

Rapport annuel et états financiers audités

Franklin Templeton

Global Funds Plc

Un Fonds à compartiments multiples avec
séparation des passifs entre les compartiments

Pour l'exercice financier clos le 28 février 2023

Sommaire

Informations générales	3
Lettre aux Actionnaires	16
Rapport des Administrateurs (révisé)	17
Rapport des Auditeurs indépendants	40
Rapport du Dépositaire	42
Portefeuille d'investissements – FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	43
Portefeuille d'investissements – FTGF Western Asset US Core Bond Fund	44
Portefeuille d'investissements – FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	53
Portefeuille d'investissements – FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	68
Portefeuille d'investissements – FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	72
Portefeuille d'investissements – FTGF Western Asset US High Yield Fund	77
Portefeuille d'investissements – FTGF Western Asset Global High Yield Fund	81
Portefeuille d'investissements – FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	84
Portefeuille d'investissements – FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	86
Portefeuille d'investissements – FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	90
Portefeuille d'investissements – FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	95
Portefeuille d'investissements – FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	99
Portefeuille d'investissements – FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	107
Portefeuille d'investissements – FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	115
Portefeuille d'investissements – FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	119
Portefeuille d'investissements – FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	127
Portefeuille d'investissements – FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	130
Portefeuille d'investissements – Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	136
Portefeuille d'investissements – FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	140
Portefeuille d'investissements – FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	142
Portefeuille d'investissements – FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	146
Portefeuille d'investissements – FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	148
Portefeuille d'investissements – FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	150
Portefeuille d'investissements – FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	153
Portefeuille d'investissements – FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	157
Portefeuille d'investissements – FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	159
Portefeuille d'investissements – FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	161
Portefeuille d'investissements – FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	163
Portefeuille d'investissements – FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	165
Portefeuille d'investissements – FTGF ClearBridge Value Fund	167
Portefeuille d'investissements – FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	169
Portefeuille d'investissements – FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	170
Portefeuille d'investissements – FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	171
Portefeuille d'investissements – FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	173
Portefeuille d'investissements – FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	175
Portefeuille d'investissements – FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	177
Portefeuille d'investissements – FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	178
Portefeuille d'investissements – FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	180
Portefeuille d'investissements – FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	182
Portefeuille d'investissements – FTGF Royce US Smaller Companies Fund	186
Portefeuille d'investissements – FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	188
Portefeuille d'investissements – Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	189
Portefeuille d'investissements – FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	190
Portefeuille d'investissements – Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^]	192
Portefeuille d'investissements – Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	193
Portefeuille d'investissements – FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	194
Portefeuille d'investissements – FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	195
Portefeuille d'investissements – FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	197
Portefeuille d'investissements – FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	199
Portefeuille d'investissements – FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	200
Portefeuille d'investissements – Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	202
État de la situation financière – Legg Mason Global Funds Plc	204
État du résultat global – Franklin Templeton Global Funds Plc	224
État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – Franklin Templeton Global Funds Plc	234
Notes aux états financiers – Franklin Templeton Global Funds Plc	264

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Table des matières – (suite)

Informations supplémentaires – Total des frais sur encours (TFE) (non audités) – Franklin Templeton Global Funds Plc	338
Informations complémentaires – Données sur la performance des fonds (non audités) – Franklin Templeton Global Funds Plc	344
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Western Asset US Core Bond Fund	358
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Western Asset US Core Bond Fund	358
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	358
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	359
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund^ État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	359
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Western Asset US High Yield Fund	360
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund^ État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund^ État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Western Asset Global High Yield Fund	360
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^	361
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	362
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	362
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	363
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Western Asset Global Credit Fund^	363
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^	363
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	364
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	364
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^	365
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	365
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^	366
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^	366
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund^	366
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^	367
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	367
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	368
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Brandywine Global High Yield Fund^	368
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	368
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	369
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	369
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	369
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^	370
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^	370
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	371
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF ClearBridge Value Fund	371
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	372
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	372
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	373
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	373
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^	373
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF ClearBridge Global Growth Fund^	374
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^	374
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^	375
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	375
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	376
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Royce US Smaller Companies Fund	376
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^	376
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^	377
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^	378
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	379
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	379
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	379
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	380
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^	380
État des principales évolutions du portefeuille (non audités) – Franklin Responsible Income 2028 Fund^	381
Politique de rémunération OPCVM V (non auditée)	382
Annexe : Réglementation relative aux opérations de financement sur titres (SFTR) (non auditée)	383
Annexe : Informations sur les personnes liées (non auditées)	384
Annexe révisée : Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (non audité)	385

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Informations générales

Conseil d'administration

Joseph Carrier (États-Unis)
 Fionnuala Doris (Irlande) (indépendante)
 William Jackson (Royaume-Uni)
 Joseph Keane (Irlande) (indépendant)
 Joseph LaRocque (États-Unis)
 Jaspal Saggar (Royaume-Uni)
 Jane Trust (États-Unis)

Siège social

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

Secrétaire

Bradwell Limited
 Ten Earlsfort Terrace, Dublin 2
 Irlande

Distributeur principal et agent de services aux actionnaires principal

Franklin Distributors, LLC
 One Franklin Parkway
 San Mateo, CA 94403
 États-Unis

Distributeurs et Agents de services aux actionnaires secondaires

Franklin Templeton International Services S.à r.l.
 8A, rue Albert Borschette
 L-1246 Luxembourg
 Grand-Duché de Luxembourg

Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc.
 8F, n° 87
 Sec. 4, Zhong Xiao E. Rd., Taipei
 Taïwan

Legg Mason Asset Management Hong Kong Limited
 (terminé le 1er juillet 2022)
 Suites 1202-03
 12/F, York House
 15 Queen's Road Central
 Hong Kong

Franklin Templeton Investments (Asia) Limited
 (avec effet le 1er juillet 2022)
 17/F, Chater House
 8 Connaught Road Central
 Hong Kong

Templeton Asset Management Ltd.
 (à compter du 1er janvier 2023,
 anciennement Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited)
 7 Temasek Boulevard, #38-03
 Suntec Tower One
 Singapour 038987

Statut de Fonds de déclaration et statut de distributeur (pour les actionnaires britanniques uniquement)

Les actionnaires britanniques peuvent identifier les catégories d'actions de la société ayant été acceptées dans le régime des Fonds de déclaration britanniques et les catégories d'actions ayant obtenu le statut de Fonds de déclaration britannique en consultant la liste des Fonds de déclaration de l'administration fiscale et douanière (HM Revenue and Customs) sur le site internet <https://www.gov.uk/government/publications/offshore-funds-list-of-reporting-funds>. Cette liste est mise à jour chaque mois par le HM Revenue and Customs.

Pour plus de renseignements, consultez le prospectus supplémentaire destiné aux investisseurs du Royaume-Uni, ou contactez Franklin Templeton International Services S.à r.l.

Représentant en Suisse

First Independent Fund Services Ltd
 Klausstrasse 33
 CH-8008 Zurich
 Suisse

Agent payeur en Suisse

NPB Neue Privat Bank Ltd
 Limmatquai 1/am Bellevue
 CH-8024 Zurich
 Suisse

Le prospectus, les documents d'information clé pour l'investisseur, la constitution de la Société, les rapports annuels et semestriels et la ventilation des transactions d'achat et de vente des compartiments sont disponibles gratuitement auprès du représentant suisse.

