<b>Versicherungen – 8,14 % (28. Februar 2023: 7,60 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b> 914.101 95,31		
476 American International Group Inc	27.844	2,90	<b>Devisenterminkontrakte – -0,16 % (28. Februar 2023: -0,10 %)</b>		
582 Equitable Holdings Inc	16.751	1,75	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) -1.547 -0,16		
47 Everest Group Ltd	16.911	1,76	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b> -1.547 -0,16		
943 MGIC Investment Corp	16.566	1,73	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b> 912.554 95,15		
	78.072	8,14	<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b> 46.519 4,85		
<b>Internet – 5,79 % (28. Februar 2023: 6,89 %)</b>			<b>Gesamtnettovermögen</b> 959.073\$ 100,00		
HKD 760 Alibaba Group Holding Ltd	8.828	0,92	– 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 %.		
103 Expedia Group Inc	11.176	1,16	<b>ABKÜRZUNGEN:</b>		
47 Meta Platforms Inc „A“	13.970	1,46	– American Depositary Receipt		
456 Uber Technologies Inc	21.540	2,25	– Euro		
	55.514	5,79	– Britisches Pfund		
<b>Hotels – 2,01 % (28. Februar 2023: 2,97 %)</b>			– Hongkong-Dollar		
196 Las Vegas Sands Corp	10.737	1,12	– Japanischer Yen		
193 MGM Resorts International	8.498	0,89			
	19.235	2,01			
<b>Maschinen – Diversifiziert – 1,65 % (28. Februar 2023: 1,57 %)</b>					
570 CNH Industrial NV	7.852	0,82			
201 Flowserve Corp	7.945	0,83			
	15.797	1,65			
<b>Bergbau – 3,86 % (28. Februar 2023: 5,43 %)</b>					
595 Freeport-McMoRan Inc	23.757	2,48			
118 Royal Gold Inc	13.219	1,38			
	36.976	3,86			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF ClearBridge Value Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,97
Finanzderivate	–
Sonstige Vermögenswerte	5,03
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)			
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	81	Verkauf	EUR	75	\$	1
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	183	Verkauf	SGD	247		–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	24	Verkauf	USD	26		–
06. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	47	Verkauf	SGD	63		–
06. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	–	Verkauf	USD	–		–
06. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	–	Verkauf	USD	–		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	5.179	Verkauf	EUR	4.749		25
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	13	Verkauf	EUR	12		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	58	Verkauf	SGD	78		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	5	Verkauf	USD	4		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	1.991	Verkauf	USD	1.482		-7
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	102.031	Verkauf	USD	112.257		-1.540
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	528	Verkauf	USD	571		2
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 10\$)								\$	28
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-976)									-1.547
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-966)								\$	-1.519

# FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Stammaktien – 98,22 % (28. Februar 2023: 93,97 %)</b>			<b>Fertigung diverse – 1,12 % (28. Februar 2023: 1,03 %)</b>		
<b>Banken – 4,04 % (28. Februar 2023: 5,28 %)</b>			10 Eaton Corp Plc		
60 Bank of America Corp	1.708	0,86		2.229	1,12
32 JPMorgan Chase & Co	4.643	2,34	<b>Öl u. Gas – 1,43 % (28. Februar 2023: 1,53 %)</b>		
46 US Bancorp	1.667	0,84	12 Pioneer Natural Resources Co		
	8.018	4,04		2.841	1,43
<b>Getränke – 2,67 % (28. Februar 2023: 2,85 %)</b>			<b>Verpackung u. Behälter – 0,58 % (28. Februar 2023: 0,65 %)</b>		
39 Coca-Cola Co/The	2.324	1,17	21 Ball Corp		
17 PepsiCo Inc	2.982	1,50		1.150	0,58
	5.306	2,67	<b>Pharma – 9,91 % (28. Februar 2023: 9,05 %)</b>		
<b>Baumaterialien – 0,95 % (28. Februar 2023: 0,85 %)</b>			12 AbbVie Inc		
9 Vulcan Materials Co	1.880	0,95	12 Becton Dickinson & Co	3.260	1,64
<b>Chemie – 4,54 % (28. Februar 2023: 4,64 %)</b>			7 Eli Lilly & Co	3.664	1,84
11 Air Products & Chemicals Inc	3.116	1,57	26 Johnson & Johnson	4.279	2,16
8 Ecolab Inc	1.520	0,77	48 Merck & Co Inc	5.250	2,64
19 PPG Industries Inc	2.747	1,38	43 Pfizer Inc	1.528	0,77
6 Sherwin-Williams Co/The	1.639	0,82		19.689	9,91
	9.022	4,54	<b>Pipelines – 0,68 % (28. Februar 2023: 0,73 %)</b>		
<b>Gewerbliche Dienstleistungen – 2,29 % (28. Februar 2023: 2,23 %)</b>			78 Kinder Morgan Inc		
16 Automatic Data Processing Inc	4.116	2,07		1.348	0,68
7 PayPal Holdings Inc	436	0,22	<b>Einzelhandel – 6,03 % (28. Februar 2023: 5,87 %)</b>		
	4.552	2,29	2 Costco Wholesale Corp		
<b>Computer – 6,69 % (28. Februar 2023: 5,41 %)</b>			9 Home Depot Inc/The		
71 Apple Inc	13.285	6,69	57 TJX Cos Inc/The	5.258	2,65
<b>Kosmetik u. Körperpflege – 1,52 % (28. Februar 2023: 1,47 %)</b>			16 Walmart Inc	2.569	1,29
20 Procter & Gamble Co/The	3.019	1,52		11.984	6,03
<b>Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 4,83 % (28. Februar 2023: 4,58 %)</b>			<b>Halbleiter – 3,60 % (28. Februar 2023: 1,79 %)</b>		
9 CME Group Inc	1.851	0,93	3 ASML Holding NV		
15 Intercontinental Exchange Inc	1.809	0,91	13 Marvell Technology Inc	738	0,37
24 Visa Inc „A“	5.940	2,99	9 NVIDIA Corp	4.444	2,24
	9.600	4,83		7.143	3,60
<b>Elektrik – 1,18 % (28. Februar 2023: 1,27 %)</b>			<b>Software – 11,69 % (28. Februar 2023: 9,29 %)</b>		
16 NextEra Energy Inc	1.101	0,56	6 Adobe Inc		
18 Sempra	1.233	0,62	50 Microsoft Corp	16.408	8,26
	2.334	1,18	28 Oracle Corp	3.339	1,68
<b>Elektrische Komponenten u. Zubehör – 1,27 % (28. Februar 2023: 0,89 %)</b>				23.216	11,69
26 Emerson Electric Co	2.524	1,27	<b>Telekommunikation – 1,20 % (28. Februar 2023: 2,55 %)</b>		
<b>Elektronik – 2,22 % (28. Februar 2023: 2,46 %)</b>			7 Arista Networks Inc		
23 Honeywell International Inc	4.411	2,22	7 T-Mobile US Inc	992	0,50
<b>Umweltschutz – 1,62 % (28. Februar 2023: 1,68 %)</b>				2.379	1,20
20 Waste Management Inc	3.210	1,62	<b>Transport – 2,50 % (28. Februar 2023: 2,88 %)</b>		
<b>Nahrungsmittel – 1,30 % (28. Februar 2023: 1,29 %)</b>			17 Canadian Pacific Kansas City Ltd		
4 McCormick & Co Inc/MD	355	0,18	4 Union Pacific Corp	915	0,46
31 Mondelez International Inc	2.224	1,12	16 United Parcel Service Inc „B“	2.685	1,35
	2.579	1,30		4.962	2,50
<b>Gesundheit – Produkte – 2,79 % (28. Februar 2023: 3,08 %)</b>			<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 141.191\$)</b>		
7 Stryker Corp	1.886	0,95		195.077	98,22
7 Thermo Fisher Scientific Inc	3.658	1,84	<b>Real Estate Investment Trusts – 1,11 % (28. Februar 2023: 1,32 %)</b>		
	5.544	2,79	<b>REITs – 1,11 % (28. Februar 2023: 1,32 %)</b>		
<b>Gesundheit – Dienstleistungen – 2,58 % (28. Februar 2023: 3,11 %)</b>			12 American Tower Corp		
11 UnitedHealth Group Inc	5.133	2,58		2.202	1,11
<b>Versicherungen – 7,64 % (28. Februar 2023: 7,66 %)</b>			<b>Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 2.146\$)</b>		
– Berkshire Hathaway Inc	7.647	3,85		2.202	1,11
16 Hartford Financial Services Group Inc/The	1.126	0,56	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 143.337\$)</b>		
21 Progressive Corp/The	2.739	1,38		197.279	99,33
23 Travelers Cos Inc/The	3.669	1,85	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
	15.181	7,64		197.279	99,33
<b>Internet – 8,95 % (28. Februar 2023: 5,69 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
25 Alphabet Inc	3.377	1,70	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
29 Alphabet Inc „A“	4.006	2,02		–	–
43 Amazon.com Inc	5.943	2,99	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>		
8 Meta Platforms Inc „A“	2.267	1,14		–	–
5 Netflix Inc	2.179	1,10	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
	17.772	8,95		197.279	99,33
<b>Eisen/Stahl – 0,71 % (28. Februar 2023: 1,09 %)</b>			<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>		
53 ArcelorMittal SA	1.415	0,71		1.325	0,67
<b>Medien – 1,69 % (28. Februar 2023: 1,98 %)</b>			<b>Gesamtvermögen</b>		
56 Comcast Corp	2.612	1,32		198.604\$	100,00
9 Walt Disney Co/The	739	0,37	– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
	3.351	1,69	<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>		
			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
			Sonstige Vermögenswerte		
			<b>Gesamtvermögen</b>		
			99,06		
			0,94		
			100,00		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)			
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	20	Verkauf	USD	22	\$	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): – USD)								\$	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): – USD)								\$	–
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): – USD)								\$	–

# FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Stammaktien – 96,57 % (28. Februar 2023: 94,00 %)</b>			<b>Transport – 2,49 % (28. Februar 2023: 2,09 %)</b>		
<b>Bekleidung – 1,50 % (28. Februar 2023: 2,34 %)</b>			72 Union Pacific Corp		
227 NIKE Inc	23.055	1,50	133 United Parcel Service Inc „B“	15.815	1,03
<b>Automobilhersteller – 0,82 % (28. Februar 2023: 0,78 %)</b>			38.369		
49 Tesla Inc	12.569	0,82	2,49		
<b>Autoteile u. Ausstattung – 1,16 % (28. Februar 2023: 1,59 %)</b>			<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 1.082.310\$)</b>		
176 Aptiv Plc	17.893	1,16	1.487.502		
<b>Getränke – 2,19 % (28. Februar 2023: 2,54 %)</b>			<b>Real Estate Investment Trusts – 1,59 % (28. Februar 2023: 1,68 %)</b>		
586 Monster Beverage Corp	33.651	2,19	<b>REITS – 1,59 % (28. Februar 2023: 1,68 %)</b>		
<b>Chemie – 1,76 % (28. Februar 2023: 1,40 %)</b>			31 Equinix Inc		
100 Sherwin-Williams Co/The	27.062	1,76	24.592		
<b>Gewerbliche Dienstleistungen – 3,49 % (28. Februar 2023: 4,38 %)</b>			<b>Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 15.492\$)</b>		
307 PayPal Holdings Inc	19.168	1,25	24.592		
88 S&P Global Inc	34.504	2,24	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 1.097.802\$)</b>		
53.672			1.512.094		
<b>Computer – 4,92 % (28. Februar 2023: 4,50 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – 0,02 % (28. Februar 2023: 0,02 %)</b>		
403 Apple Inc	75.784	4,92	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
<b>Kosmetik u. Körperpflege – 1,15 % (28. Februar 2023: 1,77 %)</b>			280		
110 Estee Lauder Cos Inc/The „A“	17.692	1,15	0,02		
<b>Distribution u. Großhandel – 2,23 % (28. Februar 2023: 2,87 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
48 WW Grainger Inc	34.348	2,23	1.512.374		
<b>Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 4,84 % (28. Februar 2023: 5,87 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – -0,15 % (28. Februar 2023: -0,12 %)</b>		
303 Visa Inc „A“	74.558	4,84	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
<b>Elektrik – 1,04 % (28. Februar 2023: 0,97 %)</b>			-2.302		
241 NextEra Energy Inc	16.075	1,04	-0,15		
<b>Elektronik – 1,43 % (28. Februar 2023: 2,13 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>		
117 Honeywell International Inc	21.978	1,43	-2.302		
<b>Gesundheit – Produkte – 7,45 % (28. Februar 2023: 8,51 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
342 Alcon Inc	28.353	1,84	1.510.072		
102 Intuitive Surgical Inc	31.839	2,07	<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>		
83 Stryker Corp	23.420	1,52	30.309		
56 Thermo Fisher Scientific Inc	31.163	2,02	1,97		
114.775			<b>Gesamtvermögen</b>		
<b>Gesundheit – Dienstleistungen – 3,15 % (28. Februar 2023: 3,99 %)</b>			1.540.381\$		
102 UnitedHealth Group Inc	48.503	3,15	100,00		
<b>Versicherungen – 1,65 % (28. Februar 2023: 1,78 %)</b>					
131 Marsh & McLennan Cos Inc	25.459	1,65			
<b>Internet – 19,28 % (28. Februar 2023: 16,25 %)</b>					
822 Amazon.com Inc	113.424	7,36			
217 Meta Platforms Inc „A“	64.159	4,17			
116 Netflix Inc	50.226	3,26			
148 Palo Alto Networks Inc	36.037	2,34			
92 Sea Ltd ADR	3.466	0,22			
629 Uber Technologies Inc	29.720	1,93			
297.032					
<b>Fertigung diverse – 2,26 % (28. Februar 2023: 2,55 %)</b>					
151 Eaton Corp Plc	34.801	2,26			
<b>Pharma – 4,33 % (28. Februar 2023: 4,30 %)</b>					
219 Dexcom Inc	22.114	1,43			
31 Eli Lilly & Co	17.129	1,11			
144 Zoetis Inc	27.510	1,79			
66.753					
<b>Einzelhandel – 0,22 % (28. Februar 2023: 1,08 %)</b>					
27 Target Corp	3.429	0,22			
<b>Halbleiter – 10,51 % (28. Februar 2023: 7,23 %)</b>					
40 ASML Holding NV	26.703	1,73			
354 Intel Corp	12.427	0,81			
249 NVIDIA Corp	122.825	7,97			
161.955					
<b>Software – 18,70 % (28. Februar 2023: 15,08 %)</b>					
69 Adobe Inc	38.604	2,51			
96 Atlassian Corp	19.645	1,28			
39 Intuit Inc	20.856	1,35			
371 Microsoft Corp	121.584	7,89			
164 Salesforce Inc	36.248	2,35			
179 Splunk Inc	21.704	1,41			
129 Unity Software Inc	4.778	0,31			
101 Workday Inc „A“	24.670	1,60			
288.089					

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

### ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt

### Verteilung des Gesamtvermögens

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,05
Finanzderivate	0,02
Sonstige Vermögenswerte	2,93
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

# FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1.538	Verkauf	BRL	7.653	\$ -7
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	20.328	Verkauf	BRL	99.536	244
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	15	Verkauf	EUR	14	-
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	211	Verkauf	GBP	166	1
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	74	Verkauf	USD	80	-
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	BRL	107.189	Verkauf	USD	22.596	-968
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	36	Verkauf	USD	47	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	2.981	Verkauf	EUR	2.716	35
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	45	Verkauf	EUR	42	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	71.651	Verkauf	USD	78.825	-1.074
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	96	Verkauf	USD	102	-
03. Okt. 2023	BNY Mellon	Kauf	BRL	101.184	Verkauf	USD	20.578	-253
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 286\$)							\$	280
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-1.551)								-2.302
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-1.265)							\$	-2.022



# FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Stammaktien – 98,84 % (28. Februar 2023: 95,22 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
<b>Getränke – 1,97 % (28. Februar 2023: 1,70 %)</b>			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
26 Diageo Plc ADR	4.254	1,97	4		–
<b>Biotechnologie – 14,62 % (28. Februar 2023: 14,46 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
28 Biogen Inc	7.524	3,48	213.407		98,84
103 Ionis Pharmaceuticals Inc	4.136	1,92	<b>Devisenterminkontrakte – -0,04 % (28. Februar 2023: -0,10 %)</b>		
56 Ultragenyx Pharmaceutical Inc	2.058	0,95	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
51 Vertex Pharmaceuticals Inc	17.851	8,27	-86		-0,04
	31.569	14,62	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>		
<b>Baumaterialien – 3,49 % (28. Februar 2023: 3,56 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
128 Johnson Controls International plc	7.533	3,49	213.321		98,80
<b>Computer – 7,94 % (28. Februar 2023: 6,43 %)</b>			<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>		
12 Accenture Plc „A“	3.786	1,75	2.595		1,20
56 CrowdStrike Holdings Inc	9.107	4,22	<b>Gesamtnettvermögen</b>		
41 Seagate Technology Holdings Plc	2.891	1,34	215.916\$		100,00
30 Western Digital Corp	1.368	0,63	– 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 %.		
	17.152	7,94	∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.		
<b>Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 0,63 % (28. Februar 2023: 0,67 %)</b>			<b>ABKÜRZUNGEN:</b>		
21 Cohen & Steers Inc	1.356	0,63	ADR	– American Depositary Receipt	
<b>Elektronik – 4,94 % (28. Februar 2023: 6,57 %)</b>			<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>		
81 TE Connectivity Ltd	10.676	4,94	<b>% des Gesamtvermögens</b>		
<b>Unterhaltung – 3,98 % (28. Februar 2023: 4,72 %)</b>			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
53 Madison Square Garden Entertainment Corp „A“	1.692	0,78	98,17		
39 Madison Square Garden Sports Corp	6.909	3,20	Finanzderivate		
	8.601	3,98	–		
<b>Gesundheit – Produkte – 1,52 % (28. Februar 2023: 2,10 %)</b>			Sonstige Vermögenswerte		
17 Insulet Corp	3.274	1,52	1,83		
<b>Gesundheit – Dienstleistungen – 9,49 % (28. Februar 2023: 9,41 %)</b>			<b>Gesamtvermögen</b>		
21 Charles River Laboratories International Inc	4.421	2,05	100,00		
34 UnitedHealth Group Inc	16.079	7,44			
	20.500	9,49			
<b>Wohnungseinrichtungen – 1,56 % (28. Februar 2023: 1,46 %)</b>					
40 Dolby Laboratories Inc „A“	3.372	1,56			
<b>Internet – 6,38 % (28. Februar 2023: 5,83 %)</b>					
35 Airbnb Inc	4.568	2,12			
47 Etsy Inc	3.475	1,61			
10 Match Group Inc	472	0,22			
8 Meta Platforms Inc „A“	2.457	1,14			
102 Pinterest Inc	2.796	1,29			
	13.768	6,38			
<b>Medien – 9,71 % (28. Februar 2023: 10,44 %)</b>					
260 Comcast Corp	12.176	5,64			
16 Liberty Broadband Corp	1.476	0,68			
74 Liberty Media Corp-Liberty Formula One	5.090	2,36			
18 Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	451	0,21			
134 Warner Bros Discovery Inc	1.767	0,82			
	20.960	9,71			
<b>Bergbau – 1,97 % (28. Februar 2023: 1,49 %)</b>					
106 Freeport-McMoRan Inc	4.247	1,97			
<b>Pharma – 2,17 % (28. Februar 2023: 2,14 %)</b>					
32 AbbVie Inc	4.689	2,17			
<b>Einzelhandel – 2,32 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
17 Starbucks Corp	1.657	0,77			
36 TJX Cos Inc/The	3.346	1,55			
	5.003	2,32			
<b>Halbleiter – 12,02 % (28. Februar 2023: 11,40 %)</b>					
23 Broadcom Inc	20.867	9,67			
106 Wolfspeed Inc	5.082	2,35			
	25.949	12,02			
<b>Software – 14,13 % (28. Februar 2023: 12,84 %)</b>					
56 Autodesk Inc	12.418	5,75			
40 DocuSign Inc „A“	2.027	0,94			
57 Doximity Inc	1.355	0,63			
19 HubSpot Inc	10.629	4,92			
26 Snowflake Inc	4.071	1,89			
	30.500	14,13			
<b>Telekommunikation – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
24 GCI Liberty, Inc. Treuhandkonto ∞	–	–			
<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 152.332\$)</b>					
	213.403	98,84			
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 152.332\$)</b>					
	213.403	98,84			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)	
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	AUD	–	\$	–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	EUR	1		–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–		–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	8	Verkauf	USD	10		–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	20	Verkauf	USD	22		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	162	Verkauf	AUD	253		-1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	167	Verkauf	AUD	256		2
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf	CHF	2		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	40	Verkauf	CNH	295		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	39	Verkauf	EUR	35		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	21	Verkauf	GBP	16		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf	SEK	19		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	21	Verkauf	SEK	219		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	203	Verkauf	SGD	273		1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	186	Verkauf	SGD	253		-1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	7.394	Verkauf	USD	5.502		-27
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	2	Verkauf	USD	1		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	444	Verkauf	USD	42		-1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	232	Verkauf	USD	295		-2
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	794	Verkauf	USD	874		-12
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CNH	5.010	Verkauf	USD	695		-6
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CHF	49	Verkauf	USD	56		-1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	147	Verkauf	USD	94		1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	6.575	Verkauf	USD	4.296		-35
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	–	Verkauf	USD	–		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CNH	155	Verkauf	USD	21		–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 4\$)								\$	4
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-229)									-86
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-225)								\$	-82

# FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Stammaktien – 82,82 % (28. Februar 2023: 78,26 %)</b>			<b>Private Equity – 3,34 % (28. Februar 2023: 1,83 %)</b>		
<b>Luft- und Raumfahrt u. Verteidigung – 1,40 % (28. Februar 2023: 2,40 %)</b>			11 Blackstone Inc 1.185 3,34		
2 L3Harris Technologies Inc	320	0,90	<b>Halbleiter – 7,71 % (28. Februar 2023: 7,20 %)</b>		
2 RTX Corp	178	0,50	– ASML Holding NV 226 0,64		
	498	1,40	2 Broadcom Inc 1.599 4,50		
<b>Banken – 2,55 % (28. Februar 2023: 3,73 %)</b>			1 NXP Semiconductors NV 307 0,86		
1 Goldman Sachs Group Inc/The	177	0,50	5 QUALCOMM Inc 608 1,71		
5 JPMorgan Chase & Co	730	2,05	2.740 7,71		
	907	2,55	<b>Software – 12,20 % (28. Februar 2023: 9,72 %)</b>		
<b>Getränke – 1,98 % (28. Februar 2023: 1,83 %)</b>			6 Activision Blizzard Inc 571 1,61		
12 Coca-Cola Co/The	705	1,98	7 Microsoft Corp 2.280 6,42		
<b>Biotechnologie – 1,23 % (28. Februar 2023: 1,29 %)</b>			10 Oracle Corp 1.199 3,37		
2 Amgen Inc	437	1,23	2 Paychex Inc 284 0,80		
<b>Chemie – 2,43 % (28. Februar 2023: 2,33 %)</b>			4.334 12,20		
2 Air Products & Chemicals Inc	457	1,29	<b>Telekommunikation – 1,56 % (28. Februar 2023: 2,44 %)</b>		
15 Huntsman Corp	406	1,14	10 Cisco Systems Inc 554 1,56		
	863	2,43	<b>Transport – 2,19 % (28. Februar 2023: 1,45 %)</b>		
<b>Computer – 5,99 % (28. Februar 2023: 4,70 %)</b>			2 Union Pacific Corp 516 1,45		
11 Apple Inc	2.127	5,99	2 United Parcel Service Inc „B“ 262 0,74		
<b>Kosmetik u. Körperpflege – 2,43 % (28. Februar 2023: 1,56 %)</b>			778 2,19		
– Colgate-Palmolive Co	34	0,10	<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 20.178\$)</b>		
8 Kenvue Inc	175	0,49	29.425 82,82		
4 Procter & Gamble Co/The	653	1,84	<b>Vorzugsaktien – 6,54 % (28. Februar 2023: 6,35 %)</b>		
	862	2,43	<b>Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 2,21 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
<b>Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 3,69 % (28. Februar 2023: 3,69 %)</b>			14 Apollo Global Management Inc 785 2,21		
45 Blue Owl Capital Inc „A“	533	1,50	<b>Elektrik – 1,39 % (28. Februar 2023: 1,34 %)</b>		
1 CME Group Inc	292	0,82	11 NextEra Energy Inc 494 1,39		
4 Intercontinental Exchange Inc	487	1,37	<b>Gas – 0,36 % (28. Februar 2023: 0,38 %)</b>		
	1.312	3,69	3 Spire Inc, Serie A 126 0,36		
<b>Elektrik – 6,04 % (28. Februar 2023: 4,78 %)</b>			<b>Medien – 0,51 % (28. Februar 2023: 0,69 %)</b>		
4 Brookfield Renewable Corp	122	0,34	8 Paramount Global, Serie A 181 0,51		
18 Brookfield Renewable Energy Partners LP/CA, MLP #	469	1,32	<b>Private Equity – 2,07 % (28. Februar 2023: 2,42 %)</b>		
5 DTE Energy Co	512	1,44	10 KKR & Co Inc, Serie C 735 2,07		
3 NextEra Energy Inc	173	0,49	<b>Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 2.630\$)</b>		
17 PPL Corp	426	1,20	2.321 6,54		
6 Sempra	444	1,25	<b>Real Estate Investment Trusts – 9,87 % (28. Februar 2023: 8,91 %)</b>		
	2.146	6,04	<b>REITS – 9,87 % (28. Februar 2023: 8,91 %)</b>		
<b>Elektrische Komponenten u. Zubehör – 1,17 % (28. Februar 2023: 0,94 %)</b>			3 Alexandria Real Estate Equities Inc 401 1,13		
4 Emerson Electric Co	414	1,17	5 American Homes 4 Rent „A“ 188 0,53		
<b>Elektronik – 0,80 % (28. Februar 2023: 0,50 %)</b>			1 American Tower Corp 185 0,52		
3 Amphenol Corp „A“	284	0,80	6 Apartment Income REIT Corp 202 0,57		
<b>Energie – Alternative Quellen – 1,09 % (28. Februar 2023: 0,97 %)</b>			4 Digital Realty Trust Inc 501 1,41		
8 NextEra Energy Partners LP	386	1,09	1 Equinix Inc 487 1,37		
<b>Versicherungen – 1,51 % (28. Februar 2023: 0,88 %)</b>			3 Equity Lifestyle Properties Inc 179 0,50		
3 Chubb Ltd	537	1,51	3 Extra Space Storage Inc 324 0,91		
<b>Anlagegesellschaften – 1,55 % (28. Februar 2023: 1,97 %)</b>			9 Gaming and Leisure Properties Inc 410 1,15		
23 Ares Capital Corp	450	1,27	9 Global Medical REIT Inc 86 0,24		
7 Trinity Capital Inc	102	0,28	4 Prologis Inc 545 1,54		
	552	1,55	3.508 9,87		
<b>Maschinen – Diversifiziert – 1,52 % (28. Februar 2023: 1,89 %)</b>			<b>Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 3.270\$)</b>		
6 Otis Worldwide Corp	540	1,52	3.508 9,87		
<b>Öl u. Gas – 2,00 % (28. Februar 2023: 0,48 %)</b>			<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 26.078\$)</b>		
3 ConocoPhillips	407	1,14	35.254 99,23		
1 Pioneer Natural Resources Co	305	0,86	<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
	712	2,00	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) – –		
<b>Pharma – 6,87 % (28. Februar 2023: 6,46 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
2 AbbVie Inc	291	0,82	35.254 99,23		
3 Johnson & Johnson	409	1,15	<b>Devisenterminkontrakte – -0,04 % (28. Februar 2023: -0,14 %)</b>		
10 Merck & Co Inc	1.072	3,02	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) -16 -0,04		
19 Pfizer Inc	668	1,88	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>		
	2.440	6,87	-16 -0,04		
<b>Pipelines – 11,57 % (28. Februar 2023: 12,16 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
6 DT Midstream Inc	331	0,93	35.238 99,19		
18 Enbridge Inc	615	1,73	<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>		
36 Kinder Morgan Inc	618	1,74	290 0,81		
6 ONEOK Inc	362	1,02	<b>Gesamtneuvermögen</b>		
60 Plains GP Holdings LP, MLP „A“ #	968	2,72	35.528\$ 100,00		
35 Williams Cos Inc/The	1.218	3,43			
	4.112	11,57			
			– 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.		
			<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>		
			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden 98,96		
			Sonstige Vermögenswerte 1,04		
			<b>Gesamtvermögen</b> 100,00		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)	
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	–	Verkauf	USD	–	\$	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	24	Verkauf	AUD	38		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	CNH	11		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	24	Verkauf	EUR	23		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	8	Verkauf	SGD	10		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	17	Verkauf	SGD	23		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	504	Verkauf	USD	553		-8
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CNH	346	Verkauf	USD	48		-1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	1.115	Verkauf	USD	729		-6
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	352	Verkauf	USD	262		-1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 1\$)								\$	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-56)									-16
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): \$-55)								\$	-16

# FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Stammaktien – 94,16 % (28. Februar 2023: 96,28 %)</b>			<b>Maschinen – Diversifiziert – 2,15 % (28. Februar 2023: 2,19 %)</b>		
<b>Bekleidung – 1,47 % (28. Februar 2023: 1,61 %)</b>			83 Deere & Co		
231 NIKE Inc	23.432	1,47	34.275	2,15	
<b>Autoteile u. Ausstattung – 0,87 % (28. Februar 2023: 1,25 %)</b>			<b>Medien – 1,36 % (28. Februar 2023: 1,56 %)</b>		
138 Aptiv Plc	13.950	0,87	260 Walt Disney Co/The	21.722	1,36
<b>Banken – 4,58 % (28. Februar 2023: 6,59 %)</b>			<b>Fertigung diverse – 2,95 % (28. Februar 2023: 2,29 %)</b>		
295 JPMorgan Chase & Co	43.160	2,70	205 Eaton Corp Plc	47.106	2,95
352 Morgan Stanley	29.930	1,88	<b>Verpackung u. Behältnisse – 1,42 % (28. Februar 2023: 1,50 %)</b>		
	73.090	4,58	416 Ball Corp	22.625	1,42
<b>Biotechnologie – 3,09 % (28. Februar 2023: 3,47 %)</b>			<b>Pharma – 5,18 % (28. Februar 2023: 5,46 %)</b>		
249 BioMarin Pharmaceutical Inc	22.755	1,43	391 CVS Health Corp	25.486	1,60
346 Gilead Sciences Inc	26.435	1,66	173 Johnson & Johnson	28.040	1,76
	49.190	3,09	156 Novo Nordisk A/S ADR	29.028	1,82
<b>Baumaterialien – 3,28 % (28. Februar 2023: 3,27 %)</b>			82.554		
135 Trane Technologies Plc	27.754	1,74	<b>Einzelhandel – 5,93 % (28. Februar 2023: 5,83 %)</b>		
343 Trex Co Inc	24.485	1,54	70 Costco Wholesale Corp	38.446	2,41
	52.239	3,28	110 Home Depot Inc/The	36.431	2,29
<b>Chemie – 1,62 % (28. Februar 2023: 1,43 %)</b>			139 Williams-Sonoma Inc		
141 Ecolab Inc	25.837	1,62	94.527	5,93	
<b>Gewerbliche Dienstleistungen – 0,97 % (28. Februar 2023: 1,20 %)</b>			<b>Halbleiter – 2,68 % (28. Februar 2023: 3,66 %)</b>		
412 Progyny Inc	15.387	0,97	37 ASML Holding NV	24.167	1,52
<b>Computer – 7,88 % (28. Februar 2023: 6,53 %)</b>			26 Lam Research Corp		
83 Accenture Plc „A“	26.817	1,68	42.710	2,68	
526 Apple Inc	98.825	6,20	<b>Software – 10,91 % (28. Februar 2023: 8,95 %)</b>		
	125.642	7,88	378 Microsoft Corp	123.831	7,77
<b>Kosmetik u. Körperpflege – 3,33 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			125 Salesforce Inc		
353 Colgate-Palmolive Co	25.919	1,63	49 Synopsys Inc	22.532	1,41
176 Procter & Gamble Co/The	27.182	1,70	173.996	10,91	
	53.101	3,33	<b>Telekommunikation – 2,15 % (28. Februar 2023: 1,86 %)</b>		
<b>Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 4,64 % (28. Februar 2023: 5,42 %)</b>			598 Cisco Systems Inc		
33 BlackRock Inc	22.760	1,43	34.310	2,15	
316 Charles Schwab Corp/The	18.684	1,17	<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 1.473.230\$)</b>		
133 Visa Inc „A“	32.593	2,04	1.501.499	94,16	
	74.037	4,64	<b>Real Estate Investment Trusts – 3,26 % (28. Februar 2023: 3,05 %)</b>		
<b>Elektrik – 2,06 % (28. Februar 2023: 1,29 %)</b>			<b>REITS – 3,26 % (28. Februar 2023: 3,05 %)</b>		
658 Brookfield Renewable Corp	18.373	1,15	31 Equinix Inc	24.134	1,52
190 Ormat Technologies Inc	14.460	0,91	224 Prologis Inc	27.788	1,74
	32.833	2,06	51.922	3,26	
<b>Elektronik – 1,44 % (28. Februar 2023: 3,82 %)</b>			<b>Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 47.489\$)</b>		
173 Keysight Technologies Inc	23.031	1,44	51.922	3,26	
<b>Energie – Alternative Quellen – 3,20 % (28. Februar 2023: 4,53 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 1.520.719\$)</b>		
55 Enphase Energy Inc	6.946	0,43	1.553.421	97,42	
359 NextEra Energy Partners LP	17.885	1,12	<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
754 Shoals Technologies Group Inc „A“	14.814	0,93	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
70 SolarEdge Technologies Inc	11.425	0,72	31	–	
	51.070	3,20	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
<b>Nahrungsmittel – 1,62 % (28. Februar 2023: 1,68 %)</b>			1.553.452		
316 McCormick & Co Inc/MD	25.900	1,62	<b>Devisenterminkontrakte – -0,05 % (28. Februar 2023: -0,05 %)</b>		
<b>Hand-/Maschinenwerkzeuge – 1,92 % (28. Februar 2023: 2,35 %)</b>			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
189 Regal Rexnord Corp	30.667	1,92	-863	-0,05	
<b>Gesundheit – Produkte – 5,40 % (28. Februar 2023: 5,15 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>		
70 Cooper Cos Inc/The	25.987	1,63	-863	-0,05	
115 Danaher Corp	30.586	1,92	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
53 Thermo Fisher Scientific Inc	29.518	1,85	1.552.589	97,37	
	86.091	5,40	<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>		
<b>Gesundheit – Dienstleistungen – 2,76 % (28. Februar 2023: 2,71 %)</b>			41.962		
92 UnitedHealth Group Inc	44.001	2,76	<b>Gesamtvermögen</b>		
<b>Versicherungen – 3,23 % (28. Februar 2023: 4,57 %)</b>			1.594.551\$		
358 Hartford Financial Services Group Inc/The	25.731	1,61	100,00		
193 Progressive Corp/The	25.734	1,62			
	51.465	3,23			
<b>Internet – 5,49 % (28. Februar 2023: 5,25 %)</b>					
343 Alphabet Inc „A“	46.665	2,93			
10 Booking Holdings Inc	31.655	1,99			
124 Etsy Inc	9.150	0,57			
	87.470	5,49			
<b>Maschinen – Bau u. Bergbau – 0,58 % (28. Februar 2023: 0,86 %)</b>					
617 Bloom Energy Corp „A“	9.241	0,58			

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

### ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt

### Verteilung des Gesamtvermögens

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,21
Finanzderivate	–
Sonstige Vermögenswerte	3,79
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>



# FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	EUR	1	\$	–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	EUR	–		–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	757	Verkauf	GBP	595		3
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	GBP	1		–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	34	Verkauf	USD	37		–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	911	Verkauf	USD	1.159		-7
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	88	Verkauf	USD	8		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1.094	Verkauf	EUR	1.005		3
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	9	Verkauf	EUR	8		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	3.401	Verkauf	GBP	2.665		25
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	37	Verkauf	GBP	30		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	59.654	Verkauf	USD	75.972		-395
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	30.579	Verkauf	USD	33.642		-461
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	38	Verkauf	USD	48		–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 22\$)								\$	31
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -840\$)									-863
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -818\$)								\$	-832

# FTGF ClearBridge Global Growth Fund<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Stammaktien – 99,02 % (28. Februar 2023: 97,30 %)</b>					
<b>Australien – 2,02 % (28. Februar 2023: 1,09 %)</b>					
AUD	18	1,14			
AUD	8	0,88			
	300	2,02			
<b>Brasilien – 0,35 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
	– MercadoLibre Inc	0,35			
	52				
<b>Kanada – 2,62 % (28. Februar 2023: 3,76 %)</b>					
CAD	– Constellation Software Inc/Canada	1,26			
CAD	1	0,81			
	1	0,55			
	389	2,62			
<b>China – 3,06 % (28. Februar 2023: 3,72 %)</b>					
HKD	12	0,91			
HKD	3	0,93			
HKD	61	0,73			
	3	0,49			
	456	3,06			
<b>Frankreich – 2,75 % (28. Februar 2023: 3,20 %)</b>					
EUR	1	0,24			
EUR	– Kering SA	0,95			
EUR	– LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	1,56			
	409	2,75			
<b>Deutschland – 4,84 % (28. Februar 2023: 4,64 %)</b>					
EUR	1	0,96			
EUR	13	1,89			
EUR	2	1,99			
	719	4,84			
<b>Hongkong – 2,59 % (28. Februar 2023: 2,63 %)</b>					
HKD	19	1,14			
HKD	6	1,45			
	386	2,59			
<b>Indien – 1,17 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
	3	1,17			
	174				
<b>Israel – 0,74 % (28. Februar 2023: 0,93 %)</b>					
	1	0,74			
	111				
<b>Japan – 6,41 % (28. Februar 2023: 5,48 %)</b>					
JPY	8	1,63			
JPY	– Daiichi Sankyo Co Ltd	0,44			
JPY	– Keyence Corp	1,02			
JPY	11	0,52			
JPY	– Olympus Corp	0,52			
JPY	– SMC Corp	1,25			
JPY	2	1,55			
JPY	– Sony Group Corp				
JPY	2	1,55			
	954	6,41			
<b>Mexiko – 0,69 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
MXN	21	0,69			
	102				
<b>Niederlande – 2,11 % (28. Februar 2023: 1,61 %)</b>					
	– Argenx SE ADR	1,01			
EUR	– ASML Holding NV	1,10			
	313	2,11			
<b>Neuseeland – 0,58 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
AUD	1	0,58			
	86				
<b>Portugal – 0,91 % (28. Februar 2023: 1,63 %)</b>					
EUR	30	0,91			
	136				
<b>Schweden – 0,80 % (28. Februar 2023: 1,02 %)</b>					
SEK	6	0,80			
	119				
<b>Schweiz – 1,12 % (28. Februar 2023: 1,84 %)</b>					
CHF	2	1,12			
	167				
<b>Taiwan – 0,92 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
TWD	8	0,92			
	137				
<b>Vereinigtes Königreich – 2,54 % (28. Februar 2023: 4,29 %)</b>					
	1	0,95			
GBP	2	1,59			
	378	2,54			
<b>USA – 62,80 % (28. Februar 2023: 59,75 %)</b>					
	1	0,89			
	1	1,38			
	– AbbVie Inc	1,62			
	– Accenture Plc „A“	3,06			
	– Adobe Inc	2,96			
	3	0,79			
	3	0,79			
	– Alphabet Inc „A“	117			
	– Amazon.com Inc				
	1	0,79			
	– Amphenol Corp „A“				
	117				
	4	4,95			
	22	1,68			
	– Apple Inc	1,27			
	– Coty Inc „A“	0,99			
	– Deere & Co	3,76			
	1	1,41			
	1	1,41			
	– Dexcom Inc	1,51			
	1	2,02			
	1	1,07			
	– Eli Lilly & Co	0,55			
	1	1,29			
	1	0,73			
	– Estee Lauder Cos Inc/The „A“	1,88			
	210	4,80			
	1	0,64			
	55	1,23			
	3	2,02			
	– Haleon Plc	1,07			
	3	0,55			
	– Intercontinental Exchange Inc	1,29			
	– Intuit Inc	0,73			
	1	1,88			
	– Karuna Therapeutics Inc	1,88			
	81	4,80			
	– Kroger Co/The	0,64			
	192	1,23			
	1	0,73			
	– Marriott International Inc/MD	1,88			
	5	4,80			
	– Marvell Technology Inc	0,64			
	2	1,23			
	– Microsoft Corp	1,24			
	714	1,90			
	1	0,64			
	– Nestle SA	1,23			
	96	1,24			
	– Netflix Inc	1,90			
	183	1,27			
	3	1,27			
	– NextEra Energy Inc	1,92			
	185	1,92			
	1	1,27			
	– NVIDIA Corp	1,27			
	282	1,27			
	1	1,27			
	– Procter & Gamble Co/The	1,92			
	189	1,92			
	1	1,92			
	– S&P Global Inc	1,92			
	285	1,65			
	1	1,65			
	– Salesforce Inc	1,09			
	246	0,79			
	1	1,09			
	– Stryker Corp	0,79			
	162	1,82			
	2	1,82			
	– Sysco Corp	1,82			
	118	1,80			
	1	1,80			
	– Tesla Inc	1,00			
	271	1,00			
	– Thermo Fisher Scientific Inc	0,75			
	268	1,94			
	2	1,94			
	– TJX Cos Inc/The	2,07			
	149	0,82			
	2	0,82			
	– Trex Co Inc	0,89			
	112	0,74			
	1	0,74			
	– Union Pacific Corp	0,63			
	288	0,63			
	1	0,63			
	– UnitedHealth Group Inc	0,63			
	307	0,63			
	– Vertex Pharmaceuticals Inc	0,63			
	122	0,63			
	2	0,63			
	– Walt Disney Co/The	0,63			
	133	0,63			
	1	0,63			
	– Waste Connections Inc	0,63			
	110	0,63			
	– Workday Inc „A“	0,63			
	94	0,63			
	9.342	62,80			
	14.730	99,02			
<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 13.451\$)</b>					
<b>Bezugsrechte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
<b>Kanada – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
CAD	– Constellation Software Inc/Canada	–			
	–	–			
<b>Summe Bezugsrechte (Anschaffungskosten – \$)</b>					
<b>Optionsscheine – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
<b>Kanada – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>					
CAD	– Constellation Software Inc/Canada	–			
	–	–			
<b>Summe Optionsscheine (Anschaffungskosten – \$)</b>					
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>					
			14.730		99,02
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>					
			14.730		99,02
<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>					
			147		0,98
<b>Gesamnettovermögen</b>					
			14.877\$		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 %.					
<b>ABKÜRZUNGEN:</b>					
ADR	– American Depositary Receipt				
AUD	– Australischer Dollar				
CAD	– Kanadischer Dollar				
CHF	– Schweizer Franken				
EUR	– Euro				
GBP	– Britisches Pfund				
HKD	– Hongkong-Dollar				
JPY	– Japanischer Yen				
MXN	– Mexikanischer Peso				
SEK	– Schwedische Kronen				
TWD	– Taiwanesischer Dollar				
<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>					
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					
98,72					
Sonstige Vermögenswerte					
1,28					
<b>Gesamtvermögen</b>					
100,00					

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert
<b>Stammaktien – 93,06 % (28. Februar 2023: 93,42 %)</b>					
<b>Australien – 4,46 % (28. Februar 2023: 5,07 %)</b>					
AUD	3.386	1,41	USD	1.476	3,88
AUD	3.379	3,05	USD	472	3,04
			USD	105	2,45
	39.009	4,46		396.104	45,31
<b>Brasilien – 2,96 % (28. Februar 2023: 1,70 %)</b>			<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 849.269€)</b>		
BRL	2.031	1,53		813.523	93,06
BRL	3.012	1,43	<b>Real Estate Investment Trusts – 3,90 % (28. Februar 2023: 3,73 %)</b>		
	25.866	2,96	<b>USA – 3,90 % (28. Februar 2023: 3,73 %)</b>		
<b>Kanada – 5,00 % (28. Februar 2023: 8,77 %)</b>					
CAD	1.561	2,47	USD	204	3,90
CAD	771	2,53		34.117	3,90
	43.739	5,00		34.117	3,90
<b>Frankreich – 6,24 % (28. Februar 2023: 6,89 %)</b>			<b>Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 47.412€)</b>		
	133	1,85		34.117	3,90
	2.491	4,39	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 896.681€)</b>		
	54.569	6,24	847.640		
<b>Deutschland – 2,09 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – 0,20 % (28. Februar 2023: 0,18 %)</b>		
	365	2,09	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
<b>Italien – 7,82 % (28. Februar 2023: 3,23 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
	5.868	4,16	849.368		
	4.208	3,66	<b>Devisenterminkontrakte – -0,03 % (28. Februar 2023: -0,10 %)</b>		
	68.315	7,82	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
<b>Japan – 5,64 % (28. Februar 2023: 6,02 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>		
JPY	200	2,71	-210		
JPY	492	2,93	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
	49.264	5,64	849.158		
<b>Portugal – 3,00 % (28. Februar 2023: 3,39 %)</b>			<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>		
	6.238	3,00	25.052		
<b>Spanien – 3,18 % (28. Februar 2023: 11,53 %)</b>			<b>Gesamtvermögen</b>		
	790	3,18	874.210€		
<b>Vereinigtes Königreich – 7,36 % (28. Februar 2023: 10,87 %)</b>			100,00		
GBP	946	3,03	–		
GBP	950	2,06	–		
GBP	1.800	2,27	–		
	64.361	7,36	–		
<b>USA – 45,31 % (28. Februar 2023: 35,95 %)</b>			–		
USD	130	1,90	–		
USD	1.301	3,83	–		
USD	146	2,51	–		
USD	281	3,09	–		
USD	1.235	3,93	–		
USD	276	2,77	–		
USD	1.277	4,27	–		
USD	654	4,61	–		
USD	64	1,38	–		
USD	613	2,20	–		
USD	3.170	5,45	–		

– 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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 27.839.000 EUR und machten 3,18 % des Nettovermögens aus.

**ABKÜRZUNGEN:**

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

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,24
Finanzderivate	0,20
Sonstige Vermögenswerte	3,56
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

**Aufstellung der Devisenterminkontrakte**

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 1	Verkauf AUD 1	€ –
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 1.949	Verkauf BRL 10.312	31
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 189	Verkauf BRL 1.031	-1
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 133	Verkauf EUR 155	–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf BRL 11.343	Verkauf EUR 2.161	-51
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 30	Verkauf EUR 28	–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 88	Verkauf EUR 81	1
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 32	Verkauf GBP 28	–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR –	Verkauf SGD –	–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 18	Verkauf USD 20	–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 125	Verkauf USD 135	–
06. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 1	Verkauf SGD 1	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 79	Verkauf AUD 133	-1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 40	Verkauf CNH 313	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 1.235	Verkauf CNH 9.801	-8
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf SGD 7	Verkauf EUR 5	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf SGD 6.963	Verkauf EUR 4.710	41
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf AUD 4.362	Verkauf EUR 2.591	14
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf CNH 245.347	Verkauf EUR 30.937	156

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

**Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)**

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	450	Verkauf	EUR	416	€	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	101.952	Verkauf	EUR	92.682		1.269
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CNH	243	Verkauf	EUR	30		-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	451	Verkauf	SGD	666		-4
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	4.903	Verkauf	USD	5.351		-28
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	156	Verkauf	USD	169		-
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	185	Verkauf	AUD	365		-3
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	2.968	Verkauf	AUD	3.410		-13
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	982	Verkauf	AUD	1.666		-14
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	96	Verkauf	AUD	110		-
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	1.965	Verkauf	BRL	7.235		-1
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	153	Verkauf	BRL	555		2
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	118	Verkauf	BRL	752		-1
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	9	Verkauf	BRL	57		-
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	50	Verkauf	BRL	264		1
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	639	Verkauf	BRL	3.477		-5
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	200	Verkauf	CAD	345		-2
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.079	Verkauf	CAD	1.594		-8
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	BRL	37	Verkauf	EUR	7		-
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.182	Verkauf	EUR	1.382		-3
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	19.624	Verkauf	EUR	13.296		86
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	74	Verkauf	GBP	64		-
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	4.897	Verkauf	GBP	2.838		28
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.517	Verkauf	GBP	1.298		4
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	223	Verkauf	JPY	41.076		-
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.206	Verkauf	JPY	189.878		-
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	3.709	Verkauf	JPY	395.164		18
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.842	Verkauf	USD	2.345		-10
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	9.953	Verkauf	USD	10.840		-31
26. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	30.583	Verkauf	USD	22.559		77
03. Okt. 2023	BNY Mellon	Kauf	BRL	8.852	Verkauf	EUR	1.663		-26
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 1.921€)								€	1.728
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.058€)									-210
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 863€)								€	1.518

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Stammaktien – 90,11 % (28. Februar 2023: 90,92 %)</b>		
<b>Australien – 8,73 % (28. Februar 2023: 9,91 %)</b>		
AUD 2.358	APA Group	13.690 3,75
AUD 2.455	Atlas Arteria Ltd	9.685 2,65
AUD 992	Transurban Group	8.499 2,33
		31.874 8,73
<b>Brasilien – 3,25 % (28. Februar 2023: 3,91 %)</b>		
BRL 2.075	CCR SA	5.221 1,43
BRL 966	CPFL Energia SA	6.662 1,82
		11.883 3,25
<b>Kanada – 8,05 % (28. Februar 2023: 10,67 %)</b>		
CAD 103	Enbridge Inc	3.620 0,99
CAD 495	Gibson Energy Inc	7.435 2,04
CAD 350	Pembina Pipeline Corp	10.897 2,98
CAD 207	TC Energy Corp	7.464 2,04
		29.416 8,05
<b>China – 1,66 % (28. Februar 2023: 1,17 %)</b>		
HKD 2.163	China Resources Gas Group Ltd	6.079 1,66
<b>Italien – 9,48 % (28. Februar 2023: 4,87 %)</b>		
EUR 2.419	Enel SpA	16.236 4,45
EUR 765	Italgas SpA	4.353 1,19
EUR 2.720	Snam SpA	14.043 3,84
		34.632 9,48
<b>Japan – 3,70 % (28. Februar 2023: 3,51 %)</b>		
JPY 312	West Japan Railway Co	13.516 3,70
<b>Portugal – 4,77 % (28. Februar 2023: 5,27 %)</b>		
EUR 3.820	EDP – Energias de Portugal SA	17.402 4,77
<b>Spanien – 5,94 % (28. Februar 2023: 11,64 %)</b>		
EUR 401	Enagas SA	6.850 1,88
EUR 636	Iberdrola SA	7.541 2,06
EUR 450	Redeia Corp SA	7.299 2,00
		21.690 5,94
<b>Vereinigtes Königreich – 10,52 % (28. Februar 2023: 14,11 %)</b>		
GBP 1.267	National Grid Plc	15.810 4,33
GBP 838	Pennington Group Plc	6.838 1,87
GBP 83	Severn Trent Plc	2.511 0,69
GBP 461	SSE Plc	9.483 2,60
GBP 315	United Utilities Group Plc	3.770 1,03
		38.412 10,52
<b>USA – 34,01 % (28. Februar 2023: 25,86 %)</b>		
254	Brookfield Renewable Corp	7.100 1,94
59	Constellation Energy Corp	6.108 1,67
222	Edison International	15.290 4,19
129	Entergy Corp	12.297 3,37
EUR 304	Ferrovial SE	9.645 2,64
186	NextEra Energy Inc	12.437 3,41
163	NextEra Energy Partners LP	8.121 2,22
386	OGE Energy Corp	13.152 3,60
248	Public Service Enterprise Group Inc	15.174 4,16
223	Southern Co/The	15.121 4,14

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
42	Union Pacific Corp	9.349 2,56
12	Williams Cos Inc/The	404 0,11
		124.198 34,01
<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 358.784\$)</b>		
<b>Vorzugsaktien – 1,56 % (28. Februar 2023: 1,42 %)</b>		
<b>Brasilien – 1,56 % (28. Februar 2023: 1,42 %)</b>		
BRL 724	Centrais Eletricas Brasileiras SA	5.684 1,56
<b>Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 6.183\$)</b>		
<b>Real Estate Investment Trusts – 5,61 % (28. Februar 2023: 6,00 %)</b>		
<b>USA – 5,61 % (28. Februar 2023: 6,00 %)</b>		
63	American Tower Corp	11.442 3,13
90	Crown Castle Inc	9.046 2,48
		20.488 5,61
<b>Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 27.361\$)</b>		
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 392.328\$)</b>		
		355.274 97,28
<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,01 %)</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	6	–
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
	355.280	97,28
<b>Devisenterminkontrakte – -0,28 % (28. Februar 2023: 0,55 %)</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	-1.018	-0,28
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>		
	-1.018	-0,28
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
	354.262	97,00
<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>		
	10.963	3,00
<b>Gesamtneuvermögen</b>		
	365.225\$	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:**

AUD	– Australischer Dollar
BRL	– Brasilianischer Real
CAD	– Kanadischer Dollar
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund
HKD	– Hongkong-Dollar
JPY	– Japanischer Yen

	% des Gesamtvermögens
<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,10
Finanzderivate	–
Sonstige Vermögenswerte	3,90
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

**Aufstellung der Devisenterminkontrakte**

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 6	Verkauf SGD 8	\$ –
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf SGD 16	Verkauf USD 12	–
06. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf SGD 126	Verkauf USD 93	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 210	Verkauf AUD 325	-1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 1	Verkauf AUD 1	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 50	Verkauf CNH 364	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 218	Verkauf EUR 202	-1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 1.372	Verkauf EUR 1.260	5
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 218	Verkauf GBP 172	-1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 243	Verkauf GBP 192	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 108	Verkauf SGD 145	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 2.864	Verkauf SGD 3.885	-13
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf AUD 10.890	Verkauf USD 7.120	-60
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 40.097	Verkauf USD 44.116	-604
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 4.437	Verkauf USD 5.651	-29
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 54	Verkauf USD 58	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

**Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)**

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	175	Verkauf	USD	222	\$ 1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	579	Verkauf	USD	428	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	79.778	Verkauf	USD	59.365	-295
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CNH	11.685	Verkauf	USD	1.621	-14
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	2	Verkauf	USD	2	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 24\$)								\$ 6
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -2.229\$)								-1.018
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -2.205\$)								\$ -1.012

# FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 5,82 % (28. Februar 2023: 4,39 %)</b>					
39.321	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	39.321	5,82		
<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 39.321\$)</b>					
		39.321	5,82		
<b>Stammaktien – 94,79 % (28. Februar 2023: 95,04 %)</b>					
<b>Werbung – 0,02 % (28. Februar 2023: 0,59 %)</b>					
322	Marin Software Inc	148	0,02		
<b>Luft- und Raumfahrt u. Verteidigung – 4,07 % (28. Februar 2023: 5,27 %)</b>					
75	AAR Corp	4.645	0,69		
248	Astronics Corp	4.348	0,64		
88	Ducommun Inc	4.004	0,59		
73	Kaman Corp	1.632	0,24		
178	Kratos Defense & Security Solutions Inc	2.864	0,42		
205	Leonardo DRS Inc	3.516	0,52		
65	Mercury Systems Inc	2.571	0,38		
44	Spirit AeroSystems Holdings Inc „A“	940	0,14		
319	Triumph Group Inc	3.007	0,45		
		27.527	4,07		
<b>Fluggesellschaften – 0,50 % (28. Februar 2023: 0,67 %)</b>					
52	Alaska Air Group Inc	2.165	0,32		
14	Allegiant Travel Co	1.226	0,18		
		3.391	0,50		
<b>Bekleidung – 0,80 % (28. Februar 2023: 1,12 %)</b>					
398	Fossil Group Inc	847	0,12		
203	Lakeland Industries Inc	2.879	0,43		
95	Rocky Brands Inc	1.690	0,25		
		5.416	0,80		
<b>Automobilhersteller – 0,68 % (28. Februar 2023: 0,76 %)</b>					
202	Wabash National Corp	4.566	0,68		
<b>Autoteile u. Ausstattung – 2,63 % (28. Februar 2023: 2,78 %)</b>					
78	Adient Plc	3.046	0,45		
438	Commercial Vehicle Group Inc	4.033	0,60		
153	Dana Inc	2.468	0,37		
474	Garrett Motion Inc	3.671	0,54		
169	Goodyear Tire & Rubber Co/The	2.183	0,32		
152	Shyft Group Inc/The	2.392	0,35		
		17.793	2,63		
<b>Banken – 2,40 % (28. Februar 2023: 1,67 %)</b>					
55	BankUnited Inc	1.446	0,21		
113	BayCom Corp	2.181	0,32		
79	Business First Bancshares Inc	1.608	0,24		
87	Capstar Financial Holdings Inc	1.141	0,17		
50	First Bancshares Inc/The	1.433	0,21		
84	Hanmi Financial Corp	1.453	0,21		
97	Hilltop Holdings Inc	2.941	0,44		
89	Seacoast Banking Corp of Florida	2.095	0,31		
39	Western Alliance Bancorp	1.930	0,29		
		16.228	2,40		
<b>Biotechnologie – 0,38 % (28. Februar 2023: 0,31 %)</b>					
172	NeoGenomics Inc	2.585	0,38		
<b>Baumaterialien – 2,89 % (28. Februar 2023: 2,89 %)</b>					
211	Aspen Aerogels Inc	1.285	0,19		
55	Gibraltar Industries Inc	4.088	0,61		
67	Griffon Corp	2.803	0,41		
122	Modine Manufacturing Co	5.785	0,86		
336	SmartRent Inc	1.144	0,17		
118	Summit Materials Inc „A“	4.401	0,65		
		19.506	2,89		
<b>Chemie – 1,61 % (28. Februar 2023: 1,84 %)</b>					
108	Huntsman Corp	3.018	0,45		
140	Livent Corp	3.003	0,44		
191	Mativ Holdings Inc	3.135	0,46		
128	Tronox Holdings Plc	1.745	0,26		
		10.901	1,61		
<b>Gewerbliche Dienstleistungen – 5,13 % (28. Februar 2023: 3,90 %)</b>					
218	Acacia Research Corp	834	0,12		
47	Adtalem Global Education Inc	2.056	0,30		
366	Arlo Technologies Inc	3.564	0,53		
116	Cross Country Healthcare Inc	2.986	0,44		
97	Evercel Inc	82	0,01		
346	Healthcare Services Group Inc	3.994	0,59		
22	Herc Holdings Inc	2.875	0,43		
57	Korn Ferry	2.902	0,43		
68	LiveRamp Holdings Inc	2.194	0,33		
233	Resources Connection Inc	3.606	0,53		
130	Sterling Check Corp	1.816	0,27		
165	TrueBlue Inc	2.490	0,37		
225	Udemy Inc	2.333	0,35		
58	V2X Inc	2.932	0,43		
		34.664	5,13		
<b>Computer – 1,97 % (28. Februar 2023: 1,39 %)</b>					
616	Confällight Inc	1.926	0,28		
247	Kyndryl Holdings Inc	4.174	0,62		
332	SecureWorks Corp	2.282	0,34		
118	TTEC Holdings Inc	3.518	0,52		
22	WNS Holdings Ltd ADR	1.422	0,21		
		13.322	1,97		
<b>Kosmetik u. Körperpflege – 0,34 % (28. Februar 2023: 0,30 %)</b>					
16	Inter Parfums Inc	2.279	0,34		
<b>Distribution u. Großhandel – 2,93 % (28. Februar 2023: 3,30 %)</b>					
376	Hudson Technologies Inc	4.535	0,67		
488	Manitex International Inc	2.276	0,34		
303	MRC Global Inc	2.824	0,42		
133	Resideo Technologies Inc	2.245	0,33		
83	VSE Corp	4.691	0,69		
20	WESCO International Inc	3.226	0,48		
		19.797	2,93		
<b>Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 3,07 % (28. Februar 2023: 2,13 %)</b>					
105	Air Lease Corp „A“	4.282	0,63		
60	Artisan Partners Asset Management Inc „A“	2.315	0,34		
100	B. Riley Financial Inc	5.125	0,76		
359	Canaccord Genuity Group Inc	2.273	0,34		
239	GCM Grosvenor Inc	1.821	0,27		
57	Moelis & Co „A“	2.716	0,40		
210	Perella Weinberg Partners „A“	2.211	0,33		
		20.743	3,07		
<b>Elektrische Komponenten u. Zubehör – 1,30 % (28. Februar 2023: 1,16 %)</b>					
222	American Superconductor Corp	2.060	0,31		
99	Insteel Industries Inc	3.458	0,51		
285	nLight Inc	3.252	0,48		
		8.770	1,30		
<b>Elektronik – 4,85 % (28. Februar 2023: 5,34 %)</b>					
38	Advanced Energy Industries Inc	4.541	0,67		
121	Applied Optoelectronics Inc	1.661	0,25		
25	Avnet Inc	1.269	0,19		
157	Benchmark Electronics Inc	4.035	0,60		
51	Coherent Corp	1.926	0,28		
306	Comtech Telecommunications Corp	3.075	0,45		
98	CTS Corp	4.375	0,65		
315	Identiv Inc	2.605	0,39		
191	Knowles Corp	3.061	0,45		
230	Stoneridge Inc	4.719	0,70		
55	Vishay Intertechnology Inc	1.500	0,22		
		32.767	4,85		
<b>Energie – Alternative Quellen – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,34 %)</b>					
	TPI Composites Inc	2	–		
<b>Hoch-/Tiefbau u. Bauwesen – 4,12 % (28. Februar 2023: 3,93 %)</b>					
22	Arcosa Inc	1.701	0,25		
8	Comfort Systems USA Inc	1.532	0,23		
488	Concrete Pumping Holdings Inc	3.728	0,55		
127	Construction Partners Inc „A“	4.423	0,66		
118	Limbach Holdings Inc	4.271	0,63		
435	Mistras Group Inc	2.317	0,34		
635	Orion Group Holdings Inc	3.040	0,45		
138	Primoris Services Corp	4.881	0,72		
24	Sterling Infrastructure Inc	1.972	0,29		
		27.865	4,12		
<b>Unterhaltung – 0,32 % (28. Februar 2023: 0,32 %)</b>					
114	IMAX Corp	2.178	0,32		
<b>Umweltschutz – 0,52 % (28. Februar 2023: 0,55 %)</b>					
253	CECO Environmental Corp	3.482	0,52		
<b>Nahrungsmittel – 0,45 % (28. Februar 2023: 0,51 %)</b>					
96	Krispy Kreme Inc	1.283	0,19		
392	SunOpta Inc	1.725	0,26		
		3.008	0,45		
<b>Hand-/Maschinenwerkzeuge – 0,53 % (28. Februar 2023: 0,80 %)</b>					
36	Hurco Cos Inc	779	0,11		
234	Luxfer Holdings Plc	2.808	0,42		
		3.587	0,53		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert		
<b>Stammaktien – (Fortsetzung)</b>							
<b>Gesundheit – Produkte – 2,99 % (28. Februar 2023: 2,02 %)</b>							
1.004	Accuray Inc	2.868	0,43				
413	Apyx Medical Corp	1.933	0,29				
209	Artivion Inc	3.540	0,52				
39	Azenta Inc	2.207	0,33				
148	CareDx Inc	1.380	0,20				
286	MiMedx Group Inc	2.119	0,31				
125	Tactile Systems Technology Inc	2.374	0,35				
194	Varex Imaging Corp	3.809	0,56				
		20.230	2,99				
<b>Gesundheit – Dienstleistungen – 1,34 % (28. Februar 2023: 1,33 %)</b>							
376	Community Health Systems Inc	1.270	0,19				
304	Quip Home Medical Corp	1.797	0,27				
111	RadNet Inc	3.717	0,55				
77	Select Medical Holdings Corp	2.249	0,33				
		9.033	1,34				
<b>Bauunternehmen – 2,75 % (28. Februar 2023: 2,86 %)</b>							
62	Beazer Homes USA Inc	1.813	0,27				
11	Cavco Industries Inc	2.954	0,44				
23	Century Communities Inc	1.694	0,25				
15	M/I Homes Inc	1.458	0,21				
59	Skyline Champion Corp	4.233	0,63				
60	Taylor Morrison Home Corp „A“	2.839	0,42				
21	Toll Brothers Inc	1.691	0,25				
60	Tri Pointe Homes Inc	1.878	0,28				
		18.560	2,75				
<b>Wohnungseinrichtungen – 0,26 % (28. Februar 2023: 0,18 %)</b>							
406	VIA Optronics AG ADR	512	0,08				
215	Vizio Holding Corp	1.235	0,18				
		1.747	0,26				
<b>Haushaltswaren u. -artikel – 0,46 % (28. Februar 2023: 0,40 %)</b>							
37	Spectrum Brands Holdings Inc	3.085	0,46				
<b>Versicherungen – 0,68 % (28. Februar 2023: 0,33 %)</b>							
92	Brighthouse Financial Inc	4.593	0,68				
<b>Internet – 4,17 % (28. Februar 2023: 3,78 %)</b>							
150	Cars.com Inc	2.809	0,42				
661	comScore Inc	463	0,07				
89	Criteo SA ADR	2.616	0,39				
672	DHI Group Inc	2.525	0,37				
585	Entravision Communications Corp	2.236	0,33				
282	EverQuote Inc	1.744	0,26				
71	IAC Inc	3.911	0,58				
703	Innovid Corp	819	0,12				
361	LifeMD Inc	1.391	0,21				
355	Magnite Inc	2.929	0,43				
119	Overstock.com Inc	3.093	0,46				
365	QuinStreet Inc	3.617	0,53				
		28.153	4,17				
<b>Eisen/Stahl – 2,63 % (28. Februar 2023: 3,20 %)</b>							
101	ATI Inc	4.557	0,68				
86	Carpenter Technology Corp	5.366	0,80				
63	Commercial Metals Co	3.540	0,52				
88	Haynes International Inc	4.272	0,63				
		17.735	2,63				
<b>Hotels – 0,58 % (28. Februar 2023: 0,61 %)</b>							
136	Century Casinos Inc	885	0,13				
200	Marcus Corp/The	3.035	0,45				
		3.920	0,58				
<b>Maschinen – Bau u. Bergbau – 1,86 % (28. Februar 2023: 1,43 %)</b>							
65	Argan Inc	2.741	0,40				
691	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	3.623	0,54				
58	BWX Technologies Inc	4.303	0,64				
31	Terex Corp	1.897	0,28				
		12.564	1,86				
<b>Maschinen – Diversifiziert – 1,40 % (28. Februar 2023: 2,02 %)</b>							
130	Ichor Holdings Ltd	4.762	0,71				
669	Intevac Inc	2.324	0,34				
118	Power Solutions International Inc	361	0,05				
142	Twin Disc Inc	2.046	0,30				
		9.493	1,40				
<b>Medien – 0,42 % (28. Februar 2023: 0,48 %)</b>							
138	Thryv Holdings Inc	2.807	0,42				
<b>Metallherstellung u. -elemente – 2,15 % (28. Februar 2023: 2,27 %)</b>							
47	Helios Technologies Inc	2.720	0,41				
151	Mayville Engineering Co Inc	1.768	0,26				
106	Northwest Pipe Co	3.515	0,52				
				32	Olympic Steel Inc	1.699	0,25
				219	TimkenSteel Corp	4.802	0,71
						14.504	2,15
<b>Bergbau – 1,31 % (28. Februar 2023: 1,17 %)</b>							
CAD	424	Capstone Copper Corp	1.972	0,29			
	34	Century Aluminum Co	254	0,04			
	690	Ferroglobe Plc	3.683	0,55			
CAD	457	Major Drilling Group International Inc	2.932	0,43			
			8.841	1,31			
<b>Fertigung diverse – 1,26 % (28. Februar 2023: 1,63 %)</b>							
	17	EnPro Industries Inc	2.369	0,35			
	17	Fabrinet	2.749	0,41			
	136	Trinity Industries Inc	3.398	0,50			
			8.516	1,26			
<b>Büroeinrichtung – 0,36 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>							
	152	Xerox Holdings Corp	2.409	0,36			
<b>Öl u. Gas – 2,74 % (28. Februar 2023: 2,57 %)</b>							
	630	Baytex Energy Corp	2.566	0,38			
	28	Chesapeake Energy Corp	2.451	0,36			
	78	Matador Resources Co	4.950	0,73			
	100	Northern Oil and Gas Inc	4.195	0,62			
	145	Patterson-UTI Energy Inc	2.054	0,31			
	338	Southwestern Energy Co	2.289	0,34			
			18.505	2,74			
<b>Öl- u. Gasdienstleistungen – 3,65 % (28. Februar 2023: 2,41 %)</b>							
	301	Archrock Inc	3.852	0,57			
	110	DMC Global Inc	2.640	0,39			
	427	Mammoth Energy Services Inc	1.980	0,29			
	420	Matrix Service Co	3.476	0,52			
	294	Newpark Resources Inc	1.758	0,26			
	210	NOW Inc	2.342	0,35			
	137	ProPetro Holding Corp	1.321	0,20			
	178	Ranger Energy Services Inc	2.120	0,31			
	254	Select Water Solutions Inc	2.042	0,30			
	298	Solaris Oilfield Infrastructure Inc „A“	3.132	0,46			
			24.663	3,65			
<b>Verpackung u. Behältnisse – 0,39 % (28. Februar 2023: 0,47 %)</b>							
	100	TriMas Corp	2.632	0,39			
<b>Pharma – 0,61 % (28. Februar 2023: 0,93 %)</b>							
	160	Organon & Co	3.522	0,52			
	999	Societal CDMO Inc	588	0,09			
			4.110	0,61			
<b>Private Equity – 0,37 % (28. Februar 2023: 0,17 %)</b>							
	211	P10 Inc	2.534	0,37			
<b>Immobilien – 0,15 % (28. Februar 2023: 0,17 %)</b>							
	157	Fathom Holdings Inc	985	0,15			
<b>Einzelhandel – 6,19 % (28. Februar 2023: 7,40 %)</b>							
	17	Asbury Automotive Group Inc	3.904	0,58			
	586	Barnes & Noble Education Inc	758	0,11			
	20	BlueLinx Holdings Inc	1.764	0,26			
	178	Caleres Inc	5.093	0,75			
	344	Carrols Restaurant Group Inc	2.400	0,36			
	404	Chico's FAS Inc	2.072	0,31			
	327	Designer Brands Inc	3.436	0,51			
	12	Dillard's Inc	4.242	0,63			
	31	Express Inc	316	0,05			
	144	J Jill Inc	3.627	0,54			
	46	MarineMax Inc	1.520	0,22			
	677	Noodles & Co „A“	1.878	0,28			
	164	Nordstrom Inc	2.656	0,39			
	60	OneWater Marine Inc „A“	1.559	0,23			
	34	Patrick Industries Inc	2.838	0,42			
	238	Sportsman's Warehouse Holdings Inc	1.145	0,17			
	164	Vera Bradley Inc	1.174	0,17			
	76	Victoria's Secret & Co	1.451	0,21			
			41.833	6,19			
<b>Sparen u. Kredite – 0,49 % (28. Februar 2023: 0,52 %)</b>							
	48	Axos Financial Inc	2.085	0,31			
	102	New York Community Bancorp Inc	1.257	0,18			
			3.342	0,49			
<b>Halbleiter – 5,87 % (28. Februar 2023: 5,09 %)</b>							
	125	Alpha & Omega Semiconductor Ltd	3.926	0,58			
	109	Amkor Technology Inc	3.048	0,45			
	359	Amtech Systems Inc	3.091	0,46			
	114	Cohu Inc	4.279	0,63			
	114	FormFactor Inc	4.040	0,60			
	107	inTEST Corp	1.869	0,28			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Stammaktien – (Fortsetzung)</b>			62 Scorpio Tankers Inc		
<b>Halbleiter – (Fortsetzung)</b>			18.953		
67 Kulicke & Soffa Industries Inc	3.488	0,52	2,81		
30 Onto Innovation Inc	4.237	0,63	<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 623.415\$)</b>		
126 Ultra Clean Holdings Inc	4.426	0,65	640.372		
182 Veeco Instruments Inc	5.305	0,78	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 662.736\$)</b>		
54 Vishay Precision Group Inc	1.953	0,29	679.693		
	39.662	5,87	<b>Devisenterminkontrakte – 0,01 % (28. Februar 2023: 0,02 %)</b>		
<b>Software – 1,87 % (28. Februar 2023: 1,81 %)</b>			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
148 ACV Auctions Inc	2.482	0,37	94		
108 Digi International Inc	3.594	0,53	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
13 Everbridge Inc	332	0,05	679.787		
151 HireRight Holdings Corp	1.578	0,23	<b>Devisenterminkontrakte – -0,14 % (28. Februar 2023: 0,22 %)</b>		
366 Immersion Corp	2.571	0,38	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
332 Viant Technology Inc	2.081	0,31	-945		
	12.638	1,87	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>		
<b>Telekommunikation – 3,52 % (28. Februar 2023: 4,15 %)</b>			-945		
179 A10 Networks Inc	2.662	0,39	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
272 ADTRAN Holdings Inc	2.325	0,34	678.842		
117 Aviat Networks Inc	4.115	0,61	<b>Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten</b>		
110 Cambium Networks Corp	1.010	0,15	-3.303		
67 Clearfield Inc	2.350	0,35	<b>Gesamtvermögen</b>		
461 DZS Inc	1.069	0,16	675.539\$		
131 Frequency Electronics Inc	870	0,13	100,00		
305 Infinera Corp	1.425	0,21			
269 Ooma Inc	3.786	0,56			
534 PCTEL Inc	2.214	0,33			
513 Ribbon Communications Inc	1.522	0,22			
372 Terran Orbital Corp	452	0,07			
	23.800	3,52			
<b>Transport – 2,81 % (28. Februar 2023: 3,64 %)</b>					
247 Ardmore Shipping Corp	3.068	0,45			
442 Daseke Inc	2.346	0,35			
60 Hub Group Inc „A“	4.669	0,69			
241 Navigator Holdings Ltd	3.322	0,49			
357 Radiant Logistics Inc	2.406	0,36			

Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 662.736\$)

Devisenterminkontrakte – 0,01 % (28. Februar 2023: 0,02 %)

Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)

Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte

Devisenterminkontrakte – -0,14 % (28. Februar 2023: 0,22 %)

Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)

Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten

Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten

Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten

Gesamtvermögen

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

### ABKÜRZUNGEN:

ADR	– American Depositary Receipt
CAD	– Kanadischer Dollar

	% des Gesamtvermögens
<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	93,96
Organismen für gemeinsame Anlagen	5,77
Finanzderivate	0,01
Sonstige Vermögenswerte	0,26
<b>Gesamtvermögen</b>	100,00

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf AUD	\$
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf BRL	1.243
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf BRL	27.558
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf EUR	16
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf GBP	5
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf SGD	196
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR	Verkauf USD	19
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR	Verkauf USD	–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP	Verkauf USD	82
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP	Verkauf USD	–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf SGD	Verkauf USD	6
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf BRL	Verkauf USD	6.071
06. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf SGD	5
06. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf USD	2
06. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf CNH	Verkauf USD	19
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf AUD	370
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf AUD	436
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf CNH	96
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf CNH	1.416
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf EUR	19
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf EUR	1.113
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf GBP	6
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf PLN	1.541
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf SEK	1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf SEK	96
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf SGD	1.300
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf SGD	4

# FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1.218	Verkauf	SGD	1.649	\$ -3
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	38.953	Verkauf	USD	28.986	-144
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	PLN	23.852	Verkauf	USD	5.851	-75
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	855	Verkauf	USD	80	-2
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	8.268	Verkauf	USD	5.405	-45
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	99	Verkauf	USD	65	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CNH	388	Verkauf	USD	53	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	64	Verkauf	USD	69	-
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	CNH	22.169	Verkauf	USD	3.075	-27
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	20.821	Verkauf	USD	22.907	-313
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	1.134	Verkauf	USD	836	3
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	93	Verkauf	USD	119	-1
03. Okt. 2023	BNY Mellon	Kauf	BRL	27.569	Verkauf	USD	5.607	-69
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 150\$)								\$ 94
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.623\$)								-945
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.473\$)								\$ -851

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Royce US Smaller Companies Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,91 % (28. Februar 2023: 3,48 %)</b>			<b>Hotels – 1,17 % (28. Februar 2023: 1,99 %)</b>		
11 iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	1.641	1,78	166 Century Casinos Inc	1.084	1,17
1.044 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.044	1,13	<b>Maschinen – Diversifiziert – 3,80 % (28. Februar 2023: 3,50 %)</b>		
<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 2.6925)</b>			22 Esab Corp	1.622	1,75
			9 Kadant Inc	1.895	2,05
			<b>2.685 2,91</b>		
<b>Stammaktien – 97,35 % (28. Februar 2023: 97,23 %)</b>			<b>Metallherstellung u. -elemente – 1,49 % (28. Februar 2023: 0,65 %)</b>		
<b>Luft- und Raumfahrt u. Verteidigung – 1,68 % (28. Februar 2023: 1,09 %)</b>			20 Northwest Pipe Co	677	0,73
91 Leonardo DRS Inc	1.550	1,68	23 Ryerson Holding Corp	702	0,76
<b>Bekleidung – 2,92 % (28. Februar 2023: 2,41 %)</b>			<b>1.379 1,49</b>		
13 Carter's Inc	927	1,00	<b>Fertigung diverse – 5,41 % (28. Februar 2023: 5,33 %)</b>		
38 Steven Madden Ltd	1.318	1,43	11 EnPro Industries Inc	1.465	1,58
57 Wolverine World Wide Inc	458	0,49	5 Fabrinet	855	0,93
<b>2.703 2,92</b>			24 John Bean Technologies Corp	2.680	2,90
			<b>5.000 5,41</b>		
<b>Autoteile u. Ausstattung – 3,94 % (28. Februar 2023: 3,47 %)</b>			<b>Öl- u. Gasdienstleistungen – 1,74 % (28. Februar 2023: 1,54 %)</b>		
62 Gentex Corp	2.020	2,18	CAD 156 Pason Systems Inc	1.612	1,74
41 Miller Industries Inc/TN	1.626	1,76	<b>Pharma – 2,23 % (28. Februar 2023: 3,27 %)</b>		
<b>3.646 3,94</b>			96 Catalyst Pharmaceuticals Inc	1.345	1,46
<b>Baumaterialien – 1,86 % (28. Februar 2023: 2,02 %)</b>			20 Harmony Biosciences Holdings Inc	715	0,77
28 Louisiana-Pacific Corp	1.719	1,86	<b>2.060 2,23</b>		
<b>Chemie – 3,31 % (28. Februar 2023: 3,48 %)</b>			<b>Immobilien – 4,39 % (28. Februar 2023: 3,88 %)</b>		
21 Innospec Inc	2.296	2,49	168 Kennedy-Wilson Holdings Inc	2.680	2,90
4 Quaker Chemical Corp	760	0,82	41 Marcus & Millichap Inc	1.378	1,49
<b>3.056 3,31</b>			<b>4.058 4,39</b>		
<b>Gewerbliche Dienstleistungen – 8,63 % (28. Februar 2023: 7,42 %)</b>			<b>Einzelhandel – 1,35 % (28. Februar 2023: 1,49 %)</b>		
12 AMN Healthcare Services Inc	1.029	1,11	46 Movado Group Inc	1.247	1,35
14 Cass Information Systems Inc	546	0,59	<b>Halbleiter – 10,25 % (28. Februar 2023: 9,18 %)</b>		
22 Computer Task Group Inc	227	0,25	8 Cirrus Logic Inc	668	0,72
139 Dun & Bradstreet Holdings Inc	1.510	1,63	16 Cohu Inc	583	0,63
58 Forrester Research Inc	1.760	1,90	70 FormFactor Inc	2.460	2,66
47 Korn Ferry	2.411	2,61	26 MKS Instruments Inc	2.556	2,77
8 RB Global Inc	495	0,54	13 Onto Innovation Inc	1.750	1,89
<b>7.978 8,63</b>			41 Vishay Precision Group Inc	1.461	1,58
			<b>9.478 10,25</b>		
<b>Computer – 0,52 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			<b>Software – 0,91 % (28. Februar 2023: 2,94 %)</b>		
8 Crane NXT Co	484	0,52	8 Avid Technology Inc	225	0,24
<b>Kosmetik u. Körperpflege – 2,26 % (28. Februar 2023: 2,16 %)</b>			14 Simulations Plus Inc	620	0,67
15 Inter Parfums Inc	2.087	2,26	<b>845 0,91</b>		
<b>Distribution u. Großhandel – 0,88 % (28. Februar 2023: 2,20 %)</b>			<b>Transport – 1,93 % (28. Februar 2023: 3,63 %)</b>		
67 Hudson Technologies Inc	811	0,88	9 Landstar System Inc	1.782	1,93
<b>Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 8,63 % (28. Februar 2023: 7,55 %)</b>			<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 83.2195)</b>		
54 Air Lease Corp „A“	2.213	2,39	<b>89.990 97,35</b>		
52 Artisan Partners Asset Management Inc „A“	2.010	2,18	<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 85.9115)</b>		
25 Houlihan Lokey Inc „A“	2.606	2,82	<b>92.675 100,26</b>		
33 Lazard Ltd „A“	1.148	1,24	<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
<b>7.977 8,63</b>			<b>Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)</b>		
			<b>– –</b>		
<b>Elektronik – 6,79 % (28. Februar 2023: 5,96 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
33 Brady Corp „A“	1.662	1,80	<b>92.675 100,26</b>		
26 ESCO Technologies Inc	2.748	2,97	<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
62 Kimball Electronics Inc	1.864	2,02	<b>Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)</b>		
<b>6.274 6,79</b>			<b>–2 –</b>		
<b>Hoch-/Tiefbau u. Bauwesen – 2,25 % (28. Februar 2023: 2,22 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>		
27 Arcosa Inc	2.083	2,25	<b>–2 –</b>		
<b>Umweltschutz – 0,39 % (28. Februar 2023: 0,88 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
8 Heritage-Crystal Clean Inc	358	0,39	<b>92.673 100,26</b>		
<b>Gesundheit – Produkte – 5,25 % (28. Februar 2023: 5,87 %)</b>			<b>Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten</b>		
31 Bio-Techne Corp	2.424	2,62	<b>–238 –0,26</b>		
31 Enovis Corp	1.756	1,90	<b>Gesamtnettovermögen</b>		
4 UFP Technologies Inc	669	0,73	<b>92.435\$ 100,00</b>		
<b>4.849 5,25</b>					
<b>Bauunternehmen – 4,13 % (28. Februar 2023: 3,71 %)</b>					
13 LCI Industries	1.598	1,73			
31 Skyline Champion Corp	2.221	2,40			
<b>3.819 4,13</b>					
<b>Versicherungen – 4,64 % (28. Februar 2023: 4,88 %)</b>					
12 RLI Corp	1.574	1,71			
2 White Mountains Insurance Group Ltd	2.711	2,93			
<b>4.285 4,64</b>					
<b>Internet – 2,93 % (28. Februar 2023: 2,92 %)</b>					
41 Ziff Davis Inc	2.705	2,93			
<b>Freizeit – 1,67 % (28. Februar 2023: 1,59 %)</b>					
20 Brunswick Corp/DE	1.544	1,67			

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

### ABKÜRZUNGEN:

ETF – Börsengehandelter Fonds  
CAD – Kanadischer Dollar

### Verteilung des Gesamtvermögens

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,72
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,89
Sonstige Vermögenswerte	0,39
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

# FTGF Royce US Smaller Companies Fund

Anlagenportfolio zum 31. August 2023 – (Fortsetzung)

## Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	20	Verkauf	USD	22	\$	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	6	Verkauf	EUR	6		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	12	Verkauf	SEK	129		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	SEK	14		–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	161	Verkauf	USD	15		-1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	92	Verkauf	USD	101		-1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	1	Verkauf	USD	–		–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): – \$)									–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -2\$)									-2
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -2\$)								\$	-2

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 4,05 % (28. Februar 2023: 4,24 %)</b>		
171 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	171	4,05
<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 1715)</b>		
<b>Stammaktien – 95,97 % (28. Februar 2023: 96,21 %)</b>		
<b>Australien – 3,88 % (28. Februar 2023: 3,53 %)</b>		
AUD 25 Hansen Technologies Ltd	89	2,12
AUD 15 IPH Ltd	75	1,76
	164	3,88
<b>Belgien – 1,01 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
EUR 2 Azelis Group NV	43	1,01
<b>Brasilien – 1,49 % (28. Februar 2023: 1,03 %)</b>		
BRL 16 Odontoprev SA	33	0,79
BRL 5 TOTVS SA	30	0,70
	63	1,49
<b>Kanada – 6,11 % (28. Februar 2023: 1,16 %)</b>		
1 Colliers International Group Inc	91	2,15
1 FirstService Corp	102	2,42
1 RB Global Inc	65	1,54
	258	6,11
<b>Frankreich – 0,80 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
EUR 1 Lectra	34	0,80
<b>Deutschland – 1,24 % (28. Februar 2023: 1,79 %)</b>		
EUR – New Work SE	53	1,24
<b>Italien – 2,97 % (28. Februar 2023: 3,01 %)</b>		
EUR 1 Carel Industries SpA, 144A	31	0,74
EUR – DiaSorin SpA	36	0,85
EUR 9 GVS SpA, 144A	58	1,38
	125	2,97
<b>Japan – 10,30 % (28. Februar 2023: 11,67 %)</b>		
JPY 1 As One Corp	39	0,93
JPY 4 BML Inc	82	1,93
JPY 3 JCU Corp	65	1,53
JPY 2 Miura Co Ltd	39	0,93
JPY 1 OBIC Business Consultants Co Ltd	47	1,12
JPY 3 TKC Corp	81	1,91
JPY 2 USS Co Ltd	33	0,78
JPY 2 Zuken Inc	50	1,17
	436	10,30
<b>Niederlande – 2,19 % (28. Februar 2023: 2,14 %)</b>		
EUR – IMCD NV	43	1,01
EUR 14 Marel hf, 144A	50	1,18
	93	2,19
<b>Polen – 1,14 % (28. Februar 2023: 1,33 %)</b>		
PLN 3 Asseco Poland SA	48	1,14
<b>Südkorea – 1,46 % (28. Februar 2023: 1,99 %)</b>		
KRW 8 NICE Information Service Co Ltd	62	1,46
<b>Schweden – 1,09 % (28. Februar 2023: 1,07 %)</b>		
SEK 11 Karnov Group AB	46	1,09
<b>Schweiz – 1,83 % (28. Februar 2023: 1,79 %)</b>		
CHF – Kardex Holding AG	32	0,76
CHF – VZ Holding AG	45	1,07
	77	1,83
<b>Vereinigtes Königreich – 13,21 % (28. Februar 2023: 12,45 %)</b>		
GBP 7 Auction Technology Group Plc	63	1,49
GBP 1 Croda International Plc	41	0,96
GBP 1 Diploma Plc	57	1,34
GBP 6 DiscoverIE Group Plc	60	1,42
GBP 1 Intertek Group Plc	43	1,01
GBP 71 Learning Technologies Group Plc	69	1,62
GBP 10 Marlowe Plc	78	1,85
GBP 26 Restore Plc	58	1,38
GBP – Spirax-Sarco Engineering Plc	49	1,17
GBP 2 Victrex Plc	41	0,97
	559	13,21
<b>USA – 46,24 % (28. Februar 2023: 52,24 %)</b>		
1 Arcosa Inc	75	1,78
1 Avid Technology Inc	17	0,40
1 Brunswick Corp/DE	69	1,64

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
1 Cognex Corp	39	0,92
1 Dorman Products Inc	70	1,66
1 Enovis Corp	46	1,09
– EnPro Industries Inc	22	0,52
1 Esab Corp	43	1,02
1 ESCO Technologies Inc	62	1,48
2 FormFactor Inc	75	1,79
2 Forrester Research Inc	53	1,24
– Fox Factory Holding Corp	34	0,80
1 Gentex Corp	49	1,15
1 Haemonetics Corp	77	1,83
– Houlihan Lokey Inc „A“	39	0,92
1 Innospec Inc	72	1,70
– Inter Parfums Inc	63	1,49
1 John Bean Technologies Corp	65	1,53
– Kadant Inc	76	1,79
5 Kennedy-Wilson Holdings Inc	79	1,86
– Landstar System Inc	56	1,31
– LCI Industries	62	1,47
– Lincoln Electric Holdings Inc	70	1,65
– Littelfuse Inc	42	0,98
1 LKQ Corp	28	0,67
1 Marcus & Millichap Inc	23	0,54
1 MKS Instruments Inc	90	2,14
– Quaker Chemical Corp	77	1,83
– Ralph Lauren Corp „A“	54	1,27
– Rogers Corp	43	1,03
1 SEI Investments Co	72	1,70
1 UFP Industries Inc	86	2,03
– Valmont Industries Inc	55	1,31
1 Ziff Davis Inc	72	1,70
	1.955	46,24

<b>Vietnam – 1,01 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
GBP 2 XP Power Ltd	43	1,01
<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 4.450\$)</b>		
	4.059	95,97
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
	4.230	100,02
<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
	4.230	100,02
<b>Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten</b>		
	-1	-0,02
<b>Gesamtvermögen</b>		
	4.229\$	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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 139.000 USD und machten 3,30 % des Nettovermögens aus.

**ABKÜRZUNGEN:**

AUD	– Australischer Dollar
BRL	– Brasilianischer Real
CHF	– Schweizer Franken
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund
JPY	– Japanischer Yen
KRW	– Südkoreanischer Won
PLN	– Polnischer Zloty
SEK	– Schwedische Kronen

	% des Gesamtvermögens
<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	95,46
Organismen für gemeinsame Anlagen	4,02
Sonstige Vermögenswerte	0,52
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Franklin MV European Equity Growth and Income Fund<sup>μ</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR
<b>Stammaktien – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>	
<b>Russland – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>	
GBP 54 Evraz Plc †	–
<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 313€)</b>	<b>–</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten</b>	<b>–</b>
<b>Gesamtnettovermögen</b>	<b>– €</b>

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

† Nicht liquide.

μ Mit Wirkung vom 11. Juli 2022 stellte der Franklin MV European Equity Growth and Income Fund<sup>μ</sup> den Handel ein.

#### ABKÜRZUNGEN:

GBP – Britisches Pfund

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtver- mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	–
Sonstige Vermögenswerte	100,00
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

<sup>μ</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>^F</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD
<b>Stammaktien – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>	
<b>Griechenland – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>	
EUR	1 FF Group †
<b>Hongkong – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>	
HKD	38 Hanergy Mobile Energy Holding Group Co Ltd †
<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 44\$)</b>	
<b>Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten</b>	
<b>Gesamtvermögen</b>	

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

† Nicht liquide.

F Mit Wirkung vom 14. November 2021 stellte der Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

#### ABKÜRZUNGEN:

EUR – Euro  
HKD – Hongkong-Dollar

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtver- mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	–
Sonstige Vermögenswerte	100,00
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund<sup>^Ω</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD
<b>Stammaktien – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>	
<b>Russland – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>	
8 Gazprom PJSC ADR †	–
<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 54\$)</b>	–
<b>Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten</b>	–
<b>Gesamt Nettovermögen</b>	– \$

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

† Nicht liquide.

Ω Mit Wirkung vom 27. April 2022 stellte der Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

#### ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtver- mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	–
Sonstige Vermögenswerte	100,00
<b>Gesamtvermögen</b>	100,00

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,38 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			19 Veeva Systems Inc „A“		
573	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,38	24	Zoetis Inc	2,98
	573	0,38		83.517	55,47
<b>Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 573\$)</b>			<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 155.254\$)</b>		
			151.696		
<b>Stammaktien – 100,75 % (28. Februar 2023: 101,05 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 155.827\$)</b>		
			152.269		
<b>China – 2,11 % (28. Februar 2023: 3,03 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – 0,02 % (28. Februar 2023: 0,03 %)</b>		
HKD	564 Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	2,11	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
<b>Dänemark – 2,98 % (28. Februar 2023: 3,50 %)</b>			33		
DKK	39 Coloplast A/S	2,98	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
<b>Frankreich – 8,82 % (28. Februar 2023: 10,14 %)</b>			152.302		
EUR	6 Kering SA	2,17	<b>Devisenterminkontrakte – 0,98 % (28. Februar 2023: 1,01 %)</b>		
EUR	14 L'Oreal SA	4,14	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
EUR	19 Pernod Ricard SA	2,51	-1.479		
	13.278	8,82	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>		
<b>Irland – 4,16 % (28. Februar 2023: 5,88 %)</b>			-1.479		
EUR	74 Kingspan Group Plc	4,16	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
<b>Italien – 8,95 % (28. Februar 2023: 8,65 %)</b>			150.823		
EUR	21 Ferrari NV	4,43	<b>Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten</b>		
EUR	100 Moncler SpA	4,52	-250		
	13.472	8,95	<b>Gesamtvermögen</b>		
<b>Niederlande – 6,99 % (28. Februar 2023: 5,90 %)</b>			150.573\$		
EUR	3 Adyen NV, 144A	1,54			
EUR	12 ASML Holding NV	5,45			
	10.527	6,99			
<b>Schweden – 8,27 % (28. Februar 2023: 9,97 %)</b>					
SEK	159 Assa Abloy AB	2,38			
SEK	421 Atlas Copco AB	3,70			
SEK	369 Hexagon AB	2,19			
	12.446	8,27			
<b>Vereinigtes Königreich – 3,00 % (28. Februar 2023: 7,55 %)</b>					
GBP	65 Croda International Plc	3,00			
<b>USA – 55,47 % (28. Februar 2023: 43,39 %)</b>					
AUD	9 Adobe Inc	3,40			
	13 ANSYS Inc	2,84			
	16 Autodesk Inc	2,38			
	27 CSL Ltd	3,22			
	24 Estee Lauder Cos Inc/The „A“	2,51			
	13 Illumina Inc	1,40			
	20 Linde Plc	5,02			
	24 Masimo Corp	1,82			
	14 Mastercard Inc	3,93			
	4 Mettler-Toledo International Inc	2,96			
	26 Microsoft Corp	5,56			
	35 NIKE Inc	2,34			
	30 NVIDIA Corp	9,79			
	25 ResMed Inc	2,67			

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

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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 5.503.000 USD und machten 3,65 % des Nettovermögens aus.

### ABKÜRZUNGEN:

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

	% des Gesamtvermögens
<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	99,44
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,38
Finanzderivate	0,02
Sonstige Vermögenswerte	0,16
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 27	Verkauf EUR 25	\$ –
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 27	Verkauf USD 30	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 1.227	Verkauf EUR 1.136	-6
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 5.576	Verkauf EUR 5.111	30
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 238	Verkauf GBP 186	2
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 25	Verkauf GBP 20	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 99.726	Verkauf USD 109.679	-1.461
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 1.706	Verkauf USD 1.850	1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 1.892	Verkauf USD 2.407	-12
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 63	Verkauf USD 80	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 41\$)				\$ 33
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.422\$)				-1.479
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -1.381\$)				\$ -1.446

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Stammaktien – 57,23 % (28. Februar 2023: 56,65 %)</b>			<b>Indien – 5,23 % (28. Februar 2023: 4,22 %)</b>		
<b>Australien – 14,62 % (28. Februar 2023: 13,13 %)</b>			<b>Neuseeland – 1,94 % (28. Februar 2023: 2,04 %)</b>		
AUD	107	AGL Energy Ltd	765	3,73	
AUD	73	APA Group	423	2,07	
AUD	583	Aurizon Holdings Ltd	1.371	6,69	
AUD	51	Transurban Group	437	2,13	
	2.996	14,62			
<b>China – 12,04 % (28. Februar 2023: 13,32 %)</b>			<b>Singapur – 5,05 % (28. Februar 2023: 6,88 %)</b>		
HKD	386	China Merchants Port Holdings Co Ltd	463	2,26	
HKD	1.996	China Tower Corp Ltd, 144A	194	0,95	
HKD	1.588	Guangdong Investment Ltd	1.239	6,04	
HKD	1.106	Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	571	2,79	
	2.467	12,04			
<b>Hongkong – 4,28 % (28. Februar 2023: 5,49 %)</b>			<b>Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 10.338\$)</b>		
HKD	90	CLP Holdings Ltd	701	3,42	
HKD	42	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	175	0,86	
	876	4,28			
<b>Indien – 7,89 % (28. Februar 2023: 7,70 %)</b>			<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 23.141\$)</b>		
INR	242	Indus Towers Ltd	512	2,49	
INR	242	NHPC Ltd	147	0,72	
INR	324	Power Grid Corp of India Ltd	959	4,68	
	1.618	7,89			
<b>Malaysia – 2,52 % (28. Februar 2023: 2,57 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
MYR	50	Petronas Gas Bhd			
MYR	442	Westports Holdings Bhd			
	517	2,52			
<b>Neuseeland – 5,32 % (28. Februar 2023: 5,98 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
NZD	186	Chorus Ltd	896	4,37	
NZD	39	Contact Energy Ltd	195	0,95	
	1.091	5,32			
<b>Philippinen – 1,84 % (28. Februar 2023: 1,10 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>		
PHP	62	Manila Electric Co			
	378	1,84			
<b>Singapur – 5,51 % (28. Februar 2023: 4,14 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
SGD	772	Capitaland India Trust			
SGD	736	NETLINK NBN TRUST			
	1.129	5,51			
<b>Thailand – 3,21 % (28. Februar 2023: 3,22 %)</b>			<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>		
THB	2.427	Digital Telecommunications Infrastructure Fund			
	658	3,21			
<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 12.803\$)</b>			<b>Gesamtvermögen</b>		
	11.730	57,23		20.497\$	100,00
<b>Real Estate Investment Trusts – 41,37 % (28. Februar 2023: 42,58 %)</b>			<b>– 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 %.</b>		
<b>Australien – 19,28 % (28. Februar 2023: 20,53 %)</b>			<b>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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 194.000 USD und machten 0,95 % des Nettovermögens aus.</b>		
AUD	63	Charter Hall Long Wale REIT	144	0,70	
AUD	420	Charter Hall Retail REIT	943	4,60	
AUD	138	GPT Group/The	373	1,82	
AUD	97	Region RE Ltd	135	0,66	
AUD	680	Scentre Group	1.203	5,87	
AUD	155	Stockland	425	2,08	
AUD	604	Vicinity Ltd	728	3,55	
	3.951	19,28			
<b>Hongkong – 9,87 % (28. Februar 2023: 8,91 %)</b>			<b>ABKÜRZUNGEN:</b>		
HKD	1.097	Fortune Real Estate Investment Trust			
HKD	271	Link REIT			
	2.023	9,87			

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf AUD	1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf AUD	2
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf CNH	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf CNH	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf SGD	13
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf SGD	4
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf SGD	Verkauf USD	5
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf SGD	Verkauf USD	233
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf CNH	Verkauf USD	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf CNH	Verkauf USD	1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf AUD	Verkauf USD	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf AUD	Verkauf USD	22
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 1\$)				\$
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -19\$)				-
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -18\$)				-

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
<b>Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,73 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			<b>Südkorea – 16,30 % (28. Februar 2023: 15,91 %)</b>		
241	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,73	KRW	1 LG Chem Ltd	1,78
			KRW	– LG Energy Solution Ltd	0,35
			KRW	– LG H&H Co Ltd	0,30
			KRW	2 NAVER Corp	0,92
			KRW	53 Samsung Electronics Co Ltd	8,16
			KRW	1 Samsung SDI Co Ltd	1,29
			KRW	13 SK Hynix Inc	3,50
				5.373	16,30
			<b>Taiwan – 12,54 % (28. Februar 2023: 12,47 %)</b>		
			TWD	54 Delta Electronics Inc	1,77
			TWD	34 Globalwafers Co Ltd	1,48
			TWD	178 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	9,29
				4.135	12,54
			<b>USA – 1,86 % (28. Februar 2023: 2,42 %)</b>		
				1 EPAM Systems Inc	0,73
				2 Globant SA	1,13
				614	1,86
				32.841	99,62
			<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 40.294\$)</b>		
			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
				33.082	100,35
			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
				33.082	100,35
			<b>Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten</b>		
				-117	-0,35
			<b>Gesamnettovermögen</b>		
				32.965\$	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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.200.000 USD und machten 3,64 % des Nettovermögens aus.		
			<b>ABKÜRZUNGEN:</b>		
			ADR	– American Depositary Receipt	
			BRL	– Brasilianischer Real	
			CNH	– Chinesischer Renminbi	
			GBP	– Britisches Pfund	
			HKD	– Hongkong-Dollar	
			IDR	– Indonesische Rupiah	
			INR	– Indische Rupie	
			KRW	– Südkoreanischer Won	
			MXN	– Mexikanischer Peso	
			PHP	– Philippinischer Peso	
			SAR	– Saudi-arabischer Riyal	
			TWD	– Taiwanischer Dollar	
			ZAR	– Südafrikanischer Rand	
					<b>% des Gesamtvermögens</b>
			<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>		
			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
					99,06
			Organismen für gemeinsame Anlagen		
					0,73
			Sonstige Vermögenswerte		
					0,21
			<b>Gesamtvermögen</b>		
					100,00
			<b>Brasilien – 6,45 % (28. Februar 2023: 6,02 %)</b>		
			BRL	206 B3 SA – Brasil Bolsa Balcao	1,63
			BRL	176 Cosan SA	1,89
			BRL	124 Odontoprev SA	0,78
			BRL	98 WEG SA	2,15
				2.128	6,45
			<b>Chile – 2,05 % (28. Februar 2023: 2,16 %)</b>		
			GBP	37 Antofagasta Plc	2,05
			<b>China – 25,56 % (28. Februar 2023: 28,67 %)</b>		
			HKD	55 Alibaba Group Holding Ltd	1,95
				7 Alibaba Group Holding Ltd ADR	1,85
			HKD	123 China Merchants Bank Co Ltd	1,48
			CNH	18 Contemporary Amperex Technology Co Ltd	1,74
			HKD	28 ENN Energy Holdings Ltd	0,67
			HKD	4 JD.com Inc	0,19
				11 JD.com Inc ADR	1,08
			HKD	44 Meituan „B“, 144A	2,23
			HKD	112 Minth Group Ltd	3,32
			CNH	189 Ping An Bank Co Ltd	0,88
			HKD	115 Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2,09
			HKD	116 Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	0,83
			CNH	34 Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	3,19
			HKD	50 Tencent Holdings Ltd	6,23
			HKD	83 Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	1,41
			CNH	26 Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	0,32
			HKD	250 Xinyi Solar Holdings Ltd	0,63
				8.424	25,56
			<b>Hongkong – 2,44 % (28. Februar 2023: 2,94 %)</b>		
			HKD	89 AIA Group Ltd	2,44
			<b>Indien – 18,75 % (28. Februar 2023: 17,02 %)</b>		
			INR	12 Asian Paints Ltd	1,38
			INR	69 HDFC Bank Ltd	4,00
			INR	86 ICICI Bank Ltd	3,02
			INR	25 Kotak Mahindra Bank Ltd	1,64
			INR	4 Maruti Suzuki India Ltd	1,62
			INR	32 Reliance Industries Ltd	2,82
			INR	26 Titan Co Ltd	3,02
			INR	4 UltraTech Cement Ltd	1,25
				6.181	18,75
			<b>Indonesien – 4,18 % (28. Februar 2023: 3,54 %)</b>		
			IDR	476 Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	0,87
			IDR	2.039 Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	2,25
			IDR	1.436 Telkom Indonesia Persero Tbk PT	1,06
				1.378	4,18
			<b>Mexiko – 4,55 % (28. Februar 2023: 4,57 %)</b>		
			MXN	75 Grupo Financiero Banorte SAB de CV	1,93
			MXN	122 Orbia Advance Corp SAB de CV	0,83
			MXN	150 Wal-Mart de Mexico SAB de CV	1,79
				1.499	4,55
			<b>Peru – 1,24 % (28. Februar 2023: 1,15 %)</b>		
				3 Credicorp Ltd	1,24
			<b>Philippinen – 0,39 % (28. Februar 2023: 0,43 %)</b>		
			PHP	148 Robinsons Retail Holdings Inc	0,39
			<b>Saudi-Arabien – 2,32 % (28. Februar 2023: 1,78 %)</b>		
			SAR	31 Al Rajhi Bank	1,79
			SAR	3 Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co	0,53
				764	2,32
			<b>Singapur – 0,29 % (28. Februar 2023: 0,47 %)</b>		
				3 Sea Ltd ADR	0,29
			<b>Südafrika – 0,70 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>		
			ZAR	3 Capitec Bank Holdings Ltd	0,70

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

# FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert	
<b>Stammaktien – 99,55 % (28. Februar 2023: 99,83 %)</b>			<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 207.873€)</b>			
<b>Dänemark – 3,65 % (28. Februar 2023: 3,76 %)</b>			<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 207.873€)</b>			
DKK	66 Coloplast A/S	6,870	3,65	187.464	99,55	
<b>Frankreich – 21,32 % (28. Februar 2023: 21,05 %)</b>			<b>Devisenterminkontrakte – 0,01 % (28. Februar 2023: 0,01 %)</b>			
	211 Dassault Systemes SE	7.728	4,10	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	16 Kering SA	7.822	4,15	11	0,01	
	25 L'Oreal SA	10.129	5,38	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
	30 Pernod Ricard SA	5.434	2,89	187.475	99,56	
	35 Sartorius Stedim Biotech	9.035	4,80	<b>Devisenterminkontrakte – -0,02 % (28. Februar 2023: -0,01 %)</b>		
		40.148	21,32	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
<b>Deutschland – 6,10 % (28. Februar 2023: 7,65 %)</b>			<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>			
	138 Infineon Technologies AG	4.566	2,42	-28	-0,02	
	109 Nemetschek SE	6.920	3,68	<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
		11.486	6,10	187.447	99,54	
<b>Irland – 5,05 % (28. Februar 2023: 6,83 %)</b>			<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>			
	122 Kingspan Group Plc	9.514	5,05	872	0,46	
<b>Italien – 17,15 % (28. Februar 2023: 15,71 %)</b>			<b>Gesamtvermögen</b>			
	64 Ferrari NV	18.807	9,99	188.319€	100,00	
	216 Moncler SpA	13.494	7,16	– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
		32.301	17,15	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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 3.197.000 EUR und machten 1,70 % des Nettovermögens aus.		
<b>Niederlande – 13,76 % (28. Februar 2023: 8,94 %)</b>			<b>ABKÜRZUNGEN:</b>			
	4 Adyen NV, 144A	3.197	1,70	CHF	– Schweizer Franken	
	29 ASML Holding NV	17.719	9,41	DKK	– Dänische Krone	
	47 BE Semiconductor Industries NV	5.001	2,65	GBP	– Britisches Pfund	
		25.917	13,76	SEK	– Schwedische Kronen	
<b>Schweden – 12,57 % (28. Februar 2023: 13,48 %)</b>			USD			– US-Dollar
SEK	397 Assa Abloy AB	8.243	4,38	<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>		
SEK	733 Atlas Copco AB	8.930	4,74	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
SEK	789 Hexagon AB	6.499	3,45	Finanzderivate		
		23.672	12,57	Sonstige Vermögenswerte		
<b>Schweiz – 3,77 % (28. Februar 2023: 3,36 %)</b>			<b>Gesamtvermögen</b>			
CHF	7 Partners Group Holding AG	7.101	3,77	100,00		
<b>Vereinigtes Königreich – 6,28 % (28. Februar 2023: 12,44 %)</b>			<b>Verteilung des Gesamtvermögens</b>			
GBP	111 Croda International Plc	7.132	3,79	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
GBP	1.684 Oxford Nanopore Technologies Plc	4.680	2,49	Finanzderivate		
		11.812	6,28	Sonstige Vermögenswerte		
<b>USA – 9,90 % (28. Februar 2023: 6,61 %)</b>			<b>Gesamtvermögen</b>			
USD	28 Linde Plc	9.938	5,28	100,00		
USD	8 Mettler-Toledo International Inc	8.705	4,62			
		18.643	9,90			

### Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR	682 Verkauf BRL	10
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR	77 Verkauf BRL	–
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf BRL	3.903 Verkauf EUR	-18
05. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf BRL	122 Verkauf EUR	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	59 Verkauf EUR	1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	– Verkauf EUR	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR	3 Verkauf USD	–
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR	– Verkauf USD	–
03. Okt. 2023	BNY Mellon	Kauf BRL	3.615 Verkauf EUR	-10
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 22€)				€ 11
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): -20€)				-28
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2023 (in Tsd.): 2€)				€ -17

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



# FTGF Martin Currie Improving Society Fund<sup>^</sup>

Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
<b>Stammaktien – 94,92 %</b>		
<b>Brasilien – 4,84 %</b>		
– MercadoLibre Inc	231	4,84
<b>Dänemark – 4,60 %</b>		
DKK 5 Novozymes A/S	219	4,60
<b>Frankreich – 4,92 %</b>		
EUR 8 Veolia Environnement SA	234	4,92
<b>Indien – 5,80 %</b>		
4 HDFC Bank Ltd ADR	276	5,80
<b>Indonesien – 3,05 %</b>		
IDR 400 Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	145	3,05
<b>Italien – 4,28 %</b>		
EUR 6 Amplifon SpA	204	4,28
<b>Nigeria – 4,31 %</b>		
GBP 142 Airtel Africa Plc, 144A	206	4,31
<b>Schweden – 1,20 %</b>		
SEK 2 MIPS AB	57	1,20
<b>Vereinigtes Königreich – 9,60 %</b>		
GBP 4 Croda International Plc	249	5,22
GBP 6 FDM Group Holdings Plc	41	0,87
GBP 13 Mears Group Plc	47	0,97
GBP 12 Vistry Group Plc	121	2,54
	458	9,60
<b>USA – 52,32 %</b>		
5 Coursera Inc	84	1,75
1 Deere & Co	215	4,51
1 Ecolab Inc	236	4,95
3 Energy Recovery Inc	88	1,84
2 Everbridge Inc	54	1,13
1 Illumina Inc	201	4,22
1 Intuitive Surgical Inc	300	6,29
1 Masimo Corp	152	3,20
1 Planet Fitness Inc „A“	74	1,55
2 Revvity Inc	246	5,17
1 Stride Inc	56	1,17
1 Valmont Industries Inc	237	4,97
1 Veeva Systems Inc „A“	209	4,38
4 Verra Mobility Corp „A“	64	1,35

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
3 Xylem Inc/NY	278	5,84
	2.494	52,32
<b>Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 4.765\$)</b>		
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 4.765\$)</b>		
	4.524	94,92
<b>Devisenterminkontrakte – 0,00 %</b>		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	–	–
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>		
	4.524	94,92
<b>Devisenterminkontrakte – -0,04 %</b>		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	-2	-0,04
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten</b>		
	-2	-0,04
<b>Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>		
	4.522	94,88
<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>		
	244	5,12
<b>Gesamtvermögen</b>		
	4.766\$	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 %.

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 31. August 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 206.000 USD und machten 4,31 % des Nettovermögens aus.

**ABKÜRZUNGEN:**

ADR	– American Depositary Receipt
DKK	– Dänische Krone
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund
IDR	– Indonesische Rupiah
SEK	– Schwedische Kronen

**Verteilung des Gesamtvermögens**

	% des Gesamtver- mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,57
Sonstige Vermögenswerte	5,43
<b>Gesamtvermögen</b>	<b>100,00</b>

**Aufstellung der Devisenterminkontrakte**

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	5 Verkauf EUR	4 \$ –
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf USD	4 Verkauf GBP	4 –
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP	76 Verkauf USD	97 -1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf EUR	91 Verkauf USD	100 -1
15. Sep. 2023	BNY Mellon	Kauf GBP	2 Verkauf USD	2 –
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten				-2
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten				\$ -2

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Franklin Responsible Income 2028 Fund<sup>^</sup>

## Anlagenportfolio zum 31. August 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert
<b>Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 96,47 % (28. Februar 2023: 92,33 %)</b>			<b>Spanien – 6,68 % (28. Februar 2023: 9,71 %)</b>		
<b>Australien – 1,44 % (28. Februar 2023: 1,34 %)</b>			1.300 Abertis Infraestructuras SA, 4,125 %, fällig 31.01.2028		
1.500	Macquarie Group Ltd, 0,350 %, fällig 03.03.2028	1,264	1,44	1.296	1,48
<b>Belgien – 2,43 % (28. Februar 2023: 2,19 %)</b>			400 Arena Luxembourg Finance Sarl, 1,875 %, fällig 01.02.2028		
900	Azelis Finance NV, 5,750 %, fällig 15.03.2028	919	1,04	335	0,38
1.200	Crelan SA, 5,750 %, fällig 26.01.2028	1.218	1,39	1.000	Banco de Sabadell SA, 5,250 %, fällig 07.02.2029 *
		2.137	2,43	994	1,13
<b>China – 1,31 % (28. Februar 2023: 1,32 %)</b>			1.400 CaixaBank SA, 0,750 %, fällig 26.05.2028 *		
1.400	Prosus NV, 1,539 %, fällig 03.08.2028	1.152	1,31	720	0,82
<b>Tschechische Republik – 1,41 % (28. Februar 2023: 1,77 %)</b>			1.300 Unicaja Banco SA, 7,250 %, fällig 15.11.2027 *		
1.300	CEZ AS, 3,000 %, fällig 05.06.2028	1.234	1,41	1.296	1,48
<b>Dänemark – 2,65 % (28. Februar 2023: 1,57 %)</b>			1.300 Werfen SA/Spain, 4,625 %, fällig 06.06.2028		
1.400	H Lundbeck A/S, 0,875 %, fällig 14.10.2027	1.227	1,40	1.296	1,48
1.300	Nykredit Realkredit AS, 0,375 %, fällig 17.01.2028	1.100	1,25		
		2.327	2,65	5.861	6,68
<b>Finnland – 1,44 % (28. Februar 2023: 1,55 %)</b>			<b>Schweden – 5,97 % (28. Februar 2023: 2,67 %)</b>		
1.500	OP Corporate Bank plc, 0,375 %, fällig 16.06.2028	1.268	1,44	1.600	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,375 %, fällig 21.06.2028
<b>Frankreich – 18,61 % (28. Februar 2023: 16,09 %)</b>			1.200 Svenska Handelsbanken AB, 3,750 %, fällig 01.11.2027		
600	Adevinta ASA, 3,000 %, fällig 15.11.2027	565	0,64	1.400	Tele2 AB, 2,125 %, fällig 15.05.2028
500	Altice France SA/France, 3,375 %, fällig 15.01.2028	354	0,40	500	Verisure Holding AB, 9,250 %, fällig 15.10.2027
1.500	BNP Paribas SA, 0,500 %, fällig 19.02.2028 *	1.317	1,50	900	Volvo Car AB, 4,250 %, fällig 31.05.2028
1.200	BPCE SA, 4,375 %, fällig am 13.07.2028	1.202	1,37		
600	CAB SELAS, 3,375 %, fällig 01.02.2028	512	0,58		
1.400	Credit Agricole SA, 0,375 %, fällig 20.04.2028	1.190	1,36		
1.200	Engie SA, 1,750 %, fällig 27.03.2028	1.108	1,26		
1.400	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1,625 %, fällig 27.11.2027	1.267	1,44		
320	Iliad Holding SASU, 5,625 %, fällig 15.10.2028	303	0,35		
300	Iliad SA, 1,875 %, fällig 11.02.2028	258	0,30		
1.300	La Banque Postale SA, 1,000 %, fällig 09.02.2028 *	1.155	1,32		
1.300	Orano SA, 2,750 %, fällig 08.03.2028	1.197	1,37		
1.200	RCI Banque SA, 4,875 %, fällig 21.09.2028	1.214	1,38		
900	Rexel SA, 2,125 %, fällig 15.12.2028	800	0,91		
400	SANEF SA, 0,950 %, fällig 19.10.2028	344	0,39		
1.300	Societe Generale SA, 0,125 %, fällig 18.02.2028	1.100	1,25		
1.200	TDF Infrastructure SASU, 5,625 %, fällig 21.07.2028	1.202	1,37		
1.500	Teleperformance SE, 0,250 %, fällig 26.11.2027	1.246	1,42		
		16.334	18,61		
<b>Deutschland – 2,42 % (28. Februar 2023: 3,54 %)</b>			<b>Schweiz – 2,93 % (28. Februar 2023: 2,49 %)</b>		
1.200	Commerzbank AG, 4,625 %, fällig 21.03.2028 *	1.190	1,35	1.400	Cloverie Plc for Zurich Insurance Co Ltd, 1,500 %, fällig 15.12.2028
1.000	Deutsche Lufthansa AG, 3,750 %, fällig 11.02.2028	938	1,07	1.300	UBS Group AG, 4,625 %, fällig 17.03.2028 *
		2.128	2,42		
<b>Irland – 2,98 % (28. Februar 2023: 3,05 %)</b>			<b>Vereinigtes Königreich – 12,62 % (28. Februar 2023: 14,60 %)</b>		
1.400	AIB Group Plc, 2,250 %, fällig 04.04.2028 *	1.292	1,47	1.500	Barclays Plc, 0,877 %, fällig 28.01.2028 *
1.300	Bank of Ireland Group Plc, 4,875 %, fällig 16.07.2028 *	1.321	1,51	1.300	easylet FinCo BV, 1,875 %, fällig 03.03.2028
		2.613	2,98	1.200	HSBC Holdings Plc, 4,752 %, fällig 10.03.2028 *
<b>Italien – 5,42 % (28. Februar 2023: 7,49 %)</b>			1.500 Motability Operations Group Plc, 0,125 %, fällig 20.07.2028		
900	Autostrade per l'Italia SpA, 1,625 %, fällig 25.01.2028	798	0,91	1.500	National Grid Plc, 0,163 %, fällig 20.01.2028
600	Autostrade per l'Italia SpA, 2,000 %, fällig 04.12.2028	528	0,60	1.500	Nationwest Building Society, 0,250 %, fällig 14.09.2028
350	IMA Industria Macchine Automatiche SpA, 3,750 %, fällig 15.01.2028	315	0,36	1.200	NatWest Markets Plc, 4,250 %, fällig 13.01.2028
1.500	Intesa Sanpaolo SpA, 1,750 %, fällig 20.03.2028	1.361	1,55	1.300	Sage Group Plc/The, 3,820 %, fällig 15.02.2028
400	Italmatch Chemicals SpA, 10,000 %, fällig 06.02.2028	395	0,45	800	Santander UK Group Holdings Plc, 3,530 %, fällig 25.08.2028 *
1.000	Mundys SpA, 1,875 %, fällig 12.02.2028	864	0,98	400	Victoria Plc, 3,625 %, fällig 24.08.2026
500	TeamSystem SpA, 7,413 %, fällig 15.02.2028 *	497	0,57		
		4.758	5,42		
<b>Japan – 1,45 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			<b>USA – 15,49 % (28. Februar 2023: 14,75 %)</b>		
1.500	NTT Finance Corp, 0,399 %, fällig 13.12.2028	1.275	1,45	600	Avantor Funding Inc, 3,875 %, fällig 15.07.2028
<b>Luxemburg – 2,02 % (28. Februar 2023: 3,14 %)</b>			640 Berry Global Inc, 1,500 %, fällig 15.01.2027		
1.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,000 %, fällig 04.05.2028	786	0,89	1.000	Crown European Holdings SA, 5,000 %, fällig 15.05.2028
500	Kleopatra Finco Sarl, 4,250 %, fällig 01.03.2026	419	0,48	1.400	DXC Capital Funding DAC, 0,450 %, fällig 15.09.2027
600	Matterhorn Telecom SA, 4,000 %, fällig 15.11.2027	567	0,65	1.300	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000 %, fällig 22.03.2028
		1.772	2,02	800	IQVIA Inc, 2,250 %, fällig am 15.01.2028
<b>Niederlande – 5,82 % (28. Februar 2023: 2,14 %)</b>			1.400 JPMorgan Chase & Co, 1,638 %, fällig 18.05.2028 *		
1.300	ABN AMRO Bank NV, 4,000 %, fällig 16.01.2028	1.285	1,46	1.200	LKQ European Holdings BV, 4,125 %, fällig 01.04.2028
1.200	Coöperatieve Rabobank UA, 4,625 %, fällig 27.01.2028 *	1.217	1,39	1.000	Morgan Stanley, 4,813 %, fällig 25.10.2028 *
1.300	ING Groep NV, 4,875 %, fällig 14.11.2027 *	1.322	1,51	1.300	PVH Corp, 3,125 %, fällig 15.12.2027
1.400	TenneT Holding BV, 1,375 %, fällig 05.06.2028	1.283	1,46	1.400	Schneider Electric SE, 1,500 %, fällig 15.01.2028
		5.107	5,82	1.500	Thermo Fisher Scientific Inc, 0,500 %, fällig 01.03.2028
<b>Norwegen – 1,48 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			1.200 Verizon Communications Inc, 1,375 %, fällig 02.11.2028		
1.500	Telenor ASA, 0,250 %, fällig 14.02.2028	1.296	1,48		
<b>Portugal – 1,31 % (28. Februar 2023: 2,24 %)</b>			<b>Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 84.963€)</b>		
1.100	Caixa Geral de Depositos SA, 5,750 %, fällig 31.10.2028 *	1.152	1,31	84.692	96,47
<b>Slowenien – 0,59 % (28. Februar 2023: 0,00 %)</b>			<b>Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 2,00 % (28. Februar 2023: 2,07 %)</b>		
600	United Group BV, 4,625 %, fällig 15.08.2028	516	0,59	<b>Rumänien – 2,00 % (28. Februar 2023: 2,07 %)</b>	
				2.000 Internationale Anleihe der rumänischen Regierung, 2,125 %, fällig 07.03.2028	
				1.761	2,00
				<b>Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 1.748€)</b>	
				1.761	2,00
				<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte</b>	
				86.453	98,47
				<b>Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten</b>	
				86.453	98,47
				<b>Verbindlichkeiten übersteigende Sonstige Vermögenswerte</b>	
				1.339	1,53
				<b>Gesamtvermögen</b>	
				87.792€	100,00

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

[Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen]

## Bilanz

(in Tsd.)	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		FTGF Western Asset US Core Bond Fund		FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	
	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023
	<b>UMLAUFVERMÖGEN:</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	\$ 1	\$ 1	\$ –	\$ –	\$ 7.482	\$ 34.310	€ 1.873	€ 4.251
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	2.257	2.060	4.123	7.065	1.863	2.191
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	950.341	844.196	226.747	140.166	1.007.553	1.183.129	86.466	125.838
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	235	–	–	–
Optionen	–	–	327	64	2.256	556	–	4
Swapkontrakte	–	–	1.321	2.534	9.469	8.276	22	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	567	540	4	72
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	310	303	2.534	2.474	322	476
Forderungen aus Anlagenverkauf	–	–	4.584	1.429	12.429	17.093	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	275	53	395	429	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	2.142	2.036	1.538	1.107	8.528	8.995	742	1.280
Dividendenforderungen	–	–	69	8	10	10	9	31
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	1	–	–	–	8	–	2	–
<b>Gesamtumlautvermögen</b>	<b>952.485</b>	<b>846.233</b>	<b>237.428</b>	<b>147.724</b>	<b>1.055.589</b>	<b>1.262.877</b>	<b>91.303</b>	<b>134.143</b>
<b>KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:</b>								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	–	–	5.862	620	6.816	849	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	1.337	2.826	1.189	445	8	9
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	195	70	1.588	615	–	4
Swapkontrakte	–	–	20	46	1.749	1.867	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	2.005	2.578	179	338
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	152	180	1.496	3.625	91	1.065
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	19.824	9.879	25.760	11.726	37.494	101.191	647	187
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	3.017	2.054	177	132	175	148	1	1
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	456	363	111	71	465	487	3	3
Performancegebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	30	24	23	16	73	73	13	14
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	10	1	23	20	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	217	1	2.052	1.904	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	239	298	88	116	435	375	38	55
<b>Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)</b>	<b>23.566</b>	<b>12.618</b>	<b>33.952</b>	<b>15.805</b>	<b>55.560</b>	<b>114.177</b>	<b>980</b>	<b>1.676</b>
<b>Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens</b>	<b>\$ 928.919</b>	<b>\$ 833.615</b>	<b>\$ 203.476</b>	<b>\$ 131.919</b>	<b>\$ 1.000.029</b>	<b>\$ 1.148.700</b>	<b>€ 90.323</b>	<b>€ 132.467</b>
<b>Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund<sup>^</sup></b>								
<b>Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund<sup>^</sup></b>								
<b>Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund<sup>^</sup></b>								
(in Tsd.)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund <sup>^</sup>	
	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023
	<b>UMLAUFVERMÖGEN:</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	\$ 1.001	\$ 3.850	\$ 14	\$ 14	\$ 17	\$ 17	\$ 15	\$ 45
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	124	162	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	50.686	52.716	–	–	–	–	–	–
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	32	60	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	38	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus Anlagenverkauf	355	554	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	8	4	–	–	–	–	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	703	739	–	–	–	–	–	–
Dividendenforderungen	1	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	9	–	–	–	–	–	–	–
<b>Gesamtumlautvermögen</b>	<b>52.919</b>	<b>58.123</b>	<b>14</b>	<b>14</b>	<b>17</b>	<b>17</b>	<b>15</b>	<b>45</b>
<b>KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:</b>								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	–	140	–	–	–	–	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	38	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	105	271	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	10	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	851	4	–	–	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	100	89	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	40	41	–	–	–	–	–	–
Performancegebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	12	11	–	–	–	–	–	3
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	3	4	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	51	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	64	94	14	14	17	17	15	42
<b>Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)</b>	<b>1.236</b>	<b>692</b>	<b>14</b>	<b>14</b>	<b>17</b>	<b>17</b>	<b>15</b>	<b>45</b>
<b>Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens</b>	<b>\$ 51.683</b>	<b>\$ 57.431</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund <sup>^</sup>		FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		FTGF Western Asset US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	
Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023
\$ 681	\$ 1.425	\$ 8.313	\$ 20.391	\$ 631	\$ 63	\$ 29	\$ 60	\$ 22	\$ 35
-	-	1.907	882	1.060	1.126	-	-	-	-
-	-	210.547	202.891	101.700	123.407	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	101	102	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	535	775	-	1	-	-	-	-
-	-	221	74	50	-	-	-	-	-
-	-	176	4.780	1.449	608	-	-	-	-
-	-	58	28	17	8	-	-	-	-
-	-	2.588	2.851	1.597	1.920	-	-	-	-
-	-	6	15	2	5	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	1	5	-	-	-	-	2	-	-
<b>681</b>	<b>1.426</b>	<b>224.356</b>	<b>232.687</b>	<b>106.607</b>	<b>127.240</b>	<b>29</b>	<b>62</b>	<b>22</b>	<b>35</b>
-	-	37	559	-	155	-	-	-	-
-	-	84	27	96	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	58	116	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	1.411	4.011	30	35	-	-	-	-
-	-	166	29	-	31	-	-	-	-
-	-	136	266	197	1.250	-	-	-	-
-	12	100	94	177	172	-	-	-	-
-	14	96	91	63	67	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	9	23	20	16	14	-	3	-	3
-	2	6	6	7	7	-	-	-	-
662	1.366	11	45	52	74	11	11	-	-
19	23	123	184	52	79	18	48	22	32
<b>681</b>	<b>1.426</b>	<b>2.193</b>	<b>5.332</b>	<b>748</b>	<b>2.000</b>	<b>29</b>	<b>62</b>	<b>22</b>	<b>35</b>
\$ -	\$ -	\$ 222.163	\$ 227.355	\$ 105.859	\$ 125.240	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>		FTGF Western Asset Global Credit Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund <sup>^</sup>	
Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023
\$ 239	\$ 998	\$ 3.854	\$ 3.559	\$ 4.628	\$ 4.735	\$ 698	\$ 743	€ 15	€ 31
1.156	1.540	3.563	2.733	1.954	1.544	967	1.074	-	-
391.029	433.473	464.179	532.162	163.564	146.874	29.460	43.765	-	-
-	-	-	-	-	152	-	-	-	-
-	-	-	-	-	19	-	-	-	-
-	-	-	213	61	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6	162	2.481	3.707	937	1.011	216	343	-	-
-	-	718	4.839	404	338	110	202	-	-
-	771	1.119	2.646	1.550	3.576	-	1	-	-
41	41	1.157	2.043	17	1	2	1	-	-
4.203	4.375	4.353	2.855	1.120	1.086	343	491	-	-
24	20	20	127	5	15	2	6	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	-	9	1	2	-	9	-	-	-
<b>396.700</b>	<b>441.380</b>	<b>481.453</b>	<b>554.885</b>	<b>174.242</b>	<b>159.351</b>	<b>31.807</b>	<b>46.626</b>	<b>15</b>	<b>31</b>
1.759	522	620	484	-	-	-	-	-	-
1	6	406	1	139	17	74	3	-	-
-	-	-	-	-	4	-	-	-	-
-	-	326	-	-	-	92	76	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
618	1.130	3.247	3.219	1.300	2.097	79	90	-	-
269	373	705	61	245	1.043	41	34	-	-
-	770	1.119	25.758	17.834	9.282	109	306	-	-
2	15	7	2	-	-	-	-	-	-
233	200	164	153	19	17	2	2	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
38	32	40	36	19	15	11	9	-	3
15	13	15	11	-	-	-	-	-	-
13	299	541	1.106	-	72	-	-	-	-
287	313	55	84	222	101	40	56	15	28
<b>3.235</b>	<b>3.673</b>	<b>7.245</b>	<b>30.915</b>	<b>19.778</b>	<b>12.648</b>	<b>448</b>	<b>576</b>	<b>15</b>	<b>31</b>
\$ 393.465	\$ 437.707	\$ 474.208	\$ 523.970	\$ 154.464	\$ 146.703	\$ 31.359	\$ 46.050	€ -	€ -

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



## Bilanz – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund <sup>^</sup>		FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund <sup>^</sup>	
	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023
	<b>UMLAUFVERMÖGEN:</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	\$ 26.891	\$ 63.691	\$ 30	\$ 30	\$ 3.764	\$ 3.203	\$ –	\$ –
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	143.867	250.586	–	–	3.779	3.915	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	1.432.224	1.913.653	–	–	275.837	267.865	–	–
Verpfändete Anlagen	57.208	1.590	–	–	–	–	–	–
Optionen	21.526	6.090	–	–	280	566	–	–
Swapkontrakte	113.490	155.867	–	–	725	1.033	–	–
Swaptions	–	–	–	–	47	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	13.409	21.504	–	–	536	536	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	54.997	20.467	–	–	1.448	53	–	–
Forderungen aus Anlagenverkauf	384	13.260	–	–	3.571	5.180	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	899	1.024	–	–	8	2.133	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	29.668	36.399	–	–	3.869	3.427	–	–
Dividendenforderungen	164	487	–	–	8	8	–	–
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	7	–	–	–	9	1	–	–
<b>Gesamtumlautvermögen</b>	<b>1.894.734</b>	<b>2.484.618</b>	<b>30</b>	<b>30</b>	<b>293.881</b>	<b>287.920</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:</b>								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	76.873	83.849	–	–	189	2	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	19.369	76.579	–	–	249	119	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten:								
Optionen	45.858	46.352	–	–	56	36	–	–
Swapkontrakte	53.289	43.002	–	–	353	761	–	–
Swaptions	–	–	–	–	73	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	14.349	43.616	–	–	2.359	2.965	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	54.049	47.194	–	–	504	890	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	114.479	4.384	–	–	1.181	7.800	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	1.627	2.062	–	–	27	24	–	–
Performancegebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	102	151	–	–	26	22	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	122	136	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	1.042	3.140	–	–	1.890	82	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	1.415	1.652	30	–	165	207	–	–
<b>Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)</b>	<b>382.574</b>	<b>352.117</b>	<b>30</b>	<b>30</b>	<b>7.072</b>	<b>12.908</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens</b>	<b>\$ 1.512.160</b>	<b>\$ 2.132.501</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 286.809</b>	<b>\$ 275.012</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>
(in Tsd.)	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>^</sup>		FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund <sup>^</sup>		FTGF Brandywine Global High Yield Fund <sup>^</sup>	
	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023
	<b>UMLAUFVERMÖGEN:</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	\$ 67	\$ 136	\$ 3.196	\$ 223	\$ 1.920	\$ 1.762	\$ 35	\$ 5
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	275	194	–	–	1.118	2.709	99	8
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	8.902	8.571	151.997	164.330	260.160	538.707	23.928	10.360
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	77	92	1.454	3.132	7.522	13.024	12	10
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	26	59	–	–	512	2.190	42	2
Forderungen aus Anlagenverkauf	–	155	106	490	–	1.798	567	248
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	157	117	2	1.797	–	1
Zinsen und sonstige Erträge	95	104	1.883	1.781	2.667	5.523	386	175
Dividendenforderungen	3	1	340	345	156	233	4	2
Verwaltungsgebühren	2	2	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	8	8	–	–	–	–	16	–
<b>Gesamtumlautvermögen</b>	<b>9.455</b>	<b>9.322</b>	<b>159.133</b>	<b>170.418</b>	<b>274.057</b>	<b>567.743</b>	<b>25.089</b>	<b>10.811</b>
<b>KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:</b>								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	32	–	–	4	–	7	123	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	26	–	850	992	2.495	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	161	107	3.353	3.966	16.536	23.627	245	202
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	13	5	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	–	145	106	490	–	1.798	350	163
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	1	1
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	–	–	85	83	208	260	6	–
Performancegebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	14	13	24	24	27	38	10	7
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	11	11	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	1.074	2.595	55	–	3	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	24	31	354	386	229	247	29	44
<b>Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)</b>	<b>244</b>	<b>327</b>	<b>5.007</b>	<b>8.409</b>	<b>18.047</b>	<b>28.472</b>	<b>767</b>	<b>417</b>
<b>Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens</b>	<b>\$ 9.211</b>	<b>\$ 8.995</b>	<b>\$ 154.126</b>	<b>\$ 162.009</b>	<b>\$ 256.010</b>	<b>\$ 539.271</b>	<b>\$ 24.322</b>	<b>\$ 10.394</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>		FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund <sup>^</sup>		FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund <sup>^</sup>		FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund		Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	
Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023
\$ 1.379 118	\$ 1.723 629	\$ 112 1.752	\$ 416 4.167	£ 809 292	£ 1.256 297	\$ 1.954 877	\$ 1.005 978	\$ 221 353	\$ 136 541
512.999	557.051	1.134.430	1.148.337	43.046	43.921	60.019	94.192	18.337	17.280
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	87	19
-	-	-	-	-	-	-	-	513	899
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
577	8	-	-	8	27	147	35	18	11
-	317	1.098	353	90	45	50	4	215	156
-	-	131.381	46.919	-	-	32.783	-	1	99
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2.461	1.998	4.581	4.402	741	686	723	1.007	212	173
117	45	54	5	2	-	12	8	1	5
-	-	-	-	-	-	-	-	4	4
6	-	3	-	-	1	-	-	6	1
<b>517.657</b>	<b>561.771</b>	<b>1.273.411</b>	<b>1.204.599</b>	<b>44.988</b>	<b>46.233</b>	<b>96.565</b>	<b>97.229</b>	<b>19.968</b>	<b>19.324</b>
-	-	26	878	7	-	-	-	930	-
-	-	1.066	54	-	-	117	6	-	389
-	-	-	-	-	-	-	-	98	38
-	-	-	-	-	-	51	74	9	2
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
664	1.683	-	-	11	7	827	404	64	58
538	73	94	731	24	29	17	103	74	120
-	-	145.752	83.125	-	229	8	1.787	96	193
-	-	-	-	-	-	157	-	-	-
57	77	15	13	-	-	5	4	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
42	38	79	69	9	11	15	12	20	31
1	2	-	-	-	-	-	-	-	-
1	-	-	-	-	-	40.028	-	-	-
288	350	200	222	36	45	50	64	40	52
<b>1.591</b>	<b>2.223</b>	<b>147.232</b>	<b>85.092</b>	<b>87</b>	<b>321</b>	<b>41.275</b>	<b>2.454</b>	<b>1.331</b>	<b>883</b>
<b>\$ 516.066</b>	<b>\$ 559.548</b>	<b>\$ 1.126.179</b>	<b>\$ 1.119.507</b>	<b>£ 44.901</b>	<b>£ 45.912</b>	<b>\$ 55.290</b>	<b>\$ 94.775</b>	<b>\$ 18.637</b>	<b>\$ 18.441</b>
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund <sup>^</sup>		FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>		FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund <sup>^α</sup>	
Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023
\$ 806 300	\$ 422 -	\$ 2.172 -	\$ 2.173 -	\$ 3.869 27.557	\$ 32.149 25.134	\$ 24 616	\$ - 980	\$ 18 -	\$ - -
207.895	204.726	-	-	1.156.117	1.153.805	32.694	45.793	-	8.488
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	1.309	68	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.150	1.448	-	-	2.658	3.510	157	403	-	-
-	-	-	-	6.156	-	18	69	-	-
13	9.346	-	-	921	838	-	-	-	134
201	-	-	-	2.528	2.452	-	-	-	-
1.822	2.543	-	-	11.774	15.517	288	215	-	137
613	601	-	-	187	337	5	11	-	2
-	-	-	-	-	-	-	-	-	21
-	-	-	-	27	8	9	1	5	-
<b>212.800</b>	<b>219.086</b>	<b>2.172</b>	<b>2.173</b>	<b>1.211.794</b>	<b>1.235.059</b>	<b>33.879</b>	<b>47.472</b>	<b>23</b>	<b>8.782</b>
-	3	-	-	808	1	41	-	-	103
-	110	-	-	802	-	1	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	9.769	878	-	37	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4.628	4.239	-	-	11.294	12.389	236	379	-	192
-	-	-	-	-	3.704	177	175	-	-
13	9.308	-	-	921	5.978	-	-	-	30
-	-	-	-	116	106	-	-	-	-
114	100	-	-	761	701	26	39	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
28	27	-	-	87	77	19	20	-	7
1	1	-	-	83	78	-	-	-	1
104	4	-	-	1.012	714	55	-	-	-
138	148	2.172	2.173	1.188	128	58	66	17	60
<b>5.026</b>	<b>13.940</b>	<b>2.172</b>	<b>2.173</b>	<b>26.841</b>	<b>24.754</b>	<b>613</b>	<b>716</b>	<b>23</b>	<b>393</b>
<b>\$ 207.774</b>	<b>\$ 205.146</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ 1.184.953</b>	<b>\$ 1.210.305</b>	<b>\$ 33.266</b>	<b>\$ 46.756</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ 8.389</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Bilanz – (Fortsetzung)

	Legg Mason Brandywine Global - US High Yield Fund <sup>^</sup>		FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup>		FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund <sup>^</sup>		FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund <sup>^</sup> <sub>α</sub>	
	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023
<b>(in Tsd.)</b>								
<b>UMLAUFVERMÖGEN:</b>								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	\$ 15	\$ –	\$ 2.369	\$ 1.879	\$ 2	\$ 1.147	\$ 26	\$ –
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	1.715	664	418	431	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	–	–	67.273	69.694	14.815	13.130	–	2.583
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	4	33	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	266	249	38	86	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	55	–	66	–	–	–
Forderungen aus Anlagenverkauf	–	–	312	327	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	–	–	690	948	155	186	–	–
Dividendenforderungen	–	–	3	9	3	–	–	5
Verwaltungsgebühren	–	–	1	–	1	5	–	23
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	4	–	–
<b>Gesamtumlautvermögen</b>	<b>15</b>	<b>–</b>	<b>72.684</b>	<b>73.770</b>	<b>15.502</b>	<b>15.022</b>	<b>26</b>	<b>2.611</b>
<b>KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:</b>								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	–	–	188	1	–	–	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	66	122	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	41	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	2.543	3.482	74	64	–	20
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	130	283	–	123	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	–	–	312	327	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Performancegebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	13	13	11	4	6	7
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	15	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	145	132	60	27	20	50
<b>Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)</b>	<b>15</b>	<b>–</b>	<b>3.397</b>	<b>4.360</b>	<b>186</b>	<b>218</b>	<b>26</b>	<b>77</b>
<b>Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 69.287</b>	<b>\$ 69.410</b>	<b>\$ 15.316</b>	<b>\$ 14.804</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 2.534</b>