Conseiller juridique irlandais

Arthur Cox LLP
 Ten Earlsfort Terrace, Dublin 2
 Irlande

Dépositaire

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

Commissaires aux comptes indépendants

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

Société d'administration

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

Société de gestion et promoteur

Franklin Templeton International Services S.à r.l.
 8A, rue Albert Borschette
 L-1246 Luxembourg
 Grand-Duché de Luxembourg

Informations générales – (suite)

Nom du Fonds	Date de lancement du Fonds	Gestionnaire de portefeuille / gestionnaire(s) de portefeuille par délégation
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund* (anciennement Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund*)	27 février 2004	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaire de portefeuille par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis
FTGF Western Asset US Core Bond Fund* (anciennement Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund*)	30 août 2002	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaire de portefeuille par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund* (anciennement Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund*)	20 avril 2007	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaires d'investissement par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokyo 100-6536 Japon
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund* (anciennement Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund*)	1er octobre 2003	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaire de portefeuille par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund^{^*b}	24 février 2004 (cessation d'activités le 16 février 2023)	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaire de portefeuille par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund* (anciennement Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund*)	29 août 2002	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaires d'investissement par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145

Informations générales – (suite)

Nom du Fonds	Date de lancement du Fonds	Gestionnaire de portefeuille / gestionnaire(s) de portefeuille par délégation
FTGF Western Asset US High Yield Fund* (anciennement Legg Mason Western Asset US High Yield Fund*)	27 février 2004	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaire de portefeuille par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund^{^*b}	24 février 2004 (cessation d'activités le 10 octobre 2022)	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaires d'investissement par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund^{^*b}	21 octobre 2011 (cessation d'activités le 21 juin 2022)	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaires d'investissement par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokyo 100-6536 Japon Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145 Western Asset Management Company Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Pres. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo – Brésil
FTGF Western Asset Global High Yield Fund* (anciennement Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund*)	20 avril 2007	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaires d'investissement par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145
Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund^{^*b}	20 avril 2007 (cessation d'activités le 8 novembre 2019)	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaire de portefeuille par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis

Informations générales – (suite)

Nom du Fonds	Date de lancement du Fonds	Gestionnaire de portefeuille / gestionnaire(s) de portefeuille par délégation
Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund^{^*b}	20 avril 2007 (cessation d'activités le 2 août 2019)	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaire de portefeuille par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^{^*b}	20 avril 2007 (cessation d'activités le 5 décembre 2022)	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaire de portefeuille par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund* (anciennement Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund ^a)	12 juin 2008	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaires d'investissement par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis Western Asset Management Company Pte. Ltd. 1 George Street, #23-01 Singapore 049145
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund* (anciennement Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund ^a)	3 juin 2009	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaires d'investissement par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokyo 100-6536 Japon Western Asset Management Company Pte. Ltd. 1 George Street, #23-01 Singapore 049145

Informations générales – (suite)

Nom du Fonds	Date de lancement du Fonds	Gestionnaire de portefeuille / gestionnaire(s) de portefeuille par délégation
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^{^^} (anciennement Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund [®])	3 décembre 2010	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street, London, EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaires d'investissement par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145 Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokyo 100-6536 Japon
FTGF Western Asset Global Credit Fund^{^^} (anciennement Legg Mason Western Asset Global Credit Fund [®])	19 novembre 2010	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaires d'investissement par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145 Western Asset Management Company Pty Limited Level 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australie
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^{^^*} (cessation d'activités le 21 juin 2022)	3 décembre 2010 (cessation d'activités le 21 juin 2022)	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaires d'investissement par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^{^^} (anciennement Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [®])	5 septembre 2013	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaires d'investissement par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokyo 100-6536 Japon Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145

Informations générales – (suite)

Nom du Fonds	Date de lancement du Fonds	Gestionnaire de portefeuille / gestionnaire(s) de portefeuille par délégation
Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^{^*b}	16 décembre 2015 (cessation d'activités le 10 décembre 2019)	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaire de portefeuille par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^{^*} (anciennement Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^])	16 décembre 2015	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaires d'investissement par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis Western Asset Management Company Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Pres. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo – Brésil Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145 Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokyo 100-6536 Japon
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^{^*b}	31 décembre 2015 (cessation d'activités le 13 novembre 2019)	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaires d'investissement par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145 Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokyo 100-6536 Japon Western Asset Management Company Pty Limited Level 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australie Western Asset Management Company Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Pres. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo – Brésil

Informations générales – (suite)

Nom du Fonds	Date de lancement du Fonds	Gestionnaire de portefeuille / gestionnaire(s) de portefeuille par délégation
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^{^*} (anciennement Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund [®])	13 janvier 2016	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaire de portefeuille par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^{^*} (anciennement Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [®])	13 janvier 2016	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaire de portefeuille par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^{^*} (anciennement Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [®])	17 novembre 2016	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaires d'investissement par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^{^*} (anciennement Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund [®])	17 novembre 2016	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaire de portefeuille par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis
FTGF Western Asset Infrastructure Debt Fund^{†*^} (anciennement Legg Mason Western Asset Infrastructure Debt Fund [®])		Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaires d'investissement par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokyo 100-6536 Japon Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145 Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Pres. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo – Brésil

Informations générales – (suite)

Nom du Fonds	Date de lancement du Fonds	Gestionnaire de portefeuille / gestionnaire(s) de portefeuille par délégation
FTGF Western Asset Short-Dated High Yield Fund^{†**} (anciennement Legg Mason Western Asset Short-Dated High Yield Fund [#])		Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaire de portefeuille par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis
FTGF Western Asset Asian Income Fund^{†*} (anciennement Legg Mason Western Asset Asian Income Fund [#])		Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaires d'investissement par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^{^*}	11 janvier 2021	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaire de portefeuille par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^{^*} (anciennement Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [#])	10 janvier 2022	Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaires d'investissement par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145 Western Asset Management Company Pty Limited Level 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australie
FTGF Western Asset China Bond Fund^{†**^} (anciennement Western Asset China Bond Fund [#])		Gestionnaire de portefeuille : Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Royaume-Uni Gestionnaires d'investissement par délégation : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapore 049145

Informations générales – (suite)

Nom du Fonds	Date de lancement du Fonds	Gestionnaire de portefeuille / gestionnaire(s) de portefeuille par délégation
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund* (anciennement Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund*)	1er octobre 2003	Gestionnaire de portefeuille : Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 États-Unis
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^* (anciennement Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund*)	3 avril 2012	Gestionnaire de portefeuille : Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 États-Unis
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^* (anciennement Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund*)	30 novembre 2012	Gestionnaire de portefeuille : Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 États-Unis
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund* (anciennement Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund*)	25 juin 2010	Gestionnaire de portefeuille : Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 États-Unis
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^*^b	10 mai 2012 (cessation d'activités le 25 février 2021)	Gestionnaire de portefeuille : Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 États-Unis
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund* (anciennement Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund*)	3 juin 2013	Gestionnaire de portefeuille : Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 États-Unis
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^* (anciennement Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund*)	30 juin 2014	Gestionnaire de portefeuille : Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 États-Unis
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund** (anciennement Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund*)	6 avril 2017	Gestionnaire de portefeuille : Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 États-Unis
Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund**^b	30 octobre 2017 (cessation d'activités le 29 janvier 2020)	Gestionnaire de portefeuille : Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 États-Unis
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund** (anciennement Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund*)	16 août 2018	Gestionnaire de portefeuille : Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 États-Unis
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund** (anciennement Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund*)	1er décembre 2022	Gestionnaire de portefeuille : Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 États-Unis
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^** (anciennement Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund*)	31 décembre 2015	Gestionnaire de portefeuille : Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 États-Unis

Informations générales – (suite)

Nom du Fonds	Date de lancement du Fonds	Gestionnaire de portefeuille / gestionnaire(s) de portefeuille par délégation
FTGF Brandywine Global – EM Macro Bond Fund**[^][^] (anciennement Legg Mason Brandywine Global - EM Macro Bond Fund [®])		Gestionnaire de portefeuille : Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 États-Unis
FTGF ClearBridge Value Fund** (anciennement Legg Mason ClearBridge Value Fund [®])	23 mars 1998	Gestionnaire de portefeuille : ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 États-Unis
Legg Mason ClearBridge Growth Fund[^][^][^][^] (cessation d'activités le 15 février 2019)	25 février 2004	Gestionnaire de portefeuille : ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 États-Unis
Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund[^][^][^] (cessation d'activités le 22 novembre 2019)	1er septembre 2006	Gestionnaire de portefeuille : ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 États-Unis
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund** (anciennement Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund [®])	20 avril 2007	Gestionnaire de portefeuille : ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 États-Unis
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund** (anciennement Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund [®])	20 avril 2007	Gestionnaire de portefeuille : ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 États-Unis
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund** (anciennement Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund [®])	20 avril 2007	Gestionnaire de portefeuille : ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 États-Unis
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund** (anciennement Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund [®])	3 juin 2013	Gestionnaire de portefeuille : ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 États-Unis
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^][^][^] (anciennement Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [®])	30 septembre 2015	Gestionnaire de portefeuille : ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 États-Unis
FTGF ClearBridge Global Growth Fund**[^][^] (anciennement Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund [®])	29 juin 2018	Gestionnaire de portefeuille : ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 États-Unis
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund**[^][^][^] (anciennement Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund [®])	9 décembre 2016	Gestionnaire de portefeuille : ClearBridge Investments (North America) Pty Limited (anciennement ClearBridge RARE Infrastructure International Pty Limited) Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australie
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund**[^][^][^] (cessation d'activités le 17 novembre 2022)	31 mars 2017	Gestionnaire de portefeuille : ClearBridge Investments (North America) Pty Limited (anciennement ClearBridge RARE Infrastructure International Pty Limited) Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australie
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund** (anciennement Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [®])	30 avril 2021	Gestionnaire de portefeuille : ClearBridge Investments (North America) Pty Limited (anciennement ClearBridge RARE Infrastructure International Pty Limited) Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australie

Informations générales – (suite)

Nom du Fonds	Date de lancement du Fonds	Gestionnaire de portefeuille / gestionnaire(s) de portefeuille par délégation
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund** (anciennement Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund [®])	8 novembre 2002	Gestionnaire de portefeuille : Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 États-Unis
FTGF Royce US Smaller Companies Fund** (anciennement Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund [®])	1er mars 2004	Gestionnaire de portefeuille : Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 États-Unis
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund*** (anciennement Royce Global Small Cap Premier Fund [®])	1er décembre 2021	Gestionnaire de portefeuille : Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 États-Unis
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund***[‡]	30 août 2002 (cessation d'activités le 11 juillet 2022)	Gestionnaire de portefeuille : Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 États-Unis
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund** (anciennement Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [®])	25 février 2004	Gestionnaire de portefeuille : Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 États-Unis
Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund***[‡]	20 avril 2007 (cessation d'activités le 25 février 2015)	
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund***[‡]	28 avril 2008 (cessation d'activités le 14 avril 2021)	Gestionnaire de portefeuille : Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 États-Unis
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund***[‡]	29 décembre 2010 (cessation d'activités le 27 avril 2022)	Gestionnaire de portefeuille : Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 États-Unis
Legg Mason QS US Large Cap Fund***[‡]		Gestionnaire de portefeuille : Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 États-Unis
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund***[^] (anciennement Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [®])	11 mars 2016 (cessation d'activités le 20 avril 2023)	Gestionnaire de portefeuille : Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Écosse Gestionnaire de portefeuille par délégation : Templeton Asset Management Ltd. (à compter du 1er janvier 2023, anciennement Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited) 7 Temasek Boulevard, #38-03 Suntec Tower One Singapour 038987

Informations générales – (suite)

Nom du Fonds	Date de lancement du Fonds	Gestionnaire de portefeuille / gestionnaire(s) de portefeuille par délégation
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund**^{ab}	11 mars 2016 (cessation d'activités le 21 août 2019)	Gestionnaire de portefeuille : Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Écosse Gestionnaire de portefeuille par délégation : Templeton Asset Management Ltd. (à compter du 1er janvier 2023, anciennement Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited) 7 Temasek Boulevard, #38-03 Suntec Tower One Singapour 038987
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund**^{ab}	11 mars 2016 (cessation d'activités le 1er juin 2021)	Gestionnaire de portefeuille : Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Écosse
Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund**^{ab}	11 mars 2016 (cessation d'activités le 31 juillet 2017)	
Legg Mason Martin Currie Greater China Fund**^{ab}	11 mars 2016 (cessation d'activités le 15 novembre 2019)	Gestionnaire de portefeuille : Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Écosse
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund**^a (anciennement Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund ^a)	28 juin 2016	Gestionnaire de portefeuille : Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Écosse
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund** (anciennement Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund ^a)	28 juin 2016	Gestionnaire de portefeuille : Franklin Templeton Australia Limited Level 47 120 Collins Street, Melbourne VIC 3000 Australie
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund**^a (anciennement Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund ^a)	24 novembre 2017	Gestionnaire de portefeuille : Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Écosse
FTGF Martin Currie European Select Absolute Alpha Fund**^a (anciennement Legg Mason Martin Currie European Select Absolute Alpha Fund ^a)		Gestionnaire de portefeuille : Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Écosse
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund**^a (anciennement Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund ^a)	9 novembre 2018	Gestionnaire de portefeuille : Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Écosse
FTGF Multi-Asset Infrastructure Income Fund**^a (anciennement Legg Mason Multi-Asset Infrastructure Income Fund ^a)		Gestionnaires : Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 États-Unis ClearBridge Investments (North America) Pty Limited (anciennement ClearBridge RARE Infrastructure International Pty Limited) Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australie

Informations générales – (suite)

Nom du Fonds	Date de lancement du Fonds	Gestionnaire de portefeuille / gestionnaire(s) de portefeuille par délégation
Legg Mason US Equity Fund [†]	8 janvier 2008 (cessation d'activités le 24 août 2010, nouveau lancement le 13 avril 2012 et cessation d'activités le 30 août 2013)	
Legg Mason Japan Equity Fund [†]	2 octobre 2008 (cessation d'activités le 30 novembre 2010)	
Franklin Responsible Income 2028 Fund ^{†*}	23 janvier 2023	Gestionnaire de portefeuille : Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street Londres EC4N 6HL Royaume-Uni
Franklin Responsible Series 2 Fund ^{†*}		Gestionnaire de portefeuille : Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street Londres EC4N 6HL Royaume-Uni
Franklin Responsible Series 3 Fund ^{†*}		Gestionnaire de portefeuille : Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street Londres EC4N 6HL Royaume-Uni

[†] À la fin de l'exercice financier, la négociation de ces compartiments n'a pas commencé.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

^μ Fonds du marché monétaire.

^{*} Compartiments obligataires (compartiments qui investissent principalement dans des titres à revenu fixe et porteurs d'intérêts).

^{**} Compartiments en actions (compartiments qui investissent principalement dans des actions).

^{***} Fonds multi-actifs (tout Fonds défini comme « Fonds multi-actifs » dans le supplément concerné du prospectus).

[†] En attente de la révocation de l'autorisation de la Banque centrale.

[#] Consulter la Note 14, Événements significatifs, pour les détails sur les modifications du nom du Fonds.

Pour de plus amples informations

Pour plus d'informations sur la gamme des compartiments de Franklin Templeton Global Funds Plc, veuillez contacter :

Pour les investisseurs professionnels en Europe (à l'exclusion du Royaume-Uni et de la Suisse)

Franklin Templeton International Services S.à r.l
8A, rue Albert Borschette
L-1246 Luxembourg
Grand-Duché de Luxembourg

www.franklinresources.com

Pour les contrepartistes agréés en Amérique du Nord et en Amérique du Sud

Franklin Templeton Investissements
1395 Brickell Avenue
Suite 1550
Miami, Florida 33131, États-Unis
Tél. : + 305 529 4400

www.franklintempletonoffshore.com

Veuillez visiter les sites Web applicables pour obtenir des informations concernant :

- Les dernières cotations
- Les divers documents, qui comprennent notamment la fiche technique de chaque Fonds sur laquelle figurent les informations les plus récentes concernant chacun d'entre eux
- Plus d'informations sur les filiales de gestion d'actifs de Franklin Templeton gérant les compartiments

Lettre aux Actionnaires

Cher actionnaire,

Nous avons le plaisir de vous présenter le rapport annuel de Franklin Templeton Global Funds Plc (la « Société ») pour la période de 12 mois close le 28 février 2023. Dans ce rapport, nous mettons en évidence les principaux facteurs de performance sur les marchés des obligations et des actions au cours de la période.

Analyse économique mondiale

L'économie mondiale a été touchée par un certain nombre d'événements pendant la période considérée, dont une inflation forte et continue, le resserrement des politiques monétaires agressives, les perturbations des chaînes logistiques, les suites de la pandémie de COVID-19 ainsi que la guerre en Ukraine et ses conséquences. Dans sa mise à jour de janvier 2023 des *Perspectives de l'économie mondiale*, le Fonds monétaire international (le « FMI ») a légèrement augmenté ses projections de croissance par rapport à sa mise à jour d'octobre 2022. Le FMI a déclaré : « La balance des risques reste orientée à la baisse, mais les risques défavorables se sont atténués depuis le rapport d'octobre 2022 *World Economic Outlook*. En revanche, il est plausible que la demande refoulée dans les nombreuses économies ou une baisse plus rapide de l'inflation donnent un coup de fouet. Du côté des inconvénients, de graves problèmes de santé en Chine pourraient freiner la reprise, la guerre de la Russie en Ukraine pourrait s'intensifier, et le resserrement des conditions de financement au niveau mondial pourrait aggraver la détresse liée à la dette. Les marchés financiers pourraient également reprendre soudainement leurs prix en réponse à une inflation défavorable, tandis qu'une fragmentation géopolitique accrue pourrait entraver les progrès économiques ». Au total, le FMI s'attend à ce que la croissance mondiale passe de 3,4 % en 2022 à 2,9 % en 2023. D'un point de vue régional, le FMI prévoit que le PIB de la zone euro sera de 0,7 % en 2023 (contre +3,5 % en 2022), de -0,6 % au Royaume-Uni (contre 4,1 % en 2022) et de 1,8 % au Japon (contre 1,4 % en 2022).