	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund		FTGF ClearBridge Global Growth Fund <sup>^</sup>	
	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023
<b>(in Tsd.)</b>								
<b>UMLAUFVERMÖGEN:</b>								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	\$ 3.747	\$ 11.596	\$ 301	\$ 2.053	\$ 27.439	\$ 11.074	\$ 164	\$ 385
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	213.403	214.039	35.254	36.590	1.553.421	1.629.033	14.730	12.823
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	4	4	–	1	31	22	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus Anlagenverkauf	92	179	–	–	14.782	3.682	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	21	5	–	–	17.776	29.209	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	6	14	–	7	10	20	1	–
Dividendenforderungen	97	42	60	72	1.208	740	21	13
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	2	–	8	–	8	4	5	–
<b>Gesamtumlautvermögen</b>	<b>217.372</b>	<b>225.879</b>	<b>35.623</b>	<b>38.723</b>	<b>1.614.675</b>	<b>1.673.784</b>	<b>14.921</b>	<b>13.221</b>
<b>KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:</b>								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	622	–	–	–	58	7	6	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten:								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	86	229	16	56	863	840	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	92	179	–	–	14.782	3.682	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	207	200	32	33	720	704	6	6
Performancegebühren (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	42	43	12	11	110	130	10	9
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	37	35	4	4	164	170	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	193	176	1	44	3.332	28.161	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	177	224	30	47	95	111	22	27
<b>Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)</b>	<b>1.456</b>	<b>1.086</b>	<b>95</b>	<b>195</b>	<b>20.124</b>	<b>33.805</b>	<b>44</b>	<b>42</b>
<b>Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens</b>	<b>\$ 215.916</b>	<b>\$ 224.793</b>	<b>\$ 35.528</b>	<b>\$ 38.528</b>	<b>\$1.594.551</b>	<b>\$1.639.979</b>	<b>\$ 14.877</b>	<b>\$ 13.179</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Growth Fund^		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^		FTGF ClearBridge US Appreciation Fund		FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023
\$ 46.573	\$ 12.361	\$ 47	\$ 59	\$ 56	\$ 55	\$ 1.472	\$ 9.110	\$ 30.356	\$ 54.486
-	-	-	-	-	-	-	-	620	530
914.073	921.986	-	-	-	-	197.279	180.681	1.512.094	1.172.787
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
28	10	-	-	-	-	-	-	280	286
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
5	4.380	-	-	-	-	-	43	7.273	2.355
480	724	-	-	-	-	194	-	6.253	1.211
95	72	-	-	-	-	4	10	40	67
1.193	989	-	-	-	-	196	160	1.068	1.120
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	2	-	-	-	-	1	-	5	-
<b>962.456</b>	<b>940.524</b>	<b>47</b>	<b>59</b>	<b>56</b>	<b>55</b>	<b>199.146</b>	<b>190.004</b>	<b>1.557.989</b>	<b>1.232.842</b>
403	2.030	-	-	-	-	206	-	9.132	5
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.547	976	-	-	-	-	-	-	2.302	1.551
5	6.635	-	-	-	-	-	43	3.829	429
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
667	609	-	-	-	-	186	165	1.040	795
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
80	86	-	-	-	-	28	27	180	165
58	56	-	-	-	-	30	23	134	109
511	288	17	29	-	-	23	55	744	3.685
112	118	30	30	56	55	69	81	247	368
<b>3.383</b>	<b>10.798</b>	<b>47</b>	<b>59</b>	<b>56</b>	<b>55</b>	<b>542</b>	<b>394</b>	<b>17.608</b>	<b>7.107</b>
<b>\$ 959.073</b>	<b>\$ 929.726</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ 198.604</b>	<b>\$ 189.610</b>	<b>\$1.540.381</b>	<b>\$1.225.735</b>
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		FTGF Royce US Smaller Companies Fund	
Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023
€ 25.184	€ 25.979	\$ 25	\$ 50	\$ 8.820	\$ 8.169	\$ -	\$ 1	\$ -	\$ -
-	-	-	-	-	-	310	330	-	-
847.640	1.032.510	-	-	355.274	399.290	679.693	744.113	92.675	78.654
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.728	1.921	-	-	6	24	94	150	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
150	3.932	-	-	2.622	3.321	352	1.897	16	144
3.983	2.238	-	-	12	1.858	446	711	293	1
-	-	-	-	-	-	11	-	3	-
2.070	1.740	-	-	2.933	2.085	601	474	55	16
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
15	3	-	-	13	14	2	-	2	1
<b>880.770</b>	<b>1.068.323</b>	<b>25</b>	<b>50</b>	<b>369.680</b>	<b>414.761</b>	<b>681.509</b>	<b>747.676</b>	<b>93.044</b>	<b>78.816</b>
-	2	-	-	5	6	878	643	94	142
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
210	1.058	-	-	1.018	2.229	945	1.623	2	2
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
151	2.286	-	-	2.395	3.872	2.421	1.944	47	358
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
747	826	-	-	360	377	618	624	100	83
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
71	103	-	3	33	31	78	82	18	16
93	99	-	-	66	74	108	109	15	12
5.216	1.022	-	-	522	2.062	769	915	281	37
72	94	25	47	56	62	153	207	52	68
<b>6.560</b>	<b>5.490</b>	<b>25</b>	<b>50</b>	<b>4.455</b>	<b>8.713</b>	<b>5.970</b>	<b>6.147</b>	<b>609</b>	<b>718</b>
<b>€ 874.210</b>	<b>€1.062.833</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ 365.225</b>	<b>\$ 406.048</b>	<b>\$ 675.539</b>	<b>\$ 741.529</b>	<b>\$ 92.435</b>	<b>\$ 78.098</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Bilanz – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund <sup>^</sup>		Legg Mason US Equity Fund <sup>^</sup>		Franklin MV European Equity Growth and Income Fund <sup>^</sup>		FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund <sup>^</sup> <sup>6</sup>	
	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023
	<b>UMLAUFVERMÖGEN:</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	\$ -	\$ -	\$ 23	\$ 23	€ 1.351	€ 1.256	\$ 2.310	\$ 402
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	-	-	-	-	-	-	-	-
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	4.230	4.273	-	-	-	-	-	20.883
Verpfändete Anlagen	-	-	-	-	-	-	-	-
Optionen	-	-	-	-	-	-	-	-
Swapkontrakte	-	-	-	-	-	-	-	-
Swaptions	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
Forderungen aus Anlagenverkauf	-	-	-	-	-	-	-	-
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-	-	-	-	-	-	-	3
Zinsen und sonstige Erträge	-	-	-	-	-	-	-	1
Dividendenforderungen	5	8	-	-	11	3	-	62
Verwaltungsgebühren	1	-	-	-	-	-	-	-
Sonstige Vermögenswerte	16	-	-	-	-	-	3	-
<b>Gesamtumlautvermögen</b>	<b>4.252</b>	<b>4.281</b>	<b>23</b>	<b>23</b>	<b>1.362</b>	<b>1.259</b>	<b>2.313</b>	<b>21.351</b>
<b>KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:</b>								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	2	-	-	-	-	-	-	-
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	-	-	-	-	-	-	-	-
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten:								
Optionen	-	-	-	-	-	-	-	-
Swapkontrakte	-	-	-	-	-	-	-	-
Swaptions	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	-	-	-	-	-	-	-	90
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	-	-	-	-	-	-	-	-
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-	-	-	-	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	-	1	-	-	-	-	-	25
Performancegebühren (Erläuterung 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	8	7	-	-	-	3	8	11
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	-	-	-	-	-	-	-	2
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-	-	-	-	1.175	1.185	2.247	-
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	13	19	23	23	187	71	58	133
<b>Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)</b>	<b>23</b>	<b>27</b>	<b>23</b>	<b>23</b>	<b>1.362</b>	<b>1.259</b>	<b>2.313</b>	<b>261</b>
<b>Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens</b>	<b>\$ 4.229</b>	<b>\$ 4.254</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>€ -</b>	<b>€ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ 21.090</b>

(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund <sup>^</sup>	
	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023
	<b>UMLAUFVERMÖGEN:</b>							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	\$ 28	\$ 28	€ 82	€ 65	\$ 51	\$ 51	\$ 61	\$ 61
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	-	-	-	-	-	-	-	-
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:								
Anlagen	-	-	-	-	-	-	-	-
Verpfändete Anlagen	-	-	-	-	-	-	-	-
Optionen	-	-	-	-	-	-	-	-
Swapkontrakte	-	-	-	-	-	-	-	-
Swaptions	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
Forderungen aus Anlagenverkauf	-	-	-	-	-	-	-	-
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-	-	-	-	-	-	-	-
Zinsen und sonstige Erträge	-	-	-	-	-	-	-	-
Dividendenforderungen	-	-	-	-	-	-	-	-
Verwaltungsgebühren	-	-	-	-	-	-	-	-
Sonstige Vermögenswerte	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Gesamtumlautvermögen</b>	<b>28</b>	<b>28</b>	<b>82</b>	<b>65</b>	<b>51</b>	<b>51</b>	<b>61</b>	<b>61</b>
<b>KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:</b>								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	-	-	-	-	-	-	-	-
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	-	-	-	-	-	-	-	-
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten:								
Optionen	-	-	-	-	-	-	-	-
Swapkontrakte	-	-	-	-	-	-	-	-
Swaptions	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	-	-	-	-	-	-	-	-
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-	-	-	-	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Performancegebühren (Erläuterung 3)	-	-	3	-	-	-	-	-
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-	-	-	-	51	51	38	38
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	28	28	79	65	-	-	23	23
<b>Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)</b>	<b>28</b>	<b>28</b>	<b>82</b>	<b>65</b>	<b>51</b>	<b>51</b>	<b>61</b>	<b>61</b>
<b>Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>€ -</b>	<b>€ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund <sup>^</sup>		Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund <sup>^</sup>		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Japan Equity Fund <sup>^</sup>		FTGF Martin Currie Asia Long- Term Unconstrained Fund <sup>^β</sup>	
Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023
\$ 60	\$ 60	\$ 38	\$ 41	\$ 2.544	\$ 2.569	¥ 122.634	¥ 114.974	\$ 61	\$ 12
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	3.598
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	14
-	-	-	-	-	-	-	-	8	4
<b>60</b>	<b>60</b>	<b>38</b>	<b>41</b>	<b>2.544</b>	<b>2.569</b>	<b>122.634</b>	<b>114.974</b>	<b>69</b>	<b>3.628</b>
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	2
-	-	-	-	-	4	-	-	7	14
59	59	1	2	2.517	2.516	-	-	-	-
1	1	37	39	27	49	122.634	114.974	62	74
<b>60</b>	<b>60</b>	<b>38</b>	<b>41</b>	<b>2.544</b>	<b>2.569</b>	<b>122.634</b>	<b>114.974</b>	<b>69</b>	<b>90</b>
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	¥ -	¥ -	\$ -	\$ 3.538
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>		FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund		FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup>		FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>^</sup>		FTGF Martin Currie Improving Society Fund <sup>^γ</sup>	
Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023
\$ 1	\$ 87	\$ 176	\$ 156	\$ 7	\$ 174	€ 876	€ 780	\$ 249	\$ -
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
152.269	142.529	20.210	24.963	33.082	34.547	187.464	188.780	4.524	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
33	41	-	1	-	-	11	22	-	-
80	154	777	-	-	-	-	4.857	-	-
46	85	-	-	33	104	-	1.732	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
114	61	150	145	24	31	110	57	3	-
-	-	-	-	-	-	-	-	8	-
6	-	9	-	7	-	2	1	-	-
<b>152.549</b>	<b>142.957</b>	<b>21.322</b>	<b>25.265</b>	<b>33.153</b>	<b>34.856</b>	<b>188.463</b>	<b>196.229</b>	<b>4.784</b>	<b>-</b>
128	-	-	-	2	-	-	3	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.479	1.422	1	19	-	-	28	20	2	-
80	154	730	-	-	-	-	4.372	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
84	76	14	18	27	26	59	55	-	-
21	19	10	9	13	11	27	41	5	-
9	8	2	3	1	1	1	1	-	-
144	184	-	-	-	-	7	2.603	-	-
31	45	68	95	145	116	22	37	11	-
<b>1.976</b>	<b>1.908</b>	<b>825</b>	<b>144</b>	<b>188</b>	<b>154</b>	<b>144</b>	<b>7.132</b>	<b>18</b>	<b>-</b>
\$ 150.573	\$ 141.049	\$ 20.497	\$ 25.121	\$ 32.965	\$ 34.702	€ 188.319	€ 189.097	\$ 4.766	\$ -

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



## Bilanz – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Franklin Responsible Income 2028 Fund <sup>^</sup>		Franklin Templeton Global Funds Plc	
	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023	Zum 31. August 2023	Zum 28. Februar 2023
<b>UMLAUFVERMÖGEN:</b>				
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 7)	€ 222	€ 1.848	\$ 235.072	\$ 331.948
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	203.275	312.657
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte:				
Anlagen	86.453	34.759	16.096.309	17.052.700
Verpfändete Anlagen	–	–	57.443	1.742
Optionen	–	–	24.476	7.318
Swapkontrakte	–	–	125.776	170.266
Swaptions	–	–	47	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	35.171	53.350
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	69.493	32.496
Forderungen aus Anlagenverkauf	156	–	218.032	135.703
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	689	35.638	48.971
Zinsen und sonstige Erträge	1.020	344	91.408	103.724
Dividendenforderungen	40	11	11.968	10.290
Verwaltungsgebühren	–	9	17	64
Sonstige Vermögenswerte	3	2	269	59
<b>Gesamtumlaufvermögen</b>	<b>87.894</b>	<b>37.662</b>	<b>17.204.394</b>	<b>18.261.288</b>
<b>KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:</b>				
Überziehung Barmittel (Erläuterung 7)	–	–	105.849	91.015
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 7)	–	–	25.997	84.123
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten:				
Optionen	–	–	47.795	47.119
Swapkontrakte	–	–	65.757	46.859
Swaptions	–	–	73	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	74.855	121.367
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	58.809	59.938
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	–	815	391.788	301.633
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	4.030	2.826
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	35	–	9.556	9.548
Performancegebühren (Erläuterung 3)	–	–	3	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	8	2	1.618	1.695
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	1.027	1.005
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	23	–	67.302	54.803
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	36	22	11.358	11.327
<b>Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)</b>	<b>102</b>	<b>839</b>	<b>865.817</b>	<b>833.258</b>
<b>Summe des auf die Inhaber rücknehmbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens</b>	<b>€ 87.792</b>	<b>€ 36.823</b>	<b>\$ 16.338.577</b>	<b>\$ 17.428.030</b>

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

Die Euro-Beträge für den FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund<sup>^</sup>, FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup>, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund<sup>^</sup>, Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup>, FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup> und Franklin Responsible Income 2028 Fund<sup>^</sup> wurden zur Berechnung der Gesamtbeträge für Franklin Templeton Global Funds Plc zum 31. August 2023 zum USD/EUR-Schlusskurs von 0,9222 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2023: 0,9454).

Die Yen-Beträge für den Legg Mason Japan Equity Fund<sup>^</sup> wurden zur Berechnung der Gesamtbeträge für Franklin Templeton Global Funds Plc zum 31. August 2023 mit dem USD/JPY-Schlusskurs von 145,4950 umgerechnet (28. Februar 2023: 136,1550).

Die Beträge in britischem Pfund für den FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup> wurden zur Berechnung der Gesamtbeträge für Franklin Templeton Global Funds Plc zum 31. August 2023 zum USD/GBP-Schlusskurs von 0,7894 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2023: 0,8314).

α Mit Wirkung vom 24. März 2023 stellten der FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>^</sup> und der FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

β Mit Wirkung vom 20. April 2023 stellte der FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

γ Mit Wirkung vom 20. Juni 2023 wurde der FTGF Martin Currie Improving Society Fund<sup>^</sup> aufgelegt.

δ Mit Wirkung vom 17. Juli 2023 stellte der FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2023			28. Februar 2023			28. Februar 2022		
	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/ Anteil:	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/ Anteil:	Gesamt-NiW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NiW/ Anteil:
<b>FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 191.997	1.683	114,09	\$ 164.832	1.477	111,57	\$ 131.265	1.197	109,62
Klasse A USD ausschüttend (D)	614.004	614.017	1,00	526.302	526.316	1,00	640.232	640.245	1,00
Klasse B USD thesaurierend	16	–	108,60	74	1	106,43	73	1	104,91
Klasse B USD ausschüttend (D)	174	174	1,00	218	218	1,00	–	–	–
Klasse C USD thesaurierend	156	1	107,00	153	1	105,01	5.317	51	103,69
Klasse C USD ausschüttend (D)	–	–	–	134	134	1,00	140	140	1,00
Klasse X USD ausschüttend (D)	121.875	121.877	1,00	141.184	141.186	1,00	141.538	141.540	1,00
Klasse A (G) USD thesaurierend	456	4	114,32	481	4	111,80	488	4	109,85
Klasse A (G) USD ausschüttend (D)	234	234	1,00	230	230	1,00	264	264	1,00
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)	7	7	1,00	7	7	1,00	7	7	1,00
<b>FTGF Western Asset US Core Bond Fund</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 29.941	234	128,18	\$ 29.314	230	127,44	\$ 35.416	245	144,44
Klasse A USD ausschüttend (D)	36.214	410	88,42	35.001	391	89,45	80.771	775	104,18
Klasse B USD ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	2	–	104,24
Klasse C USD thesaurierend	4.305	37	117,94	5.503	47	117,55	8.586	64	133,90
Klasse C USD ausschüttend (D)	2.346	27	88,47	2.543	28	89,49	3.580	34	104,21
Klasse E USD thesaurierend	988	11	87,22	803	9	86,98	2.222	22	99,25
Klasse F USD thesaurierend	106.547	910	117,09	31.628	272	116,19	58.355	445	131,23
Klasse F USD ausschüttend (D)	16.358	188	86,97	11.329	129	87,97	14.031	137	102,43
Klasse X USD thesaurierend	2.060	20	102,55	2.156	21	101,70	2.384	21	114,69
Klasse X USD ausschüttend (D)	217	3	86,02	266	3	87,02	298	3	101,33
Klasse Premier USD thesaurierend	9	–	102,84	8.681	85	101,94	19.841	173	114,85
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	2.570	22	105,86
Klasse LM USD thesaurierend	3.392	39	87,39	3.593	42	86,47	3.558	37	97,13
Klasse GA USD thesaurierend	1.056	8	126,76	1.059	8	125,95	1.232	9	142,64
Klasse GE USD thesaurierend	43	–	117,23	43	–	116,84	60	–	133,11
<b>FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 99.317	694	143,14	\$ 103.760	730	142,14	\$ 122.223	748	163,35
Klasse A USD ausschüttend (D)	31.017	325	95,55	28.475	295	96,61	47.095	412	114,18
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	3.628	46	78,95	4.183	52	80,27	7.597	79	95,64
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	671	14	75,31	5.786	111	77,22	6.011	89	93,32
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	719	8	88,35	715	8	88,75	1.452	12	104,74
Klasse B USD ausschüttend (D)	11	–	95,36	11	–	96,41	86	1	114,12
Klasse C USD thesaurierend	17.246	134	129,02	16.162	126	128,45	23.167	156	148,35
Klasse C USD ausschüttend (D)	8.020	83	96,23	7.865	81	97,30	10.764	94	114,99
Klasse E USD thesaurierend	12.864	122	105,50	13.647	130	105,09	21.829	180	121,50
Klasse F USD thesaurierend	412.268	3.617	113,99	524.507	4.647	112,86	675.110	5.237	128,91
Klasse F USD ausschüttend (D)	8.472	95	89,61	8.486	94	90,60	11.889	111	107,08
Klasse X USD thesaurierend	3.840	36	106,11	2.793	27	105,00	8.356	70	119,85
Klasse X USD ausschüttend (D)	3.200	38	83,31	3.236	38	84,24	5.357	54	99,58
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert)	206	2	84,19	285	3	84,29	2.903	26	98,90
Klasse Premier USD thesaurierend	340.148	2.479	137,20	374.417	2.760	135,67	491.421	3.179	154,57
Klasse Premier USD ausschüttend (M)	3.346	37	90,75	2.837	31	91,71	2.929	27	108,14
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert)	38.590	376	94,57	31.663	316	94,59	22.936	185	110,65
Klasse LM USD ausschüttend (M)	13.939	178	78,15	16.273	206	78,97	22.527	242	93,11
Klasse LM EUR thesaurierend	340	3	115,82	1.375	11	117,39	1.726	12	125,79
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)	45	–	132,27	34	–	131,13	27	–	150,84
Klasse A (G) USD thesaurierend	170	1	145,38	169	1	144,38	200	1	165,90
Klasse A (G) USD ausschüttend (D)	782	8	96,30	833	9	97,37	1.106	10	115,07
Klasse B (G) USD ausschüttend (D)	3	–	96,31	3	–	97,38	4	–	115,09
Klasse L (G) USD thesaurierend	203	2	133,95	202	2	133,36	234	2	154,01
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)	984	10	96,31	983	10	97,38	1.141	10	115,09
<b>FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund</b>									
Klasse A USD ausschüttend (D)	€ 368	4	96,89	€ 35	–	93,08	€ 50	–	117,82
Klasse A EUR ausschüttend (D)	878	9	92,67	862	9	91,32	1.190	11	108,97
Klasse C USD ausschüttend (D)	55	1	96,30	54	1	92,57	65	1	117,09
Klasse F EUR ausschüttend (Q)	–	–	–	–	–	–	1	–	124,95
Klasse Premier EUR thesaurierend	4.943	53	92,60	7.303	81	90,38	1.825	17	106,44
Klasse LM EUR thesaurierend	83.100	864	96,19	123.205	1.314	93,74	145.011	1.317	110,07
Klasse GA EUR thesaurierend	610	5	114,53	636	6	112,08	741	6	132,69
Klasse GA EUR ausschüttend (A)	273	3	103,02	278	3	101,67	391	3	120,65
Klasse GE EUR thesaurierend	96	1	105,93	94	1	103,97	112	1	123,83
<b>Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund<sup>^</sup></b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ –	–	–	\$ –	–	–	\$ 23.402	144	162,96
Klasse A USD ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	7.876	90	87,34
Klasse A USD ausschüttend (M)	–	–	–	–	–	–	252	3	92,27
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	–	–	–	–	–	–	207	2	91,74
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–	–	–	–	–	–	30	–	89,13
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	1.481	9	142,92
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	–	–	–	–	–	–	452	38	92,09
Klasse B USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	13	–	156,15
Klasse B USD ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	64	1	87,30
Klasse C USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	7.053	47	151,17
Klasse C USD ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	4.005	46	87,30
Klasse F USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	3.094	29	108,26
Klasse Premier USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1	–	98,57
Klasse Premier USD ausschüttend (M)	–	–	–	–	–	–	1	–	97,46
Klasse A (G) USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	757	5	161,24
Klasse A (G) USD ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	3.274	37	88,89
Klasse B (G) USD ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	5	–	88,98
Klasse L (G) USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	890	6	149,79
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	135	2	88,90
<b>FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 11.050	70	156,95	\$ 9.390	61	154,26	\$ 12.161	74	165,33
Klasse A USD ausschüttend (D)	11.312	115	98,39	13.012	132	98,88	15.078	137	109,94
Klasse A USD ausschüttend (M)	1.536	18	83,62	1.619	19	83,98	2.287	25	93,16
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	815	11	76,28	683	9	77,14	879	10	86,54
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	137	3	72,75	166	3	74,10	47	1	84,12
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	2.597	18	130,36	3.009	22	129,52	4.100	26	142,38
Klasse A EUR ausschüttend (M) (abgesichert)	2.483	33	68,43	2.671	36	69,49	3.395	38	79,05
Klasse A EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	203	3	57,40	201	3	58,69	252	3	67,69
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	472	5	81,24	498	5	81,90	581	5	91,73
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	48	5	74,35	49	5	75,26	110	10	84,03
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	948	1.639	0,78	960	1.626	0,80	1.033	1.563	0,90
Klasse B USD ausschüttend (D)	264	3	98,37	262	3	98,86	531	5	109,92
Klasse C USD thesaurierend	5.481	39	140,91	6.279	45	138,84	6.780	45	149,55
Klasse C USD ausschüttend (D)	7.952	81	98,36	8.448	85	98,85	10.758	98	109,90
Klasse A ZAR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	322	9	663,25	349	9	681,64	451	9	788,67
Klasse E USD thesaurierend	1.186	10	123,62	1.240	10	121,87	1.505	11	131,41
Klasse E USD ausschüttend (D)	441	5	81,92	583	7	82,33	661	7	91,53
Klasse E EUR thesaurierend (abgesichert)	58	1	96,34	92	1	96,02	125	1	106,18
Klasse E EUR ausschüttend (M) (abgesichert)	31	–	69,79	30	–	70,87	36	–	80,64
Klasse F USD thesaurierend	17.781	121	146,71	17.061	119	143,75	20.347	133	153,16
Klasse F USD ausschüttend (D)	4.583	56	81,92	4.951	60	82,33	5.501	60	91,53

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2023			28. Februar 2023			28. Februar 2022		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:
<b>FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund (Fortsetzung)</b>									
Klasse X USD ausschüttend (D)	\$ 708	9	82,04	\$ 697	8	82,45	\$ 1.399	15	91,68
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert)	62	1	101,30	8	–	100,36	–	–	–
Klasse X GBP ausschüttend (D) (abgesichert)	63	1	77,55	60	1	78,21	76	1	87,81
Klasse Premier USD thesaurierend	28.825	162	178,09	34.965	201	174,28	44.980	243	185,22
Klasse Premier USD ausschüttend (M)	361	4	102,25	368	4	102,68	12.098	106	113,85
Klasse Premier CHF thesaurierend (abgesichert)	58.335	522	98,79	54.671	522	98,72	3.442	28	111,13
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert)	818	6	130,90	1.365	10	129,55	4.740	30	141,32
Klasse Premier EUR ausschüttend (M) (abgesichert)	39	1	66,14	39	1	67,15	69	1	76,38
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	49.523	266	138,99
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	744	7	78,41	827	9	79,03	2.899	24	88,49
Premier Class GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	203	2	68,28	203	2	69,00	205	2	77,65
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)	2.800	90	128,35	2.666	95	124,47	3.664	121	127,30
Klasse LM AUD ausschüttend (M) (abgesichert)	59.304	1.015	90,19	59.726	973	91,26	93.108	1.251	102,46
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)	201	1	138,43	207	1	135,69	148	1	145,04
<b>FTGF Western Asset US High Yield Fund</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 17.076	93	184,30	\$ 18.805	105	179,29	\$ 25.055	129	194,84
Klasse A USD ausschüttend (D)	25.944	385	67,32	27.885	411	67,77	34.889	446	78,15
Klasse A USD ausschüttend (M)	1.203	15	81,53	1.375	17	82,01	2.271	24	94,27
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	1.024	15	68,57	1.290	18	69,82	2.424	30	81,29
Klasse A EUR ausschüttend (M) (abgesichert)	1.401	19	66,39	1.403	20	67,53	1.414	16	79,66
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	17	1	100,59	5	–	94,71	–	–	93,84
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	394	823	0,65	383	776	0,66	520	907	0,78
Klasse B USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	338	2	192,79
Klasse B USD ausschüttend (D)	–	–	–	46	1	67,77	106	1	78,17
Klasse C USD thesaurierend	4.095	23	174,58	4.132	24	170,27	3.170	17	185,96
Klasse C USD ausschüttend (D)	1.703	25	67,32	2.074	31	67,78	2.748	35	78,16
Klasse E USD thesaurierend	2.611	16	164,69	3.404	21	160,70	3.857	22	175,71
Klasse E USD ausschüttend (D)	433	5	84,10	581	7	84,66	1.106	11	97,67
Klasse E EUR thesaurierend (abgesichert)	361	3	95,28	347	3	94,00	413	3	105,40
Klasse F USD thesaurierend	4.092	24	169,77	4.327	26	164,83	7.467	42	178,39
Klasse F USD ausschüttend (D)	230	3	80,12	257	3	80,65	226	2	93,01
Klasse Premier USD thesaurierend	20.214	114	176,94	35.228	205	171,58	101.736	549	185,21
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	696	5	105,44	1	–	102,60	1	–	111,69
Klasse S USD ausschüttend (M)	1	–	87,88	1	–	88,37	–	–	–
LM Klasse EUR ausschüttend (M) (abgesichert)	30	–	84,70	28	–	86,14	–	–	–
Klasse LM USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	45.730	232	197,50
Klasse LM USD ausschüttend (M)	22.136	297	74,59	21.415	285	75,02	23.015	267	86,21
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)	32	–	107,51	40	–	104,43	51	–	113,46
Klasse A (G) USD thesaurierend	194	1	188,59	189	1	183,52	211	1	199,51
Klasse A (G) USD ausschüttend (D)	1.037	16	66,79	1.072	16	67,23	1.243	16	77,53
Klasse L (G) USD thesaurierend	147	1	173,75	170	1	169,50	185	1	185,19
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)	647	10	66,78	645	10	67,22	795	10	77,52
Klasse GF USD thesaurierend	141	1	168,26	137	1	163,56	149	1	177,45
<b>Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund<sup>A</sup></b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ –	–	–	\$ –	–	–	\$ 5.371	32	170,12
Klasse A USD ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	1.415	14	99,47
Klasse A USD ausschüttend (M)	–	–	–	–	–	–	908	10	89,94
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	–	–	–	–	–	–	10	–	67,72
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	219	2	127,14
Klasse A EUR ausschüttend (D) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	293	4	67,99
Klasse A GBP ausschüttend (D) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	44	–	84,50
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–	–	–	–	–	–	9	17	0,70
Klasse C USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	243	2	154,50
Klasse C USD ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	1.023	10	99,42
Klasse E USD ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	413	5	84,99
Klasse E EUR thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	10	–	88,88
Klasse E EUR ausschüttend (M) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	15	–	75,92
Klasse F USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	67	–	151,93
Klasse X GBP ausschüttend (D) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	15	–	82,01
Klasse Premier USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	93	1	93,44
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	2.097	15	123,82
Klasse Premier GBP ausschüttend (D) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	79	1	73,50
Klasse LM USD ausschüttend (M) (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	25.470	288	88,50
Klasse A (G) USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	494	3	178,03
Klasse A (G) USD ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	814	9	89,17
Klasse L (G) USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1.125	7	165,24
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	891	10	89,14
<b>Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund<sup>A</sup></b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ –	–	–	\$ –	–	–	\$ 24	–	106,83
Klasse A USD ausschüttend (M)	–	–	–	–	–	–	1	–	90,49
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	5	–	89,98
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	1.928	18	94,23
Klasse LM USD ausschüttend (M)	–	–	–	–	–	–	25.890	286	90,51
<b>FTGF Western Asset Global High Yield Fund</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 5.261	32	166,22	\$ 5.649	34	164,18	\$ 8.812	49	178,94
Klasse A USD ausschüttend (D)	5.910	95	62,16	6.082	96	63,39	7.374	101	72,88
Klasse A USD ausschüttend (M)	7.340	106	69,05	8.467	120	70,35	11.065	137	80,65
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	4.397	71	61,63	5.245	83	63,52	10.681	145	73,86
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	4.259	93	70,73	5.294	107	73,48	7.679	122	86,67
Klasse A EUR thesaurierend	2.114	18	109,24	2.233	19	110,61	2.029	16	113,76
Klasse A EUR ausschüttend (D) (abgesichert)	119	2	61,48	120	2	63,37	65	1	74,80
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.668	3.836	0,59	1.724	3.810	0,61	2.177	4.140	0,71
Klasse B USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	72	–	175,72
Klasse B USD ausschüttend (D)	29	–	62,04	30	–	63,26	201	3	72,72
Klasse C USD thesaurierend	929	6	157,16	920	6	155,61	1.483	9	170,46
Klasse C USD ausschüttend (D)	2.108	34	61,89	2.429	38	63,11	2.962	41	72,56
Klasse E USD thesaurierend	861	6	143,64	1.123	8	142,35	1.249	8	156,17
Klasse E USD ausschüttend (D)	162	2	76,20	165	2	77,70	207	2	89,34
Klasse E EUR ausschüttend (M) (abgesichert)	14	–	61,20	14	–	63,06	18	–	74,28
Klasse F USD thesaurierend	2.919	19	150,47	2.845	19	148,37	2.036	13	161,10
Klasse F USD ausschüttend (D)	456	6	72,32	543	7	73,75	965	11	84,81
Klasse X USD ausschüttend (D)	4.181	52	81,07	4.458	54	82,67	5.807	61	95,06
Klasse X GBP ausschüttend (D) (abgesichert)	3.820	47	64,73	3.701	46	66,23	4.406	43	77,04
Klasse Premier USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	6.086	29	212,96
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert)	1.691	14	114,25	2.244	19	113,78	1.770	12	126,57
Klasse Premier GBP ausschüttend (D) (abgesichert)	28	–	70,38	27	–	72,01	35	–	83,77
Klasse S USD ausschüttend (M)	1	–	88,52	1	–	90,17	–	–	–
LM Klasse EUR ausschüttend (M) (abgesichert)	30	–	85,24	29	–	87,81	–	–	–
Klasse A (G) USD thesaurierend	1.411	8	169,02	2.047	12	167,12	2.374	13	182,46
Klasse A (G) USD ausschüttend (D)	936	15	62,16	1.003	16	63,38	1.240	17	72,88
Klasse L (G) USD thesaurierend	434	3	155,73	431	3	154,37	507	3	169,39
Klasse L (G) USD ausschüttend (D)	605	10	62,17	607	10	63,40	678	9	72,89

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2023			28. Februar 2023			28. Februar 2022		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:
<b>Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund<sup>^</sup></b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ –	–	–	\$ –	–	–	\$ 3.549	23	155,66
Klasse A USD ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	4.844	36	133,96
Klasse B USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	28	–	108,80
Klasse C USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	93	1	99,75
Klasse C USD ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	843	6	130,28
Klasse F USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	29	–	100,15
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	7.094	63	100,66
Klasse LM USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	42.980	369	116,57
Klasse A (G) USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	5	–	163,47
Klasse A (G) USD ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	45	–	130,79
Klasse L (G) USD ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	15	–	120,50
<b>FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 26.990	180	150,19	\$ 29.246	196	149,02	\$ 39.106	241	162,46
Klasse A USD ausschüttend (D)	5.387	56	95,90	5.574	58	96,54	6.592	61	108,04
Klasse A USD ausschüttend (M)	5.038	57	88,47	9.535	107	89,01	12.847	129	99,50
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	28.058	433	64,79	29.850	452	66,00	45.247	604	74,94
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	11.979	259	71,45	13.954	283	73,37	21.798	356	84,24
Klasse A CHF thesaurierend (abgesichert) Plus	301	3	85,99	286	3	87,16	330	3	98,04
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	6.439	675	69,42	3.528	341	71,91	5.325	405	83,16
Klasse A EUR thesaurierend	1.695	7	218,21	1.927	8	221,94	2.698	11	228,02
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	962	9	95,50	935	9	95,84	1.734	14	107,09
Klasse A EUR ausschüttend (A)	398	4	104,93	447	4	109,59	541	4	115,43
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	5.913	592	78,31	6.684	657	79,85	10.989	951	90,29
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	783	766	1,38	672	656	1,38	1.296	1.162	1,51
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.548	3.132	0,67	1.394	2.739	0,69	2.389	4.143	0,78
Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	429	817	0,71	605	1.131	0,72	940	1.545	0,82
Klasse B USD thesaurierend	55	–	144,50	54	–	143,57	62	–	156,90
Klasse B USD ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	19	–	107,96
Klasse C USD thesaurierend	1.452	10	138,79	1.433	10	138,07	1.697	11	151,27
Klasse C USD ausschüttend (D)	1.096	11	95,92	1.111	12	96,56	1.306	12	108,06
Klasse E USD thesaurierend	581	5	119,64	590	5	119,08	704	5	130,59
Klasse E USD ausschüttend (D)	182	2	88,16	181	2	88,75	199	2	99,32
Klasse F USD thesaurierend	2.324	17	137,93	2.326	17	136,58	2.699	18	148,29
Klasse F USD ausschüttend (D)	581	7	88,21	585	7	88,80	654	7	99,38
Klasse X USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	221	2	110,48
Klasse X USD ausschüttend (M)	1.159	14	85,06	1.204	14	85,58	3.705	39	95,65
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert)	233	2	89,30	228	2	89,39	268	2	99,36
Klasse Premier USD thesaurierend	59.543	360	165,39	83.254	509	163,56	72.450	409	177,15
Klasse Premier USD ausschüttend (M)	136	1	102,26	137	1	102,87	–	–	–
Klasse Premier EUR thesaurierend	121.629	732	153,33	120.289	732	155,45	130.405	732	158,82
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert)	11.741	100	107,82	8.187	72	107,84	8.686	65	119,68
Klasse Premier EUR ausschüttend (A)	65.928	657	92,51	69.572	678	96,97	77.670	678	102,12
Klasse Premier EUR ausschüttend (M)	10.869	102	98,66	10.936	102	101,76	12.221	102	107,28
Klasse Premier GBP ausschüttend (M)	74	1	105,01	84	1	111,31	92	1	111,51
Klasse LM USD thesaurierend	15.063	84	179,53	25.877	146	176,99	43.801	230	190,55
Klasse LM USD ausschüttend (M)	3.249	37	88,99	4.430	49	89,52	–	–	–
Klasse LM EUR ausschüttend (M) (abgesichert)	1.650	18	82,79	1.358	15	84,23	1.103	10	96,42
<b>FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 32.260	262	123,03	\$ 30.772	254	121,01	\$ 22.239	176	126,60
Klasse A USD ausschüttend (M)	11.497	112	102,58	7.663	75	101,67	6.851	64	106,79
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	21.870	223	90,61	21.104	222	90,07	9.882	91	96,55
Klasse A EUR ausschüttend (M) (abgesichert)	321	3	98,62	313	3	98,80	–	–	–
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	11.777	1.413	91,26	12.582	1.452	90,68	22.680	2.221	96,73
Klasse A SEK ausschüttend (M) (abgesichert)	1	–	90,08	1	–	90,27	1	–	96,70
Klasse B USD thesaurierend	–	–	–	52	1	99,51	–	–	–
Klasse C USD thesaurierend	3.523	31	114,62	3.828	34	113,01	8.415	71	118,83
Klasse C USD ausschüttend (M)	4.053	40	101,44	3.761	37	100,53	519	5	105,71
Klasse E USD thesaurierend	3.329	31	107,84	3.313	31	106,39	3.238	29	111,98
Klasse E USD ausschüttend (D)	4.903	50	97,33	4.856	50	96,49	4.983	49	101,56
Klasse F USD thesaurierend	3.396	27	123,95	3.410	28	121,66	7.631	60	126,78
Klasse F USD ausschüttend (D)	904	10	93,67	1.287	14	92,86	1.596	16	97,66
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert)	22.778	229	91,58	8.345	87	90,78	9.247	85	96,86
Klasse Premier USD thesaurierend	15.094	111	135,64	25.521	192	132,97	27.247	197	138,22
Klasse Premier CHF ausschüttend (M) (abgesichert)	4.526	40	99,95	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert)	11.851	113	96,35	65.972	653	95,51	31.220	274	101,73
Klasse Premier EUR ausschüttend (M) (abgesichert)	247	2	99,50	–	–	87,78	189	2	94,28
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	112	1	126,64	565	4	124,65	2	–	130,72
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	34	–	96,69	13	–	96,15	1.278	9	101,92
Klasse S USD ausschüttend (M) Plus (e)	30.863	318	97,02	29.107	302	96,32	10.106	100	101,50
Klasse S EUR thesaurierend (abgesichert)	27	–	92,56	27	–	91,66	55	–	97,58
Klasse S EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	8.813	94	86,09	6.422	70	86,37	3.050	29	93,27
Klasse S GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	272.530	2.353	91,42	285.334	2.604	91,09	262.829	2.023	96,86
Klasse LM AUD thesaurierend (abgesichert)	9.499	155	94,58	9.722	155	93,22	10.991	155	97,63
<b>FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>^</sup></b>									
Klasse A USD ausschüttend (A)	\$ 17	–	91,00	\$ 1	–	91,31	\$ 1	–	102,91
Klasse X USD thesaurierend	1.681	16	105,85	1.721	17	103,78	2.746	24	115,64
Klasse Premier USD thesaurierend	16.767	116	143,93	25.147	178	141,02	42.779	273	156,86
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert)	35.323	332	98,05	20.636	201	97,14	39.201	315	110,84
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	2	–	87,15	2	–	85,63	3	–	96,15
Klasse Premier NZD thesaurierend (abgesichert)	4.127	71	98,08	5.009	84	96,21	6.128	84	107,57
Klasse S USD thesaurierend	1	–	93,62	1	–	91,67	–	–	–
Klasse S EUR thesaurierend (abgesichert)	28	–	90,30	28	–	89,44	–	–	–
Klasse LM USD thesaurierend	4.168	41	101,50	4.099	41	99,25	4.122	37	109,96
Klasse LM EUR thesaurierend (abgesichert)	1.603	17	84,74	1.857	21	83,81	2.442	23	95,23
Klasse LM CAD thesaurierend (abgesichert)	90.747	1.177	104,18	88.202	1.177	102,26	105.526	1.177	113,65
<b>FTGF Western Asset Global Credit Fund<sup>^</sup></b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 2.178	17	126,88	\$ 2.174	17	127,27	\$ 3.171	22	142,04
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	277	2	107,38	321	3	108,91	408	3	124,74
Klasse X USD thesaurierend	1	–	100,31	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert)	27	–	82,03	27	–	82,92	53	1	94,35
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	19	–	84,06	18	–	84,38	63	1	94,58
Klasse LM USD thesaurierend	24.453	160	152,58	39.438	259	152,29	69.126	411	168,26
Klasse LM EUR thesaurierend (abgesichert)	4.404	50	81,89	4.072	47	82,64	4.532	43	93,68
<b>Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund<sup>^</sup></b>									
Klasse A EUR ausschüttend (D)	€ –	–	–	€ –	–	–	€ 48	–	96,68
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	6	–	97,70
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	1	–	105,33
Klasse LM EUR thesaurierend	–	–	–	–	–	–	37.393	205	182,42
<b>FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup></b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 317.519	2.547	124,65	\$ 388.476	3.241	119,86	\$ 788.243	5.937	132,77
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	113.722	1.481	76,80	124.647	1.627	76,61	200.496	2.254	88,97
Klasse A USD ausschüttend (S)	25.352	277	91,61	28.115	311	90,26	41.551	408	101,44
Klasse A AUD thesaurierend (abgesichert)	1.469	25	90,25	1.089	18	87,62	1.348	19	98,55

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses





## Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2023			28. Februar 2023			28. Februar 2022		
	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:
<b>FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 101	1	107,81	\$ 102	1	108,03	\$ 644	5	122,84
Klasse Premier USD thesaurierend	15.518	158	98,63	16.144	164	98,52	19.025	171	111,27
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	870	7	111,34
Klasse S USD thesaurierend	1	–	90,80	1	–	90,61	–	–	–
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	154.630	951	121,21
Klasse LM GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	39.670	352	90,32	78.528	704	92,75	–	–	–
<b>Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund<sup>Δ</sup></b>									
Klasse LM USD ausschüttend (Q)	\$ 18.637	257	72,58	\$ 18.441	250	73,76	\$ 21.958	244	90,04
<b>FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>Δ</sup></b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 8	–	85,83	\$ 9	–	85,86	\$ 10	–	95,97
Klasse F USD thesaurierend	9	–	86,43	9	–	86,26	10	–	96,01
Klasse Premier USD thesaurierend	2.120	24	86,78	2.138	25	86,50	2.401	25	96,05
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	2.756	139	98,23	2.540	140	94,89	2.664	142	96,96
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert)	40	–	83,58	39	–	84,26	47	–	95,97
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	40	–	85,55	38	–	85,61	47	–	96,05
Klasse S USD thesaurierend	4.198	48	86,92	4.183	48	86,60	4.640	48	96,06
Klasse S EUR thesaurierend (abgesichert)	40	–	83,72	39	–	84,36	47	–	95,98
<b>FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 8.456	69	122,18	\$ 9.739	79	122,52	\$ 12.568	87	144,07
Klasse A USD ausschüttend (M)	620	8	73,62	521	7	75,50	1.099	12	91,71
Klasse A USD ausschüttend (S)	17.885	196	91,41	17.976	192	93,73	22.007	196	112,29
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	180	5	54,03	381	10	56,40	526	10	69,92
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	620	8	67,76	717	10	68,79	1.075	11	83,44
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert) (IH)	14.405	103	129,37	14.676	107	130,10	25.053	152	146,74
Klasse A EUR ausschüttend (A) (abgesichert)	189	3	56,00	305	5	58,95	583	7	72,27
Klasse A EUR ausschüttend (S)	39	–	74,96	41	–	78,82	49	–	89,08
Klasse A EUR ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	5.161	57	84,08	5.444	60	86,44	7.052	63	99,31
Klasse A GBP thesaurierend	87	1	87,01	87	1	91,89	102	1	96,89
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	160	2	60,69	204	3	62,54	254	2	77,41
Klasse A GBP ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	2.952	25	93,79	3.053	27	95,78	4.647	32	108,33
Klasse A SGD thesaurierend	62	101	0,84	60	97	0,84	68	93	0,99
Klasse B USD thesaurierend	6	–	110,57	7	–	111,01	23	–	130,86
Klasse B USD ausschüttend (S)	61	1	91,36	63	1	93,69	107	1	112,23
Klasse C USD thesaurierend	253	2	106,35	285	3	106,92	450	4	126,35
Klasse C USD ausschüttend (S)	801	9	90,99	833	9	93,31	1.099	10	111,77
Klasse E USD thesaurierend	749	9	81,08	666	8	81,55	625	6	96,47
Klasse E EUR thesaurierend (abgesichert) (IH)	476	5	91,40	492	5	92,19	737	6	104,63
Klasse F USD thesaurierend	157	2	87,32	182	2	87,39	1.023	10	102,33
Klasse F USD ausschüttend (S)	77	1	67,44	79	1	69,16	202	2	82,84
Klasse R GBP ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	24	–	77,47	24	–	79,11	38	–	89,48
Klasse X USD thesaurierend	2.541	29	87,68	2.545	29	87,70	3.321	32	102,61
Klasse X USD ausschüttend (S)	35	1	67,76	35	1	69,49	234	3	83,25
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert)	63	1	74,32	97	1	75,27	104	1	90,83
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert) (IH)	312	3	88,49	315	3	88,76	1.203	11	99,63
Klasse X EUR ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	–	–	–	8	–	75,89	528	5	87,56
Klasse X GBP thesaurierend	14.747	110	105,88	17.560	131	111,55	26.213	167	117,12
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	4.427	46	76,43	5.057	55	76,86	18.737	152	91,79
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert) (IH)	154	1	94,44	162	1	94,07	250	2	104,00
Klasse X GBP ausschüttend (S) (abgesichert)	6.267	82	60,35	6.551	88	62,22	11.372	111	76,08
Klasse X GBP ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	4.018	40	79,10	4.031	41	80,78	6.464	53	91,37
Klasse Premier USD thesaurierend	21.505	211	102,08	21.695	213	102,03	26.070	219	119,20
Klasse Premier USD ausschüttend (S)	89	1	69,93	110	2	71,71	922	11	85,89
Klasse Premier EUR thesaurierend	2.503	18	128,89	2.927	21	132,08	4.125	25	145,57
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert)	1.860	24	72,39	1.864	24	73,25	81	1	88,25
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert) (IH)	3.936	33	111,32	4.278	36	111,56	11.130	79	125,02
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	3	–	78,09	3	–	78,48	4	–	93,51
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	87	1	60,16	99	1	62,01	270	3	76,76
Klasse Premier GBP ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	642	6	85,23	672	6	87,04	1.663	13	98,46
Klasse LM USD thesaurierend	3.083	35	87,95	3.149	36	87,64	3.162	31	101,78
Klasse LM USD ausschüttend (abgesichert) (IH)	34.434	313	110,14	35.016	322	108,78	20.395	173	118,09
<b>FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>Δ</sup></b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 710	6	115,31	\$ 847	7	114,61	\$ 938	8	119,84
Klasse A USD ausschüttend (A)	143	2	89,32	142	2	91,28	149	2	96,69
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	188	2	90,22	230	2	90,77	386	4	97,53
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Klasse A SGD thesaurierend	43	60	0,98	1	1	0,97	–	–	–
Klasse C USD thesaurierend	557	6	99,64	69	1	99,28	124	1	104,34
Klasse E USD thesaurierend	–	–	–	71	1	98,39	172	2	103,51
Klasse E USD ausschüttend (A)	22	–	90,65	23	–	92,36	24	–	97,84
Klasse F USD thesaurierend	27	–	106,82	519	5	105,96	807	7	110,36
Klasse X USD thesaurierend	170	2	98,59	168	2	97,77	189	2	101,78
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	2.610	21	99,23	2.468	21	98,87	3.499	25	104,13
Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	86	1	80,55	403	4	82,44	154	1	89,35
Klasse Premier USD thesaurierend	132.800	1.194	111,22	226.102	2.052	110,21	85.918	750	114,56
Klasse Premier USD ausschüttend (A)	–	–	–	160	2	90,05	169	2	95,36
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert)	74.454	663	103,51	103.945	947	103,83	77.402	623	110,83
Klasse Premier EUR ausschüttend (A) (abgesichert)	26.877	348	71,22	26.284	337	73,84	29.738	330	80,37
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert) (IH)	12.142	122	78,26	9.234	96	80,03	11.162	96	86,74
Klasse LM USD thesaurierend	5.181	44	118,70	5.111	44	117,09	5.265	44	120,62
Klasse LM AUD thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	163.494	1.698	143,13	536.622	4.944	149,45
<b>FTGF Brandywine Global High Yield Fund<sup>Δ</sup></b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 557	5	119,94	\$ 260	2	114,70	\$ 207	2	121,94
Klasse A USD ausschüttend (D)	105	1	82,51	91	1	81,94	103	1	92,91
Klasse Premier USD thesaurierend	4.726	32	149,10	1	–	142,10	1	–	150,00
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert) (IH)	74	–	145,97	67	–	140,14	102	1	146,92
Klasse S Euro ausschüttend (A) (abgesichert) (IH)	8.353	73	106,03	–	–	–	–	–	–
Klasse S CAD thesaurierend (abgesichert) (IH)	10.507	100	142,26	9.975	100	136,39	11.177	100	141,96
<b>FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 4.814	46	104,11	\$ 3.169	31	102,90	\$ 3.382	28	122,37
Klasse A USD ausschüttend (M)	575	7	86,77	583	7	87,66	702	7	106,98
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	1	–	73,43	1	–	73,48	1	–	90,11
Klasse A SGD thesaurierend	48	74	0,88	23	36	0,87	51	67	1,04
Klasse C USD thesaurierend	130	1	94,62	129	1	93,75	1.096	10	112,05
Klasse E USD thesaurierend	283	3	92,53	281	3	91,73	347	3	109,74
Klasse F USD thesaurierend	2.155	24	91,35	2.342	26	90,10	3.090	29	106,72
Klasse F USD ausschüttend (M)	221	3	74,39	231	3	75,15	280	3	91,69
Klasse X USD thesaurierend	264	3	95,52	261	3	94,17	308	3	111,42
Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert)	–	–	–	135	2	66,38	382	3	82,76
Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	791	7	87,77	970	9	88,36	1.209	9	101,85
Klasse Premier USD thesaurierend	181.879	1.641	110,82	175.727	1.610	109,17	207.613	1.610	128,99
Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	1.970	19	83,85	1.835	18	84,39	2.282	17	97,27

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



## Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2023			28. Februar 2023			28. Februar 2022		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:
<b>FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund (Fortsetzung)</b>									
Klasse Premier NZD thesaurierend (abgesichert) (IH)	\$ 5.493	62	148,58	\$ 5.577	62	145,48	\$ 6.513	59	161,81
Klasse LM EUR thesaurierend	1.823	16	107,44	3.990	35	108,20	5.010	37	119,82
Klasse LM NZD thesaurierend (abgesichert) (IH)	7.281	70	175,49	9.892	93	171,35	12.130	95	189,36
<b>FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 191.927	1.467	130,83	\$ 184.162	1.434	128,45	\$ 227.926	1.582	144,04
Klasse A USD ausschüttend (A)	1.560	18	84,56	1.913	22	86,14	2.423	24	99,14
Klasse A USD ausschüttend (D)	15.839	191	82,72	15.995	192	83,26	28.700	297	96,74
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	32.340	417	77,58	36.853	469	78,56	67.038	726	92,32
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	91.888	1.131	81,27	103.737	1.260	82,33	163.878	1.695	96,70
Klasse A AUD thesaurierend (abgesichert)	2.665	48	85,02	2.736	48	84,05	3.500	50	95,72
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2.928	59	76,66	2.007	38	78,18	4.268	63	93,28
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.384	134	75,08	871	78	77,28	1.169	80	92,59
Klasse A EUR thesaurierend	2	–	98,50	2	–	99,13	1	–	104,69
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	43.584	414	97,00	32.034	315	96,30	49.951	401	111,20
Klasse A EUR ausschüttend (A) (abgesichert)	27.207	313	80,26	27.469	314	82,68	33.645	306	98,11
Klasse A EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2.307	28	75,07	2.230	27	76,87	3.108	30	93,01
Klasse A EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	31.505	422	68,79	33.044	443	70,47	38.905	407	85,23
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2.291	24	76,93	2.189	23	78,20	3.289	26	93,28
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	6.233	66	74,72	6.204	68	75,97	8.329	69	90,60
Klasse A HKD thesaurierend	627	56	87,20	577	53	85,70	766	63	95,68
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	9.822	982	78,46	9.913	978	79,53	17.554	1.474	93,06
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	36.156	58.508	0,84	37.208	58.904	0,85	49.398	66.538	1,01
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	23.544	41.366	0,77	24.225	41.619	0,78	3.914	5.723	0,93
Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	4.196	7.178	0,79	5.130	8.666	0,80	8.763	12.594	0,94
Klasse C USD thesaurierend	22.751	251	90,77	22.302	250	89,35	39.688	394	100,69
Klasse C USD ausschüttend (D)	9.641	119	81,24	9.667	118	81,77	1.454	15	95,00
Klasse C CZK thesaurierend (abgesichert)	32	1	1.004,96	28	1	979,39	–	–	–
Klasse E USD thesaurierend	34.706	353	98,25	30.426	314	96,75	35.222	323	109,15
Klasse E USD ausschüttend (D)	651	8	81,02	611	7	81,55	567	6	94,73
Klasse E EUR thesaurierend (abgesichert)	5.097	50	93,41	4.425	45	93,02	4.373	44	108,08
Klasse F USD thesaurierend	25.305	272	92,88	25.037	275	90,98	40.863	402	101,56
Klasse F USD ausschüttend (D)	4.925	55	90,33	5.074	56	90,91	6.875	65	105,62
Klasse X USD thesaurierend	5.465	58	94,13	9.584	104	92,12	14.895	145	102,71
Klasse X USD ausschüttend (D)	158	2	90,32	387	4	90,97	147	1	106,01
Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	16.086	188	85,44	17.624	204	86,27	25.931	257	100,74
Klasse X CHF thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	88	1	82,57	1.173	11	95,30
Klasse X CHF ausschüttend (A) (abgesichert)	–	–	–	396	5	80,59	3.019	29	95,94
Klasse X EUR thesaurierend	1.045	10	99,04	972	9	99,36	1.281	11	104,50
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert)	9.257	101	84,61	15.314	173	83,73	36.681	340	96,16
Klasse X EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	12.777	162	72,63	16.053	205	74,16	22.675	227	89,18
Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	4.270	43	79,03	5.206	54	80,09	9.746	76	94,97
Klasse Premier USD thesaurierend	70.538	754	93,28	51.346	563	91,22	82.954	817	101,55
Klasse Premier USD ausschüttend (M) Plus (e)	19.539	223	87,52	19.197	217	88,30	21.157	205	102,96
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	2.379	116	101,15	2.211	121	96,03	2.265	118	98,52
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert)	90.517	766	108,93	91.195	801	107,70	141.515	1.022	123,47
Klasse Premier EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	36.021	450	73,83	41.888	526	75,35	42.876	423	90,45
Premier Class GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	1.742	17	79,79	6.824	70	80,81	2.311	18	95,62
Klasse Premier SEK thesaurierend (abgesichert)	2.334	234	109,26	2.027	196	107,98	3.339	256	123,61
Klasse S USD thesaurierend	82.078	848	96,74	90.056	952	94,56	188.113	1.790	105,08
Klasse S USD ausschüttend (Q) Plus (e)	194	2	80,93	208	3	81,54	262	3	94,61
Klasse S EUR thesaurierend (abgesichert)	47.513	435	100,81	49.405	469	99,63	70.922	555	114,04
Klasse S EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	4.468	49	83,45	5.144	57	85,09	6.325	55	101,98
Klasse S GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	194	2	82,61	284	3	83,61	1.909	14	98,90
Klasse LM USD thesaurierend	15.213	149	101,81	11.406	115	99,33	–	–	–
Klasse LM USD ausschüttend (M)	5.283	65	81,73	6.126	75	82,22	7.573	79	95,27
Klasse LM EUR ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	101.200	1.195	78,13	115.356	1.372	79,49	44.361	418	94,65
Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)	25.749	219	92,60	25.939	238	90,69	30.076	220	101,96
<b>FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^A</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 440	4	107,91	\$ 12.219	109	111,73	\$ 12.217	108	113,34
Klasse X USD ausschüttend (M)	1	–	89,02	1	–	94,36	1	–	98,28
Klasse Premier USD thesaurierend	29.038	254	114,54	30.650	259	118,21	36.297	305	119,13
Klasse LM USD thesaurierend	3.787	30	127,00	3.886	30	130,32	3.871	30	129,83
<b>FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^A</b>									
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	\$ –	–	–	\$ 75	1	75,72	\$ 86	1	87,94
Klasse S Euro ausschüttend (A) (abgesichert) (IH)	–	–	–	8.314	100	78,60	10.077	100	89,87
<b>FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^A</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 28	–	85,04	\$ 27	–	82,04	\$ 10	–	92,02
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	74	120	0,83	72	120	0,81	3.880	5.726	0,92
Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	4	–	61,36	4	–	61,32	6	–	73,57
Klasse LM AUD thesaurierend (abgesichert)	69.181	1.223	87,31	69.307	1.223	84,23	100.335	1.460	94,63
<b>FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^A</b>									
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	\$ 101	1	96,80	\$ 98	1	97,52	\$ –	–	–
Klasse S USD thesaurierend	15.083	148	102,08	14.581	148	98,69	–	–	–
Klasse S EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	106	1	95,69	101	1	96,98	–	–	–
Klasse S GBP thesaurierend (abgesichert)	26	–	99,94	24	–	97,01	–	–	–
<b>FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^A</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ –	–	–	\$ 650	3	191,94	\$ 141	1	196,64
Klasse Premier USD thesaurierend	–	–	–	581	3	205,43	589	3	208,48
Klasse Premier GBP thesaurierend	–	–	–	3	–	108,28	3	–	98,53
Klasse S EUR thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	1.300	7	180,30	1.444	7	188,84
<b>FTGF ClearBridge Value Fund</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 116.841	688	169,75	\$ 123.192	764	161,25	\$ 121.303	732	165,63
Klasse A USD ausschüttend (A)	31.565	98	322,50	32.769	107	306,36	34.995	111	314,69
Klasse A EUR thesaurierend	13.575	63	198,03	10.721	53	192,77	8.899	43	186,70
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	546	5	109,57	2.900	26	105,31	–	–	–
Klasse A EUR ausschüttend (A) (abgesichert)	44	–	154,22	163	1	148,17	82	–	158,13
Klasse A GBP ausschüttend (A)	23	–	239,70	22	–	239,81	23	–	220,87
Klasse A SGD thesaurierend	5.314	5.047	1,42	4.485	4.483	1,35	4.372	4.254	1,39
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	1.436	728	2,67	1.709	903	2,55	2.375	1.214	2,65
Klasse C USD thesaurierend	9.606	56	170,58	11.911	73	162,44	9.512	57	167,70
Klasse C USD ausschüttend (A)	2.778	10	290,33	2.870	10	276,49	2.695	9	285,43
Klasse E USD thesaurierend	3.286	31	107,58	4.195	41	102,58	2.907	27	106,16
Klasse F USD thesaurierend	21.389	63	339,60	25.113	78	321,62	24.053	73	328,39
Klasse F USD ausschüttend (A)	347	2	187,10	385	2	177,83	2.818	16	181,76
Klasse X USD thesaurierend	143	1	110,61	110	1	110,72	–	–	–
Klasse X USD ausschüttend (A)	6.313	27	234,05	1.839	8	222,54	15.344	67	227,42
Klasse X EUR thesaurierend	1.891	13	130,23	4.337	32	126,47	5.094	37	121,64
Klasse Premier USD thesaurierend	580.623	1.878	309,18	546.618	1.871	292,19	506.317	1.704	297,07
Klasse Premier USD ausschüttend (A)	462	2	208,91	2.347	12	198,95	482	2	203,29
Klasse Premier EUR thesaurierend	48.152	170	261,89	87.612	327	253,64	105.810	388	243,25
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert)	106.655	948	103,70	57.089	544	99,13	31.343	267	104,79
Klasse LM USD ausschüttend (A)	8.084	75	107,96	9.339	91	103,12	13.814	132	104,99

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



## Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2023			28. Februar 2023			28. Februar 2022		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:
<b>FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund (Fortsetzung)</b>									
Klasse A USD ausschüttend (Q)	\$ 1.158	10	112,77	\$ 1.092	10	106,31	\$ 1.216	10	118,47
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	714	15	75,19	859	18	72,55	1.166	19	85,71
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	47	4	81,73	60	5	79,42	124	8	93,35
Klasse A EUR thesaurierend	148	1	134,77	141	1	129,46	150	1	134,68
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	461	4	110,15	502	5	104,45	1.262	9	119,24
Klasse A EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	17	–	79,96	294	4	76,94	366	4	90,31
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	125	12	84,59	151	15	80,92	790	67	92,60
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	238	403	0,80	599	1.052	0,77	483	735	0,89
Klasse C USD thesaurierend	771	6	139,78	896	7	131,30	972	7	145,53
Klasse C USD ausschüttend (A)	112	1	113,21	106	1	107,11	246	2	119,46
Klasse C USD ausschüttend (Q)	78	1	104,62	73	1	98,62	81	1	109,98
Klasse F USD thesaurierend	17.194	122	141,18	17.713	134	131,88	20.648	143	144,58
Klasse F EUR thesaurierend	59	–	142,04	55	–	136,03	61	–	140,68
Klasse F EUR ausschüttend (A)	83	1	114,03	79	1	111,26	88	1	116,98
Klasse X EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	54	1	97,54	50	1	93,55	62	1	109,21
<b>FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 49.497	327	151,51	\$ 47.722	328	145,55	\$ 48.817	304	160,43
Klasse A USD ausschüttend (A)	11.631	49	237,53	10.477	46	228,19	10.463	42	251,52
Klasse A EUR thesaurierend	5.422	51	97,74	4.993	49	96,27	–	–	–
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	19.896	92	200,52	21.414	104	194,79	49.413	198	223,06
Klasse A SEK thesaurierend	56.684	4.179	148,50	56.766	4.360	136,29	66.724	4.656	135,75
Klasse F USD thesaurierend	6.101	39	154,55	5.947	40	148,03	6.403	39	162,19
Klasse X USD thesaurierend	12.873	100	129,28	12.869	104	123,82	20.266	149	135,66
Klasse X USD ausschüttend (A)	795	3	248,86	857	4	238,35	1.622	6	261,15
Klasse X EUR thesaurierend	6.727	55	112,46	708	6	110,40	927	7	114,04
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert)	5.792	25	210,51	2.811	13	203,85	1.823	7	231,69
Klasse X GBP thesaurierend	419.260	1.179	280,80	478.725	1.405	283,28	237.295	635	278,51
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1.052	6	131,21	2.318	15	126,11	2.436	13	141,45
Klasse Premier USD thesaurierend	95.629	683	139,95	94.620	707	133,80	167.377	1.146	146,09
Klasse Premier USD ausschüttend (A)	33.952	135	250,98	33.164	138	240,49	35.826	136	262,86
Klasse Premier EUR thesaurierend	–	1	103,17	–	1	101,11	–	–	–
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert)	4.728	20	216,61	5.531	25	209,43	2.203	8	237,15
Klasse Premier GBP thesaurierend	26.175	68	304,79	11.173	30	306,82	4.987	12	300,59
Klasse S USD thesaurierend	548.776	3.043	180,34	532.065	3.089	172,25	601.256	3.203	187,69
Klasse S EUR thesaurierend	67.520	437	142,38	52.170	354	139,45	56.873	354	143,34
Klasse S EUR thesaurierend (abgesichert)	1.906	14	128,01	1.699	13	123,63	7.774	50	139,69
Klasse S GBP thesaurierend	97.500	517	148,97	145.409	807	149,85	161.607	823	146,43
Klasse S GBP thesaurierend (abgesichert)	72.604	416	137,67	72.678	458	132,01	78.117	395	147,25
Klasse S GBP ausschüttend (Q)	11.797	64	146,07	10.539	59	147,32	15.238	79	144,37
Klasse LM EUR thesaurierend	38.233	313	112,53	35.323	304	109,96	21.868	173	112,61
<b>FTGF ClearBridge Global Growth Fund^</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 757	5	151,35	\$ 686	5	137,15	\$ 754	5	150,84
Klasse Premier USD thesaurierend	14.120	89	159,38	12.493	87	143,70	15.264	98	156,48
<b>FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^</b>									
Klasse A USD thesaurierend	€ 11.191	997	12,18	€ 22.713	1.980	12,13	€ 30.452	2.723	12,54
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)	42.544	3.096	14,90	54.425	3.812	15,10	49.791	3.885	14,37
Klasse A USD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	39.436	4.156	10,29	44.093	4.340	10,75	47.028	4.911	10,74
Klasse A USD ausschüttend (Q)	2.826	225	13,63	2.915	226	13,62	3.039	242	14,09
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2.561	439	9,76	2.473	382	10,18	5.707	853	10,33
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	30.223	23.828	10,01	23.313	16.311	10,51	7.660	5.083	10,67
Klasse A EUR thesaurierend	129.526	9.261	13,99	145.537	10.186	14,29	73.628	5.290	13,92
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert) (PH)	4.482	396	11,31	6.339	554	11,43	5.029	436	11,54
Klasse A EUR ausschüttend (A)	451	49	9,16	418	45	9,36	–	–	–
Klasse A EUR ausschüttend (M) Plus	4.000	337	11,86	3.899	315	12,36	2.624	210	12,47
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	4.359	6.394	1,00	4.235	5.789	1,04	4.158	6.018	1,05
Klasse C USD thesaurierend	2.811	262	11,65	3.347	304	11,64	3.683	342	12,08
Klasse C USD thesaurierend (abgesichert)	1.304	101	14,04	1.366	101	14,27	646	53	13,66
Klasse E USD thesaurierend	5.027	402	13,55	6.399	499	13,56	8.126	646	14,10
Klasse E USD thesaurierend (abgesichert)	1.279	120	11,54	2.326	210	11,74	904	90	11,26
Klasse E EUR thesaurierend	1	–	9,56	–	–	–	–	–	–
Klasse E EUR ausschüttend (A)	1	–	9,56	–	–	–	–	–	–
Klasse F USD thesaurierend	4.899	425	12,51	4.659	397	12,43	1.537	135	12,77
Klasse F USD thesaurierend (abgesichert)	6.202	449	14,99	9.258	646	15,15	1.840	144	14,34
Klasse U EUR thesaurierend	38.218	3.951	9,67	–	–	–	–	–	–
Klasse X USD thesaurierend	1.150	102	12,27	1.495	130	12,17	67	6	12,46
Klasse X USD ausschüttend (A)	–	488	12,19	–	501	12,22	–	447	40
Klasse X EUR thesaurierend	40.052	2.789	14,36	57.566	3.942	14,60	26.937	1.910	14,10
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert) (PH)	5.652	489	11,57	10.121	869	11,65	2.536	218	11,65
Klasse X GBP ausschüttend (Q)	2.023	146	11,83	2.493	176	12,45	1.489	108	11,53
Klasse X GBP ausschüttend (Q) (abgesichert)	–	–	–	410	34	10,52	810	67	10,15
Klasse Premier USD thesaurierend	55.978	3.787	16,03	74.451	4.958	15,88	11.876	820	16,23
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	1.651	434	20,43	2.798	775	20,00	5.511	1.828	17,42
Klasse Premier CAD ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	46.138	5.941	11,38	46.777	5.861	11,52	51.721	6.384	11,51
Klasse Premier CAD ausschüttend (Q) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	6.322	811	11,08
Klasse Premier EUR thesaurierend	301.473	12.986	23,21	432.296	18.330	23,58	207.952	9.151	22,73
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert) (PH)	11.730	952	12,32	4.026	325	12,40	7.393	596	12,40
Klasse Premier GBP thesaurierend	353	19	15,95	405	21	16,65	6.622	363	15,25
Klasse Premier GBP ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	4.753	196	20,76	14.897	618	21,18	21.555	844	21,34
Klasse Premier GBP ausschüttend (Q)	71.428	4.518	13,53	76.882	4.746	14,25	74.334	4.710	13,19
<b>Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ –	–	–	\$ –	–	–	\$ 224	3	87,06
Klasse A USD ausschüttend (Q)	–	–	–	–	–	–	174	2	83,85
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	679	7	81,36
Klasse X GBP ausschüttend (Q)	–	–	–	–	–	–	730	7	79,04
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	858	9	82,16
<b>FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 21.947	231	95,21	\$ 27.166	280	96,98	\$ 17.858	169	105,90
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	54.222	621	87,31	61.518	674	91,28	28.785	274	104,96
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	53.530	609	87,90	61.812	670	92,22	74.314	707	105,12
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	6.862	129	82,12	8.133	139	86,78	5.538	75	102,34
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.559	137	82,95	1.325	104	88,26	315	19	103,79
Klasse A EUR ausschüttend (A) Plus (e)	90	1	79,87	67	1	85,09	–	–	–
Klasse A EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	6.973	80	80,86	8.022	89	85,54	3.929	34	101,92
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	5.030	48	81,99	5.016	48	86,10	136	1	101,30
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	1.325	117	88,68	1.385	117	92,80	1.827	135	106,10
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	56.598	91.187	0,84	63.459	96.802	0,88	27.834	36.826	1,02
Klasse U USD thesaurierend	11.194	120	93,11	4.556	48	94,25	–	–	–
Klasse U EUR thesaurierend	2.677	26	93,25	8.777	86	96,85	–	–	–
Klasse U EUR ausschüttend (Q) Plus (e)	65	1	92,54	67	1	97,29	–	–	–
Klasse U GBP thesaurierend	3.258	28	90,45	3.127	27	96,41	–	–	–
Klasse U GBP thesaurierend (abgesichert)	29	–	98,63	–	–	–	–	–	–
Klasse U GBP ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	219	2	100,37	–	–	–	–	–	–
Klasse U GBP ausschüttend (Q) Plus (e)	586	5	91,95	–	–	–	–	–	–
Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	6.436	72	89,44	17.277	185	93,47	322	3	105,76