Revue de marché – Titres à revenu fixeⁱ

Globalement, le marché mondial des titres à revenu fixe a généré de faibles résultats au cours de la période considérée. Aux États-Unis, le rendement des bons du Trésor a crû rapidement, avec une inflation atteignant un taux record sur plusieurs décennies. Dans ce contexte, le conseil des gouverneurs de la Réserve fédérale (« Fed ») a relevé ses taux huit fois durant la période considérée, la hausse des taux de février 2023 ayant mené le taux directeur à son niveau le plus élevé depuis 2007. Les rendements des bons du Trésor américains à dix ans ont commencé la période de déclaration à 1,83 %, et ont terminé la période à 3,92 %. Cette augmentation des rendements s'est également observée dans les pays développés en dehors des États-Unis. Au total, les bons du Trésor américain et les obligations des entreprises de première catégorieⁱⁱ ont enregistré des rendements négatifs. Les obligations d'entreprises américaines moins dette souveraine bien notée et libellée en dollars américains des marchés émergents a également généré des rendements négatifs.

Revue de marché – Actions mondiales^{iv}

Les actions mondiales ont connu des périodes de volatilité accrue et ont produit des résultats décevants pendant la période considérée. La confiance des investisseurs a été affectée par la forte inflation, par le resserrement de la politique de la Banque centrale irlandaise, par la crainte d'une récession mondiale et par les enjeux géopolitiques. Pour la période de 12 mois close le 28 février 2023, l'indice S&P 500 a affiché un rendement de -7,69 %. En dehors des États-Unis, les actions des marchés développés internationaux, dont le cours est mesuré à travers l'indice MSCI EAFE Index (net), ont affiché un rendement de -3,14 %, tandis que celles de marchés émergents, mesurées par l'indice MSCI Emerging Markets Index (net), ont enregistré une performance de -15,28 %.

i Revenu fixe : obligations.

ii Investment grade (catégorie « investissement ») : une notation de crédit qui désigne une obligation d'État ou d'entreprises présentant un risque de défaillance relativement faible.

Nous vous remercions de votre fidélité.

Sincères salutations,

Franklin Templeton International Services S.à r.l

Mars 2023

Les performances passées ne préjugent pas des résultats futurs. Les informations présentées ne sauraient constituer une prévision d'événements futurs, une garantie de résultats futurs ou des conseils d'investissement.

Sauf indications contraires, toutes les données sont valables au 28 février 2023.

Franklin Templeton Global Funds plc est un Fonds à compartiments avec séparation des passifs entre les compartiments constitué comme une société d'investissement à capital variable, agréé en Irlande par la Banque centrale d'Irlande en tant qu'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.

Tous les investissements impliquent des risques, y compris l'éventualité d'une perte du capital investi. Les performances passées ne préjugent pas des résultats futurs et ne sont pas constantes dans le temps.

Ces informations ont été préparées à partir de sources jugées fiables, mais ne sont en aucune façon garanties par une société ou une société affiliée de Franklin Resources, Inc. (collectivement « Franklin Templeton »), et elles ne constituent en aucun cas un résumé complet de ni une déclaration complète sur toutes les données disponibles.

Les opinions exprimées sont susceptibles d'être modifiées sans notification préalable et elles ne tiennent pas compte des objectifs d'investissement, de la situation financière ou des besoins particuliers des investisseurs individuels.

Avant d'effectuer un investissement, il est recommandé de lire le document d'information clé pour l'investisseur et le prospectus, qui contiennent une description complète des objectifs et des facteurs de risque des compartiments. Ces documents et d'autres documents pertinents peuvent être obtenus dans plusieurs langues auprès de BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company, One Dockland Central, Guild Street, IFSC, Dublin 1, Irlande, sur www.franklinresources.com et au siège social.

Émis et approuvé par Franklin Templeton International Services S.à r.l, 8A, rue Albert Borschette, L-1246 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg, société constituée au Luxembourg et réglementée par la Commission de Surveillance du Secteur Financier.

Ces documents ne sont en aucun cas prévus pour une utilisation par une personne ou dans un contexte violant toute loi ou réglementation locale. Franklin Templeton décline toute responsabilité de quelque sorte que ce soit en cas de transmission ultérieure de ces documents.

iii Obligation d'entreprise : une obligation émise par une société en vue de lever des Fonds efficacement et d'étendre ses activités.

iv Capitaux propres : participation dans une société sous forme d'actions ordinaires ou d'actions privilégiées.

Rapport des Administrateurs (révisé)

Après l'approbation du Rapport des Administrateurs, mais avant la publication du rapport annuel aux actionnaires, les administrateurs de la Société (les « Administrateurs ») ont inclus des informations supplémentaires dans la section intitulée « Annexe révisée : Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (non vérifié) » conformément à l'article 366 (1)(b) et (4)(a) de la Loi sur les sociétés de 2014. Les Administrateurs soumettent leur rapport annuel révisé ainsi que les états financiers vérifiés pour l'exercice clos le 28 février 2023.

Déclaration de responsabilité des Administrateurs

Les Administrateurs sont responsables de la préparation du rapport des administrateurs et des états financiers conformément au droit irlandais.

Le droit des sociétés irlandais exige que les Administrateurs établissent les états financiers pour chaque exercice financier, lesquels doivent présenter un état fidèle et réel des actifs, des passifs et de la situation financière de la Société à la clôture de l'exercice financier, ainsi que des profits et pertes de la Société pour cet exercice. Les Administrateurs ont préparé les états financiers conformément aux normes comptables généralement acceptées en Irlande, en ce compris la Financial Reporting Standard (« FRS ») 102 : « La norme d'information financière applicable au Royaume-Uni et en République d'Irlande » (« FRS 102 »).

En vertu du droit des sociétés irlandais, les Administrateurs ne doivent pas approuver les états financiers s'ils n'ont pas l'assurance qu'ils présentent un état fidèle et sincère des actifs, des passifs et de la situation financière de la Société à la clôture de l'exercice financier ainsi que des profits ou des pertes de la Société pour ledit exercice.

Aux fins de préparer ces états financiers, les Administrateurs sont tenus de :

- sélectionner des méthodes comptables appropriées et les appliquer de manière cohérente ;
- émettre des jugements et des estimations qui sont raisonnables et prudents ;
- indiquer si les états financiers ont été préparés conformément aux normes comptables en vigueur et définir les normes en question, tout écart important par rapport auxdites normes étant publié et expliqué dans les notes aux états financiers ;
- établir les états financiers en appliquant le principe de continuité d'exploitation, à moins qu'il soit inapproprié de présumer que la Société poursuivra ses activités.

Les Administrateurs sont chargés de veiller à ce que soient tenus des livres comptables appropriés et suffisamment précis pour :

- conserver la trace des transactions de la Société et les justifier ;
- permettre, à tout moment, de déterminer avec une précision raisonnable l'actif, le passif, la situation financière et le résultat de la Société ;
- permettre aux administrateurs de s'assurer que les états financiers sont conformes aux dispositions de la loi irlandaise de 2014 sur les sociétés et qu'ils peuvent être audités.

À cette fin, les Administrateurs ont nommé un administrateur expérimenté, BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company, chargé de la tenue des livres comptables et de l'exécution de tâches administratives complémentaires.

Les Administrateurs sont également responsables de la préservation des actifs de la Société. Pour s'acquitter de cette responsabilité, ils ont nommé The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch, pour assurer la garde des actifs de la Société conformément aux statuts de la Société. Les Administrateurs sont aussi chargés de prévenir et de détecter la fraude et toute autre irrégularité par la mise en place de mesures raisonnables.

Les Administrateurs sont responsables du suivi et de l'intégrité des informations et des états financiers relatifs à la Société publiés sur les sites Web des sociétés affiliées de Franklin Templeton qui distribuent les Compartiments. La législation irlandaise régissant la préparation et la diffusion des états financiers peut différer des législations des autres juridictions.

Analyse de l'activité et des développements futurs

La Lettre aux Actionnaires page 16 contient une analyse des facteurs ayant contribué à la performance des Compartiments pendant l'exercice. Les administrateurs ne prévoient aucune modification des objectifs d'investissement des Fonds existants sur le site, à l'exception de ce qui est indiqué dans la Note 16 - Événements postérieurs à la date de clôture des présents états financiers.

Au 28 février 2023, la société compte 48 Fonds actifs (2022 : 54 Fonds) en activité. Les détails de leurs valeurs nettes d'inventaire au 28 février 2023 sont présentés dans l'état de la situation financière aux pages 204 à 223.

À compter du 27 avril 2022, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] a cessé ses activités.

À compter du 21 juin 2022, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] et Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] ont cessé leurs activités.

À compter du 11 juillet 2022, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] a cessé ses activités.

À compter du 10 octobre 2022, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^] a cessé ses activités.

À compter du 17 novembre 2022, Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^] a cessé ses activités.

À compter du 1er décembre 2022, le FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] a commencé à être négocié.

À compter du 5 décembre 2022, le Fonds Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^] a cessé ses activités.

À compter du 23 janvier 2023, le Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] a commencé à être négocié.

À compter du 16 février 2023, Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^] a cessé ses activités.

Objectifs et politique de gestion des risques

Les informations liées aux certains objectifs et politiques de gestion des risques de la Société sont reprises à la Note 12 aux états financiers.

Résultats pour l'exercice financier et situation de la Société au 28 février 2023

L'état de la situation financière au 28 février 2023 et au 28 février 2022 ainsi que l'état du résultat global pour les exercices financiers clos les 28 février 2023 et 28 février 2022 sont présentés respectivement aux pages 204 à 223 et 224 à 232.

Distributions aux Détenteurs d'Actions de Participation Rachetables

Les distributions aux détenteurs d'Actions Participatives Rachetables pour les exercices clos le 28 février 2023 et le 28 février 2022 sont indiquées dans l'état du résultat global.

Événements importants

Voir la Note 14 pour de plus amples détails concernant les événements importants survenus au cours de l'exercice financier.

Événements ultérieurs

Voir la Note 16 pour de plus amples détails concernant les événements importants survenus après la fin de l'exercice financier.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

Administrateurs

Les noms des personnes qui sont actuellement Administrateurs ou qui ont occupé ce poste à tout moment pendant l'exercice sont présentés ci-dessous.

Joseph Carrier (États-Unis)
Fionnuala Doris (Irlande) (indépendante)
William Jackson (Royaume-Uni)
Joseph Keane (Irlande) (indépendant)
Joseph LaRocque (États-Unis)
Jaspal Saggar (Royaume-Uni)
Jane Trust (États-Unis)

Intérêts des Administrateurs et du Secrétaire

Les administrateurs, le secrétaire et les membres de leurs familles ne détenaient pas de participation sous la forme d'actions de la Société au 28 février 2023 et au 28 février 2022. Aucun Administrateur n'a détenu, à aucun moment de l'exercice financier, un intérêt substantiel dans un quelconque contrat significatif relatif aux activités de la Société au cours ou à la fin de l'exercice financier.

Déclaration sur la gouvernance d'entreprise

Le conseil d'administration de la Société (le « conseil ») a évalué toutes les mesures, dont le code de gouvernance d'entreprise à l'intention des organismes de placement collectif et des sociétés de gestion (Corporate Governance Code for Collective Investment Schemes and Management Companies), d'application facultative, tel que publié par Irish Funds en décembre 2011 (l'« Irish Funds Code »). Le Conseil a adopté toutes les procédures et pratiques de gouvernance d'entreprise prévues dans l'Irish Funds Code.

Déclaration de conformité des Administrateurs

La politique de la Société est de se conformer aux obligations qui lui sont propres (comme défini par le Companies Act de 2014). Conformément aux exigences stipulées sous la Section 225(2) du Companies Act de 2014, les Administrateurs reconnaissent qu'ils sont tenus de garantir le respect des obligations propres à la Société. Les Administrateurs ont rédigé une déclaration de principes de conformité, selon les dispositions de la Section 225(3)(a) du Companies Act de 2014 ainsi qu'une politique de conformité présentant les accords et structures en place, lesquels sont, de l'avis des Administrateurs, conçus pour garantir le respect substantiel des obligations propres à la Société. En s'acquittant des responsabilités visées par la Section 225, les Administrateurs se sont, entre autres, appuyés sur les services fournis, les conseils et/ou les déclarations de tiers que les Administrateurs jugent pourvus des connaissances et de l'expérience requises pour garantir le respect substantiel des obligations pertinentes de la Société.

Informations d'audit pertinentes

Pour autant qu'il ait été porté à la connaissance des Administrateurs, il n'existe aucune information d'audit pertinente dont les auditeurs de la société n'ont pas connaissance et les Administrateurs ont pris toutes les mesures qu'un administrateur ou une administratrice devrait prendre afin de s'assurer qu'ils ont connaissance de toutes les informations d'audit pertinentes et pour établir que les Auditeurs de la société ont connaissance de ces informations.

Transactions de parties rattachées

Le règlement 43 (1) de la réglementation de 2019 de la Banque centrale irlandaise sur les OPCVM, « Central Bank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2019 », stipule qu'une « personne responsable doit veiller à ce que toute transaction entre un OPCVM et une personne rattachée soit négociée a) sans lien de dépendance et b) au mieux des intérêts des détenteurs de parts de l'OPCVM ».

Conformément aux dispositions du règlement 81 (4) de la réglementation de la Banque centrale irlandaise sur les OPCVM, le conseil d'administration est convaincu que : (a) il existe des dispositions attestées par des procédures écrites garantissant que les obligations prescrites par le règlement 43 (1) s'appliquent à toutes les transactions avec des personnes rattachées ; et (b) toutes les transactions avec des personnes rattachées qui ont été conclues pendant l'exercice respectent les obligations prescrites par le règlement 43 (1).

Commissaires aux comptes indépendants

PricewaterhouseCoopers a indiqué sa volonté d'être reconduit dans son mandat conformément à la Section 383(2) du Companies Act de 2014.

Objectifs et politiques d'investissement

Tous les Fonds actifs, à l'exception des Fonds Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^], FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^], FTGF Western Asset Global Credit Fund[^], Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^], FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^], FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^], Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^], FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^], FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^], FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^], FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] et Franklin Responsible Income 2028 Fund[^], ont été autorisés par la Securities and Futures Commission de Hong Kong. Par conséquent, les Fonds mentionnés ci-dessus ne sont pas autorisés à la vente au public à Hong Kong. L'autorisation de la Securities and Futures Commission de Hong Kong n'implique pas une recommandation d'investissement dans les Fonds.

Les principaux objectifs et politiques d'investissement de tous les Fonds actifs à la fin de l'exercice sont énumérés ci-dessous et dans les pages suivantes. Rien ne permet de garantir qu'un Fonds atteindra son objectif ni qu'une stratégie d'investissement réussira ou obtiendra des résultats ou un niveau de rentabilité particuliers (les termes définis correspondent aux définitions données dans le prospectus relatif au Fonds concerné (le « prospectus »)).

Rapports périodiques pour les produits SFDR de l'article 8 uniquement

Transparence de la promotion des caractéristiques environnementales ou sociales et des investissements durables dans les rapports périodiques

Le règlement « Disclosure », ou relatif à la divulgation d'informations en matière de finance durable ((UE) 2019/2088), (le « SFDR ») exige de la part de la Société d'inclure dans ses rapports périodiques une description de la mesure dans laquelle tout Fonds classé article 8 du SFDR (un « Fonds de l'article 8 ») a satisfait à ses caractéristiques environnementales ou sociales. Le SFDR habilite également l'Autorité bancaire européenne, l'Autorité européenne des assurances et des pensions professionnelles et l'Autorité européenne des marchés financiers (collectivement les « AES ») à élaborer des projets de normes techniques réglementaires (« RTS ») afin de préciser le format d'information et de présentation dans les rapports périodiques. Les informations suivantes ont été préparées à l'aide de l'ensemble commun d'informations sur le développement durable ou des exigences de déclaration des RTS qui sont entrées en vigueur le 1er janvier 2023.