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2023			28. Februar 2023			28. Februar 2022		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:
<b>FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund (Fortsetzung)</b>									
Klasse X EUR ausschüttend (M) (abgesichert)	\$ 373	4	79,99	\$ 376	4	84,08	\$ –	–	–
Klasse X EUR ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	1.270	14	85,72	2.323	24	90,22	645	5	105,94
Klasse X GBP ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	120	1	83,56	651	6	87,29	160	1	100,27
Klasse Premier USD thesaurierend	2.334	27	84,93	2.352	27	86,03	4.720	46	102,52
Klasse Premier USD ausschüttend (M) Plus	58.473	669	87,46	59.725	657	90,93	4.994	48	103,28
Klasse Premier EUR ausschüttend (M) (abgesichert)	33.585	358	86,44	32.976	343	90,86	155	1	105,08
Klasse S USD thesaurierend	29.676	301	98,72	28.020	281	99,82	263	2	107,42
Klasse S USD ausschüttend (M) Plus	6.794	76	88,94	7.918	86	92,31	1.599	15	104,48
<b>FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 132.626	464	285,90	\$ 136.340	481	283,21	\$ 179.306	607	295,45
Klasse A USD ausschüttend (A)	28.058	32	868,27	30.404	35	860,08	35.534	40	897,28
Klasse A AUD thesaurierend (abgesichert)	5.013	36	213,69	5.856	41	213,77	7.110	43	230,14
Klasse A CNH thesaurierend (abgesichert)	2.929	112	189,70	2.411	88	190,89	2.416	76	201,78
Klasse A EUR thesaurierend	31.266	84	344,81	32.297	87	350,21	46.391	120	344,60
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	8.133	36	208,07	14.136	64	208,42	14.213	56	225,70
Klasse A EUR ausschüttend (A) (abgesichert)	216	1	158,23	172	1	158,47	385	2	171,75
Klasse A GBP thesaurierend (abgesichert)	114	1	173,52	460	2	172,42	1.070	4	184,68
Klasse A GBP ausschüttend (A)	678	2	356,38	727	2	371,81	778	2	347,78
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	71	4	204,00	80	4	204,46	88	4	222,22
Klasse A SGD thesaurierend	3.941	1.890	2,82	10.567	5.109	2,79	11.147	5.166	2,93
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	28.349	14.270	2,68	26.220	13.193	2,68	26.201	12.563	2,83
Klasse B USD thesaurierend	16	–	294,55	119	–	292,49	127	–	306,67
Klasse B USD ausschüttend (A)	21	–	787,73	21	–	782,27	22	–	820,22
Klasse C USD thesaurierend	9.753	33	295,05	11.432	39	293,00	13.207	43	307,21
Klasse C USD ausschüttend (A)	5.205	7	782,60	5.195	7	777,17	5.656	7	814,85
Klasse E USD thesaurierend	8.155	31	263,27	9.939	38	261,78	11.386	41	275,16
Klasse E USD ausschüttend (A)	505	2	263,23	502	2	261,74	528	2	275,11
Klasse E EUR thesaurierend	2.507	7	348,28	1.582	4	355,11	1.274	3	351,98
Klasse E EUR thesaurierend (abgesichert)	2.169	12	165,57	1.111	6	166,43	1.109	5	181,52
Klasse F USD thesaurierend	12.593	40	311,86	15.873	52	307,98	26.949	84	319,38
Klasse F USD ausschüttend (A)	272	1	312,19	267	1	308,31	244	1	319,72
Klasse R USD thesaurierend	–	–	111,83	–	–	110,12	–	–	113,60
Klasse R EUR thesaurierend	309	1	271,14	302	1	274,66	307	1	268,95
Klasse X USD thesaurierend	40.094	145	276,75	47.508	174	273,10	33.276	118	282,78
Klasse X USD ausschüttend (A)	1.162	6	191,88	1.177	6	189,35	1.492	8	196,06
Klasse X EUR thesaurierend	5.542	29	174,23	5.887	32	176,23	13.906	72	172,19
Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert)	8.287	41	185,85	11.488	59	185,38	22.708	102	199,32
Klasse X GBP thesaurierend	38.332	85	354,69	39.715	90	368,64	42.807	93	342,20
Klasse X GBP ausschüttend (A)	2.744	7	324,69	3.082	8	337,47	4.309	10	313,21
Klasse Premier USD thesaurierend	205.641	562	365,64	220.211	611	360,19	257.900	692	371,66
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	5.577	152	178,16	6.630	203	170,82	17.351	541	165,25
Klasse Premier EUR thesaurierend	44.552	84	487,57	46.669	90	492,39	63.706	119	479,41
Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert)	3.097	14	201,81	5.193	24	200,98	960	4	215,21
Klasse Premier GBP thesaurierend	32.194	75	337,99	44.274	105	350,66	67.856	156	324,40
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)	5.418	152	147,50	3.681	114	144,10	5.300	152	146,12
<b>FTGF Royce US Smaller Companies Fund</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 34.969	145	241,87	\$ 31.063	134	231,96	\$ 35.531	154	231,37
Klasse A USD ausschüttend (A)	9.078	22	409,45	9.540	24	392,74	11.155	28	391,87
Klasse A EUR thesaurierend	1.447	3	389,12	2.035	5	382,78	1.975	5	360,17
Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert)	94	1	164,80	98	1	159,80	174	1	165,50
Klasse A EUR ausschüttend (A)	118	–	275,78	124	–	271,21	111	–	255,46
Klasse A GBP ausschüttend (A)	56	–	381,80	54	–	385,69	123	–	345,13
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	2	–	166,15	2	–	161,28	1	–	167,25
Klasse C USD thesaurierend	3.053	13	234,06	2.964	13	225,03	3.094	14	225,58
Klasse C USD ausschüttend (A)	2.714	7	369,82	2.765	8	355,62	2.999	8	356,61
Klasse E USD thesaurierend	749	3	250,38	721	3	241,07	750	3	242,35
Klasse E USD ausschüttend (A)	7	–	147,32	7	–	141,84	8	–	142,67
Klasse E EUR thesaurierend	9	–	161,02	9	–	158,95	8	–	150,73
Klasse F USD thesaurierend	13.614	45	300,70	11.194	39	287,56	10.813	38	285,20
Klasse F USD ausschüttend (A)	669	2	321,67	532	2	307,61	543	2	305,10
Klasse R USD thesaurierend	86	–	176,29	109	1	168,67	212	1	167,46
Klasse X USD thesaurierend	18	–	217,76	53	–	208,08	333	2	206,08
Klasse X USD ausschüttend (A)	1	–	99,92	–	–	95,46	–	–	94,37
Klasse Premier USD thesaurierend	9.818	30	330,91	600	2	315,65	966	3	311,50
Klasse Premier USD ausschüttend (A)	12.473	54	230,17	12.361	56	219,68	14.320	66	216,79
Klasse Premier GBP ausschüttend (A)	1.472	4	291,45	1.473	4	292,99	1.769	5	259,24
Klasse LM EUR thesaurierend	320	1	231,20	702	3	225,37	854	4	208,25
Klasse A (G) USD thesaurierend	886	3	272,14	941	4	260,24	1.022	4	258,11
Klasse L (G) USD thesaurierend	782	3	250,62	750	3	240,27	1.174	5	239,50
<b>FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^</b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 8	–	82,86	\$ 8	–	83,66	\$ 9	–	90,44
Klasse X USD thesaurierend	8	–	83,95	9	–	84,44	9	–	90,61
Klasse X GBP thesaurierend	6	–	92,94	14	–	98,60	–	–	–
Klasse Premier USD thesaurierend	4.207	50	84,47	4.223	50	84,81	4.516	50	90,69
<b>Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^</b>									
Klasse A USD thesaurierend	€ –	–	–	€ –	–	–	€ 608	7	100,59
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	1.157	9	144,30
Klasse A USD ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	762	5	183,06
Klasse A USD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–	–	–	–	–	–	4.140	48	97,65
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–	–	–	–	–	–	1.402	23	92,61
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–	–	–	–	–	–	158	11	102,33
Klasse A EUR thesaurierend	–	–	–	–	–	–	333	2	195,74
Klasse A EUR ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	84	1	166,20
Klasse A EUR ausschüttend (M) Plus	–	–	–	–	–	–	430	4	97,95
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–	–	–	–	–	–	224	390	0,87
Klasse B USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	14	–	93,06
Klasse B USD ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	56	–	180,51
Klasse C USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	144	2	94,91
Klasse C USD ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	1.236	8	180,39
Klasse E USD thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	123	1	102,25
Klasse F USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	290	3	124,53
Klasse X EUR thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1	–	104,43
Klasse Premier EUR thesaurierend	–	–	–	–	–	–	53	–	144,35
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	–	–	–	480	18	127,46
Klasse LM EUR thesaurierend	–	–	–	–	–	–	2.034	15	137,11
Klasse A (G) USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	958	10	104,34
Klasse B (G) USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1	–	96,33
Klasse L (G) USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	95	1	96,85
Klasse GA USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	870	5	178,58
Klasse GA EUR thesaurierend	–	–	–	–	–	–	12.539	62	201,63
Klasse GA EUR ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	101	1	158,26
Klasse GE USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	44	–	163,28

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



## Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2023			28. Februar 2023			28. Februar 2022		
	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:
<b>FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund<sup>δ</sup></b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ –	–	–	\$ 1.708	12	143,40	\$ 2.058	13	156,45
Klasse A USD ausschüttend (A)	–	–	–	2.930	13	229,91	3.344	13	258,01
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	–	–	–	3.235	38	84,93	3.851	40	97,45
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–	–	–	2.539	45	83,03	2.093	30	97,46
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–	–	–	173	16	74,97	223	16	87,97
Klasse A EUR thesaurierend	–	–	–	134	1	137,11	249	2	141,19
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	–	–	–	1.518	139	85,63	2.075	166	97,83
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–	–	–	32	48	0,91	33	42	1,05
Klasse B USD ausschüttend (A)	–	–	–	13	–	223,94	43	–	251,36
Klasse C USD thesaurierend	–	–	–	100	1	98,15	109	1	107,62
Klasse C USD ausschüttend (A)	–	–	–	1.236	6	222,72	1.632	7	250,00
Klasse E USD thesaurierend	–	–	–	14	–	133,58	16	–	147,17
Klasse E USD ausschüttend (A)	–	–	–	10	–	94,16	11	–	105,87
Klasse F USD thesaurierend	–	–	–	298	2	128,31	29	–	139,46
Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)	–	–	–	35	1	138,86	2.281	66	145,76
Klasse GA USD thesaurierend	–	–	–	6.520	45	143,98	7.183	46	157,32
Klasse GA EUR thesaurierend	–	–	–	124	1	173,18	135	1	178,49
Klasse GA EUR ausschüttend (A)	–	–	–	2	–	143,83	2	–	152,37
Klasse GE USD thesaurierend	–	–	–	469	4	131,10	516	4	144,31
<b>Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund<sup>α</sup></b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ –	–	–	\$ –	–	–	\$ 2.462	12	198,91
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	–	–	–	–	–	–	352	3	104,25
Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–	–	–	–	–	–	457	6	98,09
Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	–	–	–	–	–	–	173	13	104,77
Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–	–	–	–	–	–	53	68	1,06
Klasse X USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1	–	104,34
Klasse Premier USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	2.811	25	110,91
Klasse GA USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	3.958	20	202,76
Klasse GA EUR thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1.589	5	259,07
Klasse GA EUR ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	342	1	220,29
Klasse GE USD thesaurierend	–	–	–	–	–	–	49	–	187,12
Klasse GE EUR thesaurierend	–	–	–	–	–	–	296	1	238,91
<b>FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>αβ</sup></b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ –	–	–	\$ 88	1	115,41	\$ 22	–	133,46
Klasse M GBP ausschüttend (A)	–	–	–	1.692	85	16,64	2.262	98	17,20
Klasse F USD thesaurierend	–	–	–	1	–	120,20	1	–	138,19
Klasse M USD ausschüttend (A)	–	–	–	320	26	12,52	367	25	14,43
Klasse M EUR ausschüttend (A)	–	–	–	62	4	15,35	72	4	16,69
Klasse Premier USD thesaurierend	–	–	–	1.362	15	89,46	13.357	131	102,18
Klasse Premier GBP thesaurierend	–	–	–	13	–	102,96	37	–	105,44
<b>FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund<sup>α</sup></b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 5.054	29	175,72	\$ 4.707	29	163,21	\$ 6.471	34	190,12
Klasse A EUR thesaurierend	4.902	25	179,26	6.205	34	170,77	3.973	19	187,53
Klasse A EUR ausschüttend (abgesichert)	14.787	166	82,30	13.539	165	77,46	22.933	217	94,30
Klasse C USD thesaurierend	167	2	74,63	181	3	69,49	212	3	81,36
Klasse E USD thesaurierend	2.341	20	115,52	2.560	24	107,70	4.240	34	126,41
Klasse F USD thesaurierend	199	3	75,90	215	3	70,28	249	3	81,38
Klasse X USD thesaurierend	98	1	86,27	91	1	79,83	105	1	92,29
Klasse X EUR thesaurierend	195	1	189,04	192	1	179,33	104	–	195,54
Klasse X GBP thesaurierend	1.398	6	192,57	1.283	6	187,66	1.631	6	194,52
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	2.121	10	163,72	2.167	12	152,41	1.876	8	181,95
Klasse Premier USD thesaurierend	13.387	71	189,85	14.049	80	175,37	37.745	187	202,05
Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)	83	1	114,08	433	3	106,02	568	3	126,13
Klasse S USD thesaurierend	–	–	–	5.827	63	92,64	7.523	71	106,36
Klasse S EUR thesaurierend (abgesichert)	87.916	947	85,60	73.491	869	79,99	58.847	547	95,95
Klasse S GBP thesaurierend	17.925	69	204,74	16.109	67	198,75	22.904	83	204,70
<b>FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund</b>									
Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	\$ 4.333	53	81,66	\$ 5.748	66	87,21	\$ 6.166	63	98,23
Klasse A AUD ausschüttend (M) Plus	437	7	94,50	454	7	97,11	487	7	101,33
Klasse A EUR ausschüttend (M) Plus (e)	440	5	83,21	457	5	91,10	490	5	96,80
Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	46	77	0,81	45	70	0,86	54	75	0,98
Klasse D AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	21	–	89,92	375	6	96,94	684	8	111,38
Klasse D CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1	–	91,17	1	–	98,76	1	–	113,18
Klasse D HKD ausschüttend (M) Plus	1	–	96,23	1	–	102,55	1	–	114,51
Klasse D SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	224	325	0,93	307	414	1,00	1.016	1.221	1,13
Klasse D USD ausschüttend (M) Plus	124	1	95,04	1.014	10	101,21	856	8	113,52
Klasse D USD thesaurierend	4.114	37	111,15	5.511	48	115,20	5.888	48	123,07
Klasse X AUD thesaurierend	223	3	128,91	312	4	128,43	350	4	126,73
Klasse X USD thesaurierend	5.584	46	122,13	5.801	46	126,36	6.077	45	134,52
Klasse S GBP thesaurierend	472	3	134,87	487	3	146,47	515	3	138,89
Klasse S GBP ausschüttend (M) Plus (e)	472	4	95,12	487	4	106,24	515	4	105,80
Klasse LM AUD thesaurierend	4.005	47	131,93	4.121	47	130,72	4.834	52	127,51
<b>FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund<sup>α</sup></b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 4.122	46	89,90	\$ 4.789	54	88,85	\$ 7.343	68	108,56
Klasse E USD thesaurierend	354	4	99,62	352	4	98,83	402	3	121,66
Klasse F USD thesaurierend	13.817	121	114,23	14.837	132	112,56	11.843	87	136,70
Klasse X USD thesaurierend	2	–	97,86	2	–	96,38	656	6	116,89
Klasse Premier USD thesaurierend	3.587	36	99,88	3.812	39	98,17	6.709	57	118,63
Klasse S USD thesaurierend	325	3	121,52	347	3	119,33	2.252	16	143,91
Klasse S EUR thesaurierend	10.758	94	105,07	10.563	94	105,77	18.633	138	120,24
<b>FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>α</sup></b>									
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)	€ 26	–	81,44	€ 26	–	80,63	€ 39	1	86,53
Klasse A EUR thesaurierend	1.691	12	136,34	1.770	13	136,40	7.094	47	151,56
Klasse E USD thesaurierend (abgesichert)	26	–	80,30	26	–	79,81	38	1	86,29
Klasse X EUR thesaurierend	454	3	141,33	528	4	140,86	1.877	12	155,36
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	667	35	101,85	1.342	76	97,67	3.184	191	96,48
Klasse Premier EUR thesaurierend	838	6	143,73	850	6	143,00	26.577	169	157,16
Klasse S USD thesaurierend	1	–	111,92	1	–	108,31	–	–	–
Klasse S EUR thesaurierend	75.665	600	126,01	76.234	609	125,11	145.601	1.063	136,96
Klasse S GBP thesaurierend	108.951	1.265	73,70	108.320	1.267	75,17	119.180	1.273	78,23
<b>FTGF Martin Currie Improving Society Fund<sup>αγ</sup></b>									
Klasse A USD thesaurierend	\$ 94	1	95,03	\$ –	–	–	\$ –	–	–
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1	–	96,65	–	–	–	–	–	–
Klasse S USD thesaurierend	4.483	47	95,38	–	–	–	–	–	–
Klasse S EUR thesaurierend (abgesichert)	94	1	94,96	–	–	–	–	–	–
Klasse S GBP thesaurierend (abgesichert)	94	1	95,25	–	–	–	–	–	–
<b>Franklin Responsible Income 2028 Fund<sup>α</sup></b>									
Klasse A EUR thesaurierend	€ 11.160	111	100,09	€ 98	1	98,13	€ –	–	–
Klasse A EUR ausschüttend (A)	44.624	446	100,15	5.022	51	98,18	–	–	–
Klasse A EUR ausschüttend (A) Plus	–	–	–	98	1	98,13	–	–	–
Klasse D EUR thesaurierend	1.330	13	99,76	98	1	98,08	–	–	–
Klasse D EUR ausschüttend (A)	203	2	99,76	98	1	98,08	–	–	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Bilanz – (Fortsetzung)

	31. August 2023			28. Februar 2023			28. Februar 2022		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:
<b>Franklin Responsible Income 2028 Fund<sup>^</sup> (Fortsetzung)</b>									
Klasse K EUR thesaurierend	€ –	–	–	€ 98	1	98,11	€ –	–	–
Klasse K EUR ausschüttend (A)	–	–	–	98	1	98,11	–	–	–
Klasse X EUR thesaurierend	474	5	100,31	9.474	97	98,17	–	–	–
Klasse X EUR ausschüttend (A)	30.001	299	100,39	21.739	221	98,22	–	–	–

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

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

<sup>α</sup> Mit Wirkung vom 24. März 2023 stellten der FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>^</sup> und der FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

<sup>β</sup> Mit Wirkung vom 20. April 2023 stellte der FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

<sup>γ</sup> Mit Wirkung vom 20. Juni 2023 wurde der FTGF Martin Currie Improving Society Fund<sup>^</sup> aufgelegt.

<sup>δ</sup> Mit Wirkung vom 17. Juli 2023 stellte der FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.





Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund <sup>^</sup>		FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		FTGF Western Asset US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	
für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022
\$ 18	\$ 1.263	\$ 6.617	\$ 6.438	\$ 4.660	\$ 7.237	\$ -	\$ 935	\$ -	\$ 357
-	-	5	-	-	-	-	-	-	-
-	-	3	2	-1	-	-	1	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-1.074	-10.176	-4.430	-6.518	-10.347	-	-1.747	-	-5.080
-	-3.503	9.141	-34.486	5.514	-19.738	-	-1.113	-	2.932
18	-3.314	5.590	-32.476	3.655	-22.848	-	-1.924	-	-1.791
-	243	576	634	400	604	-	103	-	2
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	19	87	95	46	78	-	17	-	7
-	27	38	42	44	55	-	7	-	-
-	1	3	4	2	3	-	-	-	-
-	13	20	19	13	13	-	12	-	10
-	2	-	12	-	8	-	3	-	1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	2	1	1	-	-	-	-
-	-	1	1	1	1	-	-	-	-
18	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	14	28	59	23	36	-	26	-	10
18	319	753	868	530	799	-	168	-	30
-	-15	-	-	-2	-	-	-14	-	-16
18	304	753	868	528	799	-	154	-	14
-	<b>-3.618</b>	<b>4.837</b>	<b>-33.344</b>	<b>3.127</b>	<b>-23.647</b>	-	<b>-2.078</b>	-	<b>-1.805</b>
-	-273	-2.487	-2.456	-2.048	-1.739	-	-581	-	-319
-	<b>-3.891</b>	<b>2.350</b>	<b>-35.800</b>	<b>1.079</b>	<b>-25.386</b>	-	<b>-2.659</b>	-	<b>-2.124</b>
-	-1	-83	-114	11	-72	-	-9	-	10
\$ -	\$ <b>-3.892</b>	\$ 2.267	\$ <b>-35.914</b>	\$ 1.090	\$ <b>-25.458</b>	\$ -	\$ <b>-2.668</b>	\$ -	\$ <b>-2.114</b>
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>		FTGF Western Asset Global Credit Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund <sup>^</sup>	
für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022
\$ 9.496	\$ 9.357	\$ 7.014	\$ 2.505	\$ 2.861	\$ 2.133	\$ 754	\$ 1.056	€ -	€ 404
1	2	11	-	3	-	1	-	-	-
-13	-	-23	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-7.794	-6.813	-1.114	-9.961	-4.499	-4.143	-4.558	2.884	-	-3.793
4.120	-44.878	20.608	-51.207	5.637	-19.964	3.897	-11.850	-	992
5.810	-42.332	26.496	-58.663	4.002	-21.974	94	-7.910	-	-2.397
1.542	1.632	1.009	752	122	125	11	13	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
168	164	196	135	62	60	18	27	-	8
87	104	82	53	1	2	2	2	-	-
6	6	7	5	2	2	1	1	-	-
20	19	13	13	13	13	13	13	-	12
-	17	8	16	3	8	1	3	-	2
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1	-	4	5	1	1	-	1	-	14
2	2	3	1	1	1	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
54	75	50	49	32	36	11	13	-	3
1.880	2.019	1.372	1.029	237	248	57	73	-	39
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-11
1.880	2.019	1.372	1.029	237	248	57	73	-	28
<b>3.930</b>	<b>-44.351</b>	<b>25.124</b>	<b>-59.692</b>	<b>3.765</b>	<b>-22.222</b>	<b>37</b>	<b>-7.983</b>	-	<b>-2.425</b>
-4.472	-4.320	-4.504	-1.426	-	-	-	-	-	-1
<b>-542</b>	<b>-48.671</b>	<b>20.620</b>	<b>-61.118</b>	<b>3.765</b>	<b>-22.222</b>	<b>37</b>	<b>-7.983</b>	-	<b>-2.426</b>
-241	-295	14	-	-30	-46	-	-5	-	-
\$ <b>-783</b>	\$ <b>-48.966</b>	\$ 20.634	\$ <b>-61.118</b>	\$ 3.735	\$ <b>-22.268</b>	\$ 37	\$ <b>-7.988</b>	€ -	€ <b>-2.426</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund <sup>^</sup>		FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund <sup>^</sup>	
	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022
<b>ANLAGEERTRÄGE:</b>								
Bruttodividenden- und Anleihezinsen	\$ 55.517	\$ 58.441	\$ –	\$ –	\$ 11.110	\$ 8.907	\$ –	\$ –
Zinsen	30	98	–	–	3	–	–	–
Ausgleich	-481	-327	–	–	-1	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-19.221	-477.283	–	–	-1.601	-46.892	–	–
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	70.165	-48.388	–	–	7.693	-24.721	–	–
<b>Gesamterträge/-verluste aus Anlagen</b>	<b>106.010</b>	<b>-467.459</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>17.204</b>	<b>-62.706</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>AUFWENDUNGEN:</b>								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	10.631	17.305	–	–	158	161	–	–
Performancegebühren (Anmerkung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	644	993	–	–	109	113	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	767	1.201	–	–	–	–	–	–
Rechtskosten	14	62	–	–	3	10	–	–
Prüfungsgebühren	20	19	–	–	13	13	–	–
Druckkosten	–	143	–	–	7	27	–	–
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	17	89	–	–	–	3	–	–
Vorstandsbezüge und -ausgaben (Erläuterung 3)	11	14	–	–	1	1	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	12	493	–	–	28	63	–	–
<b>Aufwendungen gesamt</b>	<b>12.116</b>	<b>20.319</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>319</b>	<b>391</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtvermögen	12.116	20.319	–	–	319	391	–	–
<b>Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten</b>	<b>93.894</b>	<b>-487.778</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>16.885</b>	<b>-63.097</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>FINANZIERUNGSKOSTEN:</b>								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	-11.992	-9.115	–	–	-1.340	-299	–	–
<b>Gewinn/Verlust für den Berichtszeitraum</b>	<b>81.902</b>	<b>-496.893</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>15.545</b>	<b>-63.396</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	-2.088	-4.053	–	–	-38	-83	–	–
<b>Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist</b>	<b>\$ 79.814</b>	<b>\$ -500.946</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 15.507</b>	<b>\$ -63.479</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>

(in Tsd.)	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>^</sup>		FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund <sup>^</sup>		FTGF Brandywine Global High Yield Fund <sup>^</sup>	
	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022
<b>ANLAGEERTRÄGE:</b>								
Bruttodividenden- und Anleihezinsen	\$ 140	\$ 118	\$ 4.922	\$ 3.864	\$ 15.092	\$ 10.072	\$ 932	\$ 356
Zinsen	–	–	1	1	–	2	–	–
Ausgleich	–	–	-12	-21	-12	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-298	524	-14.204	-17.945	-15.960	-64.076	265	-1.289
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	445	-1.495	12.052	-16.282	14.594	-20.744	110	-284
<b>Gesamterträge/-verluste aus Anlagen</b>	<b>287</b>	<b>-853</b>	<b>2.759</b>	<b>-30.383</b>	<b>13.714</b>	<b>-74.746</b>	<b>1.307</b>	<b>-1.217</b>
<b>AUFWENDUNGEN:</b>								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	14	14	530	689	1.472	904	40	26
Performancegebühren (Anmerkung 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	10	10	66	72	177	226	11	7
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	70	101	4	4	–	–
Rechtskosten	5	–	2	2	6	7	–	–
Prüfungsgebühren	9	9	20	19	13	13	13	13
Druckkosten	–	–	–	1	–	24	–	1
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	1	2	1	21	1	–
Vorstandsbezüge und -ausgaben (Erläuterung 3)	–	–	1	–	3	2	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	12	9	28	21	44	82	7	7
<b>Aufwendungen gesamt</b>	<b>50</b>	<b>42</b>	<b>718</b>	<b>907</b>	<b>1.720</b>	<b>1.283</b>	<b>72</b>	<b>54</b>
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	-29	-21	–	–	–	–	-15	-20
Gesamtvermögen	21	21	718	907	1.720	1.283	57	34
<b>Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten</b>	<b>266</b>	<b>-874</b>	<b>2.041</b>	<b>-31.290</b>	<b>11.994</b>	<b>-76.029</b>	<b>1.250</b>	<b>-1.251</b>
<b>FINANZIERUNGSKOSTEN:</b>								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	–	–	-925	-349	-1.217	-668	-4	-3
<b>Gewinn/Verlust für den Berichtszeitraum</b>	<b>266</b>	<b>-874</b>	<b>1.116</b>	<b>-31.639</b>	<b>10.777</b>	<b>-76.697</b>	<b>1.246</b>	<b>-1.254</b>
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	–	-1	5	-88	125	-469	–	-2
<b>Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist</b>	<b>\$ 266</b>	<b>\$ -875</b>	<b>\$ 1.121</b>	<b>\$ -31.727</b>	<b>\$ 10.902</b>	<b>\$ -77.166</b>	<b>\$ 1.246</b>	<b>\$ -1.256</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>		FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund <sup>^</sup>		FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund <sup>^</sup>		FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund		Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	
für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022
\$ 12.674	\$ 13.236	\$ 19.185	\$ 15.600	£ 805	£ 947	\$ 2.335	\$ 2.896	\$ 384	\$ 295
-	-	8	-	4	-	3	-	1	-
-14	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-11.422	-24.228	-15.221	-25.430	-443	-813	-3.266	-22.966	-99	-2.306
8.293	-26.455	445	-67.968	-581	-8.519	4.586	-17.109	-123	-923
9.531	-37.447	4.417	-77.798	-215	-8.385	3.658	-37.179	163	-2.934
427	841	89	28	-	-	26	34	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
206	265	425	384	19	26	40	56	10	9
6	15	-	-	-	-	-	-	-	-
24	19	15	11	1	1	1	2	-	-
20	20	13	13	8	8	13	13	23	18
-	35	19	33	1	2	2	6	-	1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	1	8	-	-	-	-	1	-	-
3	3	6	3	-	-	1	1	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
27	101	98	94	2	9	17	21	-4	17
713	1.300	673	566	31	46	100	134	29	45
-	-	-	-	-	-	-	-	-29	-45
713	1.300	673	566	31	46	100	134	-	-
<b>8.818</b>	<b>-38.747</b>	<b>3.744</b>	<b>-78.364</b>	<b>-246</b>	<b>-8.431</b>	<b>3.558</b>	<b>-37.313</b>	<b>163</b>	<b>-2.934</b>
-513	-477	-	-	-762	-	-2.182	-	-459	-290
<b>8.305</b>	<b>-39.224</b>	<b>3.744</b>	<b>-78.364</b>	<b>-1.008</b>	<b>-8.431</b>	<b>1.376</b>	<b>-37.313</b>	<b>-296</b>	<b>-3.224</b>
-	-	-	-	-3	-4	-7	-36	-2	-
<b>\$ 8.305</b>	<b>\$ -39.224</b>	<b>\$ 3.744</b>	<b>\$ -78.364</b>	<b>£ -1.011</b>	<b>£ -8.435</b>	<b>\$ 1.369</b>	<b>\$ -37.349</b>	<b>\$ -298</b>	<b>\$ -3.224</b>
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund <sup>^</sup>		FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>		FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund <sup>^</sup>	
für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022
\$ 6.299	\$ 3.833	\$ -	\$ -	\$ 37.070	\$ 25.456	\$ 1.385	\$ 1.061	\$ 50	\$ 280
-	-	-	-	1	7	-	-	-	-
-1	-	-	-	-93	113	-	-	-	-
-	-	-	761	-	-	-	-	-	-
-18.913	-21.087	-	-	-65.770	-138.672	-3.204	-443	-420	-2.067
16.074	-16.191	-	-	66.953	-77.529	853	-1.354	452	98
3.459	-33.445	-	761	38.161	-190.625	-966	-736	82	-1.689
673	678	-	-	4.519	5.514	222	306	2	17
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
84	80	-	-	455	479	20	24	1	6
6	5	-	-	499	597	5	9	-	-
3	3	-	-	17	14	1	1	-	-
13	13	-	-	20	16	13	13	-	13
4	9	-	-	20	42	1	2	-	1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	2	-	-	4	9	-	-	-	-
1	1	-	-	6	7	-	-	-	-
-	-	-	761	-	-	-	-	-	-
30	22	-	-	167	153	15	7	-	10
814	813	-	761	5.707	6.831	277	362	3	47
-	-	-	-	-	-	-21	-8	-	-23
814	813	-	761	5.707	6.831	256	354	3	24
<b>2.645</b>	<b>-34.258</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>32.454</b>	<b>-197.456</b>	<b>-1.222</b>	<b>-1.090</b>	<b>79</b>	<b>-1.713</b>
-95	-46	-	-	-16.814	-11.121	-	-	-576	-585
<b>2.550</b>	<b>-34.304</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>15.640</b>	<b>-208.577</b>	<b>-1.222</b>	<b>-1.090</b>	<b>-497</b>	<b>-2.298</b>
-5	-150	-	-	-478	-185	-6	25	-	-2
<b>\$ 2.545</b>	<b>\$ -34.454</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ 15.162</b>	<b>\$ -208.762</b>	<b>\$ -1.228</b>	<b>\$ -1.065</b>	<b>\$ -497</b>	<b>\$ -2.300</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

	Legg Mason Brandywine Global - US High Yield Fund <sup>^</sup>		FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup>		FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund <sup>^</sup>		FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund <sup>^,α</sup>	
	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022
<b>(in Tsd.)</b>								
<b>ANLAGEERTRÄGE:</b>								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	\$ -	\$ -	\$ 2.580	\$ 2.250	\$ 539	\$ -	\$ 7	\$ 23
Zinsen	-	-	-	-	-	-	-	-
Ausgleich	-	-	-	-	-	-	-	-
Sonstige Erträge	-	-	-	-	-	-	-	-
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-	-	-8.838	-13.714	-390	-	-109	-66
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-	-	6.230	-4.266	404	-	-63	-298
<b>Gesamterträge/-verluste aus Anlagen</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-28</b>	<b>-15.730</b>	<b>553</b>	<b>-</b>	<b>-165</b>	<b>-341</b>
<b>AUFWENDUNGEN:</b>								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	-	-	1	1	27	-	1	5
Performancegebühren (Anmerkung 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	-	-	30	32	9	-	-	4
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Rechtskosten	-	-	1	2	-	-	-	-
Prüfungsgebühren	-	-	13	13	10	-	-	13
Druckkosten	-	-	2	6	1	-	-	-
Dividendenaufwand	-	-	-	-	-	-	-	-
Zinsaufwendungen	-	-	-	-	-	-	-	-
Vorstandsbezüge und -ausgaben (Erläuterung 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-	-	-	-
Sonstige Aufwendungen	-	-	13	28	22	-	-	5
<b>Aufwendungen gesamt</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>60</b>	<b>82</b>	<b>69</b>	<b>-</b>	<b>1</b>	<b>27</b>
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	-	-	-6	-17	-34	-	-	-20
Gesamt Nettovermögen	-	-	54	65	35	-	1	7
<b>Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-82</b>	<b>-15.795</b>	<b>518</b>	<b>-</b>	<b>-166</b>	<b>-348</b>
<b>FINANZIERUNGSKOSTEN:</b>								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	-	-	-	-	-7	-	-	-
<b>Gewinn/Verlust für den Berichtszeitraum</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-82</b>	<b>-15.795</b>	<b>511</b>	<b>-</b>	<b>-166</b>	<b>-348</b>
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	-	-	-41	-79	-7	-	-2	-6
<b>Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -123</b>	<b>\$ -15.874</b>	<b>\$ 504</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -168</b>	<b>\$ -354</b>
<b>(in Tsd.)</b>								
<b>ANLAGEERTRÄGE:</b>								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	\$ 1.191	\$ 2.171	\$ 637	\$ 853	\$ 12.276	\$ 9.634	\$ 123	\$ 123
Zinsen	-	-	-	-	-	-	-	-
Ausgleich	-5	-	-1	-	-	-	-	-
Sonstige Erträge	-	-	-	-	-	-	-	-
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	1.512	11.278	1.252	392	-8.928	-14.603	292	148
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	16.274	-85.884	899	-4.703	83.654	-164.705	1.098	-1.866
<b>Gesamterträge/-verluste aus Anlagen</b>	<b>18.972</b>	<b>-72.435</b>	<b>2.787</b>	<b>-3.458</b>	<b>87.002</b>	<b>-169.674</b>	<b>1.513</b>	<b>-1.595</b>
<b>AUFWENDUNGEN:</b>								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	1.239	2.192	210	239	4.402	4.017	49	46
Performancegebühren (Anmerkung 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	91	165	18	18	620	526	8	8
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	221	276	33	38	1.076	744	2	1
Rechtskosten	2	6	1	1	23	15	-	-
Prüfungsgebühren	20	20	13	13	15	11	7	6
Druckkosten	6	-	1	2	29	43	-	-
Dividendenaufwand	-	-	-	-	-	-	-	-
Zinsaufwendungen	-	-	-	-	27	9	-	-
Vorstandsbezüge und -ausgaben (Erläuterung 3)	1	2	-	-	9	6	-	-
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-	-	-	-
Sonstige Aufwendungen	31	36	17	16	189	122	10	9
<b>Aufwendungen gesamt</b>	<b>1.611</b>	<b>2.697</b>	<b>293</b>	<b>327</b>	<b>6.390</b>	<b>5.493</b>	<b>76</b>	<b>70</b>
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	-	-	-22	-18	-46	-45	-15	-13
Gesamt Nettovermögen	1.611	2.697	271	309	6.344	5.448	61	57
<b>Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten</b>	<b>17.361</b>	<b>-75.132</b>	<b>2.516</b>	<b>-3.767</b>	<b>80.658</b>	<b>-175.122</b>	<b>1.452</b>	<b>-1.652</b>
<b>FINANZIERUNGSKOSTEN:</b>								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	-57	-	-80	-117	-100	-58	-	-
<b>Gewinn/Verlust für den Berichtszeitraum</b>	<b>17.304</b>	<b>-75.132</b>	<b>2.436</b>	<b>-3.884</b>	<b>80.558</b>	<b>-175.180</b>	<b>1.452</b>	<b>-1.652</b>
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	-232	-422	-113	-175	-3.082	-2.586	-16	-17
<b>Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist</b>	<b>\$ 17.072</b>	<b>\$ -75.554</b>	<b>\$ 2.323</b>	<b>\$ -4.059</b>	<b>\$ 77.476</b>	<b>\$ -177.766</b>	<b>\$ 1.436</b>	<b>\$ -1.669</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Growth Fund^		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^		FTGF ClearBridge US Appreciation Fund		FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022
\$ 8.579	\$ 9.165	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 1.772	\$ 1.574	\$ 5.237	\$ 5.727
-	-	-	-	-	-	-	-	1	-
-8	-	-	-	-	-	-1	-	-	-
-	-	-	-	2	-	-	-	-	-
17.246	-5.114	-	-	-	-	10.250	8.552	29.223	99.923
28.207	-85.709	-	-	-	-	16.220	-23.314	262.101	-377.299
54.024	-81.658	-	-	2	-	28.241	-13.188	296.562	-271.649
3.782	3.744	-	-	-	-	1.097	1.136	5.875	5.994
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
350	318	-	-	-	-	80	73	562	537
334	352	-	-	-	-	174	189	766	797
12	8	-	-	-	-	3	2	16	21
10	9	-	-	-	-	13	13	20	19
19	25	-	-	-	-	3	7	-	59
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1	-	-	-	-	-	-	-	1	-
5	2	-	-	-	-	1	1	6	6
-	-	-	-	2	-	-	-	-	-
112	81	-	-	-	-	44	33	100	200
4.625	4.539	-	-	2	-	1.415	1.454	7.346	7.633
-	-	-	-	-	-	-4	-	-	-
4.625	4.539	-	-	2	-	1.411	1.454	7.346	7.633
<b>49.399</b>	<b>-86.197</b>	-	-	-	-	<b>26.830</b>	<b>-14.642</b>	<b>289.216</b>	<b>-279.282</b>
-153	-136	-	-	-	-	-14	-6	-	-
<b>49.246</b>	<b>-86.333</b>	-	-	-	-	<b>26.816</b>	<b>-14.648</b>	<b>289.216</b>	<b>-279.282</b>
-2.090	-2.392	-	-	-	-	-487	-443	-1.334	-1.528
<b>\$ 47.156</b>	<b>\$ -88.725</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ 26.329</b>	<b>\$ -15.091</b>	<b>\$ 287.882</b>	<b>\$ -280.810</b>
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		FTGF Royce US Smaller Companies Fund	
für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022
€ 18.308	€ 11.900	\$ -	\$ 63	\$ 13.421	\$ 8.136	\$ 4.299	\$ 5.373	\$ 595	\$ 452
78	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-83	3	-	-	-65	122	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-7.270	85.236	-	-164	-8.163	558	4.826	-2.842	-217	2.911
-19.559	21.390	-	-164	-6.432	-20.722	-4.036	-111.326	3.627	-9.679
-8.526	118.529	-	-265	-1.239	-11.906	5.089	-108.795	4.005	-6.316
4.928	4.657	-	14	2.323	1.859	3.565	4.198	537	551
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
381	323	-	4	153	103	263	280	34	33
601	603	-	2	436	383	628	706	88	92
13	8	-	-	7	1	9	11	2	1
12	12	-	6	9	9	20	20	13	13
17	21	-	-	9	3	-	36	2	4
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	148	-	-	-	-	1	-	-	-
6	2	-	-	2	1	3	3	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
93	70	-	7	64	25	86	124	22	19
6.051	5.844	-	33	3.003	2.384	4.575	5.378	698	713
-	-	-	-20	-2	-	-	-	-7	-4
6.051	5.844	-	13	3.001	2.384	4.575	5.378	691	709
<b>-14.577</b>	<b>112.685</b>	-	<b>-278</b>	<b>-4.240</b>	<b>-14.290</b>	<b>514</b>	<b>-114.173</b>	<b>3.314</b>	<b>-7.025</b>
-3.615	-2.957	-	-11	-8.674	-5.927	-	-	-8	-
<b>-18.192</b>	<b>109.728</b>	-	<b>-289</b>	<b>-12.914</b>	<b>-20.217</b>	<b>514</b>	<b>-114.173</b>	<b>3.306</b>	<b>-7.025</b>
-2.028	-1.947	-	-10	-1.404	-882	-827	-773	-120	-84
<b>€ -20.220</b>	<b>€ 107.781</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -299</b>	<b>\$ -14.318</b>	<b>\$ -21.099</b>	<b>\$ -313</b>	<b>\$ -114.946</b>	<b>\$ 3.186</b>	<b>\$ -7.109</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



## Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^A				Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^A		FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^A,B	
	für die sechs Monate zum 31 August 2023		für die sechs Monate zum 31 August 2022		für die sechs Monate zum 31 August 2023		für die sechs Monate zum 31 August 2022	
	\$	\$	\$	\$	€	€	\$	\$
<b>ANLAGEERTRÄGE:</b>								
Bruttodividenden- und Anleihezinsen	44	40	-	-	-	793	749	987
Zinsen	-	-	-	-	-	-	-	-
Ausgleich	-	-	-	-	-	-	-	-
Sonstige Erträge	-	-	-	-	135	-	-	-
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-113	-131	-	-	-	-706	-2.379	-507
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	78	-434	-	-	-	-522	2.918	-3.080
<b>Gesamterträge/-verluste aus Anlagen</b>	<b>9</b>	<b>-525</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>135</b>	<b>-435</b>	<b>1.288</b>	<b>-2.600</b>
<b>AUFWENDUNGEN:</b>								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	16	16	-	-	-	125	115	172
Performancegebühren (Anmerkung 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	4	4	-	-	-	8	6	11
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	-	-	-	-	-	12	17	27
Rechtskosten	-	-	-	-	-	-	-	-
Prüfungsgebühren	6	5	-	-	-	12	10	9
Druckkosten	-	-	-	-	-	-	-	2
Dividendenaufwand	-	-	-	-	-	-	-	-
Zinsaufwendungen	-	-	-	-	-	2	-	-
Vorstandsbezüge und -ausgaben (Erläuterung 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	-	-	135	-	-	-
Sonstige Aufwendungen	11	8	-	-	-	1	34	15
<b>Aufwendungen gesamt</b>	<b>37</b>	<b>33</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>135</b>	<b>160</b>	<b>182</b>	<b>236</b>
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	-18	-14	-	-	-	-9	-41	-14
Gesamtnettvermögen	19	19	-	-	135	151	141	222
<b>Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten</b>	<b>-10</b>	<b>-544</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-586</b>	<b>1.147</b>	<b>-2.822</b>
<b>FINANZIERUNGSKOSTEN:</b>								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	-	-	-	-	-	-119	-324	-325
<b>Gewinn/Verlust für den Berichtszeitraum</b>	<b>-10</b>	<b>-544</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-705</b>	<b>823</b>	<b>-3.147</b>
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	-7	-7	-	-	-	-226	-11	-100
<b>Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist</b>	<b>\$ -17</b>	<b>\$ -551</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>€ -</b>	<b>€ -931</b>	<b>\$ 812</b>	<b>\$ -3.247</b>
(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund^A		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^A		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund^A		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^A	
	für die sechs Monate zum 31 August 2023		für die sechs Monate zum 31 August 2022		für die sechs Monate zum 31 August 2023		für die sechs Monate zum 31 August 2022	
	\$	\$	€	€	\$	\$	\$	\$
<b>ANLAGEERTRÄGE:</b>								
Bruttodividenden- und Anleihezinsen	-	-	-	-	-	-	-	-
Zinsen	-	-	-	-	-	-	-	-
Ausgleich	-	-	-	-	-	-	-	-
Sonstige Erträge	-	-	22	-	-	-	-	-
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-	-	-	-	-	-	-	-
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Gesamterträge/-verluste aus Anlagen</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>22</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>AUFWENDUNGEN:</b>								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Performancegebühren (Anmerkung 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Rechtskosten	-	-	-	-	-	-	-	-
Prüfungsgebühren	-	-	-	-	-	-	-	-
Druckkosten	-	-	-	-	-	-	-	-
Dividendenaufwand	-	-	-	-	-	-	-	-
Zinsaufwendungen	-	-	-	-	-	-	-	-
Vorstandsbezüge und -ausgaben (Erläuterung 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	22	-	-	-	-	-
Sonstige Aufwendungen	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Aufwendungen gesamt</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>22</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Gesamtnettvermögen	-	-	22	-	-	-	-	-
<b>Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>FINANZIERUNGSKOSTEN:</b>								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Gewinn/Verlust für den Berichtszeitraum</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>€ -</b>	<b>€ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund <sup>α</sup>		Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund <sup>α</sup>		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund <sup>α</sup>		Legg Mason Japan Equity Fund <sup>α</sup>		FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund <sup>αβ</sup>	
für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 95	¥ -	¥ -	\$ 4	\$ 246
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	9	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	1.634	-	-	-410	-206
-	-	-	-	-	-1.498	-	-	564	-1.946
-	-	-	-	9	231	-	-	158	-1.906
-	-	-	-	-	24	-	-	4	51
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	2	-	-	1	8
-	-	-	-	-	2	-	-	1	4
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	13	-	-	6	6
-	-	-	-	-	-	-	-	-	4
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	9	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	19	-	-	11	10
-	-	-	-	9	60	-	-	23	83
-	-	-	-	-	-33	-	-	-18	-20
-	-	-	-	9	27	-	-	5	63
-	-	-	-	-	204	-	-	153	-1.969
-	-	-	-	-	-12	-	-	-23	-13
-	-	-	-	-	192	-	-	130	-1.982
-	-	-	-	-	-26	-	-	-3	-26
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 166	¥ -	¥ -	\$ 127	\$ -2.008
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund <sup>α</sup>		FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund		FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>α</sup>		FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>α</sup>		FTGF Martin Currie Improving Society Fund <sup>αγ</sup>	
für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022
\$ 1.009	\$ 956	\$ 740	\$ 804	\$ 501	\$ 537	€ 1.729	€ 2.341	\$ 12	\$ -
-	-	-	-	-	-	4	-	-	-
-	-	-2	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-608	-10.689	-568	-22	-139	-2.068	-7.937	-8.920	1	-
13.455	-35.809	-709	-2.095	468	-6.298	8.269	-32.918	-243	-
13.856	-45.542	-539	-1.313	830	-7.829	2.065	-39.497	-230	-
517	545	107	125	182	201	357	507	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
63	57	12	12	17	18	80	100	2	-
58	59	33	38	9	10	4	10	-	-
2	2	-	-	-	1	3	3	-	-
10	10	10	10	6	6	10	7	3	-
2	5	-	1	1	2	3	8	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	7	-	-
1	-	-	-	-	-	1	1	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
23	21	16	16	20	23	6	25	16	-
676	699	178	202	235	261	464	668	21	-
-	-	-21	-19	-18	-19	-	-7	-19	-
676	699	157	183	217	242	464	661	2	-
13.180	-46.241	-696	-1.496	613	-8.071	1.601	-40.158	-232	-
-	-	-230	-230	-	-	-	-	-	-
13.180	-46.241	-926	-1.726	613	-8.071	1.601	-40.158	-232	-
-63	-61	-48	-64	-52	-52	-133	-217	-1	-
\$ 13.117	\$ -46.302	\$ -974	\$ -1.790	\$ 561	\$ -8.123	€ 1.468	€ -40.375	\$ -233	\$ -

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

## Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Franklin Responsible Income 2028 Fund <sup>^</sup>		Franklin Templeton Global Funds Plc	
	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022	für die sechs Monate zum 31 August 2023	für die sechs Monate zum 31 August 2022
<b>ANLAGEERTRÄGE:</b>				
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen	€ 1.623	€ –	\$ 332.686	\$ 278.665
Zinsen	5	–	205	110
Ausgleich	528	–	-269	-106
Sonstige Erträge	–	–	182	762
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten:				
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-389	–	-241.931	-834.932
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	480	–	708.669	-1.602.174
<b>Gesamterträge/-verluste aus Anlagen</b>	<b>2.247</b>	<b>–</b>	<b>799.542</b>	<b>-2.157.675</b>
<b>AUFWENDUNGEN:</b>				
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 3)	152	–	58.828	68.952
Performancegebühren (Anmerkung 3)	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 3)	29	–	6.381	6.826
Informationsstellengebühren (Erläuterung 3)	–	–	6.379	6.914
Rechtskosten	1	–	244	259
Prüfungsgebühren	9	–	629	696
Druckkosten	1	–	169	731
Dividendenaufwand	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	94	345
Vorstandsbezüge und -ausgaben (Erläuterung 3)	–	–	90	71
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	200	762
Sonstige Aufwendungen	11	–	1.901	2.649
<b>Aufwendungen gesamt</b>	<b>203</b>	<b>–</b>	<b>74.915</b>	<b>88.205</b>
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 3)	-1	–	-392	-1.112
Gesamt Nettovermögen	202	–	74.523	87.093
<b>Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten</b>	<b>2.045</b>	<b>–</b>	<b>725.019</b>	<b>-2.244.768</b>
<b>FINANZIERUNGSKOSTEN:</b>				
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 4)	–	–	-84.425	-49.425
<b>Gewinn/Verlust für den Berichtszeitraum</b>	<b>2.045</b>	<b>–</b>	<b>640.594</b>	<b>-2.294.193</b>
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	-10	–	-15.212	-17.967
<b>Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist</b>	<b>€ 2.035</b>	<b>€ –</b>	<b>\$ 625.382</b>	<b>\$ -2.312.160</b>

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

Gewinne und Verluste haben sich ausschließlich aus dem laufenden Geschäftsbetrieb ergeben, außer beim FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>^</sup>, FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>^</sup>, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup> und FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund<sup>^</sup>, die ihren Geschäftsbetrieb eingestellt haben. Es gab keine sonstigen Gewinne oder Verluste außer den in der Gesamtergebnisrechnung erfassten.

Die Euro-Beträge für den FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund<sup>^</sup>, FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup>, FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup> und Franklin Responsible Income 2028 Fund<sup>^</sup> wurden zur Berechnung der Gesamtbeträge für Franklin Templeton Global Funds Plc zum 31. August 2023 zum durchschnittlichen USD/EUR-Wechselkurs von 0,9186 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2023: 0,9590).

Die Beträge in britischem Pfund für den FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup> wurden zur Berechnung der Gesamtbeträge für Franklin Templeton Global Funds Plc zum 31. August 2023 zum durchschnittlichen USD/GBP-Wechselkurs von 0,7973 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2023: 0,8252).

α Mit Wirkung vom 24. März 2023 stellten der FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>^</sup> und der FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

β Mit Wirkung vom 20. April 2023 stellte der FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

γ Mit Wirkung vom 20. Juni 2023 wurde der FTGF Martin Currie Improving Society Fund<sup>^</sup> aufgelegt.

δ Mit Wirkung vom 17. Juli 2023 stellte der FTGF Franklin MV Japan Equity Growth and Income Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

[Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen]

# Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden 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 Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 3.881	\$ 353	\$ 100	\$ -23.208	\$ 11.257	\$ -163.099	€ 3.235	€ -16.029
<b>TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN</b>								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	892.129	785.309	93.855	16.134	154.975	406.503	804	7.423
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	15.427	851	603	374	509	428	4	1
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-816.133	-841.015	-23.001	-42.699	-315.412	-462.033	-46.187	-696
<b>Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen</b>	<b>91.423</b>	<b>-54.855</b>	<b>71.457</b>	<b>-26.191</b>	<b>-159.928</b>	<b>-55.102</b>	<b>-45.379</b>	<b>6.728</b>
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	95.304	-54.502	71.557	-49.399	-148.671	-218.201	-42.144	-9.301
<b>AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN</b>								
Beginn des Berichtszeitraums	833.615	919.324	131.919	232.906	1.148.700	1.488.090	132.467	149.386
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Ende des Berichtszeitraums</b>	<b>\$ 928.919</b>	<b>\$ 864.822</b>	<b>\$ 203.476</b>	<b>\$ 183.507</b>	<b>\$1.000.029</b>	<b>\$1.269.889</b>	<b>€ 90.323</b>	<b>€ 140.085</b>
<b>(in Tsd.)</b>								
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -780	\$ -10.172	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -3.242
<b>TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN</b>								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	2.186	4.323	-	-	-	-	-	5.977
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	133	104	-	-	-	-	-	46
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-7.287	-14.246	-	-	-	-	-	-52.270
<b>Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen</b>	<b>-4.968</b>	<b>-9.819</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-46.247</b>
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-5.748	-19.991	-	-	-	-	-	-49.489
<b>AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN</b>								
Beginn des Berichtszeitraums	57.431	81.978	-	-	-	-	-	59.525
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Ende des Berichtszeitraums</b>	<b>\$ 51.683</b>	<b>\$ 61.987</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ 10.036</b>
<b>(in Tsd.)</b>								
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 79.814	\$ -500.946	\$ -	\$ -	\$ 15.507	\$ -63.479	\$ -	\$ -
<b>TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN</b>								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	94.495	260.281	-	-	24.364	39.773	-	-
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	374	349	-	-	-	-	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-795.024	-1.317.097	-	-	-28.074	-100.127	-	-
<b>Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen</b>	<b>-700.155</b>	<b>-1.056.467</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-3.710</b>	<b>-60.354</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-620.341	-1.557.413	-	-	11.797	-123.833	-	-
<b>AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN</b>								
Beginn des Berichtszeitraums	2.132.501	4.183.834	-	-	275.012	371.899	-	-
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Ende des Berichtszeitraums</b>	<b>\$ 1.512.160</b>	<b>\$ 2.626.421</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ 286.809</b>	<b>\$ 248.066</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund <sup>^</sup>		FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		FTGF Western Asset US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	
für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022
\$ -	\$ -3.892	\$ 2.267	\$ -35.914	\$ 1.090	\$ -25.458	\$ -	\$ -2.668	\$ -	\$ -2.114
-	4.868	8.619	21.958	4.249	64.811	-	9.347	-	1
-	157	291	226	1.463	1.075	-	549	-	319
-	-15.363	-16.369	-36.977	-26.183	-109.343	-	-3.141	-	-26.054
-	-10.338	-7.459	-14.793	-20.471	-43.457	-	6.755	-	-25.734
-	-14.230	-5.192	-50.707	-19.381	-68.915	-	4.087	-	-27.848
-	52.992	227.355	302.969	125.240	259.100	-	41.118	-	27.848
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ -	\$ 38.762	\$ 222.163	\$ 252.262	\$ 105.859	\$ 190.185	\$ -	\$ 45.205	\$ -	\$ -
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>		FTGF Western Asset Global Credit Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund <sup>^</sup>	
für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022
\$ -783	\$ -48.966	\$ 20.634	\$ -61.118	\$ 3.735	\$ -22.268	\$ 37	\$ -7.988	€ -	€ -2.426
39.903	17.457	137.909	65.411	19.589	16.477	374	434	-	4
58	47	21	4	-	-	-	-	-	-
-83.420	-35.776	-208.326	-80.735	-15.563	-38.046	-15.102	-3.164	-	-35.026
-43.459	-18.272	-70.396	-15.320	4.026	-21.569	-14.728	-2.730	-	-35.022
-44.242	-67.238	-49.762	-76.438	7.761	-43.837	-14.691	-10.718	-	-37.448
437.707	509.794	523.970	444.249	146.703	202.948	46.050	77.353	-	37.448
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 393.465	\$ 442.556	\$ 474.208	\$ 367.811	\$ 154.464	\$ 159.111	\$ 31.359	\$ 66.635	€ -	€ -
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>		FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund <sup>^</sup>		FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund <sup>^</sup>		FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund		Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	
für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022
\$ 8.305	\$ -39.224	\$ 3.744	\$ -78.364	£ -1.011	£ -8.435	\$ 1.369	\$ -37.349	\$ -298	\$ -3.224
253	9.235	2.928	44.563	-	69.541	41	133.770	172	328
-	-	-	-	-	-	-	-	442	275
-52.040	-366.026	-	-345	-	-69.541	-40.895	-130.219	-120	-342
-51.787	-356.791	2.928	44.218	-	-	-40.854	3.551	494	261
-43.482	-396.015	6.672	-34.146	-1.011	-8.435	-39.485	-33.798	196	-2.963
559.548	1.057.941	1.119.507	1.147.280	45.912	73.633	94.775	175.169	18.441	21.958
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 516.066	\$ 661.926	\$ 1.126.179	\$ 1.113.134	£ 44.901	£ 65.198	\$ 55.290	\$ 141.371	\$ 18.637	\$ 18.995

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



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

(in Tsd.)	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>^</sup>		FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund <sup>^</sup>		FTGF Brandywine Global High Yield Fund <sup>^</sup>		
	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	
	Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 266	\$ -875	\$ 1.121	\$ -31.727	\$ 10.902	\$ -77.166	\$ 1.246	\$ -1.256
<b>TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN</b>									
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	–	–	11.355	37.486	18.678	10.821	12.804	19	
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	297	79	9	5	1	1	
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-50	-6	-20.656	-35.094	-312.850	-148.873	-123	–	
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen</b>	<b>-50</b>	<b>-6</b>	<b>-9.004</b>	<b>2.471</b>	<b>-294.163</b>	<b>-138.047</b>	<b>12.682</b>	<b>20</b>	
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	216	-881	-7.883	-29.256	-283.261	-215.213	13.928	-1.236	
<b>AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN</b>									
Beginn des Berichtszeitraums	8.995	9.866	162.009	215.635	539.271	752.718	10.394	11.590	
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–	
<b>Ende des Berichtszeitraums</b>	<b>\$ 9.211</b>	<b>\$ 8.985</b>	<b>\$ 154.126</b>	<b>\$ 186.379</b>	<b>\$ 256.010</b>	<b>\$ 537.505</b>	<b>\$ 24.322</b>	<b>\$ 10.354</b>	
<b>Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund<sup>^</sup></b>									
<b>FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup></b>									
<b>FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund<sup>^</sup></b>									
<b>FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>^</sup></b>									
(in Tsd.)	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	
	Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ –	\$ –	\$ -123	\$ -15.874	\$ 504	\$ –	\$ -168	\$ -354
	<b>TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN</b>								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	–	–	–	112	4	–	–	69	
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	–	–	4	–	–	–	
Kosten für zurückgekaufte Anteile	–	–	–	-17.709	–	–	-2.366	-7	
<b>Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>-17.597</b>	<b>8</b>	<b>–</b>	<b>-2.366</b>	<b>62</b>	
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	–	–	-123	-33.471	512	–	-2.534	-292	
<b>AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN</b>									
Beginn des Berichtszeitraums	–	–	69.410	104.231	14.804	–	2.534	2.177	
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–	
<b>Ende des Berichtszeitraums</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 69.287</b>	<b>\$ 70.760</b>	<b>\$ 15.316</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ –</b>	<b>\$ 1.885</b>	
<b>FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund</b>									
<b>FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund</b>									
<b>FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund</b>									
<b>FTGF ClearBridge Global Growth Fund<sup>^</sup></b>									
(in Tsd.)	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	
	Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 17.072	\$ -75.554	\$ 2.323	\$ -4.059	\$ 77.476	\$ -177.766	\$ 1.436	\$ -1.669
	<b>TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN</b>								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	8.484	4.589	811	3.404	319.430	614.239	1.002	211	
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	4	3	–	–	–	–	
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-34.433	-54.880	-6.138	-2.023	-442.334	-402.757	-740	-1.888	
<b>Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen</b>	<b>-25.949</b>	<b>-50.291</b>	<b>-5.323</b>	<b>1.384</b>	<b>-122.904</b>	<b>211.482</b>	<b>262</b>	<b>-1.677</b>	
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-8.877	-125.845	-3.000	-2.675	-45.428	33.716	1.698	-3.346	
<b>AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN</b>									
Beginn des Berichtszeitraums	224.793	538.159	38.528	43.279	1.639.979	1.599.315	13.179	16.018	
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–	
<b>Ende des Berichtszeitraums</b>	<b>\$ 215.916</b>	<b>\$ 412.314</b>	<b>\$ 35.528</b>	<b>\$ 40.604</b>	<b>\$ 1.594.551</b>	<b>\$ 1.633.031</b>	<b>\$ 14.877</b>	<b>\$ 12.672</b>	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund <sup>^</sup>		FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>		FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund <sup>^α</sup>	
für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022
\$ 2.545	\$ -34.454	\$ -	\$ -	\$ 15.162	\$ -208.762	\$ -1.228	\$ -1.065	\$ -497	\$ -2.300
27.081	1.598	-	-	134.138	246.355	2.279	1.476	-	-
7	3	-	-	237	155	-	-	-	1
-27.005	-9.529	-	-	-174.889	-434.813	-14.541	-1.565	-7.892	-
<b>83</b>	<b>-7.928</b>	-	-	<b>-40.514</b>	<b>-188.303</b>	<b>-12.262</b>	<b>-89</b>	<b>-7.892</b>	<b>1</b>
2.628	-42.382	-	-	-25.352	-397.065	-13.490	-1.154	-8.389	-2.299
205.146	244.396	-	-	1.210.305	1.608.073	46.756	52.386	8.389	10.163
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>\$ 207.774</b>	<b>\$ 202.014</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$1.184.953</b>	<b>\$1.211.008</b>	<b>\$ 33.266</b>	<b>\$ 51.232</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ 7.864</b>
FTGF ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund <sup>^</sup>		FTGF ClearBridge US Appreciation Fund		FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022
\$ 47.156	\$ -88.725	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 26.329	\$ -15.091	\$ 287.882	\$ -280.810
185.570	183.445	-	-	-	-	14.365	14.256	363.086	213.856
1	4	-	-	-	-	2	-	-	-
-203.380	-105.991	-	-	-	-	-31.702	-22.771	-336.322	-419.098
<b>-17.809</b>	<b>77.458</b>	-	-	-	-	<b>-17.335</b>	<b>-8.515</b>	<b>26.764</b>	<b>-205.242</b>
29.347	-11.267	-	-	-	-	8.994	-23.606	314.646	-486.052
929.726	892.238	-	-	-	-	189.610	213.480	1.225.735	1.772.695
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>\$ 959.073</b>	<b>\$ 880.971</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ 198.604</b>	<b>\$ 189.874</b>	<b>\$1.540.381</b>	<b>\$1.286.643</b>
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup>		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund <sup>^</sup>		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		FTGF Royce US Smaller Companies Fund	
für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022
€ -20.220	€ 107.781	\$ -	\$ -299	\$ -14.318	\$ -21.099	\$ -313	\$ -114.946	\$ 3.186	\$ -7.109
190.309	561.163	-	15	31.752	305.392	131.912	101.415	19.906	4.716
13	11	-	1	1.181	496	-	-	-	-
-358.725	-255.798	-	-2	-59.438	-44.110	-197.589	-244.838	-8.755	-10.172
<b>-168.403</b>	<b>305.376</b>	-	<b>14</b>	<b>-26.505</b>	<b>261.778</b>	<b>-65.677</b>	<b>-143.423</b>	<b>11.151</b>	<b>-5.456</b>
-188.623	413.157	-	-285	-40.823	240.679	-65.990	-258.369	14.337	-12.565
1.062.833	671.424	-	2.665	406.048	173.394	741.529	916.209	78.098	87.935
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>€ 874.210</b>	<b>€1.084.581</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ 2.380</b>	<b>\$ 365.225</b>	<b>\$ 414.073</b>	<b>\$ 675.539</b>	<b>\$ 657.840</b>	<b>\$ 92.435</b>	<b>\$ 75.370</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

(in Tsd.)	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund <sup>^</sup>		Legg Mason US Equity Fund <sup>^</sup>		Franklin MV European Equity Growth and Income Fund <sup>^</sup>		FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund <sup>^</sup> <sup>§</sup>	
	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -17	\$ -551	\$ -	\$ -	€ -	€ -931	\$ 812	\$ -3.247
<b>TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN</b>								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	9	1	-	-	-	305	53	1.589
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	-	-	-	-	98	88
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-17	-	-	-	-	-27.711	-22.053	-3.353
<b>Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen</b>	<b>-8</b>	<b>1</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-27.406</b>	<b>-21.902</b>	<b>-1.676</b>
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-25	-550	-	-	-	-28.337	-21.090	-4.923
<b>AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN</b>								
Beginn des Berichtszeitraums	4.254	4.534	-	-	-	28.337	21.090	25.883
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Ende des Berichtszeitraums</b>	<b>\$ 4.229</b>	<b>\$ 3.984</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>€ -</b>	<b>€ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ 20.960</b>

  

(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund <sup>^</sup>	
	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -	\$ -	€ -	€ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
<b>TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN</b>								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	-	-	-	-	-	-	-	-
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	-	-	-	-	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN</b>								
Beginn des Berichtszeitraums	-	-	-	-	-	-	-	-
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Ende des Berichtszeitraums</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>€ -</b>	<b>€ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>	<b>\$ -</b>

  

(in Tsd.)	Franklin Responsible Income 2028 Fund <sup>^</sup>		Franklin Templeton Global Funds Plc	
	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	€ 2.035	€ -	\$ 625.382	\$ -2.312.160
<b>TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN</b>				
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	70.915	-	3.075.829	4.431.367
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	21.345	5.801
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-21.981	-	-4.853.609	-6.180.820
<b>Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen</b>	<b>48.934</b>	<b>-</b>	<b>-1.756.435</b>	<b>-1.743.652</b>
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	50.969	-	-1.131.053	-4.055.812
<b>AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN</b>				
Beginn des Berichtszeitraums	36.823	-	1.742.8.030	2.262.8.678
Währungsumrechnung	-	-	41.600	-162.565
<b>Ende des Berichtszeitraums</b>	<b>€ 87.792</b>	<b>€ -</b>	<b>\$ 16.338.577</b>	<b>\$ 18.410.301</b>

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund <sup>^</sup>		Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund <sup>^</sup>		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund <sup>^</sup>		Legg Mason Japan Equity Fund <sup>^</sup>		FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund <sup>^β</sup>	
für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 166	¥ -	¥ -	\$ 127	\$ -2.008
-	-	-	-	-	-	-	-	12	27
-	-	-	-	-	-	-	-	3	2
-	-	-	-	-	-12.709	-	-	-3.680	-265
-	-	-	-	-	-12.709	-	-	-3.665	-236
-	-	-	-	-	-12.543	-	-	-3.538	-2.244
-	-	-	-	-	12.543	-	-	3.538	16.118
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	¥ -	¥ -	\$ -	\$ 13.874
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>		FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund		FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup>		FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>^</sup>		FTGF Martin Currie Improving Society Fund <sup>^γ</sup>	
für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022	für das Halbjahr zum 31. August 2023	für das Halbjahr zum 31. August 2022
\$ 13.117	\$ -46.302	\$ -974	\$ -1.790	\$ 561	\$ -8.123	€ 1.468	€ -40.375	\$ -233	\$ -
14.413	56.471	51	657	1.447	11.301	9.972	23.179	4.999	-
-	-	161	146	-	-	-	-	-	-
-18.006	-28.057	-3.862	-1.412	-3.745	-17.015	-12.218	-86.025	-	-
-3.593	28.414	-3.650	-609	-2.298	-5.714	-2.246	-62.846	4.999	-
9.524	-17.888	-4.624	-2.399	-1.737	-13.837	-778	-103.221	4.766	-
141.049	169.381	25.121	27.934	34.702	47.838	189.097	303.590	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 150.573	\$ 151.493	\$ 20.497	\$ 25.535	\$ 32.965	\$ 34.001	€ 188.319	€ 200.369	\$ 4.766	\$ -

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

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

Alle Euro-Beträge, außer des zu Beginn des Berichtszeitraums den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens, für den FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund<sup>^</sup>, FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup>, FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup> und Franklin Responsible Income 2028 Fund<sup>^</sup> wurden zur Berechnung der Gesamtbeträge für Franklin Templeton Global Funds Plc für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023 zum durchschnittlichen USD/EUR-Wechselkurs von 0,9186 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2023: 0,9590).

Das den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums für den FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund<sup>^</sup>, FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup>, FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup> und Franklin Responsible Income 2028 Fund<sup>^</sup> wurde zur Berechnung der Gesamtbeträge zum 28. Februar 2023 zum USD/EUR-Schlusskurs von 0,9454 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2022: 0,8919).

Alle Beträge in britischem Pfund, außer des zu Beginn des Berichtszeitraums den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens, für den FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup> wurden zur Berechnung der Gesamtbeträge für Franklin Templeton Global Funds Plc für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023 zum durchschnittlichen USD/GBP-Wechselkurs von 0,7973 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2023: 0,8252).

Das den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnende Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums für den FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup> wurde zur Berechnung der Gesamtbeträge zum 28. Februar 2023 zum USD/GBP-Schlusskurs von 0,8314 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2022: 0,7454).

α Mit Wirkung vom 24. März 2023 stellten der FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>^</sup> und der FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

β Mit Wirkung vom 20. April 2023 stellte der FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

γ Mit Wirkung vom 20. Juni 2023 wurde der FTGF Martin Currie Improving Society Fund<sup>^</sup> aufgelegt.

δ Mit Wirkung vom 17. Juli 2023 stellte der FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)
<b>FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	878	1.094		
Zurückgenommen	-672	-904		
Nettozunahme	206	190		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	604.431	320.506		
Zurückgenommen	-516.730	-414.297		
Nettozunahme/-abnahme	87.701	-93.791		
<b>Klasse B USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-1	-		
Nettoabnahme	-1	-		
<b>Klasse B USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	-	218		
Zurückgenommen	-44	-		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-44	218		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-	-2		
Nettoabnahme	-	-2		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (D)</b>				
Zurückgenommen	-134	-		
Nettoabnahme	-134	-		
<b>Klasse X USD ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	212.512	351.147		
Zurückgenommen	-231.821	-332.929		
Nettozunahme/-abnahme	-19.309	18.218		
<b>Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	4	35		
Zurückgenommen	-	-72		
Nettozunahme/-abnahme	4	-37		
<b>FTGF Western Asset US Core Bond Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	40	35		
Zurückgenommen	-36	-43		
Nettozunahme/-abnahme	4	-8		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	46	48		
Zurückgenommen	-27	-59		
Nettozunahme/-abnahme	19	-11		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	2	-		
Zurückgenommen	-12	-15		
Nettoabnahme	-10	-15		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	1	1		
Zurückgenommen	-2	-6		
Nettoabnahme	-1	-5		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	3	-		
Zurückgenommen	-1	-11		
Nettozunahme/-abnahme	2	-11		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	668	53		
Zurückgenommen	-30	-211		
Nettozunahme/-abnahme	638	-158		
<b>Klasse F USD ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	74	3		
Zurückgenommen	-15	-21		
Nettozunahme/-abnahme	59	-18		
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	-	1		
Zurückgenommen	-1	-1		
Nettoabnahme	-1	-		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-85	-		
Nettoabnahme	-85	-		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	-	1		
Zurückgenommen	-	-2		
Nettoabnahme	-	-1		
<b>Klasse LM USD thesaurierend</b>				
Verkauft			1	2
Zurückgenommen			-4	-1
Netto-(Abgang)/-Zugang			-3	1
<b>Klasse GA USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen			-	-1
Nettoabnahme			-	-1
<b>FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft			57	80
Zurückgenommen			-93	-134
Nettoabnahme			-36	-54
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft			56	106
Zurückgenommen			-26	-160
Nettozunahme/-abnahme			30	-54
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft			1	4
Zurückgenommen			-7	-21
Nettoabnahme			-6	-17
<b>Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft			8	59
Zurückgenommen			-105	-4
Netto-(Abgang)/-Zugang			-97	55
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft			-	1
Zurückgenommen			-	-5
Nettoabnahme			-	-4
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft			15	2
Zurückgenommen			-7	-33
Nettozunahme/-abnahme			8	-31
<b>Klasse C USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft			5	1
Zurückgenommen			-3	-10
Nettozunahme/-abnahme			2	-9
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft			5	7
Zurückgenommen			-13	-60
Nettoabnahme			-8	-53
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft			598	1.705
Zurückgenommen			-1.628	-2.608
Nettoabnahme			-1.030	-903
<b>Klasse F USD ausschüttend (D)</b>				
Verkauft			55	11
Zurückgenommen			-54	-28
Nettozunahme/-abnahme			1	-17
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft			13	2
Zurückgenommen			-4	-9
Nettozunahme/-abnahme			9	-7
<b>Klasse X USD ausschüttend (D)</b>				
Verkauft			1	8
Zurückgenommen			-1	-2
Nettozunahme			-	6
<b>Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen			-1	-3
Nettoabnahme			-1	-3
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft			407	1.030
Zurückgenommen			-688	-629
Nettozunahme/-abnahme			-281	401
<b>Klasse Premier USD ausschüttend (M)</b>				
Verkauft			6	4
Zurückgenommen			-	-1
Nettozunahme			6	3
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft			60	146
Zurückgenommen			-	-18
Nettozunahme			60	128

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



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

	Für den Berichtszeitraum zum			Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)		31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)
<b>FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – (Fortsetzung)</b>					
<b>Klasse LM USD, ausschüttend (M)</b>					
Verkauft	7	28			
Zurückgenommen	-35	-33			
Nettoabnahme	-28	-5			
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend</b>					
Zurückgenommen	-8	-1			
Nettoabnahme	-8	-1			
<b>Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)</b>					
Zurückgenommen	-1	-2			
Nettoabnahme	-1	-2			
<b>FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund</b>					
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>					
Verkauft	4	-			
Nettozunahme	4	-			
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (D)</b>					
Zurückgenommen	-	-1			
Nettoabnahme	-	-1			
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend</b>					
Verkauft	5	76			
Zurückgenommen	-33	-4			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-28	72			
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend</b>					
Zurückgenommen	-450	-1			
Nettoabnahme	-450	-1			
<b>Klasse GA EUR, thesaurierend</b>					
Zurückgenommen	-1	-			
Nettoabnahme	-1	-			
<b>Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund<sup>Δ</sup></b>					
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	-	4			
Zurückgenommen	-	-57			
Nettoabnahme	-	-53			
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>					
Verkauft	-	5			
Zurückgenommen	-	-25			
Nettoabnahme	-	-20			
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	-	1			
Zurückgenommen	-	-1			
Nettoabnahme	-	-			
<b>Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus</b>					
Verkauft	-	2			
Zurückgenommen	-	-12			
Nettoabnahme	-	-10			
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	-	9			
Zurückgenommen	-	-10			
Nettoabnahme	-	-1			
<b>Klasse C USD, ausschüttend (D)</b>					
Zurückgenommen	-	-22			
Nettoabnahme	-	-22			
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>					
Zurückgenommen	-	-2			
Nettoabnahme	-	-2			
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	-	23			
Zurückgenommen	-	-1			
Nettozunahme	-	22			
<b>Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)</b>					
Zurückgenommen	-	-2			
Nettoabnahme	-	-2			
<b>Klasse L (G) USD, thesaurierend</b>					
Zurückgenommen	-	-1			
Nettoabnahme	-	-1			
<b>Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)</b>					
Zurückgenommen	-	-1			
Nettoabnahme	-	-1			
<b>FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund</b>					
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>					
Verkauft			15	4	
Zurückgenommen			-6	-13	
Nettozunahme/-abnahme			9	-9	
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>					
Verkauft			2	4	
Zurückgenommen			-19	-5	
Nettoabnahme			-17	-1	
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>					
Verkauft			9	-	
Zurückgenommen			-7	-1	
Nettozunahme/-abnahme			2	-1	
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M)</b>					
Zurückgenommen			-1	-2	
Nettoabnahme			-1	-2	
<b>Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>					
Verkauft			-	2	
Nettozunahme			-	2	
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft			1	1	
Zurückgenommen			-5	-4	
Nettoabnahme			-4	-3	
<b>Klasse A EUR ausschüttend (M) (abgesichert)</b>					
Zurückgenommen			-3	-1	
Nettoabnahme			-3	-1	
<b>Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus</b>					
Zurückgenommen			-	-5	
Nettoabnahme			-	-5	
<b>Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>					
Verkauft			67	60	
Zurückgenommen			-54	-16	
Nettozunahme			13	44	
<b>Klasse B USD ausschüttend (D)</b>					
Zurückgenommen			-	-2	
Nettoabnahme			-	-2	
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>					
Verkauft			-	1	
Zurückgenommen			-6	-3	
Nettoabnahme			-6	-2	
<b>Klasse C USD, ausschüttend (D)</b>					
Verkauft			1	1	
Zurückgenommen			-5	-10	
Nettoabnahme			-4	-9	
<b>Klasse A ZAR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>					
Verkauft			3	6	
Zurückgenommen			-3	-5	
Nettozunahme			-	1	
<b>Klasse E USD, ausschüttend (D)</b>					
Zurückgenommen			-2	-	
Nettoabnahme			-2	-	
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>					
Verkauft			12	12	
Zurückgenommen			-10	-19	
Nettozunahme/(-abnahme)			2	-7	
<b>Klasse F USD ausschüttend (D)</b>					
Zurückgenommen			-4	-	
Nettoabnahme			-4	-	
<b>Klasse X USD ausschüttend (D)</b>					
Verkauft			1	-	
Zurückgenommen			-	-4	
Nettozunahme/-abnahme			1	-4	
<b>Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft			1	-	
Nettozunahme			1	-	
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>					
Verkauft			3	86	
Zurückgenommen			-42	-21	
Netto-(Abgang)/-Zugang			-39	65	
<b>Klasse Premier USD ausschüttend (M)</b>					
Verkauft			-	13	
Zurückgenommen			-	-102	
Nettoabnahme			-	-89	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)
<b>FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	-4	-4		
Nettoabnahme	-4	-4		
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	-	-71		
Nettoabnahme	-	-71		
<b>Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	-2	-13		
Nettoabnahme	-2	-13		
<b>Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	-	1		
Zurückgenommen	-5	-17		
Nettoabnahme	-5	-16		
<b>Klasse LM AUD ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Verkauft	42	28		
Nettozunahme	42	28		
<b>FTGF Western Asset US High Yield Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	4	15		
Zurückgenommen	-16	-16		
Nettoabnahme	-12	-1		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	12	7		
Zurückgenommen	-38	-19		
Nettoabnahme	-26	-12		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	4	1		
Zurückgenommen	-7	-12		
Nettoabnahme	-3	-11		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	1	4		
Zurückgenommen	-3	-9		
Nettoabnahme	-2	-5		
<b>Klasse A EUR ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Verkauft	-	4		
Zurückgenommen	-1	-		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	4		
<b>Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	2	-		
Zurückgenommen	-1	-		
Nettozunahme	1	-		
<b>Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	66	6		
Zurückgenommen	-19	-145		
Nettozunahme/(-abnahme)	47	-139		
<b>Klasse B USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-	-2		
Nettoabnahme	-	-2		
<b>Klasse B USD ausschüttend (D)</b>				
Zurückgenommen	-1	-		
Nettoabnahme	-1	-		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	-	8		
Zurückgenommen	-1	-		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	8		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	-	1		
Zurückgenommen	-6	-4		
Nettoabnahme	-6	-3		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	-	5		
Zurückgenommen	-5	-4		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-5	1		
<b>Klasse E USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	-	1		
Zurückgenommen	-2	-		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-2	1		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	-	12		
Zurückgenommen	-2	-19		
Nettoabnahme	-2	-7		
<b>Klasse F USD ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	-	2		
Nettozunahme	-	2		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	13	327		
Zurückgenommen	-104	-560		
Nettoabnahme	-91	-233		
<b>Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	5	-		
Nettozunahme	5	-		
<b>LM Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Verkauft	-	1		
Nettozunahme	-	1		
<b>Klasse LM USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-	-17		
Nettoabnahme	-	-17		
<b>Klasse LM USD, ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	12	8		
Nettozunahme	12	8		
<b>Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	1	-		
Zurückgenommen	-1	-		
Nettozunahme	-	-		
<b>Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund<sup>A</sup></b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-	-8		
Nettoabnahme	-	-8		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>				
Zurückgenommen	-	-6		
Nettoabnahme	-	-6		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	-	19		
Nettozunahme	-	19		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M)</b>				
Zurückgenommen	-	-1		
Nettoabnahme	-	-1		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	-	-1		
Nettoabnahme	-	-1		
<b>Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	-	5		
Zurückgenommen	-	-3		
Nettozunahme	-	2		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-	-2		
Nettoabnahme	-	-2		
<b>Klasse E USD, ausschüttend (D)</b>				
Zurückgenommen	-	-1		
Nettoabnahme	-	-1		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	-	-6		
Nettoabnahme	-	-6		
<b>Klasse LM USD ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Verkauft	-	102		
Nettozunahme	-	102		
<b>FTGF Western Asset Global High Yield Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	3	3		
Zurückgenommen	-5	-6		
Nettoabnahme	-2	-3		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	1	4		
Zurückgenommen	-2	-7		
Nettoabnahme	-1	-3		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	-	8		
Zurückgenommen	-12	-51		
Nettoabnahme	-12	-43		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	1	2		
Zurückgenommen	-15	-18		
Nettoabnahme	-14	-16		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)
<b>FTGF Western Asset Global High Yield Fund – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	3	7		
Zurückgenommen	-17	-17		
Nettoabnahme	-14	-10		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-1	–		
Nettoabnahme	-1	–		
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	1		
Nettozunahme	–	1		
<b>Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	508	333		
Zurückgenommen	-482	-297		
Nettozunahme	26	36		
<b>Klasse B USD ausschüttend (D)</b>				
Zurückgenommen	–	-3		
Nettoabnahme	–	-3		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	–	-2		
Nettoabnahme	–	-2		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	1	–		
Zurückgenommen	-5	-2		
Nettoabnahme	-4	-2		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-2	–		
Nettoabnahme	-2	–		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	5	9		
Zurückgenommen	-5	-6		
Nettozunahme	–	3		
<b>Klasse F USD ausschüttend (D)</b>				
Zurückgenommen	-1	-4		
Nettoabnahme	-1	-4		
<b>Klasse X USD ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	2	2		
Zurückgenommen	-4	-4		
Nettoabnahme	-2	-2		
<b>Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)</b>				
Verkauft	5	4		
Zurückgenommen	-4	-2		
Nettozunahme	1	2		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	–	-23		
Nettoabnahme	–	-23		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	1		
Zurückgenommen	-5	–		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-5	1		
<b>Klasse S EUR ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	1		
Nettozunahme	–	1		
<b>Klasse A (G) USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-4	–		
Nettoabnahme	-4	–		
<b>Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)</b>				
Zurückgenommen	-1	–		
Nettoabnahme	-1	–		
<b>Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund<sup>^</sup></b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	17		
Zurückgenommen	–	-4		
Nettozunahme	–	13		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	–	7		
Zurückgenommen	–	-22		
Nettoabnahme	–	-15		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	1		
Nettozunahme	–	1		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	11		
Nettozunahme	–	11		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	12		
Zurückgenommen	–	-75		
Nettoabnahme	–	-63		
<b>Klasse LM USD thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	–	-369		
Nettoabnahme	–	-369		
<b>FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	14	29		
Zurückgenommen	-30	-62		
Nettoabnahme	-16	-33		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	–	1		
Zurückgenommen	-2	-3		
Nettoabnahme	-2	-2		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	44	32		
Zurückgenommen	-63	-129		
Nettoabnahme	-19	-97		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	7	9		
Zurückgenommen	-57	-7		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-50	2		
<b>Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	23	24		
Zurückgenommen	-47	-81		
Nettoabnahme	-24	-57		
<b>Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	429	2		
Zurückgenommen	-95	-50		
Nettozunahme/-abnahme	334	-48		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	–	-2		
Nettoabnahme	–	-2		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	2		
Zurückgenommen	-1	-2		
Nettoabnahme	-1	–		
<b>Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	6	16		
Zurückgenommen	-71	-163		
Nettoabnahme	-65	-147		
<b>Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	123	16		
Zurückgenommen	-13	-52		
Nettozunahme/-abnahme	110	-36		
<b>Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	9.492	79		
Zurückgenommen	-9.099	-87		
Nettozunahme/-abnahme	393	-8		
<b>Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	43	300		
Zurückgenommen	-357	-312		
Nettoabnahme	-314	-12		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (D)</b>				
Zurückgenommen	-1	–		
Nettoabnahme	-1	–		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	1		
Nettozunahme	–	1		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	1		
Zurückgenommen	–	-1		
Nettozunahme	–	–		
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	–	-2		
Nettoabnahme	–	-2		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)
<b>FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse X USD ausschüttend (M)</b>				
Zurückgenommen	–	-26	179	14
Nettoabnahme	–	-26	-37	-33
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	76	10	142	-19
Zurückgenommen	-225	-13	21	196
Nettoabnahme	-149	-3	-102	-50
<b>Klasse Premier USD ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	36	–	-81	146
Zurückgenommen	-48	–	<b>Klasse Premier CHF ausschüttend (M) (abgesichert)</b>	
Nettoabnahme	-12	–	40	–
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	53	12	40	–
Zurückgenommen	-25	-16	40	–
Nettozunahme/-abnahme	28	-4	<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>	
<b>Klasse Premier EUR ausschüttend (A)</b>				
Zurückgenommen	-21	–	174	12
Nettoabnahme	-21	–	-714	-64
<b>Klasse LM USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-62	-9	Nettoabnahme	-540
Nettoabnahme	-62	-9	<b>Klasse Premier EUR ausschüttend (M) (abgesichert)</b>	
<b>Klasse LM USD, ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	1	41	Verkauft	2
Zurückgenommen	-13	-2	Nettozunahme	2
Netto-(Abgang)/-Zugang	-12	39	<b>Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)</b>	
<b>Klasse LM EUR ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Verkauft	3	–	Verkauft	–
Nettozunahme	3	–	Zurückgenommen	3
<b>FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	71	75	Netto-(Abgang)/-Zugang	-3
Zurückgenommen	-63	-47	<b>Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert)</b>	
Nettozunahme	8	28	Zurückgenommen	-9
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	59	1	Nettoabnahme	-9
Zurückgenommen	-22	-6	<b>Klasse S USD ausschüttend (M) Plus (e)</b>	
Nettozunahme/-abnahme	37	-5	Verkauft	33
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	70	29	Zurückgenommen	-17
Zurückgenommen	-69	-37	Nettozunahme/(-abnahme)	16
Nettozunahme/-abnahme	1	-8	<b>Klasse S EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>	
<b>Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	710	536	Verkauft	54
Zurückgenommen	-749	-1.977	Zurückgenommen	-30
Nettoabnahme	-39	-1.441	Nettozunahme/-abnahme	-4
<b>Klasse B USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-1	–	<b>Klasse S GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>	
Nettoabnahme	-1	–	Verkauft	504
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	2	5	Zurückgenommen	-755
Zurückgenommen	-5	-33	Nettoabnahme	-251
Nettoabnahme	-3	-28	<b>FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^</b>	
<b>Klasse C USD ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	3	32	<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>	
Zurückgenommen	–	-2	Zurückgenommen	-1
Nettozunahme	3	30	Nettoabnahme	-1
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	1	<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>	
Zurückgenommen	-1	-2	Verkauft	19
Nettoabnahme	–	-1	Zurückgenommen	-81
<b>Klasse E USD, ausschüttend (D)</b>				
Verkauft	–	1	Nettoabnahme	-62
Nettozunahme	–	1	<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>	
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	–	Verkauft	140
Zurückgenommen	-2	-15	Zurückgenommen	-9
Nettoabnahme	-1	-15	Nettozunahme/-abnahme	131
<b>Klasse F USD ausschüttend (D)</b>				
Zurückgenommen	-4	–	<b>Klasse Premier NZD thesaurierend (abgesichert)</b>	
Nettoabnahme	-4	–	Verkauft	25
<b>FTGF Western Asset Global Credit Fund^</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	–	-5	Zurückgenommen	-38
Nettoabnahme	–	-5	Nettoabnahme	-13
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	1	<b>Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>	
Zurückgenommen	-1	-1	Verkauft	–
Nettoabnahme	-1	–	Nettozunahme	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum			Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)		31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)
<b>FTGF Western Asset Global Credit Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)</b>					
<b>Klasse LM USD thesaurierend</b>					
Zurückgenommen	-99	-15			
Nettoabnahme	-99	-15			
<b>Klasse LM EUR thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	3	4			
Zurückgenommen	-	-1			
Nettozunahme	3	3			
<b>FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup></b>					
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	32	60			
Zurückgenommen	-726	-1.371			
Nettoabnahme	-694	-1.311			
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)</b>					
Verkauft	6	63			
Zurückgenommen	-152	-364			
Nettoabnahme	-146	-301			
<b>Klasse A USD ausschüttend (S)</b>					
Verkauft	5	20			
Zurückgenommen	-39	-106			
Nettoabnahme	-34	-86			
<b>Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	9	1			
Zurückgenommen	-2	-			
Nettozunahme	7	1			
<b>Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>					
Verkauft	2	-			
Zurückgenommen	-51	-67			
Nettoabnahme	-49	-67			
<b>Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Zurückgenommen	-10	-54			
Nettoabnahme	-10	-54			
<b>Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>					
Zurückgenommen	-86	-61			
Nettoabnahme	-86	-61			
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	186	351			
Zurückgenommen	-316	-1.721			
Nettoabnahme	-130	-1.370			
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (A)</b>					
Verkauft	3	-			
Zurückgenommen	-8	-11			
Nettoabnahme	-5	-11			
<b>Klasse A EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>					
Zurückgenommen	-18	-9			
Nettoabnahme	-18	-9			
<b>Klasse A EUR ausschüttend (S) (abgesichert)</b>					
Verkauft	1	8			
Zurückgenommen	-5	-3			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-4	5			
<b>Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	1	-			
Zurückgenommen	-9	-90			
Nettoabnahme	-8	-90			
<b>Klasse A GBP thesaurierend</b>					
Zurückgenommen	-1	-1			
Nettoabnahme	-1	-1			
<b>Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>					
Verkauft	-	1			
Zurückgenommen	-36	-7			
Nettoabnahme	-36	-6			
<b>Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus</b>					
Zurückgenommen	-7	-			
Nettoabnahme	-7	-			
<b>Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	4	11			
Zurückgenommen	-12	-57			
Nettoabnahme	-8	-46			
<b>Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	3.504	-			
Zurückgenommen	-4.937	-12.305			
Nettoabnahme	-1.433	-12.305			
<b>Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>					
Verkauft	225	893			
Zurückgenommen	-6.314	-11.870			
Nettoabnahme	-6.089	-10.977			
<b>Klasse B USD, thesaurierend</b>					
Zurückgenommen	-1	-			
Nettoabnahme	-1	-			
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>					
Zurückgenommen	-35	-61			
Nettoabnahme	-35	-61			
<b>Klasse C USD ausschüttend (S)</b>					
Verkauft	1	-			
Zurückgenommen	-4	-10			
Nettoabnahme	-3	-10			
<b>Klasse A NOK, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	111	254			
Zurückgenommen	-439	-121			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-328	133			
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>					
Zurückgenommen	-22	-20			
Nettoabnahme	-22	-20			
<b>Klasse E USD ausschüttend (S)</b>					
Zurückgenommen	-2	-5			
Nettoabnahme	-2	-5			
<b>Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	2	-			
Zurückgenommen	-3	-8			
Nettoabnahme	-1	-8			
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	9	61			
Zurückgenommen	-84	-204			
Nettoabnahme	-75	-143			
<b>Klasse F USD ausschüttend (S)</b>					
Verkauft	7	3			
Zurückgenommen	-12	-30			
Nettoabnahme	-5	-27			
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	22	3			
Zurückgenommen	-150	-551			
Nettoabnahme	-128	-548			
<b>Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)</b>					
Verkauft	-	2			
Zurückgenommen	-122	-125			
Nettoabnahme	-122	-123			
<b>Klasse X USD ausschüttend (S)</b>					
Verkauft	-	1			
Zurückgenommen	-17	-60			
Nettoabnahme	-17	-59			
<b>Klasse X CHF thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	2	7			
Zurückgenommen	-13	-71			
Nettoabnahme	-11	-64			
<b>Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	142	1.408			
Zurückgenommen	-95	-622			
Nettozunahme	47	786			
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>					
Zurückgenommen	-1	-14			
Nettoabnahme	-1	-14			
<b>Klasse X EUR ausschüttend (A) (abgesichert)</b>					
Verkauft	1	7			
Zurückgenommen	-79	-18			
Nettoabnahme	-78	-11			
<b>Klasse X EUR ausschüttend M (abgesichert)</b>					
Zurückgenommen	-23	-31			
Nettoabnahme	-23	-31			
<b>Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	2	25			
Zurückgenommen	-58	-138			
Nettoabnahme	-56	-113			
<b>Klasse X GBP thesaurierend</b>					
Zurückgenommen	-	-3			
Nettoabnahme	-	-3			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)
<b>FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	–	1		
Zurückgenommen	-6	-21		
Nettoabnahme	-6	-20		
<b>Klasse X SGD thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	266	930		
Zurückgenommen	-1.768	-1.063		
Nettoabnahme	-1.502	-133		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	30	52		
Zurückgenommen	-507	-934		
Nettoabnahme	-477	-882		
<b>Klasse Premier USD ausschüttend (S)</b>				
Verkauft	6	1		
Zurückgenommen	-15	-218		
Nettoabnahme	-9	-217		
<b>Klasse Premier AUD thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	1		
Zurückgenommen	–	-16		
Nettoabnahme	–	-15		
<b>Klasse Premier AUD ausschüttend (S) (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	10		
Zurückgenommen	-16	-548		
Nettoabnahme	-16	-538		
<b>Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	19	92		
Zurückgenommen	-253	-1.998		
Nettoabnahme	-234	-1.906		
<b>Klasse Premier CHF thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	-5	-81		
Nettoabnahme	-5	-81		
<b>Klasse Premier CHF ausschüttend (S) (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	–	-11		
Nettoabnahme	–	-11		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	134	1.114		
Zurückgenommen	-2.327	-2.581		
Nettoabnahme	-2.193	-1.467		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	11		
Zurückgenommen	-131	-34		
Nettoabnahme	-131	-23		
<b>Klasse Premier EUR ausschüttend (S) (abgesichert)</b>				
Verkauft	197	1		
Zurückgenommen	-258	-97		
Nettoabnahme	-61	-96		
<b>Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	5	12		
Zurückgenommen	-13	-482		
Nettoabnahme	-8	-470		
<b>Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	4	7		
Zurückgenommen	-20	-1.018		
Nettoabnahme	-16	-1.011		
<b>Klasse Premier JPY thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	99		
Zurückgenommen	-15	-156		
Nettoabnahme	-15	-57		
<b>Klasse Premier JPY ausschüttend (S) (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	–	-100		
Nettoabnahme	–	-100		
<b>Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	16		
Zurückgenommen	-3	-31		
Nettoabnahme	-3	-15		
<b>Klasse Premier SEK thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	–	-1		
Nettoabnahme	–	-1		
<b>Klasse S USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	8	–		
Zurückgenommen	–	-26		
Nettozunahme/-abnahme	8	-26		
<b>Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	4	–		
Zurückgenommen	-1.209	-9		
Nettoabnahme	-1.205	-9		
<b>Klasse LM AUD ausschüttend (S) (abgesichert)</b>				
Verkauft	13	31		
Zurückgenommen	-108	-565		
Nettoabnahme	-95	-534		
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	1		
Zurückgenommen	-3	-1		
Nettoabnahme	-3	–		
<b>FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup></b>				
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	19		
Zurückgenommen	–	-15		
Nettozunahme	–	4		
<b>Premier Class GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)</b>				
Zurückgenommen	-2	-3		
Nettoabnahme	-2	-3		
<b>Klasse S USD thesaurierend</b>				
Verkauft	–	1		
Zurückgenommen	-1	-1		
Nettoabnahme	-1	–		
<b>Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	9	35		
Zurückgenommen	-8	-28		
Nettozunahme	1	7		
<b>Klasse S GBP thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	27	21		
Zurückgenommen	-16	-10		
Nettozunahme	11	11		
<b>Klasse LM AUD thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	–	-1.230		
Nettoabnahme	–	-1.230		
<b>Klasse LM EUR thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	164	21		
Zurückgenommen	-79	-14		
Nettozunahme	85	7		
<b>Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	20	43		
Zurückgenommen	-103	-22		
Nettozunahme/-abnahme	-83	21		
<b>Klasse LM CAD thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	264		
Zurückgenommen	-30	-4		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-30	260		
<b>Klasse S CHF ausschüttend (A) (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	20		
Nettozunahme	–	20		
<b>FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup></b>				
<b>Klasse D USD thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-98	-7		
Nettoabnahme	-98	-7		
<b>Klasse D USD ausschüttend (M)</b>				
Zurückgenommen	-5	–		
Nettoabnahme	-5	–		
<b>Klasse M CHF thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	–	-10		
Nettoabnahme	–	-10		
<b>Klasse M USD ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	1	–		
Nettozunahme	1	–		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	62		
Zurückgenommen	-11	-1.316		
Nettoabnahme	-10	-1.254		
<b>Klasse Premier USD ausschüttend (Q)</b>				
Zurückgenommen	-10	–		
Nettoabnahme	-10	–		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



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

	Für den Berichtszeitraum zum			Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)		31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)
<b>FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)</b>					
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	1	5			
Zurückgenommen	-3	-1.030			
Nettoabnahme	-2	-1.025			
<b>Klasse Premier EUR ausschüttend (Q) (abgesichert)</b>					
Verkauft	-	3			
Zurückgenommen	-5	-175			
Nettoabnahme	-5	-172			
<b>Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>					
Zurückgenommen	-1	-105			
Nettoabnahme	-1	-105			
<b>Klasse Premier JPY thesaurierend (abgesichert)</b>					
Zurückgenommen	-500	-			
Nettoabnahme	-500	-			
<b>Klasse LM USD, thesaurierend</b>					
Zurückgenommen	-	-209			
Nettoabnahme	-	-209			
<b>FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup></b>					
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	30	420			
Nettozunahme	30	420			
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	-	19			
Zurückgenommen	-	-3			
Nettozunahme	-	16			
<b>FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup></b>					
<b>Klasse LM GBP, thesaurierend</b>					
Zurückgenommen	-	-637			
Nettoabnahme	-	-637			
<b>Klasse LM GBP ausschüttend (M)</b>					
Verkauft	-	695			
Nettozunahme	-	695			
<b>FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund</b>					
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	-	5			
Zurückgenommen	-6	-2			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-6	3			
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	-	31			
Zurückgenommen	-	-3			
Nettozunahme	-	28			
<b>Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)</b>					
Zurückgenommen	-	-951			
Nettoabnahme	-	-951			
<b>Klasse LM GBP ausschüttend (M) (abgesichert)</b>					
Verkauft	-	1.065			
Zurückgenommen	-352	-			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-352	1.065			
<b>Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup></b>					
<b>Klasse LM USD, ausschüttend (Q)</b>					
Verkauft	9	7			
Zurückgenommen	-2	-4			
Nettozunahme	7	3			
<b>FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup></b>					
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>					
Zurückgenommen	-1	-			
Nettoabnahme	-1	-			
<b>Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Zurückgenommen	-1	-1			
Nettoabnahme	-1	-1			
<b>FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund</b>					
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	8	2			
Zurückgenommen	-18	-5			
Nettoabnahme	-10	-3			
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M)</b>					
Verkauft			8	1	
Zurückgenommen			-7	-6	
Nettozunahme/-abnahme			1	-5	
<b>Klasse A USD ausschüttend (S)</b>					
Verkauft			8	12	
Zurückgenommen			-4	-11	
Nettozunahme			4	1	
<b>Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>					
Zurückgenommen			-5	-	
Nettoabnahme			-5	-	
<b>Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert) (IH)</b>					
Verkauft			4	1	
Zurückgenommen			-8	-24	
Nettoabnahme			-4	-23	
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft			-	2	
Zurückgenommen			-2	-3	
Nettoabnahme			-2	-1	
<b>Klasse A EUR ausschüttend (A) (abgesichert)</b>					
Zurückgenommen			-2	-2	
Nettoabnahme			-2	-2	
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)</b>					
Verkauft			1	1	
Zurückgenommen			-4	-3	
Nettoabnahme			-3	-2	
<b>Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert)</b>					
Zurückgenommen			-1	-	
Nettoabnahme			-1	-	
<b>Klasse A GBP ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)</b>					
Zurückgenommen			-2	-2	
Nettoabnahme			-2	-2	
<b>Klasse A SGD thesaurierend</b>					
Verkauft			1.831	2	
Zurückgenommen			-1.827	-	
Nettozunahme			4	2	
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>					
Zurückgenommen			-1	-1	
Nettoabnahme			-1	-1	
<b>Klasse C USD ausschüttend (S)</b>					
Zurückgenommen			-	-1	
Nettoabnahme			-	-1	
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>					
Verkauft			2	-	
Zurückgenommen			-1	-	
Nettozunahme			1	-	
<b>Klasse E EUR thesaurierend (abgesichert) (IH)</b>					
Zurückgenommen			-	-1	
Nettoabnahme			-	-1	
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>					
Verkauft			-	1	
Zurückgenommen			-	-2	
Nettoabnahme			-	-1	
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>					
Verkauft			-	59	
Zurückgenommen			-	-4	
Nettozunahme			-	55	
<b>Klasse X USD ausschüttend (S)</b>					
Zurückgenommen			-	-2	
Nettoabnahme			-	-2	
<b>Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert) (IH)</b>					
Zurückgenommen			-	-8	
Nettoabnahme			-	-8	
<b>Klasse X EUR ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)</b>					
Zurückgenommen			-	-4	
Nettoabnahme			-	-4	
<b>Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert) (IH)</b>					
Zurückgenommen			-	-1	
Nettoabnahme			-	-1	
<b>Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft			9	12	
Zurückgenommen			-18	-34	
Nettoabnahme			-9	-22	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)
<b>FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse X GBP thesaurierend</b>				
Verkauft	15	105		
Zurückgenommen	-36	-61		
Nettozunahme/-abnahme	-21	44		
<b>Klasse X GBP ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)</b>				
Verkauft	4	3		
Zurückgenommen	-5	-8		
Nettoabnahme	-1	-5		
<b>Klasse X GBP ausschüttend (S) (abgesichert)</b>				
Verkauft	5	9		
Zurückgenommen	-11	-22		
Nettoabnahme	-6	-13		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	6	–		
Zurückgenommen	-8	-2		
Nettoabnahme	-2	-2		
<b>Klasse Premier USD ausschüttend (S)</b>				
Zurückgenommen	-1	-9		
Nettoabnahme	-1	-9		
<b>Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert) (IH)</b>				
Verkauft	2	1		
Zurückgenommen	-5	-51		
Nettoabnahme	-3	-50		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	1		
Zurückgenommen	-3	-4		
Nettoabnahme	-3	-3		
<b>Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	–	-1		
Nettoabnahme	–	-1		
<b>Klasse Premier GBP ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)</b>				
Zurückgenommen	–	-4		
Nettoabnahme	–	-4		
<b>Klasse LM USD thesaurierend (abgesichert) (IH)</b>				
Verkauft	22	103		
Zurückgenommen	-31	-18		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-9	85		
<b>Klasse LM USD thesaurierend</b>				
Verkauft	1	2		
Zurückgenommen	-2	-1		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	1		
<b>FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup></b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-1	–		
Nettoabnahme	-1	–		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	–	-2		
Nettoabnahme	–	-2		
<b>Klasse A SGD thesaurierend</b>				
Verkauft	3.319	3.936		
Zurückgenommen	-3.260	-3.936		
Nettozunahme	59	–		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	5	–		
Nettozunahme	5	–		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-1	–		
Nettoabnahme	-1	–		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-5	–		
Nettoabnahme	-5	–		
<b>Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	–	-4		
Nettoabnahme	–	-4		
<b>Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	3		
Zurückgenommen	-3	–		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-3	3		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	34	63		
Zurückgenommen	-892	-38		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-858	25		
<b>Klasse Premier USD ausschüttend (A)</b>				
Zurückgenommen	-2	–		
Nettoabnahme	-2	–		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	2	–		
Zurückgenommen	-286	–		
Nettoabnahme	-284	–		
<b>Klasse Premier EUR ausschüttend (A) (abgesichert)</b>				
Verkauft	11	7		
Nettozunahme	11	7		
<b>Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Verkauft	109	–		
Zurückgenommen	-83	–		
Nettozunahme	26	–		
<b>Klasse LM AUD thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	-1.698	-1.443		
Nettoabnahme	-1.698	-1.443		
<b>FTGF Brandywine Global High Yield Fund<sup>^</sup></b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	4	–		
Zurückgenommen	-1	–		
Nettozunahme	3	–		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	32	–		
Nettozunahme	32	–		
<b>Klasse S Euro, ausschüttend (A) (abgesichert) (IH)</b>				
Verkauft	73	–		
Nettozunahme	73	–		
<b>FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	24	3		
Zurückgenommen	-9	-5		
Nettozunahme/(-abnahme)	15	-2		
<b>Klasse A SGD thesaurierend</b>				
Verkauft	6.710	3		
Zurückgenommen	-6.672	-34		
Nettozunahme/-abnahme	38	-31		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	–	-9		
Nettoabnahme	–	-9		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-2	-2		
Nettoabnahme	-2	-2		
<b>Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)</b>				
Zurückgenommen	-2	–		
Nettoabnahme	-2	–		
<b>Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	-2	–		
Nettoabnahme	-2	–		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	171	5		
Zurückgenommen	-140	-54		
Nettozunahme/-abnahme	31	-49		
<b>Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)</b>				
Verkauft	1	1		
Nettozunahme	1	1		
<b>Klasse Premier NZD thesaurierend (abgesichert) (IH)</b>				
Verkauft	–	3		
Nettozunahme	–	3		
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-19	-2		
Nettoabnahme	-19	-2		
<b>Klasse LM NZD thesaurierend (abgesichert) (IH)</b>				
Verkauft	5	2		
Zurückgenommen	-28	-6		
Nettoabnahme	-23	-4		
<b>FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	187	74		
Zurückgenommen	-154	-274		
Nettozunahme/-abnahme	33	-200		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum			Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)		31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)
<b>FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – (Fortsetzung)</b>					
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>					
Verkauft	1	5			
Zurückgenommen	-5	-7			
Nettoabnahme	-4	-2			
<b>Klasse A USD, ausschüttend (D)</b>					
Verkauft	19	7			
Zurückgenommen	-20	-112			
Nettoabnahme	-1	-105			
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)</b>					
Verkauft	57	54			
Zurückgenommen	-186	-354			
Nettoabnahme	-129	-300			
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>					
Verkauft	7	11			
Zurückgenommen	-59	-211			
Nettoabnahme	-52	-200			
<b>Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Zurückgenommen	-	-2			
Nettoabnahme	-	-2			
<b>Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>					
Verkauft	27	-			
Zurückgenommen	-6	-14			
Nettozunahme/(-abnahme)	21	-14			
<b>Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>					
Verkauft	56	3			
Zurückgenommen	-	-11			
Nettozunahme/-abnahme	56	-8			
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	139	75			
Zurückgenommen	-40	-157			
Nettozunahme/-abnahme	99	-82			
<b>Klasse A EUR ausschüttend (A) (abgesichert)</b>					
Verkauft	23	32			
Zurückgenommen	-24	-15			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	17			
<b>Klasse A EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>					
Verkauft	28	44			
Zurückgenommen	-49	-31			
Nettozunahme/-abnahme	-21	13			
<b>Klasse A EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>					
Verkauft	1	1			
Zurückgenommen	-	-4			
Nettozunahme/-abnahme	1	-3			
<b>Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>					
Verkauft	7	1			
Zurückgenommen	-9	-8			
Nettoabnahme	-2	-7			
<b>Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>					
Verkauft	2	5			
Zurückgenommen	-1	-6			
Nettozunahme/-abnahme	1	-1			
<b>Klasse A HKD, thesaurierend</b>					
Verkauft	9	1			
Zurückgenommen	-6	-14			
Nettozunahme/(-abnahme)	3	-13			
<b>Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus</b>					
Verkauft	48	15			
Zurückgenommen	-44	-478			
Nettozunahme/-abnahme	4	-463			
<b>Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>					
Verkauft	5.024	45.934			
Zurückgenommen	-5.277	-7.819			
Nettozunahme/-abnahme	-253	38.115			
<b>Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>					
Verkauft	1.350	2.040			
Zurückgenommen	-1.746	-5.580			
Nettoabnahme	-396	-3.540			
<b>Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus</b>					
Verkauft	32	140			
Zurückgenommen	-1.520	-1.092			
Nettoabnahme	-1.488	-952			
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	48	3			
Zurückgenommen	-47	-130			
Nettozunahme/-abnahme	1	-127			
<b>Klasse C USD, ausschüttend (D)</b>					
Verkauft			3	101	
Zurückgenommen			-2	-2	
Nettozunahme			1	99	
<b>Klasse A CZK, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft			-	1	
Nettozunahme			-	1	
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>					
Verkauft			54	10	
Zurückgenommen			-15	-21	
Nettozunahme/(-abnahme)			39	-11	
<b>Klasse E USD, ausschüttend (D)</b>					
Verkauft			2	-	
Zurückgenommen			-1	-2	
Nettozunahme/(-abnahme)			1	-2	
<b>Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft			7	4	
Zurückgenommen			-2	-7	
Nettozunahme/(-abnahme)			5	-3	
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>					
Verkauft			18	30	
Zurückgenommen			-21	-168	
Nettoabnahme			-3	-138	
<b>Klasse F USD ausschüttend (D)</b>					
Verkauft			4	4	
Zurückgenommen			-5	-14	
Nettoabnahme			-1	-10	
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>					
Verkauft			12	3	
Zurückgenommen			-58	-12	
Nettoabnahme			-46	-9	
<b>Klasse X USD ausschüttend (D)</b>					
Zurückgenommen			-2	-1	
Nettoabnahme			-2	-1	
<b>Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)</b>					
Verkauft			-	10	
Zurückgenommen			-16	-52	
Nettoabnahme			-16	-42	
<b>Klasse X CHF thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft			-	1	
Zurückgenommen			-1	-6	
Nettoabnahme			-1	-5	
<b>Klasse X CHF ausschüttend (A) (abgesichert)</b>					
Zurückgenommen			-5	-20	
Nettoabnahme			-5	-20	
<b>Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft			5	29	
Zurückgenommen			-77	-199	
Nettoabnahme			-72	-170	
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>					
Verkauft			1	-	
Nettozunahme			1	-	
<b>Klasse X EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>					
Verkauft			4	4	
Zurückgenommen			-47	-19	
Nettoabnahme			-43	-15	
<b>Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>					
Verkauft			-	1	
Zurückgenommen			-11	-11	
Nettoabnahme			-11	-10	
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>					
Verkauft			295	70	
Zurückgenommen			-104	-336	
Nettozunahme/-abnahme			191	-266	
<b>Klasse Premier USD ausschüttend (M) Plus (e)</b>					
Verkauft			6	4	
Zurückgenommen			-	-57	
Nettozunahme/(-abnahme)			6	-53	
<b>Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft			-	4	
Zurückgenommen			-5	-	
Netto-(Abgang)/-Zugang			-5	4	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)
<b>FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	108	142	-	104
Zurückgenommen	-143	-341	-	-5.710
Nettoabnahme	-35	-199	-	-5.606
<b>Klasse Premier EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	31	76	-	-237
Zurückgenommen	-107	-132	-	-237
Nettoabnahme	-76	-56	-	-
<b>Klasse Premier GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	5	-	-	-
Zurückgenommen	-58	-14	-	-
Nettoabnahme	-53	-14	-	-
<b>Klasse Premier SEK thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	53	1	-	-
Zurückgenommen	-15	-38	-	-
Nettozunahme/-abnahme	38	-37	-	-
<b>Klasse S USD thesaurierend</b>				
Verkauft	-	193	-	-
Zurückgenommen	-104	-1.031	-	-
Nettoabnahme	-104	-838	-	-
<b>Klasse S USD ausschüttend (Q) Plus (e)</b>				
Zurückgenommen	-1	-	-	-
Nettoabnahme	-1	-	-	-
<b>Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	30	158	-	-
Zurückgenommen	-64	-235	-	-
Nettoabnahme	-34	-77	-	-
<b>Klasse S EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	-	5	-	-
Zurückgenommen	-8	-2	-	-
Netto-(Abgang)/-Zugang	-8	3	-	-
<b>Klasse S GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	-	2	-	-
Zurückgenommen	-1	-12	-	-
Nettoabnahme	-1	-10	-	-
<b>Klasse LM USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	34	100	-	-
Nettozunahme	34	100	-	-
<b>Klasse LM USD, ausschüttend (M)</b>				
Verkauft	2	8	-	-
Zurückgenommen	-12	-8	-	-
Nettoabnahme	-10	-	-	-
<b>Klasse LM EUR ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	104	910	-	-
Zurückgenommen	-281	-6	-	-
Netto-(Abgang)/-Zugang	-177	904	-	-
<b>Klasse LM GBP thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	10	25	-	-
Zurückgenommen	-29	-106	-	-
Nettoabnahme	-19	-81	-	-
<b>FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>α</sup></b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-105	-	-	-
Nettoabnahme	-105	-	-	-
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	20	12	-	-
Zurückgenommen	-25	-13	-	-
Nettoabnahme	-5	-1	-	-
<b>FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>α</sup></b>				
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)</b>				
Zurückgenommen	-1	-	-	-
Nettoabnahme	-1	-	-	-
<b>Klasse S Euro, ausschüttend (A) (abgesichert) (IH)</b>				
Zurückgenommen	-100	-	-	-
Nettoabnahme	-100	-	-	-
<b>FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>α</sup></b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	-	1	-	-
Nettozunahme	-	1	-	-
<b>Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	-	104	-	104
Zurückgenommen	-	-5.710	-	-5.710
Nettoabnahme	-	-5.606	-	-5.606
<b>Klasse LM AUD thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	-	-237	-	-237
Nettoabnahme	-	-237	-	-237
<b>FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>α</sup></b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-3	-	-	-
Nettoabnahme	-3	-	-	-
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-3	-	-	-
Nettoabnahme	-3	-	-	-
<b>Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	-7	-	-	-
Nettoabnahme	-7	-	-	-
<b>FTGF ClearBridge Value Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	49	141	-	-
Zurückgenommen	-125	-102	-	-
Nettozunahme/-abnahme	-76	39	-	-
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	9	9	-	-
Zurückgenommen	-18	-8	-	-
Netto-(Abgang)/-Zugang	-9	1	-	-
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	2	29	-	-
Zurückgenommen	-23	-29	-	-
Nettoabnahme	-21	-	-	-
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	36	28	-	-
Zurückgenommen	-26	-23	-	-
Nettozunahme	10	5	-	-
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	-1	-	-	-
Nettoabnahme	-1	-	-	-
<b>Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	169	124	-	-
Zurückgenommen	-344	-525	-	-
Nettoabnahme	-175	-401	-	-
<b>Klasse A SGD thesaurierend</b>				
Verkauft	845	581	-	-
Zurückgenommen	-281	-488	-	-
Nettozunahme	564	93	-	-
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	2	22	-	-
Zurückgenommen	-19	-3	-	-
Netto-(Abgang)/-Zugang	-17	19	-	-
<b>Klasse C USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	-	2	-	-
Nettozunahme	-	2	-	-
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	14	-	-
Zurückgenommen	-11	-	-	-
Netto-(Abgang)/-Zugang	-10	14	-	-
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	7	26	-	-
Zurückgenommen	-22	-25	-	-
Netto-(Abgang)/-Zugang	-15	1	-	-
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	-	4	-	-
Zurückgenommen	-	-3	-	-
Nettozunahme	-	1	-	-
<b>Klasse X USD ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	19	19	-	-
Zurückgenommen	-	-75	-	-
Nettozunahme/-abnahme	19	-56	-	-
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	7	72	-	-
Zurückgenommen	-26	-46	-	-
Nettozunahme/-abnahme	-19	26	-	-

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)
<b>FTGF ClearBridge Value Fonds – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	184	281		
Zurückgenommen	-177	-70		
Nettozunahme	7	211		
<b>Klasse Premier USD ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	–	10		
Zurückgenommen	-10	–		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-10	10		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	651	159		
Zurückgenommen	-247	-45		
Nettozunahme	404	114		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	119	83		
Zurückgenommen	-276	-82		
Nettozunahme/-abnahme	-157	1		
<b>Klasse LM USD ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	2	5		
Zurückgenommen	-18	-31		
Nettoabnahme	-16	-26		
<b>FTGF ClearBridge US Appreciation Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	7	7		
Zurückgenommen	-18	-12		
Nettoabnahme	-11	-5		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	–	1		
Zurückgenommen	-4	-7		
Nettoabnahme	-4	-6		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	2	–		
Zurückgenommen	-1	–		
Nettozunahme	1	–		
<b>Klasse B USD, ausschüttend (A)</b>				
Zurückgenommen	–	-1		
Nettoabnahme	–	-1		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	1		
Zurückgenommen	-1	-2		
Nettoabnahme	-1	-1		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (A)</b>				
Zurückgenommen	-1	-2		
Nettoabnahme	-1	-2		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	1		
Zurückgenommen	-11	-5		
Nettoabnahme	-10	-4		
<b>Klasse E USD, ausschüttend (A)</b>				
Zurückgenommen	-1	–		
Nettoabnahme	-1	–		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	4	7		
Zurückgenommen	-24	-14		
Nettoabnahme	-20	-7		
<b>Klasse F USD ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	1	1		
Zurückgenommen	-2	–		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	1		
<b>Klasse X USD ausschüttend (A)</b>				
Zurückgenommen	-2	–		
Nettoabnahme	-2	–		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	5	–		
Zurückgenommen	-6	-21		
Nettoabnahme	-1	-21		
<b>Klasse Premier USD ausschüttend (A)</b>				
Zurückgenommen	-1	-3		
Nettoabnahme	-1	-3		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	18	18		
Zurückgenommen	-13	-2		
Nettozunahme	5	16		
<b>Klasse LM USD thesaurierend</b>				
Verkauft	–	6		
Zurückgenommen	-15	–		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-15	6		
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-4	–		
Nettoabnahme	-4	–		
<b>Klasse A (G) USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-1	–		
Nettoabnahme	-1	–		
<b>FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	55	54		
Zurückgenommen	-83	-75		
Nettoabnahme	-28	-21		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	4	7		
Zurückgenommen	-5	-7		
Nettoabnahme	-1	–		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	14	17		
Zurückgenommen	-9	-18		
Nettozunahme/(-abnahme)	5	-1		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	9	11		
Zurückgenommen	-11	-36		
Nettoabnahme	-2	-25		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	2		
Zurückgenommen	-7	-4		
Nettoabnahme	-7	-2		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (A)</b>				
Zurückgenommen	-2	-1		
Nettoabnahme	-2	-1		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	3	4		
Zurückgenommen	-6	-7		
Nettoabnahme	-3	-3		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	48	101		
Zurückgenommen	-140	-121		
Nettoabnahme	-92	-20		
<b>Klasse F USD ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	15	2		
Zurückgenommen	-14	-32		
Nettozunahme/-abnahme	1	-30		
<b>Klasse U USD thesaurierend</b>				
Verkauft	174	291		
Zurückgenommen	-340	-413		
Nettoabnahme	-166	-122		
<b>Klasse U EUR thesaurierend</b>				
Verkauft	289	19		
Zurückgenommen	-9	-137		
Nettozunahme/-abnahme	280	-118		
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	18	19		
Zurückgenommen	-30	-32		
Nettoabnahme	-12	-13		
<b>Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	6	1		
Zurückgenommen	-4	-12		
Nettozunahme/(-abnahme)	2	-11		
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	7	1		
Zurückgenommen	-2	-1		
Nettozunahme	5	–		
<b>Klasse X GBP, thesaurierend</b>				
Verkauft	18	8		
Zurückgenommen	-10	-7		
Nettozunahme	8	1		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	416	250		
Zurückgenommen	-237	-607		
Nettozunahme/-abnahme	179	-357		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)
<b>FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse Premier USD ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	1	11		
Zurückgenommen	-9	-5		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-8	6		
<b>Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	-228	-492		
Nettoabnahme	-228	-492		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	263	14		
Zurückgenommen	-107	-34		
Nettozunahme/-abnahme	156	-20		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	14	11		
Zurückgenommen	-36	-99		
Nettoabnahme	-22	-88		
<b>Klasse Premier EUR ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	1	4		
Zurückgenommen	-2	-		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	4		
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend</b>				
Verkauft	88	27		
Zurückgenommen	-52	-68		
Nettozunahme/-abnahme	36	-41		
<b>Klasse LM USD thesaurierend</b>				
Verkauft	31	89		
Zurückgenommen	-193	-38		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-162	51		
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-1	-		
Nettoabnahme	-1	-		
<b>Klasse A (G) USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-1	-1		
Nettoabnahme	-1	-1		
<b>FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	7	7		
Zurückgenommen	-44	-32		
Nettoabnahme	-37	-25		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	-	1		
Zurückgenommen	-9	-4		
Nettoabnahme	-9	-3		
<b>Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	3	2		
Zurückgenommen	-11	-3		
Nettoabnahme	-8	-1		
<b>Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	54	2		
Zurückgenommen	-71	-		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-17	2		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	1		
Zurückgenommen	-2	-1		
Nettoabnahme	-1	-		
<b>Klasse A HKD thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-4	-2		
Nettoabnahme	-4	-2		
<b>Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	3	1		
Zurückgenommen	-3	-1		
Nettozunahme	-	-		
<b>Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	2.871	54		
Zurückgenommen	-73	-352		
Nettozunahme/-abnahme	2.798	-298		
<b>Klasse B USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-	-1		
Nettoabnahme	-	-1		
<b>Klasse B USD, ausschüttend (A)</b>				
Zurückgenommen	-	-1		
Nettoabnahme	-	-1		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-	-3		
Nettoabnahme	-	-3		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (A)</b>				
Zurückgenommen	-4	-8		
Nettoabnahme	-4	-8		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-6	-20		
Nettoabnahme	-6	-20		
<b>Klasse E USD, ausschüttend (A)</b>				
Zurückgenommen	-2	-		
Nettoabnahme	-2	-		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	2		
Zurückgenommen	-5	-3		
Nettoabnahme	-4	-1		
<b>Klasse F USD ausschüttend (A)</b>				
Zurückgenommen	-4	-1		
Nettoabnahme	-4	-1		
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-2	-2		
Nettoabnahme	-2	-2		
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-3	-2		
Nettoabnahme	-3	-2		
<b>Klasse X GBP thesaurierend</b>				
Verkauft	1	1		
Zurückgenommen	-4	-12		
Nettoabnahme	-3	-11		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	2	1		
Zurückgenommen	-6	-79		
Nettoabnahme	-4	-78		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	1	-		
Nettozunahme	1	-		
<b>Klasse Premier GBP ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	1	2		
Zurückgenommen	-29	-27		
Nettoabnahme	-28	-25		
<b>Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	-	-33		
Nettoabnahme	-	-33		
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-2	-		
Nettoabnahme	-2	-		
<b>Klasse A (G) USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-4	-3		
Nettoabnahme	-4	-3		
<b>Klasse L (G) USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-2	-1		
Nettoabnahme	-2	-1		
<b>FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	3	10		
Zurückgenommen	-18	-2		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-15	8		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)</b>				
Zurückgenommen	-1	-		
Nettoabnahme	-1	-		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	2	8		
Zurückgenommen	-5	-2		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-3	6		
<b>Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	-	2		
Zurückgenommen	-3	-1		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-3	1		
<b>Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Zurückgenommen	-1	-3		
Nettoabnahme	-1	-3		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses



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

	Für den Berichtszeitraum zum			Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)		31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)
<b>FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – (Fortsetzung)</b>					
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Zurückgenommen	-1	-			
Nettoabnahme	-1	-			
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)</b>					
Zurückgenommen	-4	-			
Nettoabnahme	-4	-			
<b>Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus</b>					
Verkauft	-	3			
Zurückgenommen	-3	-24			
Nettoabnahme	-3	-21			
<b>Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>					
Verkauft	306	1.297			
Zurückgenommen	-955	-17			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-649	1.280			
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>					
Zurückgenommen	-1	-1			
Nettoabnahme	-1	-1			
<b>Klasse C USD, ausschüttend (A)</b>					
Zurückgenommen	-	-1			
Nettoabnahme	-	-1			
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	-	1			
Zurückgenommen	-12	-6			
Nettoabnahme	-12	-5			
<b>FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund</b>					
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	28	58			
Zurückgenommen	-29	-28			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	30			
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>					
Verkauft	14	13			
Zurückgenommen	-11	-15			
Nettozunahme/-abnahme	3	-2			
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	11	43			
Zurückgenommen	-23	-136			
Nettoabnahme	-12	-93			
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>					
Verkauft	7	-			
Zurückgenommen	-5	-			
Nettozunahme	2	-			
<b>Klasse A SEK, thesaurierend</b>					
Verkauft	41	58			
Zurückgenommen	-222	-188			
Nettoabnahme	-181	-130			
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	-	1			
Zurückgenommen	-1	-			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	1			
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	3	9			
Zurückgenommen	-7	-94			
Nettoabnahme	-4	-85			
<b>Klasse X USD ausschüttend (A)</b>					
Verkauft	-	2			
Zurückgenommen	-1	-3			
Nettoabnahme	-1	-1			
<b>Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	15	1			
Zurückgenommen	-3	-2			
Nettozunahme/(-abnahme)	12	-1			
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>					
Verkauft	52	-			
Zurückgenommen	-3	-			
Nettozunahme	49	-			
<b>Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	1	4			
Zurückgenommen	-10	-4			
Nettoabnahme	-9	-			
<b>Klasse X GBP thesaurierend</b>					
Verkauft	415	829			
Zurückgenommen	-641	-226			
Nettozunahme/-abnahme	-226	603			
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	69	226			
Zurückgenommen	-93	-432			
Nettoabnahme	-24	-206			
<b>Klasse Premier USD ausschüttend (A)</b>					
Verkauft	-	8			
Zurückgenommen	-3	-			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-3	8			
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	1	7			
Zurückgenommen	-6	-2			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-5	5			
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend</b>					
Verkauft	55	63			
Zurückgenommen	-17	-47			
Nettozunahme	38	16			
<b>Klasse S USD thesaurierend</b>					
Verkauft	504	1.096			
Zurückgenommen	-550	-876			
Nettozunahme/-abnahme	-46	220			
<b>Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	3	2			
Zurückgenommen	-2	-42			
Nettozunahme/(-abnahme)	1	-40			
<b>Klasse S EUR thesaurierend</b>					
Verkauft	86	-			
Zurückgenommen	-3	-			
Nettozunahme	83	-			
<b>Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	21	33			
Zurückgenommen	-63	-16			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-42	17			
<b>Klasse S GBP thesaurierend</b>					
Verkauft	86	172			
Zurückgenommen	-376	-185			
Nettoabnahme	-290	-13			
<b>Klasse S GBP ausschüttend (Q)</b>					
Verkauft	13	14			
Zurückgenommen	-8	-10			
Nettozunahme	5	4			
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend</b>					
Verkauft	24	84			
Zurückgenommen	-15	-2			
Nettozunahme	9	82			
<b>FTGF ClearBridge Global Growth Fund^</b>					
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	7	1			
Zurückgenommen	-5	-12			
Nettozunahme/(-abnahme)	2	-11			
<b>FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^</b>					
<b>Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	700	6.788			
Zurückgenommen	-1.416	-4.737			
Nettozunahme/-abnahme	-716	2.051			
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	120	1.108			
Zurückgenommen	-1.103	-1.859			
Nettoabnahme	-983	-751			
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>					
Verkauft	697	2.195			
Zurückgenommen	-881	-2.706			
Nettoabnahme	-184	-511			
<b>Klasse A USD, ausschüttend (Q)</b>					
Verkauft	19	61			
Zurückgenommen	-20	-73			
Nettoabnahme	-1	-12			
<b>Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>					
Verkauft	117	314			
Zurückgenommen	-60	-751			
Nettozunahme/-abnahme	57	-437			
<b>Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>					
Verkauft	9.697	5.708			
Zurückgenommen	-2.180	-4.011			
Nettozunahme	7.517	1.697			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum			Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)		31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)
<b>FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)</b>					
<b>Klasse A EUR thesaurierend (abgesichert) (PH)</b>					
Verkauft	14	317			
Zurückgenommen	-172	-63			
Nettozunahme/-abnahme	-158	254			
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>					
Verkauft	1.997	4.336			
Zurückgenommen	-2.922	-1.104			
Nettozunahme/-abnahme	-925	3.232			
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (A)</b>					
Verkauft	13	10			
Zurückgenommen	-9	-			
Nettozunahme	4	10			
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus</b>					
Verkauft	84	163			
Zurückgenommen	-62	-99			
Nettozunahme	22	64			
<b>Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>					
Verkauft	2.180	5.156			
Zurückgenommen	-1.575	-3.078			
Nettozunahme	605	2.078			
<b>Klasse C USD thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	13	40			
Zurückgenommen	-13	-			
Nettozunahme	-	40			
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	100	34			
Zurückgenommen	-142	-31			
Nettozunahme/-abnahme	-42	3			
<b>Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	6	143			
Zurückgenommen	-96	-44			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-90	99			
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	7	95			
Zurückgenommen	-104	-61			
Nettozunahme/-abnahme	-97	34			
<b>Klasse F USD thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	19	252			
Zurückgenommen	-216	-27			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-197	225			
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	135	393			
Zurückgenommen	-107	-125			
Nettozunahme	28	268			
<b>Klasse U EUR thesaurierend</b>					
Verkauft	4.208	-			
Zurückgenommen	-257	-			
Nettozunahme	3.951	-			
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	9	93			
Zurückgenommen	-37	-			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-28	93			
<b>Klasse X USD ausschüttend (A)</b>					
Verkauft	-	5			
Nettozunahme	-	5			
<b>Klasse X EUR thesaurierend (abgesichert) (PH)</b>					
Verkauft	215	554			
Zurückgenommen	-595	-131			
Nettozunahme/-abnahme	-380	423			
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>					
Verkauft	446	1.347			
Zurückgenommen	-1.599	-682			
Nettozunahme/-abnahme	-1.153	665			
<b>Klasse X GBP ausschüttend (Q) (abgesichert)</b>					
Verkauft	-	32			
Zurückgenommen	-34	-32			
Nettoabnahme	-34	-			
<b>Klasse X GBP, ausschüttend (Q)</b>					
Verkauft	33	36			
Zurückgenommen	-63	-15			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-30	21			
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	584	4.001			
Zurückgenommen	-1.755	-1.401			
Nettozunahme/-abnahme	-1.171	2.600			
<b>Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)</b>					
Verkauft	-	320			
Zurückgenommen	-341	-114			
Nettozunahme/-abnahme	-341	206			
<b>Klasse Premier CAD ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)</b>					
Verkauft	80	68			
Nettozunahme	80	68			
<b>Klasse Premier CAD ausschüttend (Q) Plus (e)</b>					
Verkauft	-	7			
Zurückgenommen	-	-108			
Nettoabnahme	-	-101			
<b>Klasse Premier EUR thesaurierend (abgesichert) (PH)</b>					
Verkauft	638	16			
Zurückgenommen	-11	-2			
Nettozunahme	627	14			
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend</b>					
Verkauft	1.833	7.891			
Zurückgenommen	-7.177	-1.262			
Nettozunahme/-abnahme	-5.344	6.629			
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend</b>					
Verkauft	1	10			
Zurückgenommen	-3	-77			
Nettoabnahme	-2	-67			
<b>Klasse Premier GBP ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)</b>					
Verkauft	1	351			
Zurückgenommen	-423	-8			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-422	343			
<b>Klasse Premier GBP ausschüttend (Q)</b>					
Verkauft	687	1.204			
Zurückgenommen	-915	-1.373			
Nettoabnahme	-228	-169			
<b>FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund</b>					
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>					
Verkauft	5	124			
Zurückgenommen	-54	-33			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-49	91			
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)</b>					
Verkauft	4	172			
Zurückgenommen	-65	-152			
Nettozunahme/-abnahme	-61	20			
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>					
Verkauft	27	407			
Zurückgenommen	-80	-53			
Nettozunahme/-abnahme	-53	354			
<b>Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>					
Verkauft	4	58			
Zurückgenommen	-14	-			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-10	58			
<b>Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>					
Verkauft	42	46			
Zurückgenommen	-9	-8			
Nettozunahme	33	38			
<b>Klasse A EUR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>					
Verkauft	6	42			
Zurückgenommen	-15	-4			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-9	38			
<b>Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>					
Verkauft	3	29			
Zurückgenommen	-3	-			
Nettozunahme	-	29			
<b>Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus</b>					
Verkauft	-	62			
Nettozunahme	-	62			
<b>Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>					
Verkauft	4.630	60.001			
Zurückgenommen	-10.245	-6.637			
Nettozunahme/-abnahme	-5.615	53.364			
<b>Klasse U USD thesaurierend</b>					
Verkauft	95	-			
Zurückgenommen	-23	-			
Nettozunahme	72	-			
<b>Klasse U EUR, thesaurierend</b>					
Verkauft	4	-			
Zurückgenommen	-64	-			
Nettoabnahme	-60	-			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)
<b>FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse U GBP thesaurierend</b>				
Verkauft	3	–		
Zurückgenommen	-2	–		
Nettozunahme	1	–		
<b>Klasse U GBP ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	2	–		
Nettozunahme	2	–		
<b>Klasse U GBP ausschüttend (Q) Plus (e)</b>				
Verkauft	5	–		
Nettozunahme	5	–		
<b>Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)</b>				
Verkauft	2	402		
Zurückgenommen	-115	-5		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-113	397		
<b>Klasse X EUR ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	2		
Nettozunahme	–	2		
<b>Klasse X EUR ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	1	7		
Zurückgenommen	-11	-2		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-10	5		
<b>Klasse X GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)</b>				
Verkauft	–	4		
Zurückgenommen	-5	-1		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-5	3		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	2	97		
Zurückgenommen	-2	-56		
Nettozunahme	–	41		
<b>Klasse Premier USD ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	70	773		
Zurückgenommen	-58	-39		
Nettozunahme	12	734		
<b>Klasse Premier EUR ausschüttend (M) (abgesichert)</b>				
Verkauft	28	11		
Zurückgenommen	-13	–		
Nettozunahme	15	11		
<b>Klasse S USD thesaurierend</b>				
Verkauft	39	210		
Zurückgenommen	-19	-19		
Nettozunahme	20	191		
<b>Klasse S USD ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	3	89		
Zurückgenommen	-13	-3		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-10	86		
<b>FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	62	46		
Zurückgenommen	-79	-132		
Nettoabnahme	-17	-86		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	1	2		
Zurückgenommen	-4	-6		
Nettoabnahme	-3	-4		
<b>Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	9	8		
Zurückgenommen	-14	-13		
Nettoabnahme	-5	-5		
<b>Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	93	9		
Zurückgenommen	-69	-4		
Nettozunahme	24	5		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	13	5		
Zurückgenommen	-41	-30		
Nettoabnahme	-28	-25		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	23	24		
Zurückgenommen	-26	-38		
Nettoabnahme	-3	-14		
<b>Klasse A EUR ausschüttend (A) (abgesichert)</b>				
Verkauft	–	1		
Zurückgenommen	–	-1		
Nettozunahme	–	–		
<b>Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen			-1	-2
Nettoabnahme			-1	-2
<b>Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft			2	11
Zurückgenommen			-2	-8
Nettozunahme			–	3
<b>Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft			3.299	2.460
Zurückgenommen			-2.222	-1.907
Nettozunahme			1.077	553
<b>Klasse A SGD thesaurierend</b>				
Verkauft			561	388
Zurückgenommen			-3.780	-423
Nettoabnahme			-3.219	-35
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Verkauft			5	2
Zurückgenommen			-11	-3
Nettoabnahme			-6	-1
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft			3	5
Zurückgenommen			-10	-5
Nettoabnahme			-7	–
<b>Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft			7	1
Zurückgenommen			-1	-1
Nettozunahme			6	–
<b>Klasse E EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft			3	1
Zurückgenommen			–	-1
Nettozunahme			3	–
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft			–	1
Zurückgenommen			-12	-18
Nettoabnahme			-12	-17
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft			31	40
Zurückgenommen			-60	-78
Nettoabnahme			-29	-38
<b>Klasse X USD ausschüttend (A)</b>				
Zurückgenommen			–	-1
Nettoabnahme			–	-1
<b>Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft			5	28
Zurückgenommen			-23	-95
Nettoabnahme			-18	-67
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft			6	7
Zurückgenommen			-9	-28
Nettoabnahme			-3	-21
<b>Klasse X GBP thesaurierend</b>				
Verkauft			9	12
Zurückgenommen			-14	-21
Nettoabnahme			-5	-9
<b>Klasse X GBP ausschüttend (A)</b>				
Verkauft			–	2
Zurückgenommen			-1	-2
Nettoabnahme			-1	–
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft			169	41
Zurückgenommen			-218	-168
Nettoabnahme			-49	-127
<b>Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen			-48	-201
Nettoabnahme			-48	-201
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft			7	13
Zurückgenommen			-17	-1
Netto-(Abgang)/-Zugang			-10	12
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft			15	50
Zurückgenommen			-21	-82
Nettoabnahme			-6	-32

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)
<b>FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse Premier GBP, thesaurierend</b>				
Verkauft	4	9		
Zurückgenommen	-34	-35		
Nettoabnahme	-30	-26		
<b>Klasse Premier PLN thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	42	–		
Zurückgenommen	-4	-48		
Nettozunahme/(-abnahme)	38	-48		
<b>FTGF Royce US Smaller Companies Fund</b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	26	8		
Zurückgenommen	-15	-18		
Nettozunahme/(-abnahme)	11	-10		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	1	1		
Zurückgenommen	-3	-4		
Nettoabnahme	-2	-3		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	–		
Zurückgenommen	-3	-1		
Nettoabnahme	-2	-1		
<b>Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	1	5		
Zurückgenommen	-1	-5		
Nettozunahme	–	–		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	–	-1		
Nettoabnahme	–	-1		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (A)</b>				
Zurückgenommen	-1	–		
Nettoabnahme	-1	–		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	10	5		
Zurückgenommen	-4	-4		
Nettozunahme	6	1		
<b>Klasse R USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-1	–		
Nettoabnahme	-1	–		
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	–	-1		
Nettoabnahme	–	-1		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	28	–		
Zurückgenommen	–	-1		
Nettozunahme/-abnahme	28	-1		
<b>Klasse Premier USD ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	2	3		
Zurückgenommen	-4	-8		
Nettoabnahme	-2	-5		
<b>Klasse LM EUR, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-2	-1		
Nettoabnahme	-2	-1		
<b>Klasse A (G) USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-1	–		
Nettoabnahme	-1	–		
<b>Klasse L (G) USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	–	-1		
Nettoabnahme	–	-1		
<b>FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund<sup>AG</sup></b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-12	-1		
Nettoabnahme	-12	-1		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	–	1		
Zurückgenommen	-13	-1		
Nettoabnahme	-13	–		
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	–	3		
Zurückgenommen	-38	-5		
Nettoabnahme	-38	-2		
<b>Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	–	14		
Zurückgenommen	-45	-2		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-45	12		
<b>Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Zurückgenommen	-16	–		
Nettoabnahme	-16	–		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	–	1		
Zurückgenommen	-1	-1		
Nettoabnahme	-1	–		
<b>Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Zurückgenommen	-139	-10		
Nettoabnahme	-139	-10		
<b>Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Verkauft	–	11		
Zurückgenommen	-48	–		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-48	11		
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-1	–		
Nettoabnahme	-1	–		
<b>Klasse C USD, ausschüttend (A)</b>				
Zurückgenommen	-6	–		
Nettoabnahme	-6	–		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-2	–		
Nettoabnahme	-2	–		
<b>Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	-1	-66		
Nettoabnahme	-1	-66		
<b>Klasse GA USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-45	-1		
Nettoabnahme	-45	-1		
<b>Klasse GA EUR, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-1	–		
Nettoabnahme	-1	–		
<b>Klasse GE USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-4	–		
Nettoabnahme	-4	–		
<b>FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>AG</sup></b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-1	–		
Nettoabnahme	-1	–		
<b>Klasse M GBP, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	–	1		
Zurückgenommen	-85	-12		
Nettoabnahme	-85	-11		
<b>Klasse M USD ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	–	1		
Zurückgenommen	-26	–		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-26	1		
<b>Klasse M EUR ausschüttend (A)</b>				
Zurückgenommen	-4	–		
Nettoabnahme	-4	–		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-15	–		
Nettoabnahme	-15	–		
<b>FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund<sup>AG</sup></b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	1		
Zurückgenommen	-1	-4		
Nettoabnahme	–	-3		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	1	–		
Zurückgenommen	–	-48		
Nettozunahme/(-abnahme)	1	-48		
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	24		
Zurückgenommen	-10	-5		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-9	19		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum		Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)
<b>FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)</b>				
<b>Klasse C USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-1	-		
Nettoabnahme	-1	-		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-4	-8		
Nettoabnahme	-4	-8		
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	-	1		
Nettozunahme	-	1		
<b>Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	-2	-2		
Nettoabnahme	-2	-2		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	3	27		
Zurückgenommen	-12	-62		
Nettoabnahme	-9	-35		
<b>Klasse Premier GBP thesaurierend (abgesichert)</b>				
Zurückgenommen	-2	-		
Nettoabnahme	-2	-		
<b>Klasse S USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-63	-8		
Nettoabnahme	-63	-8		
<b>Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	136	520		
Zurückgenommen	-58	-107		
Nettozunahme	78	413		
<b>Klasse S GBP thesaurierend</b>				
Verkauft	3	3		
Zurückgenommen	-1	-		
Nettozunahme	2	3		
<b>FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund</b>				
<b>Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)</b>				
Verkauft	2	1		
Zurückgenommen	-15	-		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-13	1		
<b>Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	14	44		
Zurückgenommen	-7	-49		
Nettozunahme/-abnahme	7	-5		
<b>Klasse D AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Zurückgenommen	-6	-		
Nettoabnahme	-6	-		
<b>Klasse D SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus</b>				
Zurückgenommen	-89	-807		
Nettoabnahme	-89	-807		
<b>Klasse D USD ausschüttend (M) Plus</b>				
Verkauft	-	2		
Zurückgenommen	-9	-		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-9	2		
<b>Klasse D USD thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-11	-		
Nettoabnahme	-11	-		
<b>Klasse X AUD thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-1	-1		
Nettoabnahme	-1	-1		
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	-	2		
Zurückgenommen	-	-1		
Nettozunahme	-	1		
<b>Klasse LM AUD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-	-4		
Nettoabnahme	-	-4		
<b>FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund<sup>^</sup></b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	-	1		
Zurückgenommen	-8	-26		
Nettoabnahme	-8	-25		
<b>Klasse E USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	-	1		
Nettozunahme	-	1		
<b>Klasse F USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	12	67		
Zurückgenommen	-23	-32		
Nettozunahme/-abnahme	-11	35		
<b>Klasse X USD, thesaurierend</b>				
Zurückgenommen	-	-6		
Nettoabnahme	-	-6		
<b>Klasse Premier USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	-	25		
Zurückgenommen	-3	-38		
Nettoabnahme	-3	-13		
<b>Klasse S USD thesaurierend</b>				
Verkauft	1	1		
Zurückgenommen	-1	-10		
Nettoabnahme	-	-9		
<b>Klasse S EUR thesaurierend</b>				
Verkauft	-	1		
Zurückgenommen	-	-45		
Nettoabnahme	-	-44		
<b>FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup></b>				
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	4		
Zurückgenommen	-2	-26		
Nettoabnahme	-1	-22		
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	-	1		
Zurückgenommen	-1	-6		
Nettoabnahme	-1	-5		
<b>Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	12	-		
Zurückgenommen	-53	-54		
Nettoabnahme	-41	-54		
<b>Klasse Premier EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	7		
Zurückgenommen	-1	-168		
Nettoabnahme	-	-161		
<b>Klasse S USD thesaurierend</b>				
Verkauft	-	5		
Nettozunahme	-	5		
<b>Klasse S EUR thesaurierend</b>				
Verkauft	31	95		
Zurückgenommen	-40	-445		
Nettoabnahme	-9	-350		
<b>Klasse S GBP thesaurierend</b>				
Verkauft	61	91		
Zurückgenommen	-63	-13		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-2	78		
<b>FTGF Martin Currie Improving Society Fund<sup>^y</sup></b>				
<b>Klasse A USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	1	-		
Nettozunahme	1	-		
<b>Klasse S USD, thesaurierend</b>				
Verkauft	47	-		
Nettozunahme	47	-		
<b>Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	1	-		
Nettozunahme	1	-		
<b>Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)</b>				
Verkauft	1	-		
Nettozunahme	1	-		
<b>Franklin Responsible Income 2028 Fund<sup>^</sup></b>				
<b>Klasse A EUR, thesaurierend</b>				
Verkauft	113	-		
Zurückgenommen	-3	-		
Nettozunahme	110	-		
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (A) Plus</b>				
Zurückgenommen	-1	-		
Nettoabnahme	-1	-		
<b>Klasse A EUR, ausschüttend (A)</b>				
Verkauft	399	-		
Zurückgenommen	-4	-		
Nettozunahme	395	-		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

	Für den Berichtszeitraum zum	
	31. August 2023 Anteile (in Tsd.)	31. August 2022 Anteile (in Tsd.)
<b>Franklin Responsible Income 2028 Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)</b>		
<b>Klasse D EUR thesaurierend</b>		
Verkauft	13	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	12	–
<b>Klasse D EUR, ausschüttend (A)</b>		
Verkauft	2	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	1	–
<b>Klasse K EUR, thesaurierend</b>		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
<b>Klasse K EUR, ausschüttend (A)</b>		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
<b>Klasse X EUR, thesaurierend</b>		
Verkauft	5	–
Zurückgenommen	-97	–
Nettoabnahme	-92	–
<b>Klasse X EUR, ausschüttend (A)</b>		
Verkauft	192	–
Zurückgenommen	-114	–
Nettozunahme	78	–

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

<sup>α</sup> Mit Wirkung vom 24. März 2023 stellten der FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>^</sup> und der FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

<sup>β</sup> Mit Wirkung vom 20. April 2023 stellte der FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

<sup>γ</sup> Mit Wirkung vom 20. Juni 2023 wurde der FTGF Martin Currie Improving Society Fund<sup>^</sup> aufgelegt.