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

Objectif d'investissement - Maintenir le capital du Fonds et fournir un rendement conforme aux taux du marché monétaire.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit au moins 99,5 % de sa valeur nette d'inventaire dans les éléments suivants : (i) instruments du marché monétaire éligibles émis ou garantis séparément par l'Union européenne, les administrations nationales, régionales et locales des États membres ou leurs banques centrales, la Banque centrale européenne, la Banque européenne d'investissement, le Fonds européen d'investissement, le Mécanisme européen de stabilité, le Fonds européen de stabilité financière, une autorité centrale ou une banque centrale d'un pays tiers (y compris les États-Unis), le Fonds monétaire international, la Banque internationale pour la reconstruction et le développement, la Banque de développement du Conseil de l'Europe, la Banque européenne pour la reconstruction et le développement, la Banque des règlements internationaux et toute autre institution ou organisation financière internationale pertinente à laquelle appartiennent un ou plusieurs États membres et dont les émetteurs peuvent inclure, sans s'y limiter, la Federal National Mortgage Association (Fannie Mae), la Federal Home Loan Mortgage Corporation (Freddie Mac) Government National Mortgage Association (Ginnie Mae),

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund – (suite)

la Student Loan Marketing Association (Sallie Mae) et la Federal Home Loan Bank (« instruments du marché monétaire de la dette publique ») ; (ii) accords de prise en pension éligibles garantis par des instruments du marché monétaire de la dette publique ; et (iii) dépôts en espèces détenus en dollars américains.

Par dérogation, le Fonds est autorisé par la Banque centrale à investir jusqu'à 100 % de sa valeur nette d'inventaire dans des instruments du marché monétaire de la Dette publique à condition que (i) il détienne des instruments du marché monétaire de la dette publique provenant d'au moins six émissions différentes par émetteur, (ii) et qu'il limite l'investissement dans des instruments du marché monétaire de la dette publique provenant de la même émission à un maximum de 30 % de sa valeur nette d'inventaire. Le Fonds investit au moins deux tiers de sa valeur liquidative dans des instruments du marché monétaire de la dette publique libellés en dollars américains et émis par des émetteurs américains. Le Fonds n'a pas l'intention d'utiliser des instruments financiers dérivés à quelque fin que ce soit.

Le Fonds est un Fonds du marché monétaire à court terme de la dette publique à valeur liquidative constante (« CNAV »), conformément aux exigences des règlements de la Banque centrale.

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Objectif d'investissement – Maximiser le rendement total par le biais de revenu et d'appréciation du capital.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit au moins 75 % de sa valeur liquidative dans des titres de créance qui sont (i) cotés ou négociés sur des marchés réglementés situés dans des pays développés et des pays émergents ; (ii) libellés en dollars américains et (iii) classés au minimum au moment de l'achat sur BBB par S&P ou équivalent par une autre NRSRO ou, s'ils ne sont pas classés, jugés de qualité comparable par le Gestionnaire de portefeuille et le Gestionnaire de portefeuille délégué du Fonds. Le Fonds peut investir dans les types de titres suivants qui sont cotés ou négociés sur des marchés réglementés : les titres de créance émis ou garantis par le gouvernement américain, ses agences ou instruments et ses subdivisions politiques (y compris les titres protégés contre l'inflation), les titres de créance d'entreprise tels que les billets à ordre librement transférables, les débentures, les obligations (y compris les obligations à coupon zéro), les obligations convertibles et non convertibles, les obligations convertibles conditionnelles (un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des obligations convertibles conditionnelles), les obligations indexées sur le crédit, les billets de trésorerie, les certificats de dépôt et les acceptations bancaires émises par des organisations industrielles, de services publics, financières, de banques commerciales ou de sociétés de portefeuille bancaires ; des titres adossés à des créances hypothécaires et à des actifs ; des actions privilégiées et d'autres organismes de placement collectif à capital variable au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM.

Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM. Au moins deux tiers de la valeur liquidative du Fonds seront investis dans des placements d'émetteurs ou de sociétés qui ont leur siège social aux États-Unis ou qui exercent une part importante de leurs activités commerciales aux États-Unis.

Le Fonds pourra avoir un effet de levier pouvant atteindre jusqu'à 100 % de sa valeur liquidative (telle que calculée selon l'approche par les engagements) en raison de l'utilisation d'instruments dérivés. Le Fonds peut être exposé à des accords de prise en pension à des fins de gestion efficace de portefeuille et sous réserve des exigences de la Banque centrale. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement de titres (SFT), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé en tant qu'Article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement Taxonomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement Taxonomie. Cependant, conformément à sa méthodologie environnementale, sociale et de gouvernance (« ESG »), le Fonds peut détenir des investissements qui cherchent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation au changement climatique.

Les titres composant l'univers d'investissement du Fonds sont évalués à l'aide d'un système propriétaire et du cadre ESG de MSCI afin de déterminer la notation ESG de l'univers d'investissement global et de chaque émetteur individuel et de ses titres, puis le gestionnaire de portefeuille sélectionne les investissements pour le Fonds en tenant compte de la politique d'investissement du Fonds et des notations ESG des émetteurs des titres concernés. Bien que les données MSCI soient la principale source de notation ESG, lorsque les données de notation ESG MSCI ne sont pas disponibles, le gestionnaire de portefeuille peut s'appuyer sur une notation ESG Western Asset pertinente pour l'émetteur. Dans le cadre de cette évaluation, le Fonds utilise des données ESG de tiers, provenant notamment de MSCI et de la Banque mondiale, pour mesurer, entre autres, l'intensité carbone des émetteurs privés et souverains, respectivement. L'alignement sur les UNSDG est mesuré à l'aide d'un cadre propriétaire de Western Asset basé sur des données obtenues auprès de fournisseurs de données tiers.

Le Fonds cherche à investir dans des titres d'émetteurs qui, dans l'ensemble, atteignent une intensité carbone moyenne pondérée du portefeuille inférieure d'au moins 20 % à celle de l'indice Bloomberg US Aggregate Index] (l'« indice de référence »). L'intensité carbone moyenne pondérée des émissions de carbone fait référence au carbone des Champs 1 et 2 du Protocole des gaz à effet de serre (« GES ») émis par un émetteur.

Comme indiqué dans la politique d'investissement, le portefeuille du Fonds conservera une note ESG MSCI moyenne de BBB ou supérieure qui, selon la méthodologie de MSCI, est une note moyenne ou supérieure par rapport aux pairs du secteur, ce qui indique un alignement crédible sur les caractéristiques ESG.

En outre, le Fonds cherchera à s'aligner, mieux que l'Indice de référence, sur les investissements en titres d'émetteurs dont les activités contribuent à au moins 1 des 8 Objectifs de développement durable des Nations Unies (« UNSDG ») (collectivement, les « émetteurs UNSDG »).

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Objectif d'investissement - Maximiser le rendement total, composé d'une appréciation du capital et d'un revenu.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit au moins 70 % de sa valeur liquidative dans des titres de créance cotés ou négociés sur des marchés réglementés aux États-Unis énumérés dans l'Annexe III du Prospectus, qui sont classés en Catégorie d'investissement ou, s'ils ne sont pas classés, considérés par le Gestionnaire de portefeuille et le Gestionnaire de portefeuille délégué comme ayant une qualité de crédit comparable, et qui sont émis par des émetteurs américains. Les titres dans lesquels le Fonds peut investir comprennent des titres de créance émis ou garantis par le gouvernement américain, ses agences, ses instruments et ses subdivisions politiques ; des titres de créance émis par d'autres gouvernements nationaux, leurs agences, leurs instruments et leurs subdivisions politiques ; des titres de créance d'organisations supranationales tels que des billets à ordre librement transférables, des obligations et des débentures ; des titres de créance de sociétés, y compris des billets à ordre librement transférables, des débentures, des obligations ; les obligations non convertibles ; les obligations convertibles contingentes (un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des obligations convertibles contingentes) ; les obligations indexées sur le crédit, les billets de trésorerie, les certificats de dépôt et les acceptations bancaires émis par des organisations industrielles, de services publics, financières, de banques commerciales ou de holdings bancaires ; et les titres adossés à des créances hypothécaires et à des actifs, structurés comme des titres de créance.

Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM. Sous réserve des limites fixées dans les politiques d'investissement, le Fonds peut également investir au total jusqu'à 30 % de sa valeur liquidative dans des titres non cotés en bourse, des titres relevant de la règle 144A, des titres à coupon zéro, des instruments du marché monétaire et des titres de créance d'émetteurs non américains. Le Fonds peut être exposé à des accords de prise en pension à des fins de gestion efficace de portefeuille et sous réserve des exigences de la Banque centrale.

L'allocation et la réallocation des actifs du Fonds seront effectuées par le Gestionnaire de portefeuille et le Gestionnaire de portefeuille délégué sur la base de leur analyse des conditions économiques et de marché et des risques et opportunités relatifs à des types particuliers de titres à revenu fixe. La durée moyenne du portefeuille variera en fonction des prévisions de taux d'intérêt du Gestionnaire de portefeuille délégué.

Le Fonds peut acheter des participations non titrisées ou des cessions de prêts hypothécaires à taux variable ou d'autres prêts commerciaux qui sont liquides et prévoient des ajustements de taux d'intérêt au moins tous les 397 jours et qui peuvent être garantis par des biens immobiliers ou d'autres actifs. Le Fonds peut investir dans certains types de produits dérivés et peut avoir un effet de levier allant jusqu'à 100 % de sa valeur liquidative du fait de l'utilisation de produits dérivés. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement de titres (SFT), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé en tant qu'Article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

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

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement Taxonomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement Taxonomie. Cependant, conformément à sa méthodologie ESG, le Fonds peut détenir des investissements qui cherchent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation au changement climatique.

Les titres composant l'univers d'investissement du Fonds sont évalués à l'aide d'un système propriétaire et du cadre ESG de MSCI afin de déterminer la notation ESG de l'univers d'investissement global et de chaque émetteur individuel et de ses titres, puis le gestionnaire de portefeuille sélectionne les investissements pour le Fonds en tenant compte de la politique d'investissement du Fonds et des notations ESG des émetteurs des titres concernés. Bien que les données MSCI soient la principale source de notation ESG, lorsque les données de notation ESG MSCI ne sont pas disponibles, le gestionnaire de portefeuille peut s'appuyer sur une notation ESG Western Asset pertinente pour l'émetteur. Dans le cadre de cette évaluation, le Fonds utilise des données ESG de tiers, provenant notamment de MSCI et de la Banque mondiale, pour mesurer, entre autres, l'intensité carbone des émetteurs privés et souverains, respectivement. L'alignement sur les UNSDG est mesuré à l'aide d'un cadre propriétaire de Western Asset basé sur des données obtenues auprès de fournisseurs de données tiers.

Le Fonds cherche à investir dans des titres d'émetteurs qui, dans l'ensemble, atteignent une intensité carbone moyenne pondérée du portefeuille inférieure d'au moins 20 % à celle de l'indice Bloomberg US Aggregate Index] (l'« indice de référence »). L'intensité moyenne pondérée des émissions de carbone fait référence au carbone des Champs 1 et 2 du Protocole des gaz à effet de serre (« GES ») émis par un émetteur.

Comme indiqué dans la politique d'investissement, le portefeuille du Fonds conservera une note ESG MSCI moyenne de BBB ou supérieure qui, selon la méthodologie de MSCI, est une note moyenne ou supérieure par rapport aux pairs du secteur, ce qui indique un alignement crédible sur les caractéristiques ESG.

En outre, le Fonds cherchera à s'aligner, mieux que l'Indice de référence, sur les investissements en titres d'émetteurs dont les activités contribuent à au moins 1 des 8 Objectifs de développement durable des Nations Unies (« UNSDG ») (collectivement, les « émetteurs UNSDG »).

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Objectif d'investissement - Maximiser le rendement total par l'appréciation du capital et des revenus.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit au moins 70 % de sa valeur liquidative dans des titres de créance libellés en euros qui sont cotés ou négociés sur des marchés réglementés situés dans des pays développés et des pays émergents, comme indiqué dans l'Annexe III du Prospectus. Le Fonds investit dans les types de titres suivants qui sont cotés ou négociés sur des marchés réglementés : les titres de créance émis ou garantis par les gouvernements nationaux des pays développés et des pays émergents, leurs agences, instruments et subdivisions politiques (y compris les titres protégés contre l'inflation) ; les titres de créance d'organisations supranationales tels que les billets à ordre, les obligations et les débentures librement transférables ; les titres de créance d'entreprises d'émetteurs situés dans des marchés réglementés de pays développés et de pays émergents ou dont les titres sont cotés ou négociés sur ces marchés, y compris les billets à ordre librement transférables, les obligations, les billets de trésorerie, les certificats de dépôt et les acceptations bancaires émises par des entreprises industrielles, des entreprises de services publics, des établissements financiers, des banques commerciales ou des sociétés de portefeuille bancaire ; des obligations convertibles contingentes (un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des obligations convertibles contingentes) ; des titres adossés à des créances hypothécaires et à des actifs ; des actions privilégiées ; et d'autres organismes de placement collectif de type ouvert au sens du Règlement 68(1)(e) des Règlements sur les OPCVM. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM.

Le Fonds n'investira pas dans des titres de participation, y compris des bons de souscription, à l'exception (1) des actions privilégiées, dans la limite de 10 % de la valeur liquidative du Fonds, et (2) des titres de participation acquis par le biais de conversions de titres de créance convertibles ou d'actions d'entreprise d'émetteurs (telles que l'émission d'actions pour remplacer des titres de créance précédemment émis). Le Fonds peut investir dans certains types d'instruments dérivés et peut avoir un effet de levier allant jusqu'à 100 % de sa valeur liquidative (calculée selon l'approche par les engagements) en raison de son utilisation d'instruments dérivés. Le Fonds peut être exposé à des accords de prise en pension à des fins de gestion efficace de portefeuille et sous réserve des exigences de la Banque centrale. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement de titres (SFT), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative. Le Fonds peut acheter des participations non titrisées ou des cessions de prêts hypothécaires à taux variable ou d'autres prêts commerciaux qui sont liquides et prévoient des ajustements de taux d'intérêt au moins tous les 397 jours et qui peuvent être garantis par des biens immobiliers ou d'autres actifs.

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund^ – (a cessé ses activités le 16 février 2023)

Objectif d'investissement - Fournir un revenu courant élevé.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit au moins 80 % de sa valeur liquidative dans des titres de créance et des instruments à haut rendement qui sont (i) libellés en dollars américains et en devises de divers autres pays développés et (ii) cotés ou négociés sur des marchés réglementés, comme indiqué dans l'annexe III du prospectus. Ces titres de créance et instruments à haut rendement sont notamment les suivants : (i) titres de créance d'entreprises, y compris (a) billets à ordre librement transférables, (b) obligations, (c) obligations (y compris les obligations à coupon zéro), (d) obligations convertibles et non convertibles, (e) obligations convertibles contingentes (un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des obligations convertibles contingentes), (f) obligations indexées sur le crédit, (g) billets de trésorerie, (h) certificats de dépôt et (i) acceptations bancaires émises par des organisations industrielles, de services publics, financières, de banques commerciales ou de sociétés de portefeuille bancaire ; (ii) obligations structurées qui sont des valeurs mobilières, dont l'exposition sous-jacente peut être des titres à revenu fixe ; (iii) titres adossés à des créances hypothécaires ; (iv) titres adossés à des actifs et (v) participations non titrisées ou cessions de prêts hypothécaires à taux variable ou d'autres prêts commerciaux qui sont liquides et prévoient des ajustements de taux d'intérêt au moins tous les 397 jours et qui peuvent être garantis par des biens immobiliers ou d'autres actifs, à condition que le Fonds investisse au moins deux tiers de sa valeur nette liquidative dans des titres de créance non convertibles. Le Fonds peut investir dans des titres de créance assortis d'une note aussi basse que D par S&P ou d'une note équivalente par une autre NRSRO, ce qui indique que les obligations sont hautement spéculatives et qu'elles peuvent être en défaut ou en danger de défaut en ce qui concerne le principal et les intérêts.