<sup>δ</sup> Mit Wirkung vom 17. Juli 2023 stellte der Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund<sup>^</sup> den Handel eingestellt.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.



# Erläuterungen zum Abschluss

## 1. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze

Die in diesem Abschluss angewendeten Rechnungslegungsgrundsätze und Berechnungsmethoden stehen mit jenen im Einklang, die im Jahresabschluss der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 angewendet wurden.

### Übereinstimmungserklärung

Der Abschluss für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023 wurde nach Financial Reporting Standard („FRS“) 104: „Interim Financial Reporting“, den European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations, 2011 (in der aktuellen Fassung) (die „UCITS Regulations“) und den Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 (die „Central Bank UCITS Regulations“) erstellt. Der gekürzte Abschluss ist zusammen mit dem geprüften Abschluss für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 zu lesen, der nach FRS 102: „The Financial Reporting Standard applicable in the United Kingdom and the Republic of Ireland“ erstellt wurde.

### Grundlagen der Erstellung

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

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

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

## 2. Effiziente Portfolioverwaltung

Vorbehaltlich der Bedingungen und innerhalb der Grenzen, die gelegentlich von der Central Bank of Ireland (die „Zentralbank“) festgelegt werden, und sofern die Anlageziele und Anlagepolitik eines Fonds keine abweichende Regelung vorsehen, können die Anlagemanager und/oder Untieranlageverwalter Investmentmethoden und -instrumente wie Futures, Optionen, Devisenterminkontrakte und sonstige Derivate für die Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung verwenden. Außerdem werden eventuell neue Methoden und Instrumente entwickelt, die künftig für einen Fonds geeignet sein können, und ein Fonds kann diese Methoden und Instrumente einsetzen, wenn dies vorher genehmigt wurde und alle Beschränkungen der Zentralbank eingehalten werden.

Für OGAW, die Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung angewendet haben, sind gemäß den OGAW-Bestimmungen der Zentralbank Offenlegungen erforderlich. OGAW sind verpflichtet, die Erträge aus Techniken und Instrumenten für ein effizientes Portfoliomanagement für den gesamten Berichtszeitraum zusammen mit den direkten und indirekten Betriebskosten und den angefallenen Gebühren auszuweisen. Siehe dazu die nachstehenden Tabellen.

Einzelheiten zu offenen derivativen Finanzinstrumenten am Ende des Berichtszeitraums 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.

Im Berichtszeitraum wurden umgekehrte Pensionsgeschäfte für die Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements geschlossen. Einzelheiten zu allen umgekehrten Pensionsgeschäften am Ende des Berichtszeitraums sind dem Anlagenportfolio zu entnehmen.

### Umgekehrte Pensionsgeschäfte

Ein Teil des Vermögens jedes Fonds kann in anderen liquiden Mitteln gehalten werden. Für die Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung kann jeder Fonds Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließen.

In der nachfolgenden Tabelle sind die Erträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften im Berichtszeitraum zum 31. August 2023 ausgewiesen:

	<b>31. August 2023</b>
<b>Name des Fonds</b>	<b>(in Tsd.)</b>
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	6.581\$

Es wurden keine Transaktionskosten für die Käufe und Verkäufe von umgekehrten Pensionsgeschäften erhoben.

### Wertpapierleihgeschäfte

Bestimmte Fonds können für die Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung wie oben dargelegt auch Wertpapierleihgeschäfte abschließen. Im Rahmen solcher Transaktionen kann der Fonds seine Wertpapiere vorübergehend an einen Entleiher übertragen, wobei sich der Entleiher verpflichtet, zu einem vorab vereinbarten Zeitpunkt gleichwertige Wertpapiere an den Fonds zurückzugeben. Beim Abschluss solcher Transaktionen wird sich der Fonds bemühen, die Renditen auf sein Wertpapierportfolio zu erhöhen, indem er für die Bereitstellung seiner Wertpapiere für den Entleiher eine Gebühr erhebt. Für keinen der Fonds wurden im Berichtszeitraum zum 31. August 2023 Wertpapierleihgeschäfte getätigt.

## 3. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien

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

Die maximale Verwaltungsgebühr für die einzelnen Anteilklassen (angegeben als Prozentsatz vom Nettoinventarwert des betreffenden Fonds, der auf diese Klasse entfällt), stellt sich wie folgt dar:

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

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr	Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
<b>FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund</b>		<b>Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse A	1,000 %	Klasse A	1,500 %
Klasse B	1,250 %	Klasse B	1,750 %
Klasse C	1,500 %	Klasse C	2,000 %
Klasse E	1,600 %	Klasse E	2,100 %
Klasse F	0,550 %	Klasse F	0,800 %
Klasse R	0,600 %	Klasse R	1,100 %
Klasse T	1,000 %	Klasse T	1,500 %
Klasse X	0,300 %	Klasse X	0,750 %
Klasse Premier	0,300 %	Premier-Klasse	0,550 %
Klasse LM	keine	Klasse S	0,450 %
Klasse A (G)	1,150 %	Klasse LM	keine
Klasse B (G)	1,650 %	<b>FTGF Western Asset Global High Yield Fund</b>	
Klasse L (G)	1,650 %	Klasse A	0,950 %
<b>FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund</b>		Klasse B	1,250 %
Klasse A	0,800 %	Klasse C	1,450 %
Klasse B	1,050 %	Klasse E	1,550 %
Klasse C	1,300 %	Klasse F	0,700 %
Klasse E	1,400 %	Klasse R	0,850 %
Klasse F	0,550 %	Klasse T	0,950 %
Klasse R	0,400 %	Klasse X	0,450 %
Klasse T	0,800 %	Premier-Klasse	0,450 %
Klasse X	0,300 %	Klasse S	0,300 %
Klasse Premier	0,300 %	Klasse LM	keine
Klasse S	0,200 %	Klasse A (G)	1,250 %
Klasse LM	keine	Klasse L (G)	1,750 %
Klasse GA	0,820 %	<b>Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse GE	1,420 %	Klasse A	0,900 %
<b>Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund<sup>^</sup></b>		Klasse B	1,150 %
Klasse A	0,950 %	Klasse C	1,400 %
Klasse B	1,200 %	Klasse E	1,500 %
Klasse C	1,450 %	Klasse F	0,600 %
Klasse E	1,550 %	Klasse R	0,550 %
Klasse F	0,700 %	Klasse T	0,900 %
Klasse R	0,550 %	Klasse X	0,450 %
Klasse X	0,450 %	Premier-Klasse	0,350 %
Premier-Klasse	0,450 %	Klasse S	0,250 %
Klasse S	0,300 %	Klasse LM	keine
Klasse LM	keine	Klasse A (G)	1,100 %
Klasse A (G)	1,200 %	Klasse L (G)	1,600 %
Klasse B (G)	1,700 %	<b>FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund</b>	
Klasse L (G)	1,700 %	Klasse A	1,100 %
<b>FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund</b>		Klasse B	1,350 %
Klasse A	1,100 %	Klasse C	1,600 %
Klasse B	1,350 %	Klasse E	1,700 %
Klasse C	1,600 %	Klasse F	0,850 %
Klasse E	1,700 %	Klasse R	0,700 %
Klasse F	0,650 %	Klasse T	1,100 %
Klasse R	0,700 %	Klasse X	0,600 %
Klasse T	1,100 %	Premier-Klasse	0,600 %
Klasse X	0,550 %	Klasse LM	keine
Premier-Klasse	0,400 %	<b>FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund</b>	
Klasse LM	keine	Klasse A	0,850 %
<b>FTGF Western Asset US High Yield Fund</b>		Klasse B	1,100 %
Klasse A	0,950 %	Klasse C	1,350 %
Klasse B	1,200 %	Klasse E	1,450 %
Klasse C	1,450 %	Klasse F	0,600 %
Klasse E	1,550 %	Klasse R	0,450 %
Klasse F	0,700 %	Klasse T	0,850 %
Klasse R	0,550 %	Klasse X	0,350 %
Klasse T	0,950 %	Premier-Klasse	0,350 %
Klasse X	0,450 %	Klasse S	0,250 %
Premier-Klasse	0,450 %	Klasse LM	keine
Klasse S	0,300 %	<b>FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse LM	keine	Klasse A	0,900 %
Klasse A (G)	1,150 %	Klasse B	1,150 %
Klasse L (G)	1,650 %	Klasse C	1,400 %
Klasse GF	0,950 %	Klasse E	1,500 %
<b>Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund<sup>^</sup></b>		Klasse F	0,650 %
Klasse A	1,500 %	Klasse R	0,500 %
Klasse B	1,750 %	Klasse T	0,900 %
Klasse C	2,000 %	Klasse X	0,400 %
Klasse E	2,100 %	Premier-Klasse	0,400 %
Klasse F	0,800 %	Klasse S	0,300 %
Klasse R	1,100 %	Klasse LM	keine
Klasse T	1,500 %	<b>FTGF Western Asset Global Credit Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse X	0,750 %	Klasse A	0,850 %
Premier-Klasse	0,550 %	Klasse B	1,100 %
Klasse S	0,450 %	Klasse C	1,350 %
Klasse LM	keine	Klasse E	1,450 %
Klasse A (G)	1,250 %	Klasse F	0,600 %
Klasse B (G)	1,750 %	Klasse R	0,650 %
Klasse L (G)	1,750 %	Klasse T	0,850 %
		Klasse X	0,350 %
		Premier-Klasse	0,350 %
		Klasse S	0,250 %
		Klasse LM	keine

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr	Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
<b>Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund<sup>^</sup></b>		<b>FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund</b>	
Klasse A	1,150 %	Klasse A	1,100 %
Klasse B	1,400 %	Klasse B	1,350 %
Klasse C	1,650 %	Klasse C	1,600 %
Klasse E	1,750 %	Klasse E	1,700 %
Klasse F	0,700 %	Klasse F	0,850 %
Klasse R	0,750 %	Klasse R	0,700 %
Klasse T	1,150 %	Klasse T	1,100 %
Klasse X	0,575 %	Klasse X	0,600 %
Premier-Klasse	0,450 %	Premier-Klasse	0,600 %
Klasse S	0,350 %	Klasse LM	keine
Klasse LM	keine	<b>FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup></b>	
<b>FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup></b>		Klasse A	1,350 %
Klasse A	1,500 %	Klasse B	1,600 %
Klasse B	1,750 %	Klasse C	1,850 %
Klasse C	2,000 %	Klasse E	1,950 %
Klasse E	2,100 %	Klasse F	1,100 %
Klasse F	1,250 %	Klasse J	0,900 %
Klasse R	1,100 %	Klasse R	0,950 %
Klasse T	1,500 %	Klasse X	0,900 %
Klasse X	1,000 %	Premier-Klasse	0,900 %
Klasse Y	1,000 %	Klasse LM	keine
Premier-Klasse	1,000 %	<b>FTGF Brandywine Global High Yield Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse S	0,600 %	Klasse A	1,100 %
Klasse LM	keine	Klasse F	0,750 %
<b>FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup></b>		Klasse T	1,100 %
Klasse A	1,250 %	Klasse X	0,550 %
Klasse B	1,500 %	Premier-Klasse	0,550 %
Klasse C	1,750 %	Klasse S	0,450 %
Klasse E	1,850 %	Klasse LM	keine
Klasse F	0,800 %	<b>FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund</b>	
Klasse R	0,750 %	Klasse A	1,150 %
Klasse T	1,250 %	Klasse B	1,400 %
Klasse X	0,625 %	Klasse C	1,650 %
Premier-Klasse	0,600 %	Klasse E	1,750 %
Klasse S	0,400 %	Klasse F	0,900 %
Klasse LM	keine	Klasse R	0,750 %
<b>FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup></b>		Klasse T	1,150 %
Klasse D	1,200 %	Klasse X	0,650 %
Klasse F	1,200 %	Premier-Klasse	0,650 %
Klasse M	0,600 %	Klasse LM	keine
Premier-Klasse	0,600 %	<b>FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund</b>	
Klasse LM	keine	Klasse A	1,100 %
<b>FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup></b>		Klasse B	1,350 %
Klasse A	1,000 %	Klasse C	1,600 %
Klasse B	1,250 %	Klasse E	1,700 %
Klasse C	1,500 %	Klasse F	0,800 %
Klasse E	1,600 %	Klasse J	0,450 %
Klasse F	0,550 %	Klasse R	0,700 %
Klasse R	0,600 %	Klasse T	1,100 %
Klasse X	0,500 %	Klasse X	0,450 %
Premier-Klasse	0,300 %	Premier-Klasse	0,450 %
Klasse LM	keine	Klasse S	0,350 %
<b>FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup></b>		Klasse LM	keine
Klasse A	0,800 %	<b>FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse R	0,500 %	Klasse A	1,650 %
Klasse T	0,800 %	Klasse B	1,900 %
Klasse X	0,400 %	Klasse C	2,150 %
Premier-Klasse	0,300 %	Klasse E	2,250 %
Klasse S	0,200 %	Klasse F	1,300 %
Klasse LM	keine	Klasse J	0,750 %
<b>FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund</b>		Klasse R	1,250 %
Klasse A	0,800 %	Klasse T	1,650 %
Klasse F	0,550 %	Klasse X	1,150 %
Klasse R	0,500 %	Premier-Klasse	1,150 %
Klasse T	0,800 %	Klasse S	0,750 %
Klasse X	0,300 %	Klasse LM	keine
Klasse Premier	0,300 %	<b>FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse S	0,200 %	Klasse A	1,050 %
Klasse LM	keine	Klasse B	1,300 %
<b>Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup></b>		Klasse C	1,550 %
Klasse LM	keine	Klasse E	1,650 %
<b>FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup></b>		Klasse F	0,700 %
Klasse A	0,850 %	Klasse T	1,050 %
Klasse B	1,100 %	Klasse X	0,525 %
Klasse C	1,350 %	Premier-Klasse	0,525 %
Klasse E	1,450 %	Klasse S	0,400 %
Klasse F	0,600 %	Klasse LM	keine
Klasse R	0,650 %	<b>FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse T	0,850 %	Klasse A	2,000 %
Klasse X	0,350 %	Klasse T	2,000 %
Premier-Klasse	0,350 %	Klasse U	1,000 %
Klasse S	0,250 %	Klasse X	1,150 %
Klasse LM	keine	Premier-Klasse	1,150 %
		Klasse LM	keine

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr	Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
<b>FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund<sup>^</sup></b>		<b>FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund</b>	
Klasse A	1,100 %	Klasse A	1,250 %
Klasse B	1,350 %	Klasse B	1,750 %
Klasse C	1,600 %	Klasse C	1,750 %
Klasse E	1,700 %	Klasse E	2,000 %
Klasse F	0,800 %	Klasse F	1,000 %
Klasse J	0,450 %	Klasse R	0,800 %
Klasse R	0,700 %	Klasse T	1,250 %
Klasse T	1,100 %	Klasse X	0,625 %
Klasse X	0,550 %	Premier-Klasse	0,625 %
Premier-Klasse	0,550 %	Klasse LM	keine
Klasse S	0,450 %	<b>FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund</b>	
Klasse LM	keine	Klasse A	1,200 %
<b>FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>^</sup></b>		Klasse B	1,700 %
Klasse A	1,200 %	Klasse C	1,700 %
Klasse E	1,950 %	Klasse E	1,950 %
Klasse F	0,950 %	Klasse F	0,950 %
Klasse R	0,700 %	Klasse R	0,700 %
Klasse T	1,200 %	Klasse T	1,200 %
Klasse X	0,600 %	Klasse X	0,600 %
Premier-Klasse	0,600 %	Premier-Klasse	0,600 %
Klasse S	0,500 %	Klasse S	0,400 %
Klasse LM	keine	Klasse LM	keine
<b>FTGF ClearBridge Value Fund</b>		<b>FTGF ClearBridge Global Growth Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse A	1,350 %	Klasse A	1,300 %
Klasse B	1,850 %	Klasse B	1,800 %
Klasse C	1,850 %	Klasse C	1,800 %
Klasse E	2,100 %	Klasse E	2,050 %
Klasse F	1,100 %	Klasse F	1,050 %
Klasse R	0,850 %	Klasse R	0,800 %
Klasse T	1,350 %	Klasse T	1,300 %
Klasse X	0,675 %	Klasse X	0,650 %
Premier-Klasse	0,675 %	Premier-Klasse	0,650 %
Klasse LM	keine	Klasse S	0,550 %
<b>FTGF ClearBridge US Appreciation Fund</b>		Klasse LM	keine
Klasse A	1,250 %	<b>FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse B	1,750 %	Klasse A	1,500 %
Klasse C	1,750 %	Klasse B	2,000 %
Klasse E	2,000 %	Klasse C	2,000 %
Klasse F	1,000 %	Klasse E	2,250 %
Klasse R	0,750 %	Klasse F	1,250 %
Klasse T	1,250 %	Klasse R	1,000 %
Klasse X	0,625 %	Klasse T	1,500 %
Premier-Klasse	0,625 %	Klasse U	0,650 %
Klasse LM	keine	Klasse X	0,750 %
Klasse A (G)	1,250 %	Premier-Klasse	0,750 %
Klasse B (G)	1,750 %	Klasse LM	keine
Klasse L (G)	1,750 %	<b>Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse GA	1,420 %	Klasse A	1,650 %
Klasse GE	2,170 %	Klasse B	2,150 %
<b>FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund</b>		Klasse C	2,150 %
Klasse A	1,250 %	Klasse E	2,400 %
Klasse B	1,750 %	Klasse F	1,400 %
Klasse C	1,750 %	Klasse R	1,150 %
Klasse E	2,000 %	Klasse T	1,650 %
Klasse F	1,000 %	Klasse X	1,000 %
Klasse R	0,750 %	Premier-Klasse	1,000 %
Klasse T	1,250 %	Klasse S	0,600 %
Klasse U	0,525 %	Klasse LM	keine
Klasse X	0,625 %	<b>FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund</b>	
Premier-Klasse	0,625 %	Klasse A	1,500 %
Klasse LM	keine	Klasse B	2,000 %
Klasse A (G)	1,250 %	Klasse C	2,000 %
Klasse L (G)	1,750 %	Klasse E	2,250 %
Klasse GA	1,420 %	Klasse F	1,250 %
<b>FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund</b>		Klasse R	1,000 %
Klasse A	1,300 %	Klasse T	1,500 %
Klasse B	1,800 %	Klasse U	0,600 %
Klasse C	1,800 %	Klasse X	0,750 %
Klasse E	2,050 %	Premier-Klasse	0,750 %
Klasse F	1,050 %	Klasse S	0,400 %
Klasse R	0,800 %	Klasse LM	keine
Klasse T	1,300 %	<b>FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund</b>	
Klasse X	0,650 %	Klasse A	1,500 %
Premier-Klasse	0,650 %	Klasse B	2,000 %
Klasse LM	keine	Klasse C	2,000 %
Klasse A (G)	1,300 %	Klasse E	2,250 %
Klasse B (G)	1,800 %	Klasse F	1,250 %
Klasse L (G)	1,800 %	Klasse R	1,000 %
Klasse GA	1,420 %	Klasse T	1,500 %
Klasse GE	2,170 %	Klasse X	0,750 %
		Premier-Klasse	0,750 %
		Klasse LM	keine

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr	Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
<b>FTGF Royce US Smaller Companies Fund</b>		<b>FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup></b>	
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 %
Premier-Klasse	0,750 %	Premier-Klasse	0,750 %
Klasse LM	keine	Klasse S	0,650 %
Klasse A (G)	1,250 %	Klasse LM	keine
Klasse L (G)	1,750 %	<b>FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund</b>	
<b>FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>^</sup></b>		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 D	1,100 %
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 %
Premier-Klasse	0,750 %	Premier-Klasse	0,750 %
Klasse S	0,550 %	Klasse S	0,440 %
Klasse LM	keine	Klasse LM	keine
<b>Franklin MV European Equity Growth and Income Fund<sup>^</sup></b>		<b>FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse A	1,350 %	Klasse A	1,500 %
Klasse B	1,850 %	Klasse B	2,000 %
Klasse C	1,850 %	Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,100 %	Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,100 %	Klasse F	1,250 %
Klasse R	0,850 %	Klasse J	0,650 %
Klasse T	1,350 %	Klasse R	1,000 %
Klasse X	0,675 %	Klasse T	1,500 %
Premier-Klasse	0,675 %	Klasse X	0,750 %
Klasse S	0,500 %	Premier-Klasse	0,750 %
Klasse LM	keine	Klasse S	0,650 %
Klasse A (G)	1,350 %	Klasse LM	keine
Klasse B (G)	1,850 %	<b>FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse L (G)	1,850 %	Klasse A	1,500 %
Klasse GA	1,420 %	Klasse B	2,000 %
Klasse GE	2,170 %	Klasse C	2,000 %
Klasse GP	0,850 %	Klasse E	2,250 %
<b>FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund<sup>^</sup></b>		Klasse F	1,250 %
Klasse A	1,350 %	Klasse R	1,000 %
Klasse B	1,850 %	Klasse X	0,750 %
Klasse C	1,850 %	Premier-Klasse	0,750 %
Klasse E	2,100 %	Klasse S	0,650 %
Klasse F	1,100 %	Klasse LM	keine
Klasse R	0,850 %	<b>FTGF Martin Currie Improving Society Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse T	1,350 %	Klasse A	1,500 %
Klasse X	0,675 %	Klasse B	2,000 %
Premier-Klasse	0,675 %	Klasse C	2,000 %
Klasse S	0,500 %	Klasse E	2,250 %
Klasse LM	keine	Klasse F	1,250 %
Klasse GA	1,620 %	Klasse R	1,000 %
Klasse GE	2,370 %	Klasse T	1,500 %
<b>Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund<sup>^</sup></b>		Klasse X	0,750 %
Klasse A	1,350 %	Premier-Klasse	0,750 %
Klasse B	1,850 %	Klasse S	0,650 %
Klasse C	1,850 %	Klasse LM	keine
Klasse E	2,100 %	<b>Franklin Responsible Income 2028 Fund<sup>^</sup></b>	
Klasse F	1,100 %	Klasse A	0,60 %
Klasse R	0,850 %	Klasse D	1,15 %
Klasse T	1,350 %	Klasse K	0,60 %
Klasse X	0,675 %	Klasse X	0,20 %
Premier-Klasse	0,675 %		
Klasse S	0,500 %		
Klasse LM	keine		
Klasse GA	1,420 %		
Klasse GE	2,170 %		
<b>FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup></b>			
Klasse A	1,500 %		
Klasse B	2,000 %		
Klasse C	2,000 %		
Klasse E	2,250 %		
Klasse F	1,250 %		
Klasse M	1,000 %		
Klasse R	1,000 %		
Klasse T	1,500 %		
Premier-Klasse	0,750 %		
Klasse LM	keine		

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Die in den obenstehenden Tabellen angegebenen Verwaltungsgebühren für die einzelnen Fonds gelten für alle in der jeweiligen Spalte aufgeführten Anteilsklassen, die der Fonds anbietet. Es werden nicht alle Anteilsklassen von jedem Fonds angeboten und am Ende des aktuellen und des vorherigen Berichtszeitraums 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 den Berichtszeitraum zum 31. August 2023 wurden folgende Verwaltungsgebühren erlassen bzw. erstattet:

Name des Fonds	Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023 (in Tsd.)	
	Erlassene Verwaltungsgebühr	Verwaltungsgebühr, die erstattet wird, und sonstige Ausgaben, die wiederhergestellt werden
FTGF Western Asset US High Yield Fund	–\$	1\$
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	–\$	29\$
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	14\$	15\$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund <sup>^</sup>	15\$	–\$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>	16\$	2\$
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup>	–\$	6\$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund <sup>^</sup>	27\$	7\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	11\$	–\$
FTGF ClearBridge Global Growth Fund <sup>^</sup>	14\$	–\$
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund <sup>^</sup>	16\$	2\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund <sup>^</sup>	1\$	38\$
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	1\$	16\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	1\$	4\$
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup>	16\$	–\$
FTGF Martin Currie Improving Society Fund <sup>^</sup>	–\$	19\$
Franklin Responsible Income 2028 Fund <sup>^</sup>	1€	–€

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

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

Gemäß den Bestimmungen des Hauptvertriebsstellenvertrags zwischen dem Manager, der Gesellschaft und Franklin Distributors, LLC (der „Master-Distributor“), ist der Master-Distributor ermächtigt, Anteile der Gesellschaft zu vermarkten, zu bewerben, anzubieten und deren Verkauf und Rücknahme zu arrangieren (zusammen als „Vertriebsleistungen“ bezeichnet). Zudem ist der Master-Distributor berechtigt, auf eigene Kosten und Aufwendungen einen oder mehrere Vertriebshändler zu beauftragen, die sie bei der Erfüllung ihrer Pflichten aus dem Vertrag unterstützen sollen, sofern die Ernennungen solcher Firmen gemäß den Anforderungen der Regeln der Zentralbank erfolgen. Gemäß den Bestimmungen des Rahmenanlageverwaltungsvertrags zwischen dem Anlage-Manager und dem Master-Distributor, haftet der Master-Distributor in solchen Fällen gegenüber dem Verwalter für die Erfüllung seiner Aufgaben gemäß dem betreffenden Vertrag. Die Hauptvertriebsstelle hat gemäß den Vorgaben der Zentralbank Franklin Templeton Investments (Asia) Limited („FTIA“) und Templeton Asset Management Ltd. als weitere Vertriebsstellen der Fonds bestellt. Der Manager hat sich selbst und Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc. mit der Erbringung bestimmter Vertriebsdienstleistungen beauftragt.

Die Gesellschaft ist ferner für die umgehende Zahlung bzw. Rückerstattung von Geldern an die Verwaltungsgesellschaft verantwortlich, die diese als Provisionen, Übertragungsgebühren, Registrierungsgebühren, Steuern und ähnliche Verbindlichkeiten sowie Kosten und Spesen zu zahlen hat bzw. ihr entstanden sind.

#### Informationsstellengebühr

Gemäß dem Verwaltungsvertrag zwischen der Gesellschaft und dem Verwalter steht dem Verwalter eine Informationsstellengebühr aus dem Vermögen des jeweiligen Fonds für seine Dienstleistungen zu, die an jedem Handelstag aufläuft und jeden Monat rückwirkend gezahlt wird (die „Informationsstellengebühr“). Die Informationsstellengebühren laufen an jedem Handelstag auf und werden rückwirkend monatlich gezahlt. Im Rahmen des Master-Informationsstellenvertrags zwischen dem Manager, der Gesellschaft und Franklin Distributors hat LLC (der „Hauptanteilsignervertreter“), der Hauptanteilsvertreter für seine Dienste Anspruch auf den Erhalt einer vom Verwalter aus bestimmten Anteilsklassen zu zahlenden Dienstleistungsgebühr.

Gemäß den Bestimmungen des Hauptinformationsstellenvertrags ist der Hauptanteilsignervertreter berechtigt, auf eigene Kosten und Aufwendungen eine oder mehrere Parteien zu bestellen, die sie bei der Erfüllung ihrer Pflichten aus dem Vertrag unterstützen sollen, wobei der Hauptanteilsignervertreter der Gesellschaft gegenüber weiterhin für die Erfüllung ihrer Verpflichtungen aus diesem Vertrag haftet. Demzufolge hat die Hauptinformationsstelle FTIA und Templeton Asset Management Ltd. als weitere Informationsstellen der Gesellschaft bestellt. Der Manager hat Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc. mit der Erbringung von Aktionärsdienstleistungen in Bezug auf Taiwan beauftragt.

Der Gesamtbetrag der von jeder Aktienklasse gezahlten Informationsstellengebühren entspricht oder hat folgendem entsprochen:

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

Informationsstellengebühren sind für alle Klassen zahlbar, außer bei Klasse F Anteilsklassen, Klasse J Anteilsklassen, Klasse U Anteilsklassen, Klasse Y Anteilsklassen, Premier Anteilsklassen, S Anteilsklassen, LM Anteilsklassen, Grandfathered Anteilsklassen und Galleon Anteilsklassen (gemäß Definition im Prospekt). Auch für alle vom FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup> und Franklin Responsible Income 2028 Fund<sup>^</sup> angebotenen Anteilsklassen sind keine Informationsstellengebühren zahlbar.

Im Berichtszeitraum zum 31. August 2023 wurde auf folgende Informationsstellengebühren verzichtet:

Name des Fonds	Verzicht auf Informationsstellengebühren für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023 (in Tsd.)	
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	8\$	
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	3\$	
FTGF Western Asset US High Yield Fund	1\$	
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	13\$	

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.



# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Name des Fonds	Verzicht auf Informationsstellengebühren für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023
	(in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>	3\$
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	4\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	11\$
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	46\$
FTGF ClearBridge Global Growth Fund <sup>^</sup>	1\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	2\$
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	7\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund <sup>^</sup>	2\$
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	1\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	16\$
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup>	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 den Berichtszeitraum zum 31. August 2023 beliefen sich diese Aufwendungen auf 581.299 USD.

### Verbundene Parteien

Jane Trust, Jaspal Sagger, William Jackson (bis zu seinem Rücktritt) und Craig Tyle sind oder waren Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft und sind auch Verwaltungsratsmitglieder und/oder Führungskräfte bestimmter verbundener Unternehmen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageverwalter, der Vertriebs- und Informationsstellen. Joseph Carrier war Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft und bis zum Ende seiner Beschäftigung bei Franklin Templeton Investments am 3. Oktober 2022 auch Verwaltungsratsmitglied und/oder leitender Angestellter einiger verbundener Unternehmen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageverwalter, der Vertriebsstellen und der Informationsstellen. William Jackson war Verwaltungsratsmitglied bei FTIS (bis zu seinem Rücktritt). Jane Trust ist auch Verwaltungsratsmitglied bei FTIS. Die übrigen Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft, wie oben aufgeführt, sind oder waren alle entweder Mitarbeiter von FTIS oder einer ihrer Tochtergesellschaften. Abgesehen von den oben genannten Ausnahmen hat bzw. hatte keiner der Verwaltungsratsmitglieder eine direkte oder indirekte Beteiligung an einem Vertrag oder einer Vereinbarung, der/die zum Zeitpunkt dieses Dokuments besteht und der/die in Bezug auf das Geschäft der Gesellschaft von Bedeutung ist.

Zum 31. August 2023 hielten die in der nachfolgenden Tabelle aufgelisteten Fonds Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen, die dieselbe Verwaltungsgesellschaft, dieselben Anlageverwalter oder Untereinlageverwalter wie der Fonds oder eine verbundene Partei dieser Verwaltungsgesellschaft, dieser Anlageverwalter oder Untereinlageverwalter bestellt haben.

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

Fonds	Zugrunde liegender Organismus für gemeinsame Anlagen	31. August 2023	
		%	Wert (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,38 %	10.768\$
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,02 %	520€
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – Klasse LM USD Thesaurierend	20,99 %	3.032\$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,01 %	143\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,09 %	2.645\$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,14 %	3.957\$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	3,40 %	11.973\$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – Klasse LM USD Thesaurierend	2,15 %	310\$
FTGF Western Asset Global Credit Fund <sup>^</sup>	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,01 %	222\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,06 %	1.606\$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,57 %	15.887\$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund <sup>^</sup>	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,13 %	3.712\$
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,03 %	750\$
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,00 %	130\$
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,01 %	365\$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,16 %	4.355\$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund <sup>^</sup>	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,28 %	7.710\$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund <sup>^</sup>	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,03 %	846\$
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,32 %	8.871\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	2,19 %	61.400\$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,02 %	630\$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund <sup>^</sup>	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,03 %	931\$
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	1,40 %	39.321\$
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,04 %	1.044\$
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund <sup>^</sup>	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,01 %	171\$
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,02 %	573\$
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup>	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	0,01 %	241\$

Die Kapitalanlagen werden in den Finanzabschlüssen in Anmerkung 13 über die Fondsgeschäfte hinweg ausgewiesen.

### Transaktionen mit verbundenen Personen

Regulation 43(1) der Central Bank UCITS Regulations sieht vor, dass „eine verantwortliche Person sicherzustellen hat, dass alle Geschäfte zwischen einem OGAW und einer verbundenen Person (a) zu üblichen Marktbedingungen und (b) im besten Interesse der Anteilinhaber des OGAW durchzuführen sind“.

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 Berichtszeitraums abgeschlossen wurden, den durch die Regulation 43(1) vorgeschriebenen Verpflichtungen entsprechen.

### Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren

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

### Vergütung der Mitglieder des Verwaltungsrats

Die sich auf den Berichtszeitraum zum 31. August 2023 beziehenden ergebniswirksam in der Gesamtergebnisrechnung erfassten Honorare und Auslagen der Mitglieder des Verwaltungsrats beliefen sich auf 90.000 USD.

Verwaltungsratsgehälter sind oder waren nicht zahlbar für Jane Trust, Jaspal Sagger, William Jackson (bis zu seinem Rücktritt) und Craig Tyle, die Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageverwalter oder ihrer verbundenen Unternehmen sind oder waren. Verwaltungsratsgehälter waren nicht zahlbar für Joseph Carrier bis zum 3. Oktober 2022, dem Datum der Beendigung seiner Vollzeitbeschäftigung bei Franklin Templeton Investments. Herr Carrier wird weiterhin als nicht geschäftsführendes Mitglied des Verwaltungsrats der Gesellschaft tätig sein und ab dem 3. Oktober 2022 genauso vergütet werden wie die übrigen nicht geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

#### 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 % 31. August 2023
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	75,07
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	20,35
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	91,87
FTGF Western Asset US High Yield Fund	23,07
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	30,37
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	23,67
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	30,17
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	25,21
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>	60,95
FTGF Western Asset Global Credit Fund <sup>^</sup>	66,97
FTGF Western Asset Global Credit Fund <sup>^</sup>	24,31
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	20,43
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>	36,77
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup>	79,97
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund <sup>^</sup>	94,53
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund <sup>^</sup>	100,00
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund	68,88
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund	30,93
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup>	95,61
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	65,19
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>^</sup>	23,35
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	20,07
FTGF Brandywine Global High Yield Fund <sup>^</sup>	47,42
FTGF Brandywine Global High Yield Fund <sup>^</sup>	34,52
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	50,42
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	30,10
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	27,98
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup>	55,28
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup>	91,03
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund <sup>^</sup>	100,00
FTGF ClearBridge Value Fund	21,02
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	33,08
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	33,14
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	31,70
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	27,58
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	35,10
FTGF ClearBridge Global Growth Fund <sup>^</sup>	53,42
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup>	30,13
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	27,53
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	21,80
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	40,96
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund <sup>^</sup>	99,92
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund <sup>^</sup>	68,22
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	53,71
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	24,86
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup>	29,66
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>^</sup>	24,20
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>^</sup>	25,72
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>^</sup>	22,01
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund <sup>^</sup>	20,83
FTGF Martin Currie Improving Society Fund <sup>^</sup>	100,00
Franklin Responsible Income 2028 Fund <sup>^</sup>	35,36

#### Global Credit Fixed

Die Gesellschaft nahm zusammen mit anderen in Europa und den USA or „Vereinigten Staaten von Amerika“ eingetragenen Investmentfonds, die von Franklin Templeton Investments verwaltet werden (einzelnen „der Kreditnehmer“; gemeinsam „die Kreditnehmer“), eine gemeinsame, syndizierte, vorrangige unbesicherte Kreditlinie in der Gesamthöhe von 2.675 Millionen USD auf (die „Global Credit Facility“), um für die Kreditnehmer eine Geldquelle zu schaffen, aus der sie vorübergehend und in Notfällen schöpfen können, wozu auch die Fähigkeit zählt, künftige unvorhergesehene oder ungewöhnlich umfangreiche Rücknahmeanträge bedienen zu können.

Gemäß den Bedingungen der weltweiten Kreditlinie hat die Gesellschaft, zusätzlich zu den Zinsen für jeden seitens der Gesellschaft aufgenommenen Kreditbetrag und anderen seitens der Gesellschaft entstandenen Kosten, ihren Anteil an den Gebühren und Kosten zu tragen, die im Zusammenhang mit der Einführung und Aufrechterhaltung der weltweiten Kreditlinie entstehen, und zwar auf der Grundlage ihres relativen Anteils am Gesamtvermögen aller Kreditnehmer, einschließlich einer jährlichen Bereitstellungsgebühr, die auf dem Anteil des nicht genutzten Teils dieser weltweiten Kreditlinie beruht.

Alle Fonds der Gesellschaft, mit Ausnahme des FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, fallen in den Geltungsbereich der Global Credit Facility.

### 4. Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen

#### Ausschüttende Anteilsklassen

Der hinter dem Namen jeder ausschüttenden Anteilsklasse in Klammern angegebene Buchstabe gibt an, in welchen Abständen die in der nachfolgenden Tabelle aufgeführten Dividenden erklärt und gezahlt werden.

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

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

Für jede ausschüttende Anteilsklasse jedes Aktienfonds (wie auf Seite 15 definiert) wird zum Zeitpunkt der Dividendenerklärung der gesamte oder ein Teil eines etwaigen Nettoanlageertrags als Dividende erklärt. Sofern der Anteilsinhaber nichts anderes verlangt, erfolgen die Ausschüttungen an jeden Anteilsinhaber der einzelnen ausschüttenden Anteilsklassen in der Währung, in der der Anteilsinhaber die Anteile gezeichnet hat.

Für jede ausschüttende Anteilsklasse jedes Mischfonds (wie auf Seite 15 definiert) wird zum Zeitpunkt der Dividendenerklärung der gesamte oder ein Teil eines etwaigen Nettoanlageertrags als Dividende erklärt. Sofern der Anteilsinhaber nichts anderes verlangt, erfolgen die Ausschüttungen an jeden Anteilsinhaber der einzelnen ausschüttenden Anteilsklassen in der Währung, in der der Anteilsinhaber die Anteile gezeichnet hat.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 4. Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile – (Fortsetzung)

Die ausschüttenden Plus-Anteilsklassen können Ausschüttungen aus dem Kapital erklären und zahlen. Anleger in diesen Anteilsklassen sollten wissen, dass Dividendenzahlungen aus Kapitalbeträgen an eine Rendite oder Rücknahme des ursprünglichen Investitionsvermögens oder der Kapitalgewinne eines Investors zurückzuführen sind, das dieser ursprünglichen Investition zuzuschreiben ist, und dass solche Ausschüttungen zu einer entsprechenden unmittelbaren Verringerung des Nettoinventarwerts pro Anteil der Anteilsklasse führen. Die Zahlung von Ausschüttungen aus dem Kapital führt entsprechend zu Kapitalerosion und kann durch Verzicht auf das Potenzial für zukünftiges Kapitalwachstum erzielt werden.

Im Berichtszeitraum haben die folgenden Fonds Ausschüttungen aus dem Kapital ausschüttender Plus-Anteilsklassen vorgenommen:

	<b>Ausschüttungen aus dem Kapital für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023 (in Tsd.)</b>
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	24\$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	7\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	5\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	–\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	7\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A ZAR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	14\$
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	15\$
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	–\$
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	3\$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	53\$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	54\$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	20\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	408\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	177\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	98\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	88\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	41\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	6\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup> – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	–\$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup> – Klasse D USD ausschüttend (M) Plus	1\$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	242\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	9\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	261\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	31\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A CNH ausschüttend (Monthly) abgesichert Plus	8\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	70\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	16\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	7\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	29\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	11\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	2\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	5\$
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup> – Klasse A USD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	954€
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup> – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	42€
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup> – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	355€
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup> – Klasse A Euro ausschüttend (M) Plus	52€
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup> – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	74€
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	8\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	412\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	42\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	40\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	29\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	8\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	336\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse S USD ausschüttend (M) Plus	23\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Premier Klasse USD ausschüttend (M) Plus	237\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund <sup>^</sup> – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	7\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund <sup>^</sup> – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	5\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund <sup>^</sup> – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund <sup>^</sup> – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	4\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund <sup>^</sup> – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) Plus	4\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	–\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse D USD ausschüttend (M) Plus	5\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse D HKD ausschüttend (M) Plus	–\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse D CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	–\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse D AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse D SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2\$

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

Die von bestimmten Fonds angebotenen ausschüttenden Plus (e)- und Plus (u)-Anteilsklassen können bestimmte Gebühren und Aufwendungen auf das Kapital statt den Ertrag berechnen. Das Berechnen aller oder eines Teils der Gebühren und Aufwendungen auf das Kapital führt zu einem höheren Ertrag zur Ausschüttung. Das Kapital, das diesen ausschüttenden Plus (e)- und Plus (u)-Anteilsklassen für Investitionen in der Zukunft zur Verfügung steht, und Kapitalwachstum kann reduziert werden. Die Anteilsinhaber sollten beachten, dass ein erhöhtes Risiko besteht, dass sie bei der Rücknahme von Anteilen der ausschüttenden Plus (e)- und Plus (u)-Anteilsklassen nicht den vollen investierten Betrag zurückerhalten. Für Investoren in den ausschüttenden Plus (e)- und Plus (u)-Anteilsklassen kann dies ungeachtet der Wertentwicklung des jeweiligen Fonds zur Erosion der Kapitalinvestitionen der Anleger oder Kapitalgewinne, die dieser ursprünglichen Investition zugeordnet sind, führen, wodurch der Wert zukünftiger Renditen möglicherweise verringert wird. Die erhöhte Dividendenauszahlung infolge der Berechnung von Gebühren und Aufwendungen auf das Kapital führt zu einer Rendite oder einer Rücknahme der ursprünglichen Kapitalinvestitionen eines Investors oder der Kapitalgewinne, die dieser ursprünglichen Investition zuzuschreiben sind. Die höhere Dividendenauszahlung unter diesem Ladesystem führt zu einer entsprechenden unmittelbaren Verringerung des Nettoinventarwerts der Anteilsklassen am Ex-Dividendendatum. Die Anteilsinhaber sollten beachten, dass in dem Ausmaß, in dem die Aufwendungen dem Kapital berechnet werden, einige oder alle der Ausschüttungen, die von den ausschüttenden Plus (e)- und Plus (u)-Anteilsklassen vorgenommen werden, als Form der Kapitalerstattung betrachtet werden sollten. Sämtliche Aufwendungen der ausschüttenden Anteilsklassen Plus (e) wurden vermögenswirksam erfasst.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 4. Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile – (Fortsetzung)

Im Berichtszeitraum haben die folgenden Fonds Gebühren und Kosten dem Kapital ausschüttender Plus (e)-Anteilsklassen belastet:

	<b>Dem Kapital belastete Gebühren und Kosten für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023 (in Tsd.)</b>
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1\$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Klasse USD ausschüttend (M) Plus (e)	55\$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	3\$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	2\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup> – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	1.043\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup> – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	117\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup> – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	17\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup> – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	44\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup> – Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	75\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup> – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus (e)	–\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup> – Klasse A JPY ausschüttend (M) Plus (e)	1\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup> – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	205\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup> – Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus (e)	–\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup> – Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	60\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup> – Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	10\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup> – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	107\$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup> – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	–\$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup> – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	–\$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup> – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	–\$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund <sup>^</sup> – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	–\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	663\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	229\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	41\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	73\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	60\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	55\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	17\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Premier Klasse USD ausschüttend (M) Plus (e)	56\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Premier Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	118\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	16\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – S Klasse USD ausschüttend (Q) Plus (e)	–\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – S Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	12\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – S Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – LM Klasse Euro ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	58\$
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup> – Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	–\$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund <sup>^</sup> – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	1\$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund <sup>^</sup> – S Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	–\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	–\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	–\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse X Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	–\$
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup> – Premier Klasse CAD ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	204€
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	596\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A Euro ausschüttend (A) Plus (e)	–\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse U Euro ausschüttend (Q) Plus (e)	–\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse U GBP ausschüttend (Q) Plus (e)	1\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse U GBP ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	–\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	62\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse X Euro ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	8\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse X GBP ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	2\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	54\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) Plus (e)	5\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – S Klasse GBP ausschüttend (M) Plus (e)	1\$

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

### Thesaurierende Anteilsklassen

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

## 5. Grundkapital und rückkaufbare gewinnberechtigter Anteile

### Grundkapital

Die Gesellschaft wurde mit einem anfänglichen Grundkapital in Höhe von 39.000 Euro (in Form von 39.000 Zeichneranteilen ohne Nennwert) gegründet. Bis auf drei hat die Gesellschaft alle Zeichneranteile zurückgekauft. Die Inhaber dieser drei Zeichneranteile sind berechtigt, an allen Versammlungen der Gesellschaft teilzunehmen und dort abzustimmen, sie sind jedoch nicht berechtigt, an den Dividenden bzw. dem Nettovermögen eines Fonds oder der Gesellschaft zu partizipieren.

### Rückkaufbare und gewinnberechtigter Anteile

Das Grundkapital der Gesellschaft entspricht zu jeder Zeit dem Nettoinventarwert. Die Mitglieder des Verwaltungsrats sind ermächtigt, bis zu 500 Milliarden Anteile der Gesellschaft ohne Nennwert zum Nettoinventarwert je Anteil und zu den ihnen angemessen erscheinenden Bedingungen auszugeben. Bei der Emission von Anteilen an der Gesellschaft besteht kein Vorkaufsrecht.

Jeder Anteil berechtigt den Anteilinhaber dazu, gleichberechtigt auf anteilmäßiger Basis an den Dividenden und gegebenenfalls dem Reinvermögen des Fonds zu partizipieren, für den die Anteile ausgegeben wurden, mit Ausnahme von Dividenden, die beschlossen wurden, bevor dieser Anteilinhaber seine Anteile kaufte.

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

Jeder Fonds bietet unterschiedliche Anteilsklassen an. Diese sind im Verkaufsprospekt der Gesellschaft angegeben. Die verschiedenen Anteilsklassen unterscheiden sich hauptsächlich durch ihre Ausgabeaufschläge, Kosten, Gebührensätze, Ausschüttungspolitik und Währungen. Anleger können je nach Anlagebetrag und Anlagehorizont somit wählen, welche Anteilsklasse für ihre Anlagebedürfnisse am besten geeignet ist. Dabei ist die Höhe der Investition und der erwartete Beteiligungszeitraum in Betracht zu ziehen.

Anteilsklassen werden in ausschüttend und thesaurierend unterschieden. Thesaurierende Anteilsklassen schütten keinen Nettoertrag und keine realisierten oder nicht realisierten Nettokapitalgewinne aus. Ausschüttende Anteilsklassen schütten indes, wie in Erläuterung 5 zu den Ausschüttungen oben erklärt, in bestimmten zeitlichen Abständen einen Ertrag aus. Diese Abstände sind unterschiedlich und hängen davon ab, welcher Buchstabe in Klammern hinter der ausschüttenden Anteilsklasse angegeben ist. Darüber hinaus befinden sich Zeichneranteile der Gesellschaft in Umlauf. Die Zeichneranteile vermitteln deren Inhaber jedoch keinen Anspruch auf eine Beteiligung am Vermögen eines Fonds.

Jeder Fonds kann Anteilsklassen anbieten, die auf andere Währungen als die Basiswährung des Fonds lauten. Sofern der Name der Anteilsklasse nicht das Wort „(abgesichert)“ enthält, wendet der Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter bei keiner solchen Anteilsklasse Methoden an, um das Risiko der Anteilsklasse in Bezug auf Änderungen der Wechselkurse zwischen der Basiswährung des Fonds und der Währung der Anteilsklasse abzusichern.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 5. Grundkapital und rückkaufbare, gewinnberechtigte Anteile – (Fortsetzung)

Anteile der Klasse A sind allen Anlegern zugänglich. Provisionen/Rabattzahlungen können von Verwaltern an Händler oder andere Anleger, die eine Vereinbarung mit dem Vertriebshändler haben, in Bezug auf solche Aktien erfolgen. Anteile der Klasse B, C, D, E und K sind für alle Anleger verfügbar, die Kunden von Händlern sind, die von einer Vertriebsstelle in Bezug auf diese Anteile beauftragt wurden. Provisionszahlungen können von Vertriebshändler an Händler oder andere Anleger, die eine Vereinbarung mit einem Vertriebshändler haben, in Bezug auf solche Aktien erfolgen. Anteile der Klasse F stehen professionellen Anlegern und Anlegern mit einer diskretionellen Anlagevereinbarung mit einem Händler zur Verfügung, der vom Vertriebshändler im Hinblick auf diese Aktien beauftragt wurde. Provisionen/Rabattzahlungen können von Verwaltern an Händler oder andere Anleger, die eine Vereinbarung mit dem Vertriebshändler haben, in Bezug auf solche Aktien erfolgen. Anteile der Klasse J sind für die japanische Verteilung nach Ermessen der Direktoren oder Vertriebshändler bestimmt. Anteile der Klasse M sind für professionelle Investoren und Investoren mit einer diskretionellen Anlagevereinbarung mit einem Händler oder einer anderen von einem Vertriebshändler im Hinblick auf diese Aktien beauftragten Stelle verfügbar. Anteile der Klasse R sind für alle Investoren verfügbar, die ein gebührenbasiertes Arrangement mit einem Vermittler haben, von dem sie eine persönliche Empfehlung in Bezug auf ihre Anlage in die Fonds erhalten haben. Anteile der Klasse T sind nach Ermessen des Verwaltungsrats oder der Vertriebsstellen für den Vertrieb in Taiwan bestimmt. Anteile der Klasse X sind für Händler, Portfoliomanager oder Plattformen verfügbar, denen es gemäß den behördlichen Bestimmungen oder auf Grundlage von Gebührenverträgen mit ihren Kunden, nicht gestattet ist, die Vertriebsprovisionen von Unternehmen anzunehmen und einzubehalten sowie für institutionelle Investoren (für Anleger in der Europäischen Union bezieht sich das auf „geeignete Gegenparteien“, wie unter MIFID II definiert), die auf eigene Rechnung investieren. Anteile der Klassen U, Y und S sind im Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler für institutionelle Anleger verfügbar. Die BW LM-Anteilsklassen sind im Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler für sich qualifizierende Investoren verfügbar, die Mitglieder der Legg Mason-Gruppe oder von Kunden solcher Mitglieder sind. LM-Anteilsklassen sind nach Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler für sich qualifizierende Anleger erhältlich, die Mitglieder der Legg Mason-Gruppe, von Pensionsplänen und ähnlichen Anlagen sind, die von Mitgliedern der Legg Mason-Gruppe oder Kunden solcher Mitglieder gefördert werden. Für Anleger, die in der Europäischen Union ansässig sind, stehen im Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler für „geeignete Gegenparteien“ gemäß Definition im Rahmen von MIFID II zur Verfügung. Für Investoren außerhalb der Europäischen Union sind die BW Premier-Anteilsklassen verfügbar für institutionelle Investoren im Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler oder für sich qualifizierende Investoren, die Mitglieder der Legg Mason-Gruppe oder Kunden dieser Mitglieder sind. Für Anleger, die in der Europäischen Union ansässig sind, stehen die Premier-Anteilsklassen für „geeignete Gegenparteien“ zur Verfügung, die unter MIFID II definiert sind. Für Anleger, die außerhalb der Europäischen Union ansässig sind, stehen die Premier Share Klassen für institutionelle Anleger zur Verfügung.

Für Anteilsklassen, in deren Namen nach der Währungsbezeichnung das Wort „(abgesichert)“ enthalten ist, ist beabsichtigt, dass solche Anteilsklassen gegen Schwankungen der Wechselkurse zwischen der Währung der Anteilsklasse und der Basiswährung des jeweiligen Fonds abgesichert werden. Bestimmte Anteilsklassen in Fonds, die von Brandywine Global Investment Management, LLC verwaltet werden, werden im Verhältnis zu einem Index abgesichert, wie durch die ein „(IH)“ im Namen der Anteilsklasse angegeben. Die von Brandywine Global Investment Management, LLC verwalteten Fonds und der von ClearBridge Investments (North America) Pty Limited verwaltete FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund bietet auf Portfolioebene abgesicherte Anteilsklassen, die mit einem „(PH)“ im Namen der Anteilsklasse gekennzeichnet sind. Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund<sup>^</sup> (der Handel wurde am 1. Juni 2021 eingestellt) bot Anteilsklassen an, für die möglicherweise eine Performancegebühr gezahlt wurde, wie durch „(PF)“ im Namen der Anteilsklasse angegeben.

Bestimmte Fonds haben auch Anteile von Grandfathered-Anteilsklassen ausgegeben, wie durch die Angabe von „GA“, „GE“, „GP“ oder „(G)“ im Namen der Anteilsklasse erkennbar. Die Grandfathered-Anteilsklassen sind nur für Anteilseigner der verbundenen Fonds verfügbar. Die Grandfathered-Klassen sind für nachfolgende Zeichnungen sowohl durch bestehende Anteilsinhaber in der Anteilsklasse als auch durch Neuanleger geschlossen, wobei Anteile jedoch noch wie folgt erworben werden können: durch (1) Wiederanlage von Dividenden, (2) automatische Umwandlung der Anteilsklasse B (G) eines Fonds in die Anteilsklasse A (G) des gleichen Fonds und (3) Umtausch von Anteilen einer Grandfathered-Anteilsklasse mit derselben Gattungsbezeichnung. Ungeachtet der vorstehenden Bestimmungen können bestimmte Grandfathered-Anteilsklassen für bestimmte Fonds, die in den Fondsumgebungen angegeben sind, für nachfolgende Zeichnungen von bestehenden Anteilseignern im alleinigen Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder zur Verfügung gestellt werden.

### 6. Besteuerung

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

Die Gesellschaft ist in Irland bei Eintritt eines Steuertatbestands in den folgenden Fällen nicht steuerpflichtig:

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

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

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

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

### 7. 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-Überziehungsgalden eines Fonds werden bei der Depotstelle gehalten. Der Posten „Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung“ weist in der Darstellung der Vermögenslage Einschusszahlungen, Barsicherheiten und realisierte Gewinne und Verluste aus Futures-Kontrakten aus, die noch nicht geliefert wurden. Einschusszahlungen und Barsicherheiten, die zum 31. August 2023 in Bezug auf OTCs und börsengehandelte Derivate gehalten wurden, werden bei den folgenden Brokern gehalten: Bank of America Merrill Lynch, Barclays, BNP Paribas, BNY Mellon, Citi, Goldman Sachs, HSBC, JP Morgan, Morgan Stanley und UBS.

### 8. Verpflichtungen und Eventualverbindlichkeiten

Zum 31. August 2023 bestanden keine wesentlichen Verbindlichkeiten oder Eventualverbindlichkeiten.

### 9. Soft-Commission-Vereinbarungen

Die Gesellschaft hat Richtlinien entwickelt, die sicherstellen sollen, dass ihre Dienstleister im besten Interesse der Fonds handeln, wenn sie Handelsentscheidungen im Auftrag dieser Fonds im Rahmen des Portfoliomanagements umsetzen. Zu diesem Zweck und um bestmögliche Ergebnisse für die Fonds zu erzielen, müssen unter Berücksichtigung von Preis, Kosten, Geschwindigkeit, Wahrscheinlichkeit der Ausführung und Abwicklung, Auftragsvolumen und -art und sonstigen für die Auftragsausführung relevanten Überlegungen alle angemessenen Maßnahmen getroffen werden. Eventuell erhaltene Barrückvergütungen von einem Makler oder Händler für an diesen Makler oder Händler gerichtete Fonds-Maklergeschäfte werden vom Anlageverwalter, dem Unteranlageverwalter oder mit diesen verbundenen Personen nicht einbehalten. Die Gesellschaft trägt nicht die Kosten externer Analysen für den Anlageverwalter und den Unteranlageverwalter. Derartige Kosten werden vom entsprechenden Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter getragen. Informationen zu den Richtlinien für Auftragsausführungen der Fonds sind für Anteilsinhaber auf Anfrage kostenlos erhältlich.

Im Berichtszeitraum zum 31. August 2023 schloss Royce & Associates, LP („Royce“) Soft-Commission-Vereinbarungen mit Brokern, entschädigte die relevanten Fonds aber für alle Researchkosten, die im Rahmen dieser Vereinbarungen entstanden sind.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.



## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 10. Wechselkurse

In diesem Abschluss wurden für die jeweiligen auf US-Dollar, Euro,ritisches Pfund und japanischer Yen lautenden Fonds die Beträge in Fremdwährungen anhand folgender Wechselkurse jeweils in US-Dollar, Euro,ritisches Pfund und japanischen Yen umgerechnet:

	Währung	Wechselkurse zum 31. August 2023
<b>Auf USD lautende Fonds</b>	Argentinischer Peso	729,8774*
	Australischer Dollar	1,5433
	Brasilianischer Real	4,9521
	Britisches Pfund	0,7894
	Kanadischer Dollar	1,3512
	Chinesischer Renminbi (CNH)	7,2777
	Chinesischer Renminbi (CNY)	7,2902
	Kolumbianischer Peso	4.090,5000
	Tschechische Krone	22,1958
	Dänische Krone	6,8731
	Ägyptisches Pfund	30,9000
	Euro	0,9222
	Hongkong-Dollar	7,8424
	Ungarischer Forint	351,6393
	Indische Rupie	82,7863
	Indonesische Rupiah	15.230,0000
	Japanischer Yen	145,4950
	Malaysischer Ringgit	4,6400
	Mexikanischer Peso	17,0505
	Neuseeland-Dollar	1,6770
	Norwegische Krone	10,6317
	Peruanischer Nuevo Sol	3,6955
	Philippinischer Peso	56,6200
	Polnischer Zloty	4,1257
	Russischer Rubel	95,8750
	Saudi-Rial	3,7507
	Singapur-Dollar	1,3515
	Südafrikanischer Rand	18,8850
	Südkoreanischer Won	1.321,7500
	Schwedische Krone	10,9485
	Schweizer Franken	0,8834
	Taiwan-Dollar	31,8465
Thailändischer Baht	35,0175	
Türkische Lira	26,7203	
		<b>Wechselkurse zum 31. August 2023</b>
<b>Auf EUR lautende Fonds</b>	Australischer Dollar	1,6735
	Brasilianischer Real	5,3698
	Britisches Pfund	0,8560
	Kanadischer Dollar	1,4652
	Dänische Krone	7,4528
	Japanischer Yen	157,7676
	Polnischer Zloty	4,4737
	Südafrikanischer Rand	20,4780
	Schwedische Krone	11,8720
	Schweizer Franken	0,9579
	US-Dollar	1,0844
<b>Auf GBP lautende Fonds</b>	Euro	1,1683
	Japanischer Yen	184,3132
	US-Dollar	1,2668

\* Abgezinster Tageskurs, basierend auf dem ARS EqWgt Impli (UNOFFICIAL) Index, gemäß Anweisung von FTIS.

### 11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts

Die Gesellschaft hat die Bewertungen zum Marktwert im Rahmen einer Marktwerthierarchie klassifiziert, die die Signifikanz von Inputs reflektiert, die bei einer Bewertung zum Marktwert herangezogen werden. Die Marktwerthierarchie kennt folgende Stufen:

Eingabewerte der Stufe 1 sind unbereinigte notierte Kurse in aktiven Märkten für gleichartige Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten, welche dem Unternehmen am Bewertungstag zugänglich sind.

Eingabewerte der Stufe 2 sind andere notierte Kurse als die in aktiven Märkten der Stufe 1, welche für die betreffenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten direkt oder indirekt beobachtbar sind (d. h. unter Verwendung von Marktdaten entwickelt werden).

Eingabewerte der Stufe 3 sind nicht beobachtbare Parameter für die Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten (d. h., es sind keine Marktdaten verfügbar).

Jede Kapitalanlage wird insgesamt stets der Stufe 1, 2 oder 3 zugeordnet. In bestimmten Fällen kann zur Bewertung des beizulegenden Zeitwerts einer Kapitalanlage eine Reihe verschiedener Parameter verschiedener Stufen der Bewertungshierarchie herangezogen werden. In diesen Fällen richtet sich die Stufe der Kapitalanlage nach der geringsten Bewertungsstufe der Eingabewerte, die für die Berechnung des beizulegenden Zeitwerts herangezogen werden. Die Beurteilung der Bedeutsamkeit eines bestimmten Eingabewerts für die Bewertung zum beizulegenden Zeitwert erfordert Urteilsvermögen und ist anlagenspezifisch.

Die Eingabewerte oder die verwendete Methode zur Bewertung der Wertpapiere sind nicht unbedingt ein Hinweis auf die Risiken, die mit einer Anlage in diesen Wertpapieren verbunden sind.



# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

Die folgende Tabelle schlüsselt die zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte zum 31. August 2023 gemäß den Bewertungsstufen auf:

	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Core Bond Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)					
<b>Stufe 1</b>										
Anleihen und Schuldtitel	\$	–	\$	–	€	–	\$	–		
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–	–	–	–		
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–	–	–	376		
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	637	4.720	–	322	–	221		
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	-347	-2.905	–	-91	–	-166		
		–	290	1.815	–	231	–	431		
<b>Stufe 2</b>										
Anleihen und Schuldtitel	\$	702.821	\$	215.372	\$	1.006.983	€	85.946	\$	207.139
Geldmarktinstrumente	–	247.520	–	–	–	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	10.768	–	–	–	520	–	3.032
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	1.321	–	10.106	–	26	–	535
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	-20	–	-3.933	–	-179	–	-1.411
		950.341		227.441		1.013.156		86.313		209.295
<b>Stufe 3</b>										
Anleihen und Schuldtitel	\$	–	\$	607	\$	805	€	–	\$	–
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
		–		607		805		–		–
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$</b>	<b>950.341</b>	<b>\$</b>	<b>228.338</b>	<b>\$</b>	<b>1.015.776</b>	<b>€</b>	<b>86.544</b>	<b>\$</b>	<b>209.726</b>
	FTGF Western Asset US High Yield Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)					
<b>Level 1</b>										
Anleihen und Schuldtitel	\$	–	\$	–	\$	–	\$	–	\$	–
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	1	–	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	50	–	–	–	–	–	718	–	404
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	-10	–	–	–	-705	–	-245
		50		-9		-269		13		159
<b>Stufe 2</b>										
Anleihen und Schuldtitel	\$	100.606	\$	50.685	\$	388.384	\$	460.222	\$	151.281
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	143	–	–	–	2.645	–	3.957	–	12.283
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	101	–	32	–	6	–	2.481	–	998
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	-88	–	-105	–	-618	–	-3.573	–	-1.300
		100.762		50.612		390.417		463.087		163.262
<b>Stufe 3</b>										
Anleihen und Schuldtitel	\$	659	\$	–	\$	–	\$	–	\$	–
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	292	–	–	–	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
		951		–		–		–		–
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$</b>	<b>101.763</b>	<b>\$</b>	<b>50.603</b>	<b>\$</b>	<b>390.148</b>	<b>\$</b>	<b>463.100</b>	<b>\$</b>	<b>163.421</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	FTGF Western Asset Global Credit Fund <sup>^</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund <sup>^</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Mortgage- Backed Securities Fund <sup>^</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	110	76.459	1.665	–	1.098
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-41	-99.527	-560	-538	-94
	<b>69</b>	<b>-23.068</b>	<b>1.105</b>	<b>-538</b>	<b>1.004</b>
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 29.238	\$ 1.480.486	\$ 273.990	\$ 479.117	\$ 1.130.718
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	222	1.606	–	15.887	3.712
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	216	126.963	1.371	577	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-171	-68.018	-2.785	-664	–
	<b>29.505</b>	<b>1.541.037</b>	<b>272.576</b>	<b>494.917</b>	<b>1.134.430</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ 7.340	\$ 731	\$ 17.995	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	1.116	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>–</b>	<b>7.340</b>	<b>1.847</b>	<b>17.995</b>	<b>–</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$ 29.574</b>	<b>\$ 1.525.309</b>	<b>\$ 275.528</b>	<b>\$ 512.374</b>	<b>\$ 1.135.434</b>
	FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund <sup>^</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)	Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund <sup>^</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund <sup>^</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	£ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	192	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	90	50	301	26	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-24	-17	-172	-13	–
	<b>66</b>	<b>225</b>	<b>129</b>	<b>13</b>	<b>–</b>
<b>Level 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	£ 43.046	\$ 59.077	\$ 18.207	\$ 8.537	\$ 147.642
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	750	130	365	4.355
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	8	147	532	77	1.454
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-11	-878	-73	-161	-3.353
	<b>43.043</b>	<b>59.096</b>	<b>18.796</b>	<b>8.818</b>	<b>150.098</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	£ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>£ 43.109</b>	<b>\$ 59.321</b>	<b>\$ 18.925</b>	<b>\$ 8.831</b>	<b>\$ 150.098</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund <sup>^</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global High Yield Fund <sup>^</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	16
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	512	42	–	6.156	18
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	-177
	<b>512</b>	<b>42</b>	<b>–</b>	<b>6.156</b>	<b>-143</b>
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 252.450	\$ 23.082	\$ 199.024	\$ 1.094.717	\$ 32.048
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	7.710	846	8.871	61.400	630
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	7.522	12	1.150	2.658	225
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-16.536	-245	-4.628	-21.063	-236
	<b>251.146</b>	<b>23.695</b>	<b>204.417</b>	<b>1.137.712</b>	<b>32.667</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$ 251.658</b>	<b>\$ 23.737</b>	<b>\$ 204.417</b>	<b>\$ 1.143.868</b>	<b>\$ 32.524</b>
	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund <sup>^</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Multi- Sector Impact Fund <sup>^</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Value Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Appreciation Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	914.073	197.279	1.512.094
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	55	66	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-130	–	–	–	–
	<b>-75</b>	<b>66</b>	<b>914.073</b>	<b>197.279</b>	<b>1.512.094</b>
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 63.486	\$ 13.884	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	3.787	931	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	266	42	28	–	280
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-2.543	-115	-1.547	–	-2.302
	<b>64.996</b>	<b>14.742</b>	<b>-1.519</b>	<b>–</b>	<b>-2.022</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$ 64.921</b>	<b>\$ 14.808</b>	<b>\$ 912.554</b>	<b>\$ 197.279</b>	<b>\$ 1.510.072</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Global Growth Fund <sup>^</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund <sup>^</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	213.403	35.254	1.553.421	14.730	847.640
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>213.403</b>	<b>35.254</b>	<b>1.553.421</b>	<b>14.730</b>	<b>847.640</b>
<b>Stufe 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	4	–	31	–	1.728
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-86	-16	-863	–	-210
	<b>-82</b>	<b>-16</b>	<b>-832</b>	<b>–</b>	<b>1.518</b>
<b>Stufe 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$ 213.321</b>	<b>\$ 35.238</b>	<b>\$ 1.552.589</b>	<b>\$ 14.730</b>	<b>€ 849.158</b>
	FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Royce US Smaller Companies Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund <sup>^</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)	Franklin MV European Equity Growth and Income Fund <sup>^</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)
<b>Stufe 1</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	355.274	640.372	91.631	4.059	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>355.274</b>	<b>640.372</b>	<b>91.631</b>	<b>4.059</b>	<b>–</b>
<b>Level 2</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	39.321	1.044	171	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	6	94	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-1.018	-945	-2	–	–
	<b>-1.012</b>	<b>38.470</b>	<b>1.042</b>	<b>171</b>	<b>–</b>
<b>Level 3</b>					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>	<b>–</b>
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$ 354.262</b>	<b>\$ 678.842</b>	<b>\$ 92.673</b>	<b>\$ 4.230</b>	<b>€ –</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

## 11. Schätzung des beizulegenden Zeitwerts – (Fortsetzung)

	Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund <sup>f</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)	Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund <sup>Ω</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund <sup>μ</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund zum 31. August 2023 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund <sup>μ</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)					
<b>Stufe 1</b>										
Anleihen und Schuldtitel	\$	–	\$	–	\$	–	\$	–		
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–	–	–	–		
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	151.696	–	20.210	–	32.841		
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–		
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–		
				<b>151.696</b>		<b>20.210</b>		<b>32.841</b>		
<b>Stufe 2</b>										
Anleihen und Schuldtitel	\$	–	\$	–	\$	–	\$	–		
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–	–	–	–		
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	573	–	–	–	241		
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	33	–	–	–	–		
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	-1.479	–	-1	–	–		
				<b>-873</b>		<b>-1</b>		<b>241</b>		
<b>Stufe 3</b>										
Anleihen und Schuldtitel	\$	–	\$	–	\$	–	\$	–		
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–	–	–	–		
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–	–	–	–		
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–		
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–		
				–	–	–	–	–		
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>\$</b>	<b>–</b>	<b>\$</b>	<b>–</b>	<b>\$</b>	<b>150.823</b>	<b>\$</b>	<b>20.209</b>	<b>\$</b>	<b>33.082</b>
	<b>FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>μ</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)</b>	<b>FTGF Martin Currie Improving Society Fund<sup>μ</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)</b>	<b>Franklin Responsible Income 2028 Fund<sup>μ</sup> zum 31. August 2023 (in Tsd.)</b>							
<b>Stufe 1</b>										
Anleihen und Schuldtitel	€	–	\$	–	€	–	–	–		
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–	–	–	–		
Eigenkapitalinstrumente	–	187.464	–	4.524	–	–	–	–		
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–		
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–		
		<b>187.464</b>		<b>4.524</b>				<b>–</b>		
<b>Level 2</b>										
Anleihen und Schuldtitel	€	–	\$	–	€	86.453	–	–		
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–	–	–	–		
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–	–	–	–		
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	11	–	–	–	–	–	–		
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	-28	–	-2	–	–	–	–		
		<b>-17</b>		<b>-2</b>		<b>86.453</b>		<b>–</b>		
<b>Stufe 3</b>										
Anleihen und Schuldtitel	€	–	\$	–	€	–	–	–		
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–	–	–	–		
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–	–	–	–		
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–		
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–		
		–	–	–	–	–	–	–		
<b>Anlagen insgesamt</b>	<b>€</b>	<b>187.447</b>	<b>\$</b>	<b>4.522</b>	<b>€</b>	<b>86.453</b>		<b>–</b>		

<sup>f</sup> Mit Wirkung vom 14. April 2021 stellte der Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund<sup>μ</sup> den Handel ein.

<sup>Ω</sup> Mit Wirkung vom 27. April 2022 stellte der Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund<sup>μ</sup> den Handel ein.

<sup>μ</sup> Mit Wirkung vom 11. Juli 2022 stellte der Franklin MV European Equity Growth and Income Fund<sup>μ</sup> den Handel ein.

## 12. Sicherheiten

Dem Kreditrisiko begegnet man durch diversifizierten Einsatz von Gegenparteien und Emittenten und durch Mindestratings für einzelne Wertpapiere und Durchschnittsratings für die Portfolios. Der betreffende Anlageverwalter und/oder die Untereinlageverwalter können Portfolio-Limits festlegen und Investitionen auf Basis interner Parameter mit vereinbarten Limits, die bei Auflegung eines Fonds festgelegt wurden, vornehmen, zum Beispiel Beschränkungen für Emittenten und Emissionen oder Mindestvorgaben für die durchschnittliche Kreditqualität. Das Konto wird fortlaufend überwacht, um sicherzustellen, dass diese Parameter erfüllt werden. Zudem kann eine konsequente unabhängige Analyse aller Sicherheiten vor dem Kauf durchgeführt werden, zum Beispiel Finanzmodellierung, Szenarioanalyse und die Überwachung von Veränderungen im Risikoprofil. Generell dürfen zum Zeitpunkt des Kaufs maximal 5 % des Portfolios in ein und dasselbe emittierende Unternehmen angelegt sein.

Sofern Transaktionen für einen Fonds zu großen nicht realisierten Gewinnen führen, kann es für einen Fonds erforderlich sein, eine von einem Makler erhaltene Sicherheit zu halten. In diesem Fall reduziert sich das Kreditrisiko des Fonds um den Wert der gehaltenen Sicherheit. Sollte der Makler Konkurs anmelden, so ist die in Verbindung mit bestimmten derivativen Finanzinstrumenten eingebrachte Sicherheit in den USA (wobei sich die Vorschriften in den verschiedenen Rechtssystemen unterscheiden können) von der bei Aufnahme des Konkursverfahrens angewandten automatischen Aussetzung

<sup>μ</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 12. Sicherheiten – (Fortsetzung)

ausgenommen. Diese Ausnahme für Derivate würde es einem Fonds erlauben, die von der zahlungsunfähigen Partei eingebrachte Sicherheit sofort zwangsvollstrecken zu lassen, um die Forderungen gegen die zahlungsunfähige Partei zu befriedigen.

Die Gesellschaft überwacht ihr Risiko, indem sie die Bonität und die Finanzpositionen der Gegenparteien, mit denen die Fonds Geschäfte abschließen, regelmäßig überprüft. Die Fonds dürfen nur mit genehmigten Gegenparteien handeln.

Der Wert der Wertpapiere, die als Sicherheit in Bezug auf den Derivatehandel dienen, werden von den folgenden Fonds wie folgt gehalten:

Fonds	Broker	Zum 31. August 2023
		Marktwert der Sicherheit in Tsd.
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Morgan Stanley	134\$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>	Citi	322\$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund <sup>^</sup>	JP Morgan	78\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	Bank of America Merrill Lynch	3.275\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	BNP Paribas	7.900\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	Goldman Sachs	1.219\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	JP Morgan	2.380\$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund <sup>^</sup>	BNP Paribas	61\$

Es wird eine Liste der zulässigen Gegenparteien geführt. Ergänzungen dieser Listen werden vierteljährlich überprüft und jedes Jahr wird eine sorgfältige Neubewertung aller Gegenparteien vorgenommen. Die Überprüfung beinhaltet die Analyse der Kapitaladäquanz, der Rentabilität und der Liquidität der Gegenpartei und anderer Faktoren, die für sinnvoll erachtet werden.

Für eine effiziente Portfolioverwaltung kann jeder Fonds gemäß den Bestimmungen und Beschränkungen der OGAW-Vorschriften der irischen Zentralbank Wertpapierpensionsgeschäfte, umgekehrte Wertpapierpensionsgeschäfte sowie Wertpapierleihverträge abschließen.

Bis zum Ablauf der Wertpapierpensionsgeschäfte, der umgekehrten Wertpapierpensionsgeschäfte sowie der Wertpapierleihgeschäfte muss die im Rahmen eines solchen Vertrags oder Geschäfts erhaltene Sicherheit:

- (i) täglich neu bewertet werden;
- (ii) jederzeit dem Wert des angelegten Betrags oder der geliehenen Wertpapiere entsprechen oder darüber liegen;
- (iii) auf den Treuhänder oder seinen Beauftragten übertragen werden; und
- (iv) dem Fonds sofort und ohne Rückgriff auf die Gegenpartei zur Verfügung stehen, falls dieses Rechtssubjekt in Verzug gerät.

Jede von der Gesellschaft erhaltene unbare Sicherheit kann nicht verkauft oder weiterverpfändet werden, sondern muss zum Kreditrisiko der Gegenpartei gehalten und von einer von der Gegenpartei unabhängigen Stelle ausgegeben werden.

Der Bewertungsausschuss trifft sich mindestens einmal monatlich und wenn die Umstände dies erfordern, um Fragen der Bewertung zu erörtern und unter anderem auch das Kreditrisiko zu prüfen. Der jeweilige Anlagemanager und/oder Unteranlageverwalter legt dem Verwaltungsrat und dem Ausschuss halbjährlich Risikoanalysen vor.

Im Wesentlichen werden alle Barmittel und Wertpapiere der Fonds über die Verwahrstelle verwaltet, die ein Rating von AA- hat. Die Rechte der Fonds an den von der Verwahrstelle gehaltenen Barmitteln können durch Konkurs oder Zahlungsunfähigkeit der Verwahrstelle verzögert oder eingeschränkt werden. Die Bonität der Verwahrstelle wird von renommierten Ratingagenturen als erstklassig eingestuft. Sollte sich die Bonität oder finanzielle Lage der Verwahrstelle erheblich verschlechtern, kann der jeweilige Anlagemanager und/oder Unteranlageverwalter den Barmittelbestand auf eine andere Bank übertragen.

Sämtliche als Sicherheit platzierte Wertpapiere sind im Anlageportfolio aufgeführt. Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente, die auf den Depotbank- und Margenkonten gehalten werden und die Barmittel sind, werden in der Rechnung der Finanzlage ausgewiesen.

Wenn ein Fonds eine Sicherheit bei einer Gegenpartei hinterlegt hat, so kann der Fonds bei Insolvenz der Gegenpartei gemäß den Handelsverträgen mit der Gegenpartei berechtigt sein, diese Sicherheit zurückzufordern. In der Praxis kann der Fonds jedoch bestrebt sein, alle der Gegenpartei geschuldeten Beträge zu reduzieren, um alle noch offenen Geschäfte durch Verrechnung der geschuldeten Beträge gegen die eingebrachte Sicherheit zu verrechnen. Wenn der Fonds nach Verrechnung der geschuldeten Beträge Anspruch auf Rückzahlung einer Sicherheit hätte (wenn z.B. die Fondsposition überbesichert war), dann hätte der Fonds im Insolvenzverfahren wahrscheinlich eine unbesicherte Forderung gegen den Kontrahenten über den Betrag, der den ihm geschuldeten Betrag übersteigt.

Zur Reduzierung des Gegenparteiausfallrisikos werden bestimmte außerbörsliche Derivate über zentrale Clearingstellen abgewickelt. Im Rahmen dieser Vereinbarung werden mit Gegenparteien abgeschlossene Transaktionen an Clearingstellen abgetreten, die nach der Annahme effektiv die Gegenpartei für die Risikoaspekte der Transaktion ersetzen.

In der folgenden Tabelle ist der Marktwert der Wertpapiere aufgeführt, die als Sicherheiten bei Brokern in Bezug auf den Derivatehandel platziert wurden:

Fonds	Broker	Zum 31. August 2023
		Marktwert der Sicherheit in Tsd.
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Bank of America Merrill Lynch	235\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund <sup>^</sup>	Bank of America Merrill Lynch	57.208\$

### 13. Angaben zu gegenseitigen Anlagen durch die Fonds innerhalb der Gesellschaft

Bestimmte Fonds investieren in andere Fonds der Gesellschaft. Diese übergreifenden Investitionen wurden im Jahresabschluss der Gesellschaft wie folgt eliminiert:

- Die Marktwerte der zugrunde liegenden Organismen für gemeinsame Anlagen wurden aus den Gesamtbeträgen für die Gesellschaft in der Bilanz herausgerechnet.
- Die realisierten Gewinne und Verluste, einschließlich der Veränderungen bei den nicht realisierten Gewinnen und Verlusten, und die jeweiligen Dividendenerträge und Ausschüttungen bei Anlagen in andere Fonds wurden aus den Gesamtbeträgen für die Gesellschaft in der Gesamtergebnisrechnung herausgerechnet.
- Die monetären Beträge der Käufe und Verkäufe von Anteilen an solchen Organismen für gemeinsame Anlagen wurden aus den Nettoerlösen aus dem Verkauf von Anteilen und den Kosten für zurückgekaufte Anteile in den Gesamtbeträgen für die Gesellschaft in der Entwicklung des Nettovermögens der Inhaber rücknahmefähiger gewinnberechtigter Anteile herausgerechnet.

#### FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup>

Der FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup> hielt am Ende des Berichtszeitraums 29.816 Anteile des FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup>. Geschäfte, die diese Anteile betrafen, und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen im Berichtszeitraum:

	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund <sup>^</sup> Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	-\$
Rücknahme von Anteilen	-
Realisierter Nettogewinn/-verlust aus zum beizulegenden Zeitwert ergebniswirksam bewerteten Finanzanlagen	-
Bezogene Ausschüttungen	-
Anschaffungskosten	3.500
Beizulegender Zeitwert	3.787
<b>Nicht realisierter Nettogewinn aus zum beizulegenden Zeitwert ergebniswirksam bewerteten Finanzanlagen</b>	<b>287\$</b>

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.



## Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

### 14. Bedeutende Ereignisse

Mit Wirkung zum 24. März 2023 haben der FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>^</sup> und der FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund<sup>^</sup> den Handel eingestellt.

Mit Wirkung vom 20. April 2023 hat der FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup> den Handel eingestellt.

Am 12. Juni 2023 wurden ein Nachtrag für den FTGF Martin Currie Improving Society Fund<sup>^</sup>, ein ergänzender Prospekt und ein Spezialprospekt für Franklin Templeton Global Funds Plc von der Gesellschaft herausgegeben und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen.

Mit Wirkung vom 20. Juni 2023 nahm der FTGF Martin Currie Improving Society Fund<sup>^</sup> den Handel auf.

Mit Wirkung vom 17. Juli 2023 stellte der FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund<sup>^</sup> den Handel ein.

Mit Wirkung vom 17. Juli 2023 trat William Jackson als Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft zurück.

Mit Wirkung vom 27. Juli 2023 wurde Craig Tyle als Verwaltungsratsmitglied in den Verwaltungsrat der Gesellschaft bestellt.

### 15. Getrennte Haftung

Am 24. Februar 2022 begann Russland mit militärischen Operationen in der Ukraine. Die anhaltende politische und finanzielle Unsicherheit in Bezug auf Russland und die Ukraine kann die Marktvolatilität und das wirtschaftliche Risiko einer Anlage in Wertpapieren in diesen Ländern und anderen betroffenen Ländern in der Region erhöhen. Aufgrund der Sanktionen, der Maßnahmen der Regierungen, der Entwicklungen in der Ukraine selbst und anderer Umstände beobachtet der Anlageverwalter die Auswirkungen auf die Bewertung und Liquidität sehr genau und wird bei Bedarf Maßnahmen gemäß den Bewertungsrichtlinien und -verfahren der Fonds ergreifen.

Während des Berichtszeitraums zum 31. August 2023 fanden keine sonstigen bedeutenden Ereignisse statt.

Die Gesellschaft ist ein Dachfonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds. Nach irischem Recht steht das Vermögen der einzelnen Fonds nicht zur Begleichung der Verbindlichkeiten eines anderen Fonds der Gesellschaft zur Verfügung. Ungeachtet dessen kann nicht garantiert werden, dass die getrennte Haftung der Teilfonds im Fall einer Klage gegen die Gesellschaft vor Gerichten einer anderen Gerichtsbarkeit Bestand hat.

### 16. Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Am 18. September 2023 wurden ein Nachtrag für den FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund<sup>^</sup>, ein ergänzender Prospekt und ein aktualisierter Spezialprospekt für Franklin Templeton Global Funds Plc von der Gesellschaft herausgegeben und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen.

Mit Wirkung vom 22. September 2023 nahm der FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund<sup>^</sup> den Handel auf.

Es gab keine sonstigen wichtigen Ereignisse nach dem Bilanzstichtag, die im Abschluss offengelegt werden müssten.

### 17. Genehmigung des Halbjahresberichts und des ungeprüften Abschlusses

Am 17. Oktober 2023 wurden der Halbjahresbericht und der ungeprüfte Zwischenabschluss dem Verwaltungsrat vorgelegt und für die Einreichung bei der Zentralbank und die Übermittlung an die Anteilsinhaber genehmigt.

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (TER)

	<b>Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023**</b>		<b>Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023**</b>
<b>FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund</b>		<b>FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund</b>	
Klasse A USD, thesaurierend	0,65	Klasse A USD, thesaurierend	1,37
Klasse A USD, ausschüttend (D)	0,65	Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,37
Klasse B USD, thesaurierend	1,10	Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,37
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,10	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,37
Klasse C USD, thesaurierend	1,35	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,37
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,45	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,37
Klasse A (G) USD, thesaurierend	0,65	Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,37
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	0,65	Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,37
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	0,69	Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,37
<b>FTGF Western Asset US Core Bond Fund</b>		<b>FTGF Western Asset US High Yield Fund</b>	
Klasse A USD, thesaurierend	1,08	Klasse A USD, thesaurierend	1,24
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,09	Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,24
Klasse C USD, thesaurierend	1,59	Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,24
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,58	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,24
Klasse E USD, thesaurierend	1,76	Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,24
Klasse F USD, thesaurierend	0,73	Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,24
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,75	Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,24
Klasse X USD, thesaurierend	0,58	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,24
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,59	Klasse C USD, thesaurierend	1,74
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,56	Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,74
Klasse LM USD, thesaurierend	0,21	Klasse E USD, thesaurierend	1,85
Klasse GA USD, thesaurierend	1,03	Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,85
Klasse GE USD, thesaurierend	1,63	Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,85
<b>FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund</b>		<b>FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund</b>	
Klasse A USD, thesaurierend	1,27	Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,10
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,27	Klasse A EUR, ausschüttend (D)	1,08
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,27	Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,58
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,28	Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,43
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,27	Klasse LM EUR, thesaurierend	0,13
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,52	Klasse GA EUR, thesaurierend	0,95
Klasse C USD, thesaurierend	1,77	Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	0,95
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,77	Klasse GE EUR, thesaurierend	1,55
Klasse E USD, thesaurierend	1,88		
Klasse F USD, thesaurierend	0,68		
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,67		
Klasse X USD, thesaurierend	0,58		
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,58		
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,57		
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,43		
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	0,42		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,42		
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,13		
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,14		
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,12		
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,28		
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,28		
Klasse B (G) USD, ausschüttend (D)	1,78		
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,78		
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1,78		

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

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023**
<b>FTGF Western Asset Global High Yield Fund</b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,24	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,24	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,24	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,24	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,24	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,24	
Klasse A EUR, ausschüttend (D) (abgesichert)	1,24	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,24	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,49	
Klasse C USD, thesaurierend	1,74	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,74	
Klasse E USD, thesaurierend	1,92	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,92	
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,92	
Klasse F USD, thesaurierend	0,92	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,92	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,82	
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	0,82	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,67	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	0,67	
Klasse S USD, ausschüttend (M)	0,45	
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,44	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,47	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,47	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,97	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1,97	
<b>FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund</b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,36	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,36	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,36	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,36	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,36	
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,36	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,36	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,36	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,36	
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,36	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,36	
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,36	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,36	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	1,36	
Klasse B USD, thesaurierend	1,61	
Klasse C USD, thesaurierend	1,86	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,86	
Klasse E USD, thesaurierend	1,96	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,96	
Klasse F USD, thesaurierend	0,96	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,96	
Klasse X USD, ausschüttend (M)	0,86	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,86	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,71	
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	0,71	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,71	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,71	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	0,71	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M)	0,71	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M)	0,71	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,11	
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,11	
Klasse LM EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,11	
<b>FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund</b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,10	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,10	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,10	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,11	
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	1,10	
Klasse A SEK, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,99	
Klasse C USD, thesaurierend	1,60	
Klasse C USD, ausschüttend (M)	1,60	
Klasse E USD, thesaurierend	1,70	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,70	
Klasse F USD, thesaurierend	0,71	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,70	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,61	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,45	
Klasse Premier CHF, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,46	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,45	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,46	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,45	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,45	
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,35	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,35	
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,35	
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,35	
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	0,10	
<b>FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,16	
Klasse X USD, thesaurierend	0,69	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,54	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,54	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,55	
Klasse Premier NZD, thesaurierend (abgesichert)	0,53	
Klasse S USD, thesaurierend	0,45	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,44	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,14	
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,14	
Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)	0,14	
<b>FTGF Western Asset Global Credit Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,19	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,19	
Klasse X USD, thesaurierend	0,58	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,54	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,54	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,18	
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,19	

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023**
<b>FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,74	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,74	
Klasse A USD, ausschüttend (S)	1,74	
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,73	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74	
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,73	
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,74	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74	
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,73	
Klasse A GBP, thesaurierend	1,74	
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74	
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,74	
Klasse C USD, thesaurierend	2,24	
Klasse C USD, ausschüttend (S)	2,24	
Klasse A JPY, ausschüttend (M) Plus (e)	1,74	
Klasse A NOK, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse E USD, thesaurierend	2,34	
Klasse E USD, ausschüttend (S)	2,34	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,34	
Klasse F USD, thesaurierend	1,34	
Klasse F USD, ausschüttend (S)	1,34	
Klasse X USD, thesaurierend	1,24	
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,24	
Klasse X USD, ausschüttend (S)	1,24	
Klasse X CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,24	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,24	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,24	
Klasse X EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,24	
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,24	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,23	
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,24	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,24	
Klasse X SGD thesaurierend (abgesichert)	1,23	
Klasse Premier USD, thesaurierend	1,08	
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	1,09	
Klasse Premier AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,08	
Klasse Premier AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier CHF, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,08	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	1,09	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,08	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,08	
Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)	1,08	
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	1,08	
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	1,08	
Klasse S USD, thesaurierend	0,71	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,69	
Klasse LM AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)	0,09	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,09	
<b>FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse D EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,45	
Klasse D EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,45	
Klasse D USD, thesaurierend	1,45	
Klasse D USD, ausschüttend (M)	1,45	
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus	1,45	
Klasse M CHF, thesaurierend (abgesichert)	0,85	
Klasse M USD, ausschüttend (M)	0,85	
Klasse M EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,85	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,70	
Klasse Premier USD, ausschüttend (Q)	0,70	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,70	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert)	0,70	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,70	
Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)	0,70	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,10	
<b>FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,26	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,40	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,10	
<b>FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A GBP, thesaurierend	1,10	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,59	
Klasse LM GBP, ausschüttend (M)	0,14	
<b>FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund</b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,08	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,44	
Klasse S USD, thesaurierend	0,35	
Klasse LM GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,14	
<b>Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse LM USD, ausschüttend (Q)	k. A.	
<b>FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,15	
Klasse F USD, thesaurierend	0,75	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,50	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Klasse S USD, thesaurierend	0,40	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,40	
<b>FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund</b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,37	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,38	
Klasse A USD, ausschüttend (S)	1,37	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,37	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,37	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	1,37	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,37	
Klasse A EUR, ausschüttend (S)	1,37	
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	1,37	
Klasse A GBP, thesaurierend	1,37	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,37	
Klasse A GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	1,37	
Klasse A SGD, thesaurierend	1,39	
Klasse B USD, thesaurierend	1,64	
Klasse B USD, ausschüttend (S)	1,62	
Klasse C USD, thesaurierend	1,87	
Klasse C USD, ausschüttend (S)	1,87	
Klasse E USD, thesaurierend	1,98	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	1,97	
Klasse F USD, thesaurierend	0,96	
Klasse F USD, ausschüttend (S)	0,97	
Klasse R GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,97	
Klasse X USD, thesaurierend	0,87	
Klasse X USD, ausschüttend (S)	0,87	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,87	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,87	
Klasse X GBP, thesaurierend	0,87	
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,87	
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,87	
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert)	0,87	
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,87	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,72	
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	0,72	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,72	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,72	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,72	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,73	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,72	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,72	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,12	
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,12	
<b>FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,51	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,51	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,51	
Klasse C USD, thesaurierend	2,05	
Klasse X CHF, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,89	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,72	
Klasse S USD, thesaurierend	0,52	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,51	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,51	
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,12	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,11	
Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)	0,12	
Klasse S CHF, ausschüttend (A)	0,52	
Klasse S CHF, ausschüttend (A) (abgesichert)	0,51	

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023**
<b>FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,60	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,60	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,60	
Klasse A SGD, thesaurierend	1,61	
Klasse C USD, thesaurierend	2,11	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,20	
Klasse F USD, thesaurierend	1,20	
Klasse X USD, thesaurierend	1,15	
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,15	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,15	
Klasse Premier USD, thesaurierend	1,00	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,00	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,00	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,00	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,10	
<b>FTGF Brandywine Global High Yield Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,39	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,39	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,75	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,74	
Klasse S EUR, ausschüttend (A) (abgesichert) (IH)	0,48	
Klasse S CAD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,50	
<b>FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund</b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,42	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,42	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,45	
Klasse A SGD, thesaurierend	1,42	
Klasse C USD, thesaurierend	1,92	
Klasse E USD, thesaurierend	2,02	
Klasse F USD, thesaurierend	1,02	
Klasse F USD, ausschüttend (M)	1,02	
Klasse X USD, thesaurierend	0,92	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,91	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	0,92	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,77	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	0,77	
Klasse Premier NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,77	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,11	
Klasse LM NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,12	
<b>FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund</b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,37	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,37	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,37	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,37	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,37	
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,37	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,37	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,37	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,40	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,37	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,37	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,37	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,37	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,37	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,37	
Klasse A HKD, thesaurierend	1,37	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,37	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,37	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,37	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	1,37	
Klasse C USD, thesaurierend	1,87	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,87	
Klasse A CZK, thesaurierend (abgesichert)	1,37	
Klasse E USD, thesaurierend	1,97	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,97	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,97	
Klasse F USD, thesaurierend	0,92	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,92	
Klasse X USD, thesaurierend	0,75	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,72	
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) Plus (e)	0,74	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus(e)	0,75	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,59	
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,59	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,59	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,59	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,59	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,57	
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	0,59	
Klasse S USD, thesaurierend	0,47	
Klasse S USD, ausschüttend (Q) Plus (e)	0,47	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,47	
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,47	
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,47	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,12	
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,12	
Klasse LM EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	0,12	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,12	
<b>FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,94	
Klasse X USD, ausschüttend (M)	1,45	
Klasse Premier USD, thesaurierend	1,30	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,15	
<b>FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD, thesaurierend	2,28	
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	2,28	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,45	
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	0,14	
<b>FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,40	
Klasse S USD, thesaurierend	0,50	
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,51	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,48	

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023**
<b>FTGF ClearBridge Value Fund</b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,81	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,81	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,81	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,81	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,81	
Klasse A GBP ausschüttend (A)	1,81	
Klasse A SGD, thesaurierend	1,81	
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,81	
Klasse C USD, thesaurierend	2,31	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,31	
Klasse E USD, thesaurierend	2,56	
Klasse F USD, thesaurierend	1,21	
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,20	
Klasse X USD, thesaurierend	1,13	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,13	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,13	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,78	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,78	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,78	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,78	
LM Klasse USD, ausschüttend (A)	0,11	
<b>FTGF ClearBridge US Appreciation Fund</b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,74	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,74	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,76	
Klasse B USD, thesaurierend	2,23	
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,23	
Klasse C USD, thesaurierend	2,23	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,23	
Klasse E USD, thesaurierend	2,51	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,51	
Klasse F USD, thesaurierend	1,16	
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,16	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,13	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,13	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,79	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,79	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,78	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,16	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,17	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,41	
Klasse B (G) USD, thesaurierend	2,35	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,91	
Klasse GA USD, thesaurierend	1,58	
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,58	
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	1,58	
Klasse GE USD, thesaurierend	2,33	
Klasse GE EUR, thesaurierend	2,33	
<b>FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund</b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,70	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,70	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,70	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,70	
Klasse B USD, thesaurierend	2,20	
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,20	
Klasse C USD, thesaurierend	2,20	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,20	
Klasse E USD, thesaurierend	2,45	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,46	
Klasse F USD, thesaurierend	1,10	
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,10	
Klasse U USD, thesaurierend	0,63	
Klasse U EUR, thesaurierend	0,63	
Klasse X USD, thesaurierend	1,08	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,08	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,08	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,08	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,73	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,73	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,73	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,73	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,72	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	0,73	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,73	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,11	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,11	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,35	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,85	
Klasse GA USD, thesaurierend	1,52	
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,52	
<b>FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund</b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,77	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,77	
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,77	
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,77	
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	1,77	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,77	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,77	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,77	
Klasse A GBP, thesaurierend	1,77	
Klasse A HKD, thesaurierend	1,77	
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	1,77	
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,78	
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,30	
Klasse C USD, thesaurierend	2,27	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,27	
Klasse E USD, thesaurierend	2,52	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,52	
Klasse E EUR, thesaurierend	2,52	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,52	
Klasse F USD, thesaurierend	1,17	
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,17	
Klasse X USD, thesaurierend	1,12	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,12	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,12	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,12	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,12	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,75	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,77	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,79	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,77	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,77	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	0,77	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,12	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,42	
Klasse B (G) USD, thesaurierend	1,92	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,92	
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,54	
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	1,54	
Klasse GE USD, thesaurierend	2,29	
Klasse GE EUR, thesaurierend	2,29	
<b>FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund</b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,74	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,74	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,74	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,74	
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	1,74	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,74	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,74	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,74	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,74	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,74	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,74	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,74	
Klasse C USD, thesaurierend	2,24	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,24	
Klasse C USD, ausschüttend (Q)	2,24	
Klasse F USD, thesaurierend	1,14	
Klasse F EUR, thesaurierend	1,14	
Klasse F EUR, ausschüttend (A)	1,14	
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,12	
<b>FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund</b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,66	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,66	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,66	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,65	
Klasse A SEK, thesaurierend	1,50	
Klasse F USD, thesaurierend	1,06	
Klasse X USD, thesaurierend	1,06	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,06	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,06	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,06	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,06	
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,05	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,70	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,71	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,75	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,71	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,71	
Klasse S USD, thesaurierend	0,51	
Klasse S EUR, thesaurierend	0,51	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,51	
Klasse S GBP, thesaurierend	0,51	
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,51	
Klasse S GBP, ausschüttend (Q)	0,51	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,11	



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

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023**
<b>FTGF ClearBridge Global Growth Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,79	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,80	
<b>FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,95	
Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)	1,95	
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,95	
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	1,95	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,95	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,95	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,95	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	1,95	
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,95	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus	1,95	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,95	
Klasse C USD, thesaurierend	2,45	
Klasse C USD, thesaurierend (abgesichert)	2,45	
Klasse E USD, thesaurierend	2,70	
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)	2,70	
Klasse E EUR, thesaurierend	2,75	
Klasse E EUR, ausschüttend (A)	2,75	
Klasse F USD, thesaurierend	1,35	
Klasse F USD, thesaurierend (abgesichert)	1,35	
Klasse U EUR, thesaurierend	0,71	
Klasse X USD, thesaurierend	1,05	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,05	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,05	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	1,05	
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)	1,05	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,85	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,85	
Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q)	0,85	
(abgesichert) (PH) Plus (e)		
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,85	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	0,85	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,85	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	0,85	
(abgesichert) (PH) Plus (e)		
Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q)	0,85	
<b>FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund</b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,96	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,96	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,96	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,96	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,97	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) Plus (e)	1,97	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,97	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,97	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,96	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,96	
Klasse U USD, thesaurierend	0,72	
Klasse U EUR, thesaurierend	0,72	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) Plus (e)	0,72	
Klasse A GBP, thesaurierend	0,72	
Klasse U GBP thesaurierend (abgesichert)	0,72	
Klasse U GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	0,72	
Klasse U GBP, ausschüttend (Q) Plus (e)	0,71	
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,21	
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,22	
Klasse X EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	1,22	
Klasse X GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	1,22	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,86	
Klasse Premier USD, ausschüttend (M) Plus	0,86	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,87	
Klasse S USD, thesaurierend	0,52	
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus	0,51	
<b>FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund</b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,96	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,96	
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,96	
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	1,96	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,96	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,96	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,96	
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,96	
Klasse A GBP ausschüttend (A)	1,96	
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	1,96	
Klasse A SGD, thesaurierend	1,96	
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,96	
Klasse B USD, thesaurierend	2,46	
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,46	
Klasse C USD, thesaurierend	2,46	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,46	
Klasse E USD, thesaurierend	2,71	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,71	
Klasse E EUR, thesaurierend	2,71	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,71	
Klasse F USD, thesaurierend	1,36	
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,36	
Klasse R USD, thesaurierend	0,90	
Klasse R EUR, thesaurierend	1,46	
Klasse X USD, thesaurierend	1,21	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,21	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,21	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,21	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,21	
Klasse X GBP ausschüttend (A)	1,21	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,86	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,86	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,86	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,86	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,86	
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	0,86	
<b>FTGF Royce US Smaller Companies Fund</b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,99	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	2,04	
Klasse A EUR, thesaurierend	2,04	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,04	
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	2,04	
Klasse A GBP ausschüttend (A)	2,04	
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)	2,00	
Klasse C USD, thesaurierend	2,49	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,53	
Klasse E USD, thesaurierend	2,79	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,79	
Klasse E EUR, thesaurierend	2,79	
Klasse F USD, thesaurierend	1,43	
Klasse F USD, ausschüttend (A)	1,43	
Klasse R USD, thesaurierend	1,54	
Klasse X USD, thesaurierend	1,29	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,28	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,92	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,94	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	0,94	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,19	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,44	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,93	
<b>FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD, thesaurierend	2,00	
Klasse X USD, thesaurierend	1,23	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,25	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,90	
<b>FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup></b>		
Klasse A USD, thesaurierend	1,98	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,98	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,98	
Klasse C USD, thesaurierend	2,48	
Klasse E USD, thesaurierend	2,73	
Klasse F USD, thesaurierend	1,38	
Klasse X USD, thesaurierend	1,23	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,23	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,23	
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,23	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,88	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,88	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,53	
Klasse S GBP, thesaurierend	0,53	

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

**Quote der Betriebskosten  
(Ratio of Total Operating  
Ausgaben in WE(1) bis  
Durchschnitt  
Tägliches Nettovermögen des  
Fonds in WE(1)(%)  
Für den Berichtszeitraum zum  
31. August 2023\*\***

<b>FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund</b>	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	2,00
Klasse A AUD, ausschüttend (M) Plus	2,00
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus (e)	2,00
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	1,99
Klasse D AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,59
Klasse D CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,60
Klasse D HKD, ausschüttend (M) Plus	1,60
Klasse D SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,60
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus	1,60
Klasse D USD, thesaurierend	1,60
Klasse X AUD, thesaurierend	1,25
Klasse X USD, thesaurierend	1,25
Klasse S GBP, thesaurierend	0,59
Klasse S GBP, ausschüttend (M) Plus (e)	0,59
Klasse LM AUD, thesaurierend	0,15
<b>FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^</b>	
Klasse A USD, thesaurierend	1,99
Klasse E USD, thesaurierend	2,74
Klasse F USD, thesaurierend	1,39
Klasse X USD, thesaurierend	1,25
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,90
Klasse S USD, thesaurierend	0,70
Klasse S EUR, thesaurierend	0,70
<b>FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^</b>	
Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)	1,97
Klasse A EUR, thesaurierend	1,97
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)	2,72
Klasse X EUR, thesaurierend	1,22
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,87
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,87
Klasse S USD, thesaurierend	0,50
Klasse S EUR, thesaurierend	0,47
Klasse S GBP, thesaurierend	0,47
<b>FTGF Martin Currie Improving Society Fund^</b>	
Klasse A USD, thesaurierend	2,00
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,25
Klasse S USD, thesaurierend	0,15
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,15
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,15
<b>Franklin Responsible Income 2028 Fund^</b>	
Klasse A EUR, thesaurierend	0,74
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	0,74
Klasse D EUR, thesaurierend	1,29
Klasse D EUR, ausschüttend (A)	1,29
Klasse X EUR, thesaurierend	0,34
Klasse X EUR, ausschüttend (A)	0,34

Die Berechnungsmethode für die Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) ist auf der Website der Asset Management Association Switzerland (AMAS) ([www.am-switzerland.ch](http://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.

# Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands

## Für den Berichtszeitraum zum 31. August 2023

Gemäß den OGAW-Verordnungen wird eine Aufstellung über die wichtigsten Veränderungen in der Zusammensetzung des Anlageportfolios jedes Fonds während des Berichtszeitraums vorgelegt, um zu gewährleisten, dass die Anteilhaber die Veränderungen in den Anlagen der einzelnen Fonds erkennen können. Diese sind definiert als die gesamten Käufe und Verkäufe einer Anlage (einschließlich Fälligkeiten, aber ohne Reverse-Repo-Geschäfte, Tagesgeldscheinen und Termineinlagen, die hauptsächlich zur Gewährleistung einer effizienten Portfolioverwaltung eingesetzt werden), die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe und Verkäufe für den Zeitraum übersteigen. Es werden mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe aufgeführt. Hat ein Fonds während des Berichtszeitraums weniger als zwanzig Käufe oder Verkäufe getätigt, sind alle Transaktionen aufgeführt.

### FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 26.06.2023	42.382	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 26.06.2023	42.400
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 21.06.2022	40.505	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 21.06.2022	40.600
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 18.05.2023	37.892	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 18.05.2023	37.900
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 14.03.2023	34.996	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 14.03.2023	35.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 15.05.2023	34.986	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 15.05.2023	35.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 13.03.2023	32.288	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 13.03.2023	32.300
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 18.08.2023	29.617	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 18.08.2023	30.000
Federal Home Loan Banks, Serie 0002, 5,330 %, fällig 25.09.2023	26.198	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 16.05.2023	25.300
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 15.03.2023	24.997	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 15.03.2023	25.000
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 06.06.2023	24.838	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 16.03.2023	25.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 16.05.2023	25.264	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 06.06.2023	25.000
Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,450 %, fällig 20.03.2024	25.001	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 14.03.2023	25.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 17.09.2023	21.431	Federal Home Loan Banks, 4,600 %, fällig 01.03.2023 FRN	22.900
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 25.05.2023	21.103	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 17.09.2023	21.500
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 26.07.2023	20.512	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 25.05.2023	21.200
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 26.07.2023	20.047	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 24.05.2023	21.000
Federal Home Loan Banks, 5,420 %, fällig 14.03.2024	20.008	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 19.05.2023	20.600
Federal Home Loan Banks, 4,630 %, fällig 14.06.2023	20.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 26.07.2023	20.515
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 11.07.2023	19.953	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 26.07.2023	20.310
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 03.05.2023	19.925	Federal Farm Credit Discount, Nullkupon, fällig 08.03.2023	20.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 27.06.2023	19.897	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 03.05.2023	20.000
		Federal Home Loan Banks, 4,850 %, fällig 03.05.2023 FRN	20.000
		Federal Home Loan Banks, 4,910 %, fällig 06.04.2023 FRN	20.000
		Federal Home Loan Banks, 5,130 %, fällig 14.06.2023 FRN	20.000
		United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 10.08.2023	20.000
		United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 11.07.2023	20.000
		United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 31.08.2023	20.000
		United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 04.04.2023	19.981
		Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 27.06.2023	19.900
		Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 17.05.2023	19.897
		Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 2,610 %, fällig 09.06.2023	19.000

### FTGF Western Asset US Core Bond Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGSTE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	57.041	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	48.014
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	8.458	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	8.448
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.05.2053	7.752	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	7.472
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	7.473	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	5.537
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.07.2028	6.091	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	4.425
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	5.565	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 31.12.2027	4.079
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	4.434	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	4.042
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	4.004	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.994
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.903	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.666
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	3.731	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.519
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.678	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.500
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.560	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.114
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.514	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.775
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.08.2023	3.323	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.518
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	3.149	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	2.427
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 31.05.2028	3.063	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.302
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.782	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.147
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.518	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.113
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	2.493	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.087
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,500 %	2.460	United States Treasury Note/Bond, 0,000 %, fällig 18.04.2023	2.050

### FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	27.049	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	27.473
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 29.02.2028	24.520	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 29.02.2028	24.827
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.05.2028	23.945	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.05.2028	23.890
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,500 %	17.327	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	22.824
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,000 %	16.648	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	17.858
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.08.2023	16.384	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,500 %	17.546
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	14.862	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 31.01.2028	17.256
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	14.791	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,000 %	16.606
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,000 %	14.248	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.08.2023	16.388
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	12.993	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.01.2025	15.342
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,000 %	12.086	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	14.970
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,000 %	12.003	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	14.797
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	11.358	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,000 %	14.316
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	11.315	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	12.927
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	11.266	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	12.343
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	11.204	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,000 %	12.325
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	11.115	United States Treasury Note/Bond, 4,500 %, fällig 30.11.2024	12.322

# Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

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

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAF-	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE
	FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		(in Tsd.) USD
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	11.013	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,000 %	11.891
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.05.2053	10.613	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 28.03.2023	11.650
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,000 %	10.494	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	11.508
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 4,000 %	10.276	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 08.03.2023	11.450
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	9.497	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	11.380
		Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	11.321
		Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	11.285
		Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	11.280
		Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	11.203

## FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAF-	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE
	FUNGSKOSTEN (in Tsd.) EUR		(in Tsd.) EUR
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	6.852	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2031	9.825
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, fällig 15.08.2032	1.971	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	6.965
Goldman Sachs Group Inc/The, 0,875 %, fällig 09.05.2029	1.220	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, fällig 15.08.2032	2.349
Bundesrepublik Deutschland, 0,000 %, fällig 04.10.2026	900	Niederländische Staatsanleihe, 144A, 0,000 %, fällig 15.07.2030	1.895
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	829	Spanische Staatsanleihe, Serie 30Y, 2,700 %, fällig 31.10.2048	1.788
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	816	Republik Frankreich, Staatsanleihe OAT, 3,250 %, fällig 25.05.2045	1.745
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	786	Republik Frankreich, Staatsanleihe OAT, 0,000 %, fällig 25.11.2030	1.676
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	708	Italien Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie 31Y, 144A, 3,250 %, fällig 01.09.2046	1.640
Vodafone Group Plc, 2,875 %, fällig 20.11.2037	694	Mexiko, internationale Staatsanleihe, 4,600 %, fällig 23.01.2046	1.435
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	684	Italien Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie CPI, 144A, 0,400 %, fällig 15.05.2030	1.421
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	629	Europäischer Stabilitätsmechanismus, Serie EUR, 0,750 %, fällig 05.09.2028	1.247
Bundesrepublik Deutschland, 4,25 %, fällig 07.04.2039	618	HSBC Holdings Plc, 3,019 %, fällig 15.06.2027	1.245
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	593	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000 %, fällig 01.11.2028	1.196
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	522	NatWest Group Plc, 2,500 %, fällig 22.03.2023	1.190
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	447	Republik Österreich, Staatsanleihe, 0,900 %, fällig 20.02.2032	1.076
Bundesrepublik Deutschland, 0,000 %, fällig 15.08.2052	377	Wells Fargo & Co, 2,250 %, fällig 02.05.2023	1.050
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	338	Königreich Belgien, Staatsanleihe, Serie 71, 3,750 %, fällig 22.06.2045	953
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	328	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	827
Cellnex Finance Co SA, 2,000 %, fällig 15.09.2032	308	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	816
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	267	Internationale Anleihe der Republik Südafrika, 4,300 %, fällig 12.10.2028	811
		Republik Frankreich, Staatsanleihe OAT, 0,750 %, fällig 25.05.2028	798
		Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	793
		Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, fällig 02.03.2028	760
		Republik Frankreich, Staatsanleihe, OAT, 1,000 %, fällig am 25.05.2027	744
		Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	704

## FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAF-	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE
	FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		(in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.10.2027	11.729	Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	4.021
Mexiko, internationale Staatsanleihe, 8,500 %, fällig 31.05.2029	4.019	JPMorgan Chase & Co., Serie U, 6,125 %, ohne Laufzeitbegrenzung	1.743
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.11.2026	3.981	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	1.522
United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 31.03.2027	1.964	Gabun, internationale Staatsanleihe, 7,000 %, fällig 24.11.2031	1.290
Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	1.513	Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Belvis Holdco SL, 144A, 5,250 %, fällig 27.04.2029	1.278
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2042	1.417	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig 21.07.2023	1.162
Vodafone Group Plc, 8,000 %, fällig 30.08.2086	1.252	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Klasse LM EUR, thesaurierend	1.141
Banco Santander SA, 5,750 %, fällig 23.08.2033	1.083	1011778 BC ULCL / New Red Finance Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.01.2028	1.085
Sedgwick Claims Management Services Inc, 8,324 %, fällig 17.02.2028	913	Vale Overseas Ltd, 6,250 %, fällig 10.08.2026	1.079
Intesa Sanpaolo SpA, 6,500 %, fällig 14.03.2029	908	Transportadora de Gas del Peru SA, 4,250 %, fällig 30.04.2028	1.066
Altice Financing SA.France, 2,250 %, fällig 15.01.2025	817	Deutsche Bank AG, 4,000 %, fällig 24.06.2026	1.031
Altice France SA, 2,125 %, fällig 15.02.2025	811	Credit Suisse Group AG, 6,373 %, fällig 15.07.2026	1.030
Via Celere Desarrollos Inmobiliari, 5,250 %, fällig 01.04.2026	761	Match Group Holdings II LLC, 144A, 5,000 %, fällig am 15.12.2027	1.018
Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig 01.01.2027	625	Delta Air Lines Inc, 114A, 7,000 %, fällig 01.05.2025	951
Internationale Anleihe der Republik Südafrika, 6,500 %, fällig 28.02.2041	613	Sedgwick Claims Management Services Inc, 5,622 %, fällig 31.12.2025	913
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.03.2028	501	DP World Ltd.United Arab Emirates, 5,625 %, fällig 25.09.2048	892
Connecticut Avenue Securities Trust, Serie 2041, 8,169 %, fällig 25.10.2041	452	Intesa Sanpaolo SpA, 6,375 %, fortwährend	886
Indonesische Staatsanleihe, Serie FR59, 7,000 %, fällig 15.05.2027	401	Renk AG/Frankfurt am Main, 5,750 %, fällig 15.07.2025	869
Connecticut Avenue Securities Trust, Serie 2043, 0,000 %, fällig 25.06.2043	390	Clarios Global LP, 5,622 %, fällig 30.04.2026	811
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.05.2053	376	IPD 3 BV, 5,500 %, fällig 01.12.2025	639
		Castor SpA, 6,000 %, fällig 15.02.2029	575
		Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, fällig 01.04.2028	565
		Panama, internationale Staatsanleihe, 4,500 %, fällig 01.04.2056	499
		CCO Holdings LLC.CCO Holdings Capital Corp., 144A, 4,500 %, fällig 01.06.2033	453
		Sands China Ltd, 3,100 %, fällig 08.03.2029	448
		Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	445
		Icici Bank Ltd.Dubai, 4,000 %, fällig 18.03.2026	405
		Chepharm Arzneimittel GmbH, 4,375 %, fällig 15.01.2028	403
		Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 20.10.2028	385
		Navient Corp, 5,875 %, fällig 25.10.2024	335
		Antofagasta Plc, 2,375 %, fällig 14.10.2030	333

# Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

## FTGF Western Asset US High Yield Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	17.354	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	18.872
Open Text Corp., 144A, 6,900 %, fällig 01.12.2027	1.543	Open Text Corp, 144A, 6,900 %, fällig 01.12.2027	1.499
ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, fällig 14.04.2030	952	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2027	1.345
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig 01.06.2031	938	Ford Motor Co, 6,100 %, fällig 19.08.2032	897
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, fällig 15.01.2026	674	Western Midstream Operating, LP, 5,450 %, fällig 01.04.2044	787
LifePoint Health Inc, 144A, 9,875 %, fällig 15.08.2030	610	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig 01.11.2033	715
Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08.08.2024	581	Penn Virginia Holdings LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.08.2026	641
DCert Buyer, Inc., 12,331 %, fällig 16.02.2029	569	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, fällig 09.05.2029	629
GFL Environmental Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15.06.2029	553	Occidental Petroleum Corp, 8,875 %, fällig 15.07.2030	623
Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, ohne Laufzeitbegrenzung	501	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	622
R.R. Donnelley, 14,500 %, fällig 08.03.2028	485	Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, fällig 15.05.2025	620
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, fällig 15.09.2031	460	US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, fällig 15.07.2027	606
Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.08.2027	439	StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.05.2029	600
Royal Caribbean Cruises Ltd, 3,700 %, fällig 15.03.2028	375	Bombardier Inc, 144A, 7,875 %, due 15.04.2027	577
Royal Caribbean Cruises Ltd, 5,375 %, fällig 15.07.2027	364	DCert Buyer, Inc., 9,372 %, fällig 16.02.2029	569
Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 9,250 %, fällig 01.07.2031	345	Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, fällig 15.06.2025	553
US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, fällig 28.06.2028	344	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.08.2027	541
Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, ohne Laufzeitbegrenzung	322	Transocean Inc, 144A, 8,750 %, fällig 15.02.2030	527
Toronto-Dominion Bank/The, 8,125 %, fällig 31.10.2082	320	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	504
BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, ohne Laufzeitbegrenzung	309	Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.05.2029	502

## FTGF Western Asset Global High Yield Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30.04.2026	905	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	992
ZF North America Capital Inc, 144A, 6,875 %, fällig 14.04.2028	578	Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, fällig 16.02.2028	765
United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.11.2027	512	VZ Secured Financing BV, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2032	631
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 15.02.2033	502	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.01.2034	598
Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2029	501	Internationale Anleihe der türkischen Regierung, 4,250 %, fällig 14.04.2026	539
Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,375 %, fällig 01.05.2025	499	Saga Plc, 5,500 %, fällig 15.07.2026	508
Panama, internationale Staatsanleihe, 2,252 %, fällig 29.09.2032	498	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31.12.2023	487
Vodafone Group Plc, 4,125 %, fällig 30.05.2025	395	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 28.02.2027	470
GFL Environmental Inc, 144A, 4,250 %, fällig 01.06.2025	386	Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.05.2029	440
American Airlines Group Inc, 144A, 3,750 %, fällig 01.03.2025	384	Level 3 Financing Inc, 144A, 3,625 %, fällig 15.01.2029	364
Nigeria, internationale Staatsanleihe, 144A, 7,143 %, fällig 23.02.2030	270	NCL Finance Ltd, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2028	344
Kolumbien, internationale Staatsanleihe, 3,125 %, fällig 15.04.2031	261	Sands China Ltd, 3,500 %, fällig 08.08.2031	332
Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, ohne Laufzeitbegrenzung	253	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30.04.2026	318
Comerica Bank, 2,500 %, fällig 23.07.2024	253	Carnival Corp, 144A, 10,500 %, fällig 01.06.2030	296
CSC Holdings LLC, 11,250 %, fällig 15.05.2028	250	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	288
Ritchie Bros Holdings Inc, 144A, 7,750 %, fällig 15.03.2031	250	MGM China Holdings Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 01.02.2027	255
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 05.09.2023	249	Ghana, internationale Staatsanleihe, 144A, 10,750 %, fällig 14.10.2030	246
Mexiko, internationale Staatsanleihe, 2,659 %, fällig 24.05.2031	249	CSC Holdings LLC, 11,250 %, fällig 15.05.2028	243
T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.04.2026	235	Altice France SA.France, 144A, 5,500 %, fällig 15.10.2029	223
Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, ohne Laufzeitbegrenzung	219	Credit Suisse Group AG, 144A, 6,537 %, fällig 12.08.2033	218
Internationale Anleihe der türkischen Regierung, 4,875 %, fällig 16.04.2043	208	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 29.02.2024	195
ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, fällig 14.04.2030	203	Altice France Holding SA, 144A, 6,000 %, fällig 15.02.2028	191
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig 01.06.2031	200	NCL Corp Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 15.12.2024	191
Telecom Italia SpA.Milano, 144A, 5,303 %, fällig 30.05.2024	196	Dominikanische Republik, internationale Staatsanleihe, 144A, 6,000 %, fällig 22.02.2033	189
Delta Air Lines Inc, 2,900 %, fällig 28.10.2024	193	APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625 %, fällig 15.01.2027	186
Service Corp International.US, 5,125 %, fällig 01.06.2029	187	Wheel Bidco Ltd, 6,750 %, fällig 15.07.2026	185
Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 144A, 5,250 %, fällig 27.04.2029	185	StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.05.2029	180
Dominican Republic International Bond, 4,875 %, fällig 23.09.2032	182	Marks & Spencer Plc, 3,750 %, fällig 19.05.2026	173
Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01.09.2026	179	Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 04.12.2029	167
CSC Holdings LLC, 144A, 3,375 %, fällig 15.02.2031	172	Match Group Holdings II LLC, 144A, 3,625 %, fällig 01.10.2031	166
Titan International Inc, 7,000 %, fällig 30.04.2028	159	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	157
Ashtead Capital Inc, 144A, 2,450 %, fällig 12.08.2031	156	Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	152
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, fällig 01.06.2032	151	Altice Financing SA, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2028	151
Bombardier Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15.06.2026	148	ZF North America Capital Inc, 144A, 6,875 %, fällig 14.04.2028	150
Southwestern Energy Co, 5,375 %, fällig 15.03.2030	135	Southwestern Energy Co, 5,375 %, fällig 15.03.2030	139
Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	132	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Klasse LM EUR, thesaurierend	136
Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, fällig 07.04.2026	119	Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 6,375 %, fällig 01.09.2037	129
Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08.08.2024	116		



# Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

## FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	74.563	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	75.780
Singapur, Staatsanleihe, 2,625 %, fällig 01.08.2032	11.183	Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 84, Nullkupon, fällig 07.07.2023	8.856
indonesische Staatsanleihe, Serie FR89, 6,875 %, fällig 15.08.2051	10.613	Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 84, Nullkupon, fällig 04.10.2023	8.524
Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung, 5,150 %, fällig 16.02.2024	9.564	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31.07.2023	7.920
Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 84, Nullkupon, fällig 07.07.2023	8.924	Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 84, Nullkupon, fällig 21.07.2023	7.880
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31.07.2023	7.914	Korea Treasury Bond, Serie 2409, 3,125 %, fällig 09.10.2024	7.607
Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 84, Nullkupon, fällig 21.07.2023	7.846	Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 84, Nullkupon, fällig 03.10.2023	7.413
Australia Staatsanleihe, 3,750 %, fällig 21.04.2037	6.514	United Overseas Bank Ltd, 3,875 %, Ewige Anleihe	6.896
Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 84, Nullkupon, fällig 28.04.2023	4.506	indonesische Staatsanleihe, Serie FR56, 8,375 %, fällig 15.09.2026	6.868
Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 84, Nullkupon, fällig 23.06.2023	4.478	Mercatus Co-operative Ltd, Serie DMTN, 2,800 %, fällig 26.07.2024	6.752
Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 84, Nullkupon, fällig 31.03.2023	4.288	koreanische Staatsanleihe, Serie 3206, 3,375 %, fällig 06.10.2032	6.604
HSBC Holdings Plc, 5,300 %, fällig 14.03.2023	3.692	Malaysia Staatsanleihe, Serie 0411, 4,232 %, fällig 30.06.2031	6.157
Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 84, Nullkupon, fällig 13.10.2023	3.445	United States Treasury Note/Bond, 0,125 %, fällig 15.12.2023	5.192
Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 84, Nullkupon, fällig 15.09.2023	2.949	Indische Staatsanleihe, 7,380 %, fällig 20.06.2027	4.857
Vietnam, internationale Staatsanleihe, 4,800 %, fällig 19.11.2024	2.947	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2048	4.679
Korea Electric Power Corp, 5,375 %, fällig 31.07.2026	2.595	Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 84, Nullkupon, fällig 28.04.2023	4.497
Bank Mandiri, 5,500 %, fällig 04.04.2026	2.539	Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 84, Nullkupon, fällig 23.06.2023	4.436
Singapur, Staatsanleihe, 3,375 %, fällig 01.09.2033	2.302	Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 84, Nullkupon, fällig 31.03.2023	4.358
Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 84, Nullkupon, fällig 28.07.2023	745	Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 84, Nullkupon, fällig 03.03.2023	4.241
Schatzwechsel der Monetary Authority of Singapore, Serie 84, Nullkupon, fällig 14.07.2023	744	HSBC Holdings Plc, 5,300 %, fällig 14.03.2023	3.753
		Singapur, Staatsanleihe, 2,625 %, fällig 01.08.2032	3.550
		indonesische Staatsanleihe, Serie FR77, 8,125 %, fällig 15.05.2024	3.499
		Bank Mandiri, 5,500 %, fällig 04.04.2026	2.550
		Coastal Emerald Ltd, 4,300 %, ohne Laufzeitbegrenzung	2.433
		Minejesa Capital BV, 5,625 %, fällig 10.08.2037	2.357
		Singapur, Staatsanleihe, 3,375 %, fällig 01.09.2033	2.316

## FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	144.801	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	157.885
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,650 %, fällig 19.05.2030	7.986	United States Treasury Note/Bond, 1,000 %, fällig 15.12.2024	25.035
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 15.02.2033	5.380	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15.05.2030	12.540
Bank of New York Mellon Corp/The, 4,947 %, fällig 26.04.2027	5.200	Exxon Mobil Corp, 0,142 %, fällig 26.06.2024	6.157
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, 3,375 %, fällig 21.10.2025	4.698	Charles Schwab Corp/The, 1,950 %, fällig 01.12.2031	5.813
Cargill Inc, 144A, 4,500 %, fällig 24.06.2026	3.992	Nykredit Realkredit AS, 0,250 %, fällig 13.01.2026	5.587
Banco Santander SA, 4,250 %, fällig 12.06.2030	3.425	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 15.02.2033	5.302
Nestle Holdings Inc, 144A, 5,250 %, fällig 13.03.2026	3.001	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 15.02.2030	4.632
Linde Plc, 3,375 %, fällig 06.12.2029	2.989	Siemens Financieringsmaatschappij, 3,375 %, fällig 24.08.2031	3.929
ABN AMRO Bank NV, 5,250 %, fällig 26.05.2026	2.987	Verizon Communications Inc, 4,329 %, fällig 21.09.2028	3.816
Robert Bosch GmbH, 3,625 %, fällig 06.02.2027	2.681	ABN AMRO Bank NV, 0,875 %, fällig 15.01.2024	3.133
Bank of America Corp, 4,134 %, fällig 12.06.2028	2.678	Home Depot Inc/The, 2,500 %, fällig 15.04.2027	2.609
Bundesrepublik Deutschland, 0,500 %, fällig 15.02.2026	2.224	UBS Group AG, 2,125 %, fällig 04.03.2024	2.524
Nationwide Building Society, 6,125 %, fällig 21.08.2028	2.010	Merck & Co Inc, 1,900 %, fällig 10.12.2028	2.395
HSBC Holdings Plc, 6,161 %, fällig 09.03.2029	1.800	NIKE Inc, 2,400 %, fällig 27.03.2025	2.394
Sika Capital BV, 3,750 %, fällig 03.11.2026	1.710	Roche Holdings Inc, 144A, 1,930 %, fällig 13.12.2028	2.389
Cargill Inc, 3,875 %, fällig 24.04.2030	1.481	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, 3,375 %, fällig 21.10.2025	2.383
Neste Oyj, 3,875 %, fällig 16.03.2029	1.286	EssilorLuxottica SA, 0,000 %, fällig 27.05.2023	2.360
Sika Capital BV, 3,750 %, fällig 03.05.2030	1.146	AstraZeneca Plc, 3,625 %, fällig 03.03.2027	2.343
		Bank of Nova Scotia/The, 0,500 %, fällig 30.04.2024	2.328



# Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

## FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund<sup>^</sup>

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 15.04.2024	12.754	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 28.02.2025	11.101
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.08.2028	8.312	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	6.231
United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31.08.2025	6.271	United States Treasury Note/Bond, 0,125 %, fällig 30.06.2023	4.716
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	6.258	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 15.04.2024	3.988
United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31.08.2025	4.706	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	3.660
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	3.676	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	3.576
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	3.595	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,000 %	3.562
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	3.581	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	3.350
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,000 %	3.569	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	3.229
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	3.394	United States Treasury Note/Bond, Nullkupon, fällig 30.11.2023	3.121
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	3.256	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.10.2027	2.898
United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 31.10.2028	3.176	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	2.658
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.10.2027	2.928	Japanische Staatsanleihe mit CPI-Anleihe, Serie 21, 0,100 %, fällig 20.03.2026	2.585
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	2.418	Japanische Staatsanleihe mit CPI-Anleihe, Serie 21, 0,100 %, fällig 10.03.2026	2.388
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	2.260	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	2.385
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	2.251	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	2.248
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	2.172	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	2.169
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	2.117	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	2.153
Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	2.028	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,500 %	1.995
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,500 %	1.997	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,000 %	1.879
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,000 %	1.893	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	1.854
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,000 %	1.766	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,000 %	1.758
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,000 %	1.761	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,000 %	1.680

## FTGF Western Asset Global Credit Fund<sup>^</sup>

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	11.451	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	11.788
JPMorgan Chase & Co, 0,389 %, fällig 24.02.2028	607	Bundesobligation, Serie 182, 0,000 %, fällig 10.10.2025	569
Morgan Stanley, 4,656 %, fällig 02.03.2029	581	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2029	547
McDonald's Corp, 5,450 %, fällig 14.08.2053	379	Banco Santander SA, 1,750 %, fällig 17.02.2027	430
Danske Bank A.S, 4,750 %, fällig 21.06.2030	367	BNP Paribas SA, 1,875 %, fällig 14.12.2027	430
Bank of America Corp, 1,662 %, fällig 25.04.2028	284	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.02.2027	418
Corning Inc, 4,125 %, fällig 15.05.2031	284	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2052	390
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2031	272	Stellantis NV, 5,250 %, fällig 15.04.2023	360
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2031	254	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2052	345
CRH SMW Finance DAC, 4,000 %, fällig 11.07.2031	250	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	336
Wells Fargo & Co, 5,389 %, fällig 24.04.2034	250	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.11.2026	328
Vodafone Group Plc, 8,000 %, fällig 30.08.2086	246	Suzano Austria GmbH, 7,000 %, fällig 16.03.2047	303
UBS Group AG, 144A, 1,305 %, fällig 02.02.2027	229	HSBC Holdings Plc, 5,875 %, ohne Laufzeitbegrenzung	291
Vereinigtes Königreich, Gilt, 4,125 %, fällig 29.01.2027	223	Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, fällig 01.10.2024	290
Floene Energias SA, 4,875 %, fällig 03.07.2028	218	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, fällig 15.02.2025	286
Bouygues SA, 3,875 %, fällig 17.07.2031	214	Glencore Finance Europe Ltd, 1,875 %, fällig 13.09.2023	282
United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.05.2043	207	Corning Inc, 4,125 %, fällig 15.05.2031	281
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2052	203	CPUK Finance Ltd, 7,239 %, fällig 28.02.2024	281
Electricité de France SA, 9,125 %, ohne Laufzeitbegrenzung	200	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, fällig 15.05.2028	268
HSBC Holdings Plc, 6,332 %, fällig 09.03.2044	200	Danske Bank A.S, 5,375 %, fällig 12.01.2024	268

## FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund<sup>^</sup>

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	862.344	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	877.107
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	115.959	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 31.01.2028	148.666
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	114.318	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	115.959
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.03.2028	101.356	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	114.318
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	97.556	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.03.2028	101.058
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.05.2053	88.311	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	97.577
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	79.123	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.05.2053	83.113
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.05.2028	72.352	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	79.176
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 6,000 %	58.165	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.05.2028	72.115
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	57.983	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	58.176
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,500 %	57.413	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 6,000 %	57.795
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	57.159	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	57.420
United States Treasury Note/Bond, 3,750 %, fällig 31.05.2030	54.085	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,500 %	56.905
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.08.2023	49.629	United States Treasury Note/Bond, 3,750 %, fällig 31.05.2030	54.317
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 30.04.2028	42.250	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.08.2023	49.643
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,500 %	40.630	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 30.04.2028	42.042
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,500 %	40.210	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,500 %	40.649
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,500 %	39.926	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,500 %	39.924
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 6,000 %	36.660	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 31.10.2029	35.932
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.02.2053	34.620	indonesische Staatsanleihe, Serie FR82, 8,375 %, fällig 15.03.2024	35.025
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, fällig 15.05.2023	28.449	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2052	33.382
		United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.02.2053	31.107

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

## FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund<sup>^</sup>

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	3.466	3.526
Cinemark USA Inc, 9,069 %, fällig 24.05.2030	1.734	2.383
Occidental Petroleum Corp, 7,950 %, fällig 15.06.2039	1.556	1.605
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	1.369	1.365
Comerica Bank, 2,500 %, fällig 23.07.2024	1.306	1.259
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 7,375 %, fällig 01.03.2031	1.295	1.199
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	1.264	1.151
Triumph Group Inc, 144A, 9,000 %, fällig 15.03.2028	1.220	1.137
CSC Holdings LLC, 144A, 11,250 %, fällig 15.05.2028	1.192	1.068
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	1.151	973
Carnival Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.03.2027	1.052	972
NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.03.2026	1.030	961
VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 9,500 %, fällig 01.06.2028	900	897
Harbor Freight Tools USA Inc, 8,196 %, fällig 19.10.2027	864	897
GFL Environmental Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15.06.2029	846	873
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig 01.06.2031	840	867
Tutor Perini Corp, 144A, 6,875 %, fällig 01.05.2025	821	834
CIFC Funding 2018-I Ltd, Serie 2018 1A, Klasse C, 144A, 7,322 %, fällig 18.04.2031	815	823
Goldentree Loan Management US Clo 3 Ltd, Serie 2018 3A, Klasse D, 144A, 8,438 %, fällig 20.04.2030	801	719
Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, fällig 07.04.2026	794	716
		714

## FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund<sup>^</sup>

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	81.441	82.766
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	4.985	4.983
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	4.711	4.705
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	4.492	4.478
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	4.090	4.288
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	3.801	4.288
Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Klasse A3, 144A, 6,319 %, fällig 25.05.2068	3.620	4.156
Chase Mortgage Finance Trust Serie 2007-A1, Serie 2007 A1, Klasse 11M1, 4,081 %, fällig 25.03.2037	3.199	4.093
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	2.963	3.807
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	2.898	3.511
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1, Serie 2015 JP1, Klasse C, 4,881 %, fällig 15.01.2049	2.880	3.459
GS Mortgage Securities Trust 2015-GC28, Serie 2015 GC28, Klasse D, 144A, 4,452 %, fällig 02.10.2048	2.732	3.436
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, Serie 2014 GC23, Klasse C, 4,572 %, fällig 10.07.2047	2.717	3.383
Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Klasse B1, 144A, 8,239 %, fällig 25.05.2068	2.640	2.983
Fannie Mae oder Freddie Mac, 4,500 %, fällig 01.10.2052, Nullkupon	2.061	2.943
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28, Serie 2015 C28, Klasse D, 4,216 %, fällig 15.05.2048	2.000	2.875
Freddie Mac Pool, 4,000 %, fällig 01.04.2053	1.234	2.643
GS Mortgage Securities Trust 2015-GC32, Serie 2015 GC32, Klasse D, 3,345 %, fällig 10.07.2048	1.223	2.455
Freddie Mac Pool, 4,000 %, fällig 01.05.2053	1.220	2.213
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	1.097	2.198
		2.129
		2.041
		1.806

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

## FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund<sup>^</sup>

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	134.544	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	131.986
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	24.658	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	26.971
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	20.902	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	20.911
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	19.922	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	17.979
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	17.968	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	17.871
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	17.853	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	17.758
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	17.757	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	16.815
Freddie Mac Pool „SD2245“, 5,500 %, fällig 12.01.2052	17.352	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	16.249
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	16.243	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	16.006
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	16.031	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	15.812
Ginnie Mae II Pool „MA7768“, 3,000 %, fällig 20.12.2051	15.856	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	13.778
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	15.812	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	13.699
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	13.718	Ginnie Mae II Pool „MA7590“, 3,000 %, fällig 20.09.2051	13.064
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	13.601	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	13.028
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	13.048	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	11.953
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	11.946	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	11.830
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	11.857	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	11.762
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	11.744	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	11.493
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	11.484	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	11.456
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	10.198	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	10.261
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	9.076	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	9.229
Freddie Mac Pool „SI2048“, 2,500 %, fällig 07.01.2050	8.558	Fannie Mae Pool „CB0414“, 2,500 %, fällig 01.05.2051	8.469
Ginnie Mae II Pool, 5,000 %, fällig 20.07.2053	8.230	United States Treasury Note/Bond, 0,000 %, fällig 09.05.2023	8.239
		United States Treasury Note/Bond, 0,000 %, fällig 20.07.2023	8.171
		Ginnie Mae II Pool, 5,000 %, fällig 20.07.2053	8.148
		Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	8.147

## FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund<sup>^</sup>

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) GBP		ERLÖSE (in Tsd.) GBP
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Intesa Sanpaolo SpA, 6,500 %, fällig 14.03.2029	359	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,500 %, fällig 02.05.2025	362
Tesco Corporate Treasury Services Plc, 1,875 %, fällig 02.11.2028	354	Barclays Plc, 3,375 %, fällig 02.04.2025	317
Engie SA, 5,625 %, fällig 03.04.2053	296	UniCredit SpA, 7,296 %, fällig 02.04.2034	297
Vereinigtes Königreich, Gilt, 4,250 %, fällig 12.07.2027	267	Close Brothers Group Plc, 2,000 %, fällig 11.09.2031	267
ABN AMRO Bank NV, 5,250 %, fällig 26.05.2026	199	South Eastern Power Networks Plc, 5,500 %, fällig 05.06.2026	255
Vereinigtes Königreich, Gilt, 0,375 %, fällig 22.10.2026	198	BNP Paribas SA, 1,875 %, fällig 14.12.2027	253
Vereinigtes Königreich, Gilt, 1,500 %, fällig 22.07.2026	196	AT&T Inc, Serie GBP, 7,000 %, fällig 30.04.2040	206
CPUK Finance Ltd, 5,876 %, fällig 28.08.2027	190	AT&T Inc, Serie GBP, 2,900 %, fällig 12.04.2026	197
Northern Gas Networks Finance Plc, 6,125 %, fällig 02.06.2033	179	HSBC Holdings Plc, 5,875 %, ohne Laufzeitbegrenzung	189
Vereinigtes Königreich, Gilt, 4,250 %, fällig 12.07.2040	178	Deutsche Bank AG, 4,000 %, fällig 24.06.2026	187
Vereinigtes Königreich, Gilt, 0,500 %, fällig 31.01.2029	176	AT&T Inc, Serie GBP, 4,375 %, fällig 14.09.2029	172
HSBC Holdings Plc, 6,332 %, fällig 09.03.2044	167	United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, fällig 15.08.2042	153
Cadent Finance Plc, 5,750 %, fällig 14.03.2034	150	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.08.2049	141
United Utilities Water Finance Plc, 5,125 %, fällig 06.10.2038	139	National Express Group Plc, 2,375 %, fällig 20.11.2028	124
Vereinigtes Königreich, Gilt, 1,625 %, fällig 22.10.2028	122	Crh Finance UK Plc, 4,125 %, fällig 02.12.2029	109
Weir Group Plc/The, 6,875 %, fällig 14.06.2028	110	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2050	40
NatWest Group Plc, 3,619 %, fällig 29.03.2029	106	Aspire Defence Finance Plc, Serie A, 4,674 %, fällig 31.03.2040	6
National Gas Transmission Plc, 5,750 %, fällig 05.04.2035	100	Greene King Finance Plc, Serie A2, 5,318 %, fällig 15.09.2031	5
		Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, fällig 13.07.2044	4
		Mitchells & Butlers Finance Plc, Serie B2, 6,013 %, fällig 15.12.2028	3

## FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	19.007	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	18.257
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, fällig 15.05.2033	1.820	United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, fällig 15.05.2033	1.811
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 15.02.2033	1.053	Credit Suisse AG/New York, 1,000 %, fällig 05.05.2023	1.250
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.02.2053	1.032	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 15.02.2033	1.099
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.05.2053	686	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.02.2053	992
Credit Suisse AG/New York, 1,000 %, fällig 05.05.2023	490	Credit Suisse AG/New York, 1,000 %, fällig 05.05.2023	930
HSBC Holdings Plc, 6,254 %, fällig 09.03.2034	460	JPMorgan Chase & Co, 5,546 %, fällig 15.12.2025	709
HEICO Corp, 5,250 %, fällig 01.08.2028	459	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.05.2053	617
Bank of America Corp, 2,972 %, fällig 04.02.2033	446	Enel Finance International NV, 144A, 6,800 %, fällig 14.10.2025	603
HCA Inc, 5,500 %, fällig 01.06.2033	420	Sands China Ltd, 5,375 %, fällig 08.08.2025	563
Bank of America Corp, 5,288 %, fällig 25.04.2034 VAR	410	Amgen Inc, 5,250 %, fällig 02.03.2033	560
Electricité de France SA, 6,250 %, fällig 23.05.2033	400	Credit Agricole SA, 144A, 5,301 %, fällig 12.07.2028	558
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,750 %, fällig 19.05.2033	395	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.01.2026	543
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, fällig 26.06.2024	390	DISH DBS Corp, 144A, 5,000 %, fällig 15.03.2023	520
Morgan Stanley Bank NA, 4,754 %, fällig 21.04.2026	390	UBS Group AG, 144A, 6,537 %, fällig 12.08.2033	499
United Airlines 2023-1 Class A Pass Through Trust, 5,800 %, fällig 15.01.2036	390	DNB Bank ASA, 144A, 2,968 %, fällig 28.03.2025	482
ONEOK Inc, 6,050 %, fällig 01.09.2033	370	Danske Bank A.S, 144A, 6,466 %, fällig 09.01.2026	480
Morgan Stanley, 5,449 %, fällig 20.07.2029	360	BNP Paribas SA, 144A, 5,125 %, fällig 13.01.2029	450
ONEOK Inc, 6,625 %, fällig 01.09.2053	358	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, fällig 12.02.2026	436
General Electric Co, 6,750 %, fällig 15.03.2032	347	Verizon Communications Inc, 4,272 %, fällig 15.01.2036	428

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

## Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund<sup>^</sup>

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	3.473	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	4.684
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.03.2028	938	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.03.2028	655
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.08.2023	686	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 30.04.2028	470
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.05.2053	582	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	199
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 15.05.2053	470	Ameriquest Mortgage Securities Inc, FRN, 6,672 %, fällig 25.11.2034	198
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125 %, fällig 15.01.2033	261	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	163
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.03.2030	250	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig 21.07.2023	119
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 31.07.2030	209	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	100
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 15.08.2043	157	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	100
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.02.2053	157	Ginnie Mae II, 5,000 %, fällig 20.12.2052	100
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2015 C03, Klasse 1M2, 10,402 %, fällig 25.07.2025	141	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	99
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, Serie 2022 DNA3, Klasse B1, 144A, 10,938 %, fällig 25.04.2042	104	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	98
Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Klasse 1B1, 144A, 8,388 %, fällig 25.10.2041	100	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	96
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	100	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	94
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	100	Ginnie Mae II, 3,500 %, fällig 20.11.2052	93
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	100	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	92
Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Klasse A1, 144A, 5,811 %, fällig 25.05.2068	100	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 31.07.2030	90
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	99	Saxon Asset Securities Trust 2006-3, Serie 2006 3, Klasse A4, 3,220 %, fällig 25.10.2046	83
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	99	Citadel Securities, 7,422 %, fällig 27.02.2028	49
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	98	RAMP Serie 2006-NC3 Trust, Serie 2006 NC3, Class M1, 5,195 %, fällig 25.08.2036	47
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	96		
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2049	95		
Ginnie Mae II Pool, 3,500 %, fällig 20.11.2052	94		
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	93		

## FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund<sup>^</sup>

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	1.620	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	1.285
Europäische Investitionsbank, 0,050 %, fällig 15.11.2029	401	United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, fällig 15.05.2033	249
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, fällig 15.05.2033	381	Danske Bank A.S, 144A, 5,375 %, fällig 12.01.2024	199
Europäische Investitionsbank, 3,750 %, fällig 14.02.2033	303	HSBC Holdings Plc, 4,950 %, fällig 31.03.2030	195
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2031	264	BNP Paribas SA, 144A, 3,052 %, fällig 13.01.2031	194
McDonald's Corp, 5,450 %, fällig 15.08.2053	189	Bundesrepublik Deutschland, 0,000 %, fällig 15.08.2031	171
Tesco Corporate Treasury Services Plc, 1,875 %, fällig 02.11.2028	115	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, fällig 01.06.2032	149
E.ON SE, 3,750 %, fällig 01.03.2029	108	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,500 %, fällig 02.05.2025	121
Danske Bank AS, 4,750 %, fällig 21.06.2030	108	Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16.03.2037	118
Intesa Sanpaolo SpA, 5,125 %, fällig 29.08.2031	108	AXA SA, 5,125 %, fällig 04.07.2043	110
Bouygues SA, 3,875 %, fällig 17.07.2031	107	Intesa Sanpaolo SpA, 5,125 %, fällig 29.08.2031	109
Morgan Stanley, 4,656 %, fällig 02.03.2029	106	Pandora A.S, 4,500 %, fällig 10.04.2028	109
Pandora A.S, 4,500 %, fällig 10.04.2028	106	Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, fällig 02.03.2028	106
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.02.2053	102	Bundesrepublik Deutschland, 0,500 %, fällig 15.02.2028	99
Bundesrepublik Deutschland, 0,500 %, fällig 15.02.2028	99	Bundesrepublik Deutschland, 4,750 %, fällig 07.04.2034	93
Bank of America Corp, 1,662 %, fällig 25.04.2028	98	UCB SA, 1,000 %, fällig 30.03.2028	92
Pfizer Investment Enterprises Pte, 5,300 %, fällig 19.05.2053	50	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.02.2029	92
Pfizer Investment Enterprises Pte, 4,750 %, fällig 19.05.2033	50	Bundesrepublik Deutschland, 0,000 %, fällig 15.08.2029	86
Wells Fargo & Co, 5,389 %, fällig 24.04.2034	40	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 1,375 %, fällig 26.01.2032	86
Citigroup Inc, 6,174 %, fällig 25.05.2034	30	Vonovia SE, 0,750 %, fällig 01.09.2032	77
		Bank of America Corp, 3,550 %, fällig 05.03.2024	60
		McDonald's Corp, 5,45 %, fällig 15.08.2053	60
		AT&T Inc, 3,500 %, fällig 15.09.2053	48
		United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2032	47
		United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.02.2053	45

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

## FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	42.843	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	38.487
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 15.02.2033	17.149	Kreditanstalt für Wiederaufbau, 0,250 %, fällig 19.10.2023	11.250
Australische Staatsanleihe, Serie 137, 2,750 %, fällig 21.04.2024	9.290	United States Treasury Note/Bond, 4,850 %, fällig 31.07.2024	10.711
Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, Nullkupon, fällig 20.09.2023	9.094	Bundesrepublik Deutschland, 1,700 %, fällig 15.08.2032	9.086
Norwegische Staatsanleihe, Serie 476, 144A, 3,000 %, fällig 14.03.2024	8.727	Koreanische Staatsanleihe, Serie 4412, 2,750 %, fällig 12.10.2044	9.008
Vereinigtes Königreich, Gilt, 3,250 %, fällig 31.01.2033	8.316	Kolumbianische TES, Serie B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	8.416
Vereinigtes Königreich, Gilt, 1,250 %, fällig 31.07.2051	7.875	Republik Polen, Staatsanleihe, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	7.884
Kolumbianische TES, Serie B, 9,250 %, fällig 28.05.2042	7.395	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 22.07.2023	7.223
Frankreich, internationale Staatsanleihe, 0,750 %, fällig 25.05.2053	6.697	Frankreich, internationale Staatsanleihe, 0,750 %, fällig 25.05.2053	6.839
Mexikanische Bonos, Serie MS, 8,000 %, fällig 24.05.2035	5.121	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051	6.125
Variabel verzinsliche United States Treasury Note – bei Ausgabe, 4,931 %, fällig 31.01.2025	4.388	Norwegische Staatsanleihe, Serie 476, 144A, 2,000 %, fällig 24.05.2023	5.833
Chile, internationale Staatsanleihe, 4,950 %, fällig 05.01.2036	3.285	Mexikanische Bonos, Serie M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038	5.745
Kreditanstalt für Wiederaufbau, 0,250 %, fällig 19.10.2023	2.448	Mexikanische Bonos, Serie M 20, 8,500 %, fällig 31.05.2029	5.485
Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	2.306	Goldman Sachs USD Liquid Reserves Fund – institutionelle Anlageklasse	4.256
Variabel verzinsliche United States Treasury Note – bei Ausgabe, 5,498 %, fällig 31.07.2025	880	Australische Staatsanleihe, Serie 137, 2,750 %, fällig 21.04.2024	3.824
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	839	Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, Nullkupon, fällig 20.09.2023	3.694
Goldman Sachs USD Liquid Reserves Fund – institutionelle Anlageklasse	161	Norwegische Staatsanleihe, Serie 476, 144A, 3,000 %, fällig 14.03.2024	3.385
		Variabel verzinsliche United States Treasury Note – bei Ausgabe, 4,931 %, fällig 31.01.2025	2.504
		Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung, 7,250 %, fällig 21.01.2027	579
		Kolumbianische TES, Serie B, 9,250 %, fällig 28.05.2042	366

## FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund<sup>^</sup>

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	201.918	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	194.208
Variabel verzinsliche United States Treasury Note – bei Ausgabe, 4,931 %, fällig 31.01.2025	55.362	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032	70.945
Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, fällig 01.01.2033	21.435	Variabel verzinsliche United States Treasury Note – bei Ausgabe, 4,931 %, fällig 31.01.2025	53.835
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032	20.098	Variabel verzinsliche United States Treasury Note – bei Ausgabe, 4,931 %, fällig 31.03.2024 FRN	46.137
Variabel verzinsliche United States Treasury Note – bei Ausgabe, 5,418 %, fällig 30.04.2025	17.145	Goldman Sachs USD Liquid Reserves Fund – institutionelle Anlageklasse	31.630
Kolumbianische TES, Serie B, 9,250 %, fällig 28.05.2042	11.646	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, fällig 01.01.2031	31.072
Vereinigtes Königreich, Gilt, 1,250 %, fällig 31.07.2051	10.949	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, fällig 01.01.2033	26.331
General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, fällig 06.04.2026	10.802	Republik Polen, Staatsanleihe, 1,750 %, fällig 25.04.2032	26.079
Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, fällig 18.05.2026	8.602	Kolumbianische TES, Serie B, 9,250 %, fällig 28.05.2042	19.808
Ginnie Mae II Pool „MA8801“, 5,500 %, fällig 20.04.2053	8.582	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	12.910
Ginnie Mae II Pool „MA8947“, 5,000 %, fällig 20.06.2053	6.707	Peruanische Staatsanleihe, 6,150 %, fällig 12.08.2032	12.087
Ginnie Mae II Pool „MA8879“, 5,500 %, fällig 20.05.2053	5.892	Kolumbianische TES, Serie B, 7,250 %, fällig 26.10.2050	11.277
Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	5.608	Macquarie Group Ltd, 6,207 %, fällig 22.11.2024	10.651
Ginnie Mae II Pool „MA8648“, 5,500 %, fällig 20.02.2053	4.759	Durch gewerbliche Hypotheken besicherte Wertpapiere, 3,510 %, fällig 10.09.2050	10.608
Ginnie Mae II Pool „MA8948“, 5,500 %, fällig 20.06.2053	4.540	Goldman Sachs USD Liquid Reserves Fund – institutionelle Anlageklasse, 5,700 %, fällig 01.11.2024	10.263
Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig 28.01.2060	4.390	Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	10.256
Goldman Sachs USD Liquid Reserves Fund – institutionelle Anlageklasse	1.065	Freddie Mac Pool „SD8277“, 5,500 %, fällig 12.01.2052	9.400
		Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,955 %, fällig 14.03.2025	9.163
		Kolumbianische TES, Serie B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	8.536
		Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, 3,276 %, fällig 15.11.2052	7.593
		Neuseeländische Staatsanleihe, Serie 0551, 2,750 %, fällig 15.05.2051	7.459

## FTGF Brandywine Global High Yield Fund<sup>^</sup>

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	10.383	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	9.537
Sabre GLBL Inc, 144A, 9,250 %, fällig 15.04.2025	945	Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, fällig 15.05.2025	629
Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.10.2026	774	Sabre GLBL Inc, 144A, 9,250 %, fällig 15.04.2025	591
Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp, 144A, 4,875 %, fällig 01.05.2029	751	Sabre GLBL Inc, 144A, 7,375 %, fällig 01.09.2025	563
Petroleos Mexicanos, 5,950 %, fällig 28.01.2031	673	Lindblad Expeditions Holdings Inc, 9,000 %, fällig 15.05.2028	521
Athabasca Oil Corp, 144A, 9,750 %, fällig 01.11.2026	666	PRA Group Inc, 144A, 8,375 %, fällig 01.02.2028	502
Allwyn Entertainment Financing UK Plc, 7,250 %, fällig 30.04.2030	632	Arko Corp, 144A, 5,125 %, fällig 15.11.2029	501
Valvoline Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.02.2030	589	MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig 14.01.2031	473
GrubHub Holdings Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.07.2027	588	Cargo Aircraft Management Inc, 144A, 4,750 %, fällig 01.02.2028	472
Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 01.02.2029	588	Petroleos Mexicanos, 5,950 %, fällig 28.01.2031	459
Station Casinos LLC, 144A, 4,625 %, fällig 01.12.2031	578	Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp, 144A, 4,875 %, fällig 01.05.2029	453
Lindblad Expeditions Holdings Inc, 9,000 %, fällig 15.05.2028	512	Electricité de France SA, 6,250 %, fällig 23.05.2033	452
PRA Group Inc, 144A, 8,375 %, fällig 01.02.2028	495	United States Cellular Corp, 6,700 %, fällig 15.12.2033	433
Cargo Aircraft Management Inc, 144A, 4,750 %, fällig 01.02.2028	476	Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01.08.2026	428
United States Cellular Corp, 6,700 %, fällig 15.12.2033	463	Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.10.2026	418
FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig 01.01.2030	459	Syneos Health Inc, 3,625 %, fällig 15.01.2029	413
Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, fällig 15.12.2027	458	Goldman Sachs USD Liquid Reserves Fund – institutionelle Anlageklasse	403
Sabre GLBL Inc, 144A, 7,375 %, fällig 01.09.2025	455	Lenovo Group Ltd, 144A, 6,536 %, fällig 27.07.2032	400
Electricité de France SA, 6,250 %, fällig 23.05.2033	450	ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, fällig 15.08.2028	349
ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, fällig 15.08.2028	444	Playtika Holding Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.03.2029	342

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.



# Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

## FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	75.952	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	67.081
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 15.02.2033	26.713	Variabel verzinst United States Treasury Note – bei Ausgabe, 4,931 %, fällig 31.01.2025	27.101
Variabel verzinsliche United States Treasury Note – bei Ausgabe, 4,931 %, fällig 31.01.2025	17.864	Bundesrepublik Deutschland, 1,700 %, fällig 15.08.2032	10.807
Australische Staatsanleihe, Serie 137, 2,750 %, fällig 21.04.2024	15.608	Koreanische Staatsanleihe, Serie 3106, 2,000 %, fällig 10.06.2031	10.611
Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, Nullkupon, fällig 20.09.2023	15.436	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051	10.301
Norwegische Staatsanleihe, Serie 476, 144A, 3,000 %, fällig 14.03.2024	14.847	Republik Polen, Staatsanleihe, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	9.640
Vereinigtes Königreich, Gilt, 3,250 %, fällig 31.01.2033	11.006	französische Staatsanleihe, 0,750 %, fällig 25.05.2053	8.759
Vereinigtes Königreich, Gilt, 1,250 %, fällig 31.07.2051	10.428	Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, Nullkupon, fällig 20.09.2023	7.145
französische Staatsanleihe, 0,750 %, fällig 25.05.2053	8.590	Variabel verzinst United States Treasury Note – bei Ausgabe, 2,796 %, fällig 31.07.2024	7.073
Variabel verzinst United States Treasury Note – bei Ausgabe, 5,498 %, fällig 31.07.2025	4.840	Mexikanische Bonos, Serie M 20, 8,500 %, fällig 31.05.2029	6.869
Kanadische Staatsanleihe, 2,000 %, fällig 01.09.2023	4.561	Australische Staatsanleihe, Serie 137, 2,750 %, fällig 21.04.2024	6.728
Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig 01.01.2033	3.577	Kanadische Staatsanleihe, 2,000 %, fällig 01.09.2023	6.410
Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	3.338	Norwegische Staatsanleihe, Serie 476, 144A, 3,000 %, fällig 14.03.2024	5.910
Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	2.752	Kolumbianische TES, Serie B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	4.573
norwegische Staatsanleihe, Serie 475, 144 A, 2,000 %, fällig 24.05.2023	2.670	Floating Rate Note der Commonwealth Bank of Australia – bei Ausgabe, 5,650 %, fällig 14.03.2025	4.243
Bundesrepublik Deutschland, 1,500 %, fällig 15.05.2023	2.530	Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207 %, fällig 22.11.2024	4.225
UK Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 22.07.2023	2.493	UK Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 22.07.2023	4.190
Kolumbianische TES, Serie B, 9,250 %, fällig 28.05.2042	2.260	Goldman Sachs USD Liquid Reserves Fund – institutionelle Anlageklasse	4.174
Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig 28.01.2060	1.951	Bundesrepublik Deutschland, 1,500 %, fällig 15.05.2023	4.100
Freddie Mac Pool „SD8257“, 4,500 %, fällig 10.01.2052	1.834	Norwegische Staatsanleihe, 2,000 %, fällig 24.05.2023	4.020
		Jackson National Life Global Funding Floating Rate Note – Bei Ausgabe 5,950 %, fällig 28.06.2024	3.913
		Koreanische Staatsanleihe, Serie 5103, 1,875 %, fällig 10.03.2051	3.623
		Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig 01.01.2033	3.578
		Malaiische Staatsanleihe, Serie 0313, 3,480 %, fällig 15.03.2023	2.995
		Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig 01.01.2027	2.748

## FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	479.031	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	417.631
Variabel verzinst United States Treasury Note – bei Ausgabe, 4,931 %, fällig 31.01.2025	227.318	Variabel verzinst United States Treasury Note – bei Ausgabe, 4,931 %, fällig 31.01.2025	174.134
Kreditanstalt für Wiederaufbau, 0,375 %, fällig 18.07.2025	37.616	Goldman Sachs USD Liquid Reserves Fund – institutionelle Anlageklasse	109.237
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 15.02.2033	35.584	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	46.281
Vereinigtes Königreich, Gilt 3,750 %, fällig 22.10.2053	33.429	Vereinigtes Königreich, Gilt 3,750 %, fällig 22.10.2053	31.802
Goldman Sachs USD Liquid Reserves Fund – institutionelle Anlageklasse	23.883	Kreditanstalt für Wiederaufbau, 2,125 %, fällig 08.07.2023	23.315
Kreditanstalt für Wiederaufbau, 2,125 %, fällig 08.07.2023	23.248	Bundesrepublik Deutschland, 1,800 %, fällig 15.08.2053	20.600
Peruanische Staatsanleihe, 6,150 %, fällig 12.08.2032	22.929	Fannie Mae Pool „MA4733“, 4,500 %, fällig 01.09.2052	20.519
Ginnie Mae II Pool „MA8801“, 5,500 %, fällig 20.04.2053	20.748	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2021 DNA2, Class M2, 144A, 7,588 %, fällig 25.08.2033	19.391
Kreditanstalt für Wiederaufbau, 0,250 %, fällig 08.03.2024	19.029	Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig 26.03.2031	15.798
Kreditanstalt für Wiederaufbau, 2,625 %, fällig 28.02.2024	18.813	Spanische Staatsanleihe, 3,550 %, fällig 31.10.2033	14.505
Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig 26.03.2031	17.776	Towd Point Mortgage Trust 2018-2, Serie 2018 2, Klasse B1, 144A, 3,308 %, fällig 25.03.2058	13.291
Spanische Staatsanleihe, 3,550 %, fällig 31.10.2033	14.402	Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC, 144A, 7,875 %, fällig 15.02.2025	13.113
Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig 01.01.2033	10.732	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14, Serie 2014 LC14, Klasse D, 144A, 4,586 %, fällig 15.03.2047	11.943
Hudbay Minerals Inc, 144A, 4,500 %, fällig 01.04.2026	10.608	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2025	9.759
UBS Group AG, 144A, 6,537 %, fällig 12.08.2033	9.238	AT&T Inc, 2,750 %, fällig 01.06.2031	9.671
GGAM Finance Ltd, 144A, 7,750 %, fällig 15.05.2026	8.945	Valero Energy Corp, 3,650 %, fällig 01.12.2051	9.552
Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	8.807	Triangle Re 2021-3 Ltd, Serie 2021 3, Klasse M1A, 144A, 7,188 %, fällig 25.02.2034	9.056
Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125 %, fällig 01.06.2028	8.100	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Serie 2020 DNA3, Klasse B1, 144A, 10,502 %, fällig 25.06.2050	9.010
KeyBank NA.Cleveland OH, Serie BKNt, 5,535 %, fällig 14.06.2024	7.327	Arab Petroleum Investments Corp, 1,483 %, fällig 10.06.2026	7.817



# Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

## FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund<sup>^</sup>

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	17.261	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	16.631
Variabel verzinst United States Treasury Note – bei Ausgabe, 4,931 %, fällig 31.01.2025	7.702	Variabel verzinst United States Treasury Note – bei Ausgabe, 4,931 %, fällig 31.01.2025	4.408
Variabel verzinsliche United States Treasury Note – bei Ausgabe, 5,418 %, fällig 30.04.2025	2.493	Goldman Sachs USD Liquid Reserves Fund – institutionelle Anlageklasse	2.216
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Serie 2020 DNA3, Klasse B1, 144A, 10,502 %, fällig 25.06.2050	1.997	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC15, Serie 2013 GC15, Klasse C, 5,335 %, fällig 10.09.2046	2.091
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA3, Serie 2020 HQA3, Klasse B1, 144A, 11,152 %, fällig 25.07.2050	1.659	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021 Floating Rate Note, 7,073 %, fällig 25.10.2033	1.863
PDC Energy Inc, 5,750 %, fällig 15.05.2026	1.030	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C14, Serie 2014 C14, Klasse A5, 4,064 %, fällig 15.02.2047	1.805
Floating Rate Note des Connecticut Avenue Securities Trust, Nullkupon, fällig 25.04.2043	780	GC Pastor Hipotecario 5 FTA 5, Klasse A2, 3,721 %, fällig 21.06.2046	1.658
Mexiko, internationale Staatsanleihe, 8,000 %, fällig 31.07.2053	660	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Klasse 1M2, 7,652 %, fällig 25.07.2030	1.642
Dream Finders Homes Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.08.2028	415	Fannie Mae Pool „MA4876“, 6,000 %, fällig 12.01.2052	1.523
Fannie Mae – CAS Floating Rate Note, Nullkupon, fällig 25.06.2043	370	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C03, Klasse 1B1, 6,194 %, fällig 25.10.2030	1.500
FirstCash Inc, 144A, 4,625 %, fällig 09.01.2028	358	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Klasse 1B1, 5,994 %, fällig 25.07.2030	1.369
Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, fällig 15.08.2027	350	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Serie 2019 R07, Klasse 1B1, 144A, 5,844 %, fällig 25.10.2039	1.173
Freddie Mac STACR REMIC Trust 202 Floating Rate Note, Nullkupon, fällig 25.05.2043	350	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC17, Serie 2013 GC17, Klasse C, 5,252 %, fällig 11.10.2046	1.226
Ford Motor Credit Co LLC, 5,584 %, fällig 18.03.2024	348	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R06, Serie 2019 R06, Klasse 2B1, 144A, 6,194 %, fällig 25.09.2039	1.171
Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 8,875 %, fällig 15.07.2028	335	Kolumbianische TES, Serie B, 7,250 %, fällig 26.10.2050	969
Ecopetrol SA, 8,625 %, fällig 19.01.2029	330	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2033	950
Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig 28.01.2060	321	Bellemeade Re 2020-2 Ltd, Serie 2020 2A, Klasse M2, 144A, 8,444 %, fällig 26.08.2030	924
Freddie Mac Structured Agency Credit Floating Rate Note, Nullkupon, fällig 25.06.2043	320	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C28, Serie 2015 C28, Klasse C, 4,281 %, fällig 15.10.2048	795
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2027	313	Connecticut Avenue Securities Trust Floating Rate Note, Nullkupon, fällig 25.04.2043	782
Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	309	Fannie Mae Pool „MA4733“, 4,500 %, fällig 09.01.2052	761
		COMM 2014-CCRE18 Mortgage Trust, Serie 2014 CR18, Klasse AM, 4,103 %, fällig 15.07.2047	719
		Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, fällig 15.08.2027	715
		Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C01, Klasse 1B1, 8,194 %, fällig 25.07.2029	665
		Mexiko, internationale Staatsanleihe, 8,000 %, fällig 31.07.2053	633
		Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, fällig 15.05.2025	556
		Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C06, Klasse 1B1, 6,594 %, fällig 25.02.2030	460

## FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>^</sup>

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	1.058	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	1.058
Openlane inc, 5,125 %, fällig 01.06.2025	97	Goldman Sachs USD Liquid Reserves Fund – institutionelle Anlageklasse	411
Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.10.2026	63	Uber Technologies Inc, 7,500 %, fällig 15.05.2025	366
Sabre GLBL Inc, 144A, 9,250 %, fällig 15.04.2025	61	Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625 %, fällig 01.09.2028	309
Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 01.02.2026	60	TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2026	272
FirstCash Inc, 144A, 4,625 %, fällig 09.01.2028	39	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig 21.07.2023	248
Enegean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 30.03.2028	18	Horizon Therapeutics USA Inc, 5,500 %, fällig 01.08.2027	227
Nordstrom Inc, 4,250 %, fällig 01.08.2031	18	Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 01.02.2029	217
		Affinity Gaming, 144A, 6,875 %, fällig 15.12.2027	228
		Freedom Mortgage Corp, 144A, 7,625 %, fällig 01.05.2026	206
		Arko Corp, 144A, 5,125 %, fällig 15.11.2029	201
		First Quantum Minerals Ltd, 6,500 %, fällig 01.03.2024	199
		Lenovo Group Ltd, 144A, 6,536 %, fällig 27.07.2032	198
		Turning Point Brands Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.02.2026	196
		MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig 14.01.2031	187
		LCPR Senior Secured Financing DAC, 144A, 6,750 %, fällig 15.10.2027	183
		Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01.08.2026	178
		ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, fällig 15.08.2028	174
		Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.10.2026	172
		Playtika Holding Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.03.2029	168
		Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2030	167
		Nissan Motor Acceptance Co LLC, 3,450 %, fällig 15.03.2023	167
		Penn Virginia Holdings LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.08.2026	153
		Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	151
		Connect Finco SARR / Connect US Finco LLC, 6,750 %, fällig 01.10.2026	148
		Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, fällig 15.11.2029	146
		United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15.04.2029	140
		Credit Acceptance Corp, 144A, 5,125 %, fällig 31.12.2024	134
		PDC Energy Inc, 5,750 %, fällig 15.05.2026	129
		Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, fällig 30.06.2030	126
		Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 01.02.2026	120
		Freedom Mortgage Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15.01.2027	117
		Carnival Corp, 4,000 %, fällig 01.08.2028	107

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

## FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)

WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Energiean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 30.03.2028	102
Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, fällig 15.08.2027	101
Ciramex Energy Co, 4,375 %, fällig 15.03.2029	98
Home BancShares Inc.AR, 3,125 %, fällig 30.01.2032	98
Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	98

## FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund<sup>^</sup>

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Variabel verzinsliche United States Treasury Note – bei Ausgabe, 4,931 %, fällig 31.01.2025	9.323	Variabel verzinst United States Treasury Note – bei Ausgabe, 2,796 %, fällig 31.07.2024	7.556
Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig 28.01.2060	2.126	Variabel verzinst United States Treasury Note – bei Ausgabe, 4,931 %, fällig 31.01.2025	4.637
Ginnie Mae II Pool „MA8801“, 5,500 %, fällig 20.04.2053	1.605	Koreanische Staatsanleihe, Serie 3106, 2,000 %, fällig 10.06.2031	3.468
General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, fällig 06.04.2026	1.416	Mexikanische Bonos, Serie M 20, 8,500 %, fällig 31.05.2029	2.269
Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, fällig 18.05.2026	1.298	Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207 %, fällig 22.11.2024	1.439
Ginnie Mae II Pool „MA8947“, 5,000 %, fällig 20.06.2053	1.294	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,700 %, fällig 01.11.2024	1.383
Ginnie Mae II Pool „MA8879“, 5,500 %, fällig 20.05.2053	1.108	Koreanische Staatsanleihe, Serie 5103, 1,875 %, fällig 10.03.2051	1.146
Ginnie Mae II Pool „MA8948“, 5,500 %, fällig 20.06.2053	910	Jackson National Life Global Funding, 144A, 6,403 %, fällig 28.06.2024	970
Ginnie Mae II Pool „MA8648“, 5,500 %, fällig 20.02.2053	891	Malaisische Staatsanleihe, Serie 0313, 3,480 %, fällig 15.03.2023	910
Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	230	Malaisische Staatsanleihe, Serie 0417, 3,899 %, fällig 16.11.2027	703
Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig 01.01.2029	138	Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	580
Goldman Sachs Group Inc/The, 5,700 %, fällig 01.11.2024	121	Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	259
Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	111	Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig 30.06.2032	224
Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig 30.06.2032	105	Malaisische Staatsanleihe, Serie 0115, 3,955 %, fällig 15.09.2025	210
Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig 01.01.2031	102	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig 01.01.2029	192
Freddie Mac Pool „SD8245“, 4,500 %, fällig 09.01.2052	93	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig 01.01.2031	186
Tschechische Republik, Staatsanleihe, Serie 138, 1,750 %, fällig 23.06.2032	92	Tschechische Republik, Staatsanleihe, Serie 138, 1,750 %, fällig 23.06.2032	182
Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207 %, fällig 22.11.2024	71	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,500 %, fällig 18.11.2038	155
Freddie Mac Pool „RA7790“, 5,000 %, fällig 08.01.2052	67	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	117
		Freddie Mac Pool „SD8277“, 5,500 %, fällig 12.01.2052	78

## FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund<sup>^</sup>

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	4.433	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	3.502
Variabel verzinst United States Treasury Note – bei Ausgabe, 5,243 %, fällig 31.01.2025	3.946	Freddie Mac Structured Agency, Credit Risk Debt Notes, Serie 2042, 9,066 %, fällig 25.07.2042	622
Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 24.05.2035	311	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	618
Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig 26.03.2031	215	Connecticut Avenue Securities Trust, Serie 2041, 6,966 %, fällig 25.12.2041	584
Banco Do Brasil SA/Cayman, 144A, 6,250 %, fällig 18.04.2030	197	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 24.05.2035	300
Spanische Staatsanleihe, 3,550 %, fällig 31.10.2033	182	Connecticut Avenue Securities Trust, Serie 2042, 6,484 %, fällig 25.03.2042	249
Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig 01.01.2033	148	Var Energi Asa, 144A, 7,500 %, fällig 15.01.2028	211
Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	148	World Acceptance Corp, 7,000 %, fällig 01.11.2026	206
Venture Global Lng Inc, 8,125 %, fällig 01.06.2028	105	BRF SA, 144A, 3,950 %, fällig 22.05.2023	200
laa Inc, 5,500 %, fällig 15.06.2027	81	Natwest Group Plc, 2,359 %, fällig 22.05.2024	200
ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, fällig 14.04.2030	80	Stellantis NV, 5,250 %, fällig 15.04.2023	200
Civitas Resources Inc, 8,375 %, fällig 01.07.2028	60	Arab Petroleum Investments Corp, 144A, 1,483 %, fällig 06.10.2026	198
Leviathan Bond Ltd, 6,125 %, fällig 30.06.2025	39	Kenbourne Invest SA, 6,875 %, fällig 26.11.2024	186
Emerald Debt Merger Sub LLC, 6,625 %, fällig 15.12.2030	30	Spanische Staatsanleihe, 3,550 %, fällig 31.10.2033	183
Charles Schwab Corp/The, 5,853 %, fällig 19.05.2034	20	Blue Owl Capital Corp, 2,625 %, fällig 15.01.2027	153
		Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc, 7,875 %, fällig 15.02.2025	153
		AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Group, 5,625 %, fällig 20.05.2024	152
		HP Inc, 4,750 %, fällig 15.01.2028	152
		AT&T Inc, 2,750 %, fällig 01.06.2031	151
		Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig 26.03.2031	150
		Variabel verzinst United States Treasury Note – bei Ausgabe, 5,489 %, fällig 31.01.2025	150
		Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 2,742 %, fällig 31.12.2039	106

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

## FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	74	Cisco Systems Inc	111
Amgen Inc	40	Union Pacific Corp	84
Norfolk Southern Corp	20	Chubb Ltd	80
CSX Corp	18	3M Co	79
Marathon Petroleum Corp	17	Caterpillar Inc	76
Die Cigna-Gruppe	16	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	74
Williams Companies Inc	15	Amgen Inc	71
Chubb Ltd	10	KLA Corp	67
3M Co	9	Aflac Inc	63
Exelon Corp	9	Kroger Co/The	63
KLA Corp	9	Travelers Cos Inc/The	62
Pioneer Natural Resources	9	iShares Russell 1000 Value ETF	61
Union Pacific Corp	9	American International Group Inc	59
Lyondellbasell Industries NV	8	PIONEER NATURAL RESOURCES CO USD0,01	57
Mosaic Co /The	5	The Cigna Group	56
Aflac Inc	4	Ulta Beauty Inc	52
American International Group Inc	4	Ameriprise Financial Inc	51
Expeditors Intern of Washington Inc	4	Marathon Petroleum Corp	51
Marathon Oil Corp	4	CSX Corp	49
Reinsurance Group Of America Inc	4	Laboratory Corp of America Holdings	48
Travelers Cos Inc/The	4	Fed Ex Corporation	47
		Quest Diagnostics Inc	47
		Exelon Corp	42
		Target Corp	42
		Goldman Sachs USD Liquid Reserves Fund – institutionelle Anlageklasse	41
		Omnicom Group Inc	41
		Capital One Financial Corp	39
		Southern Copper Corp	36
		Johnson & Johnson	35
		Hartford Financial Services Group Inc/The	34
		LKQ Corp	34
		Tyson Foods Inc „A“	32
		Builders FirstSource Inc	31
		Discover Financial Services	30
		Principal Financial Group Inc	29
		Fifth Third Bancorp	27
		Lyondellbasell Industries NV	27

## FTGF ClearBridge Value Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Johnson & Johnson	35.490	Meta Platforms Inc „A“	36.259
Pioneer Natural Resources Co	22.606	Bank of America Corp	26.037
Eastman Chemical Co	15.232	BioMarin Pharmaceutical Inc	19.519
Union Pacific Corp	15.131	Hess Corp	18.336
Gilead Sciences Inc	15.045	Zimmer Biomet Holdings Inc	17.968
American Tower Corp	14.643	Vertex Pharmaceuticals Inc	15.570
First Horizon Corp	14.573	Airbus Group	14.599
Apollo Global Management Inc	14.480	T-Mobile US Inc	13.949
Block Inc	11.328	M&T Bank Corp	12.654
Canadian Pacific Kansas City Ltd	11.049	CVS Health Corp	11.742
UnitedHealth Group Inc	10.562	Oracle Corp	11.272
Microsoft Corp	9.778	Black Knight Inc	10.969
Alibaba Group Holding Ltd	9.052	Uber Technologies Inc	10.595
Clean Harbors Inc	8.404	EQT Corp	9.442
Flowserve Corp	7.867	MGM Resorts International	9.277
Western Alliance Bancorporation	7.596	Tenet Healthcare Corp	9.231
Teck Resources Ltd,	7.251	SolarEdge Technologies Inc	8.786
Ross Stores Inc	7.096	Coty Inc „A“	8.685
Everest Group Ltd	6.189	TotalEnergies SE ADR	8.046
BioNTech SE ADR	5.765	Mosaic Co/The	8.045
Micron Technology Inc	5.218	Signature Bank/New York NY	7.998
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	4.610	Alcoa Corp	7.548
United Airlines Holdings Inc	4.582	OneMain Holdings Inc	7.084
Siemens AG	4.264	General Motors Co	6.832
Meta Platforms Inc „A“	3.800	Baker Hughes Co „A“	5.590
APA Corp	3.464	Micron Technology Inc	5.017
Biogen Inc	3.198	Western Alliance Bancorporation	4.694
		CNH Industrial NV	4.577
		Royal Gold Inc	4.199
		Freeport-McMoRan Inc	4.075

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

### FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Netflix Inc	1.945	Microsoft Corp	1.650
AbbVie Inc	1.185	T-Mobile US Inc	1.362
Apple Inc	1.067	Verizon Communications Inc	1.287
Meta Platforms Inc „A“	986	Bank of America Corp	1.147
Becton Dickinson & Co	865	Apple Inc	1.049
Microsoft Corp	830	JPMorgan Chase & Co	1.049
Marvell Technology Inc	816	UnitedHealth Group Inc	1.026
US Bancorp	773	Amazon.com Inc	879
NVIDIA Corp	763	General Motors Co	745
Emerson Electric Co	631	Marriott International Inc.MD	744
Progressive Corp/The	611	Pfizer Inc	697
Amazon.com Inc	398	Pioneer Natural Resources Co	693
ASML Holding NV	302	Home Depot Inc/The	670
Hartford Financial Services Group Inc/The	288	Thermo Fisher Scientific Inc	660
Intercontinental Exchange Inc	280	Johnson & Johnson	639
UnitedHealth Group Inc	257	ArcelorMittal SA	622
Visa Inc „A“	241	Travelers Cos Inc/The	532
NextEra Energy Inc	238	Air Products & Chemicals Inc	523
Merck & Co Inc	224	Alphabet Inc	513
JPMorgan Chase & Co	207	Enphase Energy Inc	505
ArcelorMittal SA	202	Comcast Corp	504
Honeywell International Inc	198	Alphabet Inc „A“	482
TJX Cos Inc/The	191	Visa Inc „A“	464
Johnson & Johnson	190	United Parcel Service Inc „B“	434
Thermo Fisher Scientific Inc	189	Merck & Co Inc	427
		Walt Disney Co/The	413
		Eaton Corp Plc	405
		TJX Cos Inc/The	382
		Honeywell International Inc	377
		Automatic Data Processing Inc	309
		Waste Management Inc	277

### FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
S&P Global Inc	26.035	S&P Global Inc	26.035
Atlassian Corp	21.384	Atlassian Corp	21.384
Intuit Inc	17.648	Unity Software Inc	13.673
Union Pacific Corp	16.529	Visa Inc „A“	11.604
Unity Software Inc	13.673	Advance Auto Parts Inc	11.180
Meta Platforms Inc „A“	11.650	Honeywell International Inc	8.220
Eli Lilly & Co	10.196	Zoetis Inc	8.029
Microsoft Corp	8.461	Eaton Corp Plc	7.470
Adobe Inc	7.646	Palo Alto Networks Inc	6.772
Amazon.com Inc	7.018	WW Grainger Inc	6.575
Apple Inc	6.735	Thermo Fisher Scientific Inc	5.855
NextEra Energy Inc	6.141	NVIDIA Corp	5.684
Visa Inc „A“	5.943	S&P Global Inc	5.271
NVIDIA Corp	5.827	Stryker Corp	4.626
Sherwin-Williams Co/The	5.713	UnitedHealth Group Inc	4.547
Estee Lauder Cos Inc/The „A“	5.018	Monster Beverage Corp	4.336
Honeywell International Inc	4.023	NIKE Inc	3.608
UnitedHealth Group Inc	3.928	Microsoft Corp	3.551
Target Corp	3.428	United Parcel Service Inc „B“	3.484
Netflix Inc	3.077	Marsh & McLennan Cos Inc	2.938
WW Grainger Inc	2.895	Amazon.com Inc	2.902
S&P Global Inc	2.701	Alcon Inc	2.681
Monster Beverage Corp	2.697	Sea Ltd ADR	2.254
Palo Alto Networks Inc	2.688	Apple Inc	2.131
Salesforce Inc	2.558		
Zoetis Inc	2.441		
Thermo Fisher Scientific Inc	2.432		
Eaton Corp Plc	2.398		

## Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

### FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
TJX Cos Inc/The	2.833	Broadcom Inc	5.967
Pinterest Inc	2.598	TE Connectivity Ltd	4.508
Broadcom Inc	2.476	Liberty Broadband Corp	2.540
Starbucks Corp	1.691	Vertex Pharmaceuticals Inc	2.222
Accenture Plc „A“	1.370	Seagate Technology Holdings Plc	2.084
Freemport-McMoRan Inc	872	Broadcom Inc	2.006
Diageo Plc ADR	613	Madison Square Garden Entertainment Corp	1.380
Etsy Inc	349	Guardant Health Inc	1.165
Airbnb Inc	312	HubSpot Inc	1.120
CrowdStrike Holdings Inc	303	Lyft Inc	965
Warner Bros Discovery Inc	285	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	887
HubSpot Inc	266	Ionis Pharmaceuticals Inc	834
Match Group Inc	147	Match Group Inc	706
Doximity Inc	102	Doximity Inc	656
AbbVie Inc	82	AMC Networks Inc	581
		Comcast Corp	456
		UnitedHealth Group Inc	440
		Autodesk Inc	426
		Liberty Media Corp-Liberty	264
		Western Digital Corp	247

### FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Apollo Global Management Inc	724	Bank of America Corp	593
Digital Realty Trust Inc	450	DanaHER Corp	586
Blackstone Inc	439	American Airlines Group Inc, 6,500 %, fällig 01.07.2025	513
Extra Space Storage Inc	366	RTX Corp	459
Prologis Inc	322	Microsoft Corp	439
Union Pacific Corp	308	AGNC Investment Corp	429
AbbVie Inc	278	Aptiv Plc, Serie A	411
PPL Corp	295	Verizon Communications Inc	411
Pioneer Natural Resources Co	275	Kimberly-Clark Corp	402
Amphenol Corp „A“	265	Texas Instruments Inc	368
Sempra	241	TC Energy Corp	358
Chubb Ltd	230	Broadcom Inc	349
US Bancorp Delaware	203	American Tower Corp	326
Starwood Property Trust Inc	195	Equitrans Midstream Corp	302
ConocoPhillips	193	KKR & Co Inc, Serie C	276
L3Harris Technologies Inc	187	Apollo Global Management Inc	255
Goldman Sachs Group Inc/The	185	Otis Worldwide Corp	200
American Homes 4 Rent „A“	184	Starwood Property Trust Inc	191
Ares Capital Corp	152	TE Connectivity Ltd	189
American Tower Corp	106	Barings BDC Inc	170
NextEra Energy Partners LP	105	Apple Inc	167
QUALCOMM Inc	93	US Bancorp Delaware	164
Gaming and Leisure Properties Inc	79	SBA Communications Corp „A“	162
Blue Owl Capital Inc 'A'	74	Stanley Black & Decker Inc	161
		Crown Castle Inc	157
		Trinity Capital Inc	155
		Boston Scientific Corp	150
		Blackstone Inc	116
		Pfizer Inc	116
		Amgen Inc	113
		NextEra Energy Inc	107

## Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

### FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
JPMorgan Chase & Co	42.685	ON Semiconductor Corp	37.734
Procter & Gamble Co/The	28.499	Bank of America Corp	37.054
Colgate-Palmolive Co	27.781	TE Connectivity Ltd	33.484
Lam Research Corp	16.859	Booking Holdings Inc	13.381
Ormat Technologies Inc	16.692	Trane Technologies Plc	10.755
NextEra Energy Partners LP	5.128	Progressive Corp/The	10.741
Microsoft Corp	3.680	Microsoft Corp	10.728
NIKE Inc	3.382	Apple Inc	10.521
UnitedHealth Group Inc	3.168	Hartford Financial Services Group Inc/The	10.068
CVS Health Corp	2.800	Regal Rexnord Corp	8.938
Apple Inc	2.721	Novo Nordisk A.S ADR	8.929
Walt Disney Co/The	2.400	Costco Wholesale Corp	8.726
Morgan Stanley	2.279	Morgan Stanley	7.160
Equinix Inc	2.261	Synopsys Inc	7.107
Shoals Technologies Group Inc „A“	2.226	Visa Inc „A“	6.809
Deere & Co	1.955	First Republic Bank/CA	6.352
Hartford Financial Services Group Inc/The	1.876	Charles Schwab Corp/The	6.112
Charles Schwab Corp/The	1.817	Salesforce Inc	5.907
Home Depot Inc/The	1.762	McCormick & Co Inc/MD	5.617
Johnson & Johnson	1.449	ASML Holding NV	5.133
		Williams-Sonoma Inc	4.805
		Progyny Inc	4.770
		Aptiv Plc	4.322
		Brookfield Renewable Corp	4.314
		UnitedHealth Group Inc	3.855
		BioMarin Pharmaceutical Inc	3.794
		JPMorgan Chase & Co	3.618
		Alphabet Inc „A“	3.505

### FTGF ClearBridge Global Growth Fund^

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Marvell Technology Inc	254	BNP Paribas SA	172
Apple Inc	225	Marvell Technology Inc	170
Adobe Inc	215	Nestle SA	170
Tokyo Electron Ltd	202	Rentokil Initial Plc	170
HDFC Bank Ltd ADR	193	Raymond James Financial Inc	161
Kering SA	169	Arista Networks Inc	147
Haleon Plc	160	NVIDIA Corp	146
Walt Disney Co/The	159	Thomson Reuters Corp	146
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	146	Straumann Holding AG	144
Intuit Inc	143	RELX Plc	143
Amazon.com Inc	141	Keyence Corp	133
Estee Lauder Cos Inc/The „A“	140	CRH Plc ADR	127
Arista Networks Inc	124	United Parcel Service Inc „B“	122
Trex Co Inc	115	Sensient Technologies Corp	120
Waste Connections Inc	115	Target Corp	120
Amphenol Corp „A“	108	United Rentals Inc	112
Grupo Bimbo SAB de CV	107	Avantor Inc	111
Alphabet Inc „A“	105	Iberdrola SA ADR	109
London Stock Exchange Group Plc	104	Kroger Co/The	98
Netflix Inc	104	Old Dominion Freight Line Inc	96
SAP SE	102	Microsoft Corp	92
Salesforce Inc	100	Aflac Inc	85
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	84	SolarEdge Technologies Inc	84
Daiichi Sankyo Co Ltd	83	Tesla Inc	83
SMC Corp	73	Workday Inc „A“	69
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	70	EDP – Energias de Portugal SA	66
Deere & Co	68	Haleon Plc	66
Microsoft Corp	66	EssilorLuxottica SA	65
Xero Ltd	66	Apple Inc	59
Alcon Inc	63	Marriott International Inc.MD	59
Tesla Inc	61	Alcon Inc	47
UnitedHealth Group Inc	58		
ASML Holding NV	57		
Karuna Therapeutics Inc	57		
MercadoLibre Inc	52		

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.



## Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

### FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund<sup>^</sup>

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) EUR	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
CenterPoint Energy Inc	39.852	Iberdrola SA	39.128
Enel SpA	38.232	TC Energy Corp	34.797
Aéroports de Paris	21.834	SSE Plc	27.763
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	20.112	Union Pacific Corp	27.094
Ferrovial SA	14.662	Vinci SA	25.884
Norfolk Southern Corp	13.873	Aena SME SA, 144A	25.787
Rumo SA	13.277	Southwest Gas Holdings Inc	19.545
PG&E Corp	10.571	Severn Trent Plc	17.942
Union Pacific Corp	10.095	East Japan Railway Co	16.930
Entergy Corp	8.244	Terna – Rete Elettrica Nazionale	10.235
American Tower Corp	7.554	NextEra Energy Inc	9.711
PPL Corp	7.514	Centrais Eletricas Brasileiras SA	9.120
CSX Corp	6.198	American Tower Corp	8.189
Terna – Rete Elettrica Nazionale	5.288	Getlink SE	8.111
NextEra Energy Inc	4.546	CSX Corp	7.452
Centrais Eletricas Brasileiras SA	3.283	PG&E Corp	7.284
Gibson Energy Inc	2.856	PPL Corp	6.931
Severn Trent Plc	2.698	Public Service Enterprise Group Inc	6.561
SSE Plc	750	Cellnex Telecom SA, 144A	6.236
		EDP – Energias de Portugal SA	6.146
		United Utilities Group Plc	5.997
		Transurban Group	5.816
		Constellation Energy Corp	5.563
		Entergy Corp	5.555
		CenterPoint Energy Inc	5.353
		OGE Energy Corp	4.992
		Pembina Pipeline Corp	4.804
		Cheniere Energy Inc	4.556
		Central Japan Railway Co	4.408
		Gibson Energy Inc	4.338
		American Water Works Co Inc	4.158

### FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Williams Cos Inc/The	22.914	Williams Cos Inc/The	28.499
Enel SpA	22.117	Iberdrola SA	25.255
NextEra Energy Inc	14.464	SSE Plc	16.819
Enbridge Inc	14.148	TC Energy Corp	15.922
Iberdrola SA	12.256	Enbridge Inc	15.351
Edison International	9.528	United Utilities Group Plc	8.013
Snam SpA	8.431	National Grid Plc	7.633
National Grid Plc	7.450	Snam SpA	7.356
Redeia Corp SA	6.467	Southwest Gas Holdings Inc	6.699
TC Energy Corp	6.157	Clearway Energy Inc „C“	6.231
SSE Plc	5.575	Enel SpA	5.995
Union Pacific Corp	5.076	Enagas SA	5.762
China Resources Gas Group Ltd	4.459	Redeia Corp SA	4.547
Entergy Corp	4.110	Engie Brasil Energia SA	3.937
NextEra Energy Partners LP	3.406	Public Service Enterprise Group Inc	3.621
Southern Co/The	3.368	Centrais Eletricas Brasileiras SA	3.621
OGE Energy Corp	3.092	Union Pacific Corp	3.620
Centrais Eletricas Brasileiras SA	2.697	Gibson Energy Inc	2.678
Severn Trent Plc	2.496	Italgas SpA	2.667
Gibson Energy Inc	2.048	CPFL Energia SA	2.432
Brookfield Renewable Corp	1.934	Transurban Group	2.361
CCR SA	1.904	West Japan Railway Co	2.265
American Tower Corp	1.898	EDP – Energias de Portugal SA	2.097
Pembina Pipeline Corp	1.883		

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

## FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	89.158	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	82.381
Alpha & Omega Semiconductor Ltd	4.325	Earthstone Energy Inc „A“	5.769
CECO Environmental Corp	3.221	CIRCOR International Inc	5.221
Fabrinet	2.606	Modine Manufacturing Co	4.603
Brighthouse Financial Inc	2.570	Heritage-Crystal Clean Inc	4.331
Clearfield Inc	2.527	Hexcel Corp	4.142
Leonardo DRS Inc	2.438	Avid Technology Inc	3.919
Udemy Inc	2.399	Limbach Holdings Inc	3.877
Canaccord Genuity Group Inc	2.246	Dorian LPG Ltd	3.850
Xerox Holdings Corp	2.222	Option Care Health Inc	3.671
Patterson-UTI Energy Inc	2.178	Sterling Infrastructure Inc	3.265
Mativ Holdings Inc	2.089	Ruth's Hospitality Group Inc	3.108
IMAX Corp	1.999	Cleveland-Cliffs Inc	2.946
Capstone Copper Corp	1.927	Barnes Group Inc	2.915
Select Water Solutions Inc	1.901	EnPro Industries Inc	2.889
Perella Weinberg Partners 'A'	1.875	Alpha & Omega Semiconductor Ltd	2.842
GCM Grosvenor Inc	1.839	Coherent Corp	2.765
Azenta Inc	1.772	Macerich Co/The	2.744
Terex Corp	1.755	Fabrinet	2.695
TTEC Holdings Inc	1.649	Leonardo DRS Inc	2.523

## FTGF Royce US Smaller Companies Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	14.862	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	14.917
EnPro Industries Inc	1.156	Avid Technology Inc	1.550
Ziff Davis Inc	966	Ironwood Pharmaceuticals Inc „A“	988
iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	907	Forward Air Corp	951
Korn Ferry	896	Computer Task Group Inc	895
Catalyst Pharmaceuticals Inc	868	iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	834
Ryerson Holding Corp	823	Cohu Inc	658
John Bean Technologies Corp	811	Inter Parfums Inc	608
Lazard Ltd „A“	775	Heritage-Crystal Clean Inc	597
Steven Madden Ltd	764	FormFactor Inc	582
FormFactor Inc	739	Harmony Biosciences Holdings Inc	570
Marcus & Millichap Inc	720	Onto Innovation Inc	570
Inter Parfums Inc	703	Louisiana-Pacific Corp	548
MKS Instruments Inc	687	Simulations Plus Inc	524
Cirrus Logic Inc	653	FARO Technologies Inc	481
Innospec Inc	645	Wolverine World Wide Inc	479
Skyline Champion Corp	629	MKS Instruments Inc	448
Dun & Bradstreet Holdings Inc	628	Kulicke & Soffa Industries Inc	408
Brady Corp „A“	603	IAA Inc	404
White Mountains Insurance Group Ltd	582	Enovis Corp	381
Fabrinet	569	Arcosa Inc	346
Cass Information Systems Inc	553	Skyline Champion Corp	333
Houlihan Lokey Inc „A“	552	Bio-Techne Corp	329
AMN Healthcare Services Inc	540	Esab Corp	328
Carter's Inc	539		
Kadant Inc	533		
Kennedy-Wilson Holdings Inc	528		
Louisiana-Pacific Corp	512		
ESCO Technologies Inc	492		
Brunswick Corp.DE	449		
Crane NXT Co	442		
Vishay Precision Group Inc	434		
Bio-Techne Corp	432		

## FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund<sup>^</sup>

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	297	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	306
FirstService Corp	109	FirstService Corporation	103
Colliers International Group Inc	95	Colliers International Group Inc	86
Auktion Technology Group Plc	66	Forward Air Corp	59
Azelis Group NV	46	OBIC Business Consultants Co Ltd	59
Miura Co Ltd	46	Inter Parfums Inc	43
Fox Factory Holding Corp	35	Douzone Bizon Co Ltd	29
Lectra	33	Ralph Lauren Corp 'A'	28
TOTVS SA	33	Meitec Corp	27
EnPro Industries Inc	22	Fukui Computer Holdings Inc	24
Rogers Corp	21	Esab Corp	23
Marlowe Plc	19	DiscoverIE Group Plc	20
New Work SE	19	GVS SpA, 144A	20
NICE Information Service Co Ltd	19	FormFactor Inc	19
Marel hf, 144A	18	New Work SE	19
Restore Plc	18	Avid Technology Inc	18
Learning Technologies Group Plc	17	Marlowe Plc	18

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

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

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Hansen Technologies Ltd	15	RB Global Inc	18
MKS Instruments Inc	14	Croda International Plc	17
Karnov Group AB	13	TechTarget Inc	15
As One Corp	12	Arcosa Inc	14
Croda International Plc	12	Gentex Corp	13
		IAA Inc	13

### Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	3.356	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	3.356
NTPC Ltd	240	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.262
Hon Hai Precision Industry Co Ltd	174	Samsung Electronics Co Ltd	1.191
		Lite-On Technology Corp	464
		BHP Group Ltd	435
		PetroChina Co Ltd	411
		NHPC Ltd	393
		REC Ltd	387
		Rio Tinto Ltd	382
		China Construction Bank Corp	372
		McMillan Shakespeare Ltd	367
		Bank of China Ltd	366
		Uni-President Enterprises Corp	366
		Power Grid Corp of India Ltd	338
		Giordano International Ltd	335
		China Shenhua Energy Co Ltd	331
		Infosys Ltd	322
		PICC Property & Casualty Co Ltd	320
		Aurizon Holdings Ltd	304
		Coles Group Ltd	303
		Aboitiz Power Corp	301
		AIA Group Ltd	297
		Jardine Cycle & Carriage Ltd	295
		Bank of Communications Co Ltd	293
		Uni-President China Holdings Ltd	289
		CITIC Telecom International Holdings Ltd	287
		Indofood Sukses Makmur Tbk PT	287
		Far East Horizon Ltd	280
		Tisco Financial Group PCL, NVDR	277
		Postal Savings Bank of China Co Ltd, 144A	270
		NTPC Ltd	267
		Jardine Matheson Holdings Ltd	260
		Telkom Indonesia Persero Tbk PT	260
		China Communications Services Corp Ltd	259
		Orora Ltd	259
		Stella International Holdings Ltd	259
		Astra International Tbk PT	254

### FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Innox Advanced Materials Co Ltd	35	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	302
LG Chem Ltd	30	Samsung Electronics Co Ltd	255
Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	21	Tencent Holdings Ltd	238
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	17	HDFC Bank Limited	209
		AIA Group Limited	186
		LG Chem Ltd	170
		Alibaba Group Holding Limited	164
		United Overseas Bank Limited	156
		Singapore Telecommunications Ltd	153
		Ishares Core Msci Asia E-HKD	149
		Singapore Technologies Engineering Ltd	131
		Venture Corporation Limited	131
		Accton Technology Corporation	130
		ENN Energy Holdings Limited	117
		CSPC Pharmaceutical Group LTD	115
		Minth Group Ltd	112
		Hansol Chemical Co Ltd	103
		Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	97
		Ping An Insurance Group	94
		Techtronic Industries Company Limited	89
		Guangdong Investment Limited	86
		LG Energy Solution Ltd	84
		Tongcheng Travel Holdings Ltd	79
		Telkom Indonesia Persero Tbk	76
		TravelSky Technology Limited	76
		Shenzhen International Group Holdings Limited	63
		LEENO Industrial Inc	60
		JD.com, Inc	57
		TATA Consultancy Services Limited	53
		Innox Advanced Materials Co Ltd	43

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

## FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund<sup>^</sup>

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	15.505	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	14.932
Estee Lauder Cos Inc/The „A“	5.133	AIA Group Ltd	4.417
Mettler-Toledo International Inc	4.898	Kerry Group Plc	3.252
Adyen NV, 144A	4.849	NVIDIA Corp	2.678
Croda International Plc	2.371	ASML Holding NV	1.202
CSL Ltd	1.292	Microsoft Corp	1.144
Moncler SpA	766	Linde Plc	1.023
NVIDIA Corp	591	Moncler SpA	977
ASML Holding NV	496	L'Oreal SA	900
Microsoft Corp	461	Ferrari NV	897
Linde Plc	424	Atlas Copco AB	818
L'Oreal SA	382	ResMed Inc	783
Ferrari NV	363	Mastercard Inc	774
Atlas Copco AB	337	Kingspan Group Plc	729
ResMed Inc	337	Coloplast A.S	708
Mastercard Inc	322	ANSYS Inc	620
Coloplast A.S	312	Pernod Ricard SA	604
Kingspan Group Plc	294	Hexagon AB	593
ANSYS Inc	252	Adobe Inc	585
Pernod Ricard SA	260	Zoetis Inc	585
		CSL Ltd	581
		NIKE Inc	559
		Masimo Corp	545
		Assa Abloy AB	533
		Veeva Systems Inc „A“	517
		Kering SA	502
		Autodesk Inc	468
		Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	454
		Croda International Plc	452
		Adyen NV, 144A	446

## FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Link REIT	674	NHPC Ltd	774
Indus Towers Ltd	647	AGL Energy Ltd	648
Aurizon Holdings Ltd	539	Transurban Group	622
CLP Holdings Ltd	433	CLP Holdings Ltd	603
Guangdong Investment Ltd	388	Capitaland Integrated Commercial Trust	577
Chorus Ltd	329	Contact Energy Ltd	497
Scentre Group	274	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd	402
Vicinity Ltd	246	Region RE Ltd	398
Charter Hall Retail REIT	203	China Tower Corp Ltd, 144A	319
Embassy Office Parks REIT	194	Power Grid Corp of India Ltd	318
AGL Energy Ltd	190	Chorus Ltd	239
Digital Telecommunications Infrastructure Fund	167	Charter Hall Retail REIT	214
NETLINK NBN TRUST	141	China Merchants Port Holdings Co Ltd	208
Manila Electric Co	121	Link REIT	204
Capitaland India Trust	109	Indus Towers Ltd	188
HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd	64	Guangdong Investment Ltd	184
Fortune Real Estate Investment Trust	51	Vicinity Ltd	183
Wharf Real Estate Investment Co Ltd	47	Scentre Group	182
APA Group	40	Aurizon Holdings Ltd	178
Westports Holdings Bhd	31	GPT Group/The	172
		Embassy Office Parks REIT	165
		Fortune Real Estate Investment Trust	143
		Digital Telecommunications Infrastructure Fund	112
		Westports Holdings Bhd	112
		Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	103
		Capitaland India Trust	98
		Mapletree Industrial Trust	95

## FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund<sup>^</sup>

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	2.694	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	2.453
HDFC Bank Ltd	528	ICICI Bank Ltd	465
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	303	Samsung Electronics Co Ltd	314
Capitec Bank Holdings Ltd	209	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	250
Dr. Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co	209	EPAM Systems Inc	212
Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	178	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	207
		SK Hynix Inc	179
		Tencent Holdings Ltd	157
		Globalwafers Co Ltd	95
		HDFC Bank Ltd	92
		Alibaba Group Holding Ltd ADR	86
		Jio Financial Services Ltd	82
		Reliance Industries Ltd	78
		Titan Co Ltd	77

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

# Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

## FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund<sup>^</sup> – (Fortsetzung)

	ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
AIA Group Ltd	65
Meituan „B“, 144A	60
WEG SA	59
Antofagasta Plc	54
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	54
Grupo Financiero Banorte SAB de CV	51

## FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund<sup>^</sup>

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) EUR		ERLÖSE (in Tsd.) EUR
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Adyen NV, 144A	6.153	Kerry Group Plc	5.337
BE Semiconductor Industries NV	4.205	Infineon Technologies AG	4.214
Croda International Plc	3.558	Ferrari NV	3.406
Sartorius Stedim Biotech	2.401	Allfunds Group Plc	3.283
Moncler SpA	2.007	Mettler-Toledo International Inc	2.543
ASML Holding NV	928	Dr. Martens Plc	1.295
L'Oreal SA	498	ASML Holding NV	734
Atlas Copco AB	470	Moncler SpA	580
Linde Plc	454	L'Oreal SA	435
Mettler-Toledo International Inc	438	Kering SA	406
Hexagon AB	421	Linde Plc	392
Dassault Systemes SE	415	Sartorius Stedim Biotech	376
Asa Abloy AB	407	Atlas-Copco AB	367
Kering SA	394	Kingspan Group	361
Nemetschek SE	368	Asa Abloy AB	350
Coloplast A.S	361	Dassault Systemes SE	334
Kingspan Group	347	Hexagon AB	330
Partners Group Holding AG	297	Coloplast A.S	328
Pernod Ricard SA	288	Nemetschek SE	324
Infineon Technologies AG	248	Pernod Ricard SA	288
		Partners Group Holding AG	268

## FTGF Martin Currie Improving Society Fund<sup>^</sup>

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
Intuitive Surgical Inc	314	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	302
Xylem Inc.NY	305	Verra Mobility Corp 'A'	35
HDFC Bank Ltd ADR	294	Ecolab Inc	20
Valmont Industries Inc	265		
Ecolab Inc	251		
Novozymes A.S	248		
Croda International Plc	247		
Illumina Inc	246		
Revvity Inc	244		
Veolia Environnement SA	238		
Amplifon SpA	236		
Airtel Africa Plc, 144A	222		
Masimo Corp	218		
Deere & Co	213		
Veeva Systems Inc „A“	202		
MercadoLibre Inc	201		
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	148		
Vistry Group Plc	109		
Verra Mobility Corp 'A'	105		
Energy Recovery Inc	89		
Planet Fitness Inc „A“	82		
MIPS AB	73		
Courseera Inc	63		
Everbridge Inc	59		
Stride Inc	51		

## Franklin Responsible Income 2028 Fund<sup>^</sup>

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) EUR		ERLÖSE (in Tsd.) EUR
<b>WICHTIGE KÄUFE</b>		<b>WICHTIGE VERKÄUFE</b>	
ING Groep NV, 4,875 %, fällig 14.11.2027	1.317	Werfen SA/Spain, 4,625 %, fällig 06.06.2028	1.290
Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,375 %, fällig 21.06.2028	1.313	International Business Machines Co, 0,300 %, fällig 11.02.2028	1.130
Thermo Fisher Scientific Inc, 0,500 %, fällig 01.03.2028	1.309	Banco Santander SA, 3,875 %, fällig 16.01.2028	1.091
Schneider Electric SE, 1,500 %, fällig 15.01.2028	1.297	UBS Group AG, VAR, fällig 17.03.2028	999
Abertis Infraestructuras SA, 4,125 %, fällig 31.01.2028	1.296	Thames Water Utilities Finance PLC, 0,875 %, fällig 31.01.2028	924
Telenor ASA, 0,250 %, fällig 14.02.2028	1.295	Vonovia Finance BV, 1,500 %, fällig 14.01.2028	768
BNP Paribas SA, 0,500 %, fällig 19.02.2028	1.294	Abanca Corp Bancaria SA, VAR, fällig 14.09.2028	689
UBS Group AG, 4,625 %, fällig 17.03.2028	1.293	UBS Group AG, VAR, fällig 14.01.2028	630
Werfen SA/Spain, 4,625 %, fällig 06.06.2028	1.290	Apple Inc, 2,000 %, fällig 17.09.2027	477
Werfen SA/Spain, 4,625 %, fällig 06.06.2028	1.290	Eurobank SA, VAR, fällig 14.03.2028	425
Tele2 AB, 2,125 %, fällig 15.05.2028	1.286	NatWest Markets PLC, 1,375 %, fällig 02.03.2027	371
Teleperformance SE, 0,250 %, fällig 26.11.2027	1.284	SBB Treasury Oyj, 0,750 %, fällig 14.12.2028	241
TenneT Holding BV, 1,375 %, fällig 05.06.2028	1.280	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,000 %, fällig 04.05.2028	155
NTT Finance Corp, 0,399 %, fällig 13.12.2028	1.270		
Motability Operations Group Plc, 0,125 %, fällig 20.07.2028	1.264		
Holding d'infrastructures de Transport SASU, 1,625 %, fällig 27.11.2027	1.255		

<sup>^</sup> In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

## Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands – (Fortsetzung)

### Franklin Responsible Income 2028 Fund^ – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) EUR
H Lundbeck A.S, 0,875 %, fällig 14.10.2027	1.223
Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, fällig 27.01.2028	1.217
HSBC Holdings Plc, 4,752 %, fällig 10.03.2028	1.202
TDF Infrastructure SASU, 5,625 %, fällig 21.07.2028	1.198
LKQ European Holdings BV, 4,125 %, fällig 01.04.2028	1.183
Credit Agricole SA, 0,375 %, fällig 20.04.2028	1.168
Verizon Communications Inc, 1,375 %, fällig 02.11.2028	1.073
UBS Group AG, VAR, fällig 17.03.2028	1.001
Crown European Holdings SA, 5,000 %, fällig 15.05.2028	1.000
Rumänien, internationale Staatsanleihe, 2,125 %, fällig 07.03.2028	947
Deutsche Lufthansa AG, 3,750 %, fällig 11.02.2028	919
Azelis Finance NV, 5,750 %, fällig 15.03.2028	908
Bank of Ireland Group Plc, 4,875 %, fällig 16.07.2028	904
Cloverie Plc für Zurich Insurance Co Ltd, 1,500 %, fällig 15.12.2028	881
Volvo Car AB, 4,250 %, fällig 31.05.2028	855
Svenska Handelsbanken AB, 3,750 %, fällig 01.11.2027	798
DXC Capital Funding DAC, 0,450 %, fällig 15.09.2027	793
National Grid Plc, 0,163 %, fällig 20.01.2028	760
Macquarie Group Ltd, 0,350 %, fällig 03.03.2028	744
PVH Corp, 3,125 %, fällig 15.12.2027	727
OP Corporate Bank plc, 0,375 %, fällig 16.06.2028	667
Prosus NV, 1,539 %, fällig 03.08.2028	658
JPMorgan Chase & Co, 1,638 %, fällig 18.05.2028	634
Intesa Sanpaolo SpA, 1,750 %, fällig 20.03.2028	629
Barclays Plc, 0,877 %, fällig 28.01.2028	609
RCI Banque SA, 4,875 %, fällig 21.09.2028	608
International Business Machines Co, 0,300 %, fällig 11.02.2028	606

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.



## Anhang: Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFTR)

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 31. August 2023 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	50.000	50.000	5,39
HSBC Bank (USA)	Vereinigtes Königreich	55.000	55.000	5,92
JP Morgan Securities LLC	USA	80.000	80.000	8,61
Royal Bank of Canada	Kanada	50.000	50.000	5,38
TD Securities (USA) LLC	Kanada	12.520	12.520	1,35
		247.520	247.520	26,65

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 31. August 2023:

Fonds	Emittent der Sicherheit*	Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	USA***	US-Dollar	252.499\$

\* Sofern es zum 31. August 2023 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 31. August 2023:

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	252.499\$

Die nachstehende Laufzeitanalyse basiert auf dem vertraglichen Fälligkeitsdatum der Reverse-Repo-Geschäfte und den damit verbundenen erhaltenen (bereitgestellten) Sicherheiten zum 31. August 2023:

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	-	247.520\$	-	-	-	-	-	247.520\$
	Erhaltene unbare Sicherheiten	-	-	-	13.005\$	33.500\$	205.994\$	-	252.499\$

Bei den Reverse-Repo-Geschäften, die für den Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund gehalten werden, handelt es sich um Dreiparteienvträge. Vom Fonds im Zusammenhang mit den zum 31. August 2023 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.