Les actifs restants du Fonds peuvent être investis dans les types de titres suivants, cotés ou négociés sur des Marchés réglementés : titres de créance classés Catégorie d'investissement, ou titres non classés jugés de qualité équivalente par le Gestionnaire de portefeuille et le Gestionnaire de portefeuille par délégation ; actions privilégiées et autres organismes de placement collectif à capital variable au sens du Règlement 68(1)(e) de la Réglementation sur les OPCVM, ainsi que des liquidités et des Instruments du marché monétaire. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif ouverts au sens de l'article 68(1)(e) de la réglementation sur les OPCVM. Le Fonds peut être exposé à des accords de prise en pension à des fins de gestion efficace de portefeuille et sous réserve des exigences de la Banque centrale. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement de titres (SFT), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative.

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Objectif d'investissement – Maximiser le rendement total par le biais de revenu et d'appréciation du capital.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit principalement dans des titres de créance libellés en dollars américains, en yens japonais, en livres sterling, en euros et dans diverses autres devises, qui sont négociés ou cotés sur l'un des marchés réglementés situés dans les pays développés et les pays émergents, comme indiqué dans l'annexe III du prospectus. Le Fonds peut investir dans les types de titres suivants qui sont cotés ou négociés sur des marchés réglementés : les titres de créance émis ou garantis par les gouvernements nationaux des pays développés et des pays émergents, leurs agences ou instruments et leurs subdivisions politiques (y compris les titres protégés contre l'inflation) ; les titres de créance d'organisations supranationales tels que les billets à ordre, les obligations et les débentures librement transférables ; les titres de créance d'entreprises d'émetteurs situés dans des pays développés et des pays émergents ou dont les titres sont cotés ou négociés sur des marchés réglementés, y compris les billets à ordre librement transférables, les obligations (y compris les obligations à coupon zéro), les titres de créance des marchés émergents (y compris les obligations Brady, les euro-obligations, les obligations nationales et internationales émises en vertu de la législation d'un pays en voie de développement), obligations convertibles et non convertibles, obligations convertibles contingentes (un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des obligations convertibles contingentes), obligations liées au crédit, papier commercial, certificats de dépôt et acceptations bancaires émises par des organisations industrielles, de services publics, financières, de banques commerciales ou de holdings bancaires ; des titres adossés à des créances hypothécaires et à des actifs ; des actions privilégiées et d'autres organismes de placement collectif à capital variable au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM. Le Fonds peut acheter des participations non titrisées ou des cessions de prêts hypothécaires à taux variable ou d'autres prêts commerciaux qui sont liquides et prévoient des ajustements de taux d'intérêt au moins tous les 397 jours et qui peuvent

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – (suite)

être garantis par des biens immobiliers ou d'autres actifs. Ces participations, combinées à tout autre investissement soumis à la clause 2.1 de l'annexe II.A. du prospectus, ne dépasseront pas 10 % de la valeur liquidative du Fonds au total.

Le Fonds peut être exposé à des accords de prise en pension à des fins de gestion efficace de portefeuille et sous réserve des exigences de la Banque centrale. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement de titres (SFT), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé en tant qu'Article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement Taxonomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement Taxonomie. Cependant, conformément à sa méthodologie ESG, le Fonds peut détenir des investissements qui cherchent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation au changement climatique.

Les titres composant l'univers d'investissement du Fonds sont évalués à l'aide d'un système propriétaire et du cadre ESG de MSCI afin de déterminer la notation ESG de l'univers d'investissement global et de chaque émetteur individuel et de ses titres, puis le gestionnaire de portefeuille sélectionne les investissements pour le Fonds en tenant compte de la politique d'investissement du Fonds et des notations ESG des émetteurs des titres concernés. Bien que les données MSCI soient la principale source de notation ESG, lorsque les données de notation ESG MSCI ne sont pas disponibles, le gestionnaire de portefeuille peut s'appuyer sur une notation ESG Western Asset pertinente pour l'émetteur. Dans le cadre de cette évaluation, le Fonds utilise des données ESG de tiers, provenant notamment de MSCI et de la Banque mondiale, pour mesurer, entre autres, l'intensité carbone des émetteurs privés et souverains, respectivement. L'alignement sur les UNSDG est mesuré à l'aide d'un cadre propriétaire de Western Asset basé sur des données obtenues auprès de fournisseurs de données tiers.

Le Fonds cherche à investir dans des titres d'émetteurs qui, dans l'ensemble, atteignent une intensité carbone moyenne pondérée du portefeuille inférieure d'au moins 20 % à celle de l'indice Bloomberg Global Aggregate Index (50 %), à l'indice JP Morgan Global Emerging Markets Diversified (25 %) et Bloomberg US High Yield Index (25 %) (l'« indice de référence »). L'intensité moyenne pondérée des émissions de carbone fait référence au carbone des Champs 1 et 2 du Protocole des gaz à effet de serre (« GES ») émis par un émetteur.

Comme indiqué dans la politique d'investissement, le portefeuille du Fonds conservera une note ESG MSCI moyenne de BBB ou supérieure qui, selon la méthodologie de MSCI, est une note moyenne ou supérieure par rapport aux pairs du secteur, ce qui indique un alignement crédible sur les caractéristiques ESG.

En outre, le Fonds cherchera à investir au moins 20 % de sa valeur liquidative dans des titres d'émetteurs dont les activités contribuent au moins à 1 des 8 objectifs de développement durable sélectionnés des Nations Unies (« UNSDG »).

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Objectif d'investissement - Fournir un revenu courant élevé.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit au moins 70 % de sa valeur liquidative dans les types suivants de titres de créance à haut rendement d'émetteurs américains libellés en dollars US qui sont cotés ou négociés sur des marchés réglementés tels qu'énumérés à l'Annexe III du Prospectus : les titres de créance d'entreprises, y compris les billets à ordre librement transférables, les débentures, les obligations (y compris les obligations à coupon zéro), les obligations non convertibles, les obligations convertibles conditionnelles (un maximum de 10 % de la valeur nette d'inventaire du Fonds peut être investi dans des obligations convertibles conditionnelles), les billets de trésorerie, les certificats de dépôt et les acceptations bancaires émis par des organisations industrielles, de services publics, financières, de banques commerciales ou de sociétés de portefeuille bancaires ; des obligations structurées qui sont des valeurs mobilières dont l'exposition sous-jacente peut être des titres à revenu fixe ; et des titres adossés à des créances hypothécaires et à des actifs qui sont structurés comme des titres de créance, à condition qu'au moins deux tiers de la valeur nette d'inventaire du Fonds soient investis dans des titres de créance non convertibles. Le Fonds peut investir dans des titres de créance assortis d'une note aussi basse que D par S&P ou d'une note équivalente par une autre NRSRO, ce qui indique que les obligations sont hautement spéculatives et qu'elles peuvent être en défaut ou en danger de défaut en ce qui concerne le principal et les intérêts.

Les actifs restants du Fonds peuvent être détenus dans des titres de créance cotés ou négociés sur des marchés réglementés et bénéficiant d'une notation supérieure à BB+ par SP ou équivalente par une autre NRSRO, ou dans des titres non notés jugés de qualité équivalente par le Gestionnaire de portefeuille et le Gestionnaire de portefeuille délégué ; dans des actions privilégiées et d'autres titres de participation cotés ou négociés sur des marchés réglementés lorsque ces investissements sont compatibles avec l'objectif d'investissement du Fonds, à savoir un revenu courant élevé ; ainsi que dans des liquidités ou des instruments du marché monétaire à court terme dont l'échéance résiduelle est inférieure ou égale à 13 mois. Le Fonds peut investir jusqu'à 20 % de sa valeur nette d'inventaire dans des titres de créance d'entreprises à haut rendement d'émetteurs non américains situés dans des pays développés et des pays émergents, à condition que ces titres de créance soient libellés en dollars américains et que ces émetteurs soient domiciliés ou exercent leurs activités principales dans des pays membres de l'OCDE. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM. Au moins 95 % de la valeur liquidative du Fonds sera libellée en dollars américains. Le Fonds peut être exposé à des accords de prise en pension à des fins de gestion efficace de portefeuille et sous réserve des exigences de la Banque centrale. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement sur titres (SFT), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé comme un article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement Taxonomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement Taxonomie est égale à zéro. Cependant, le Fonds peut détenir des investissements qui visent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation à celui-ci conformément à la méthodologie ESG.

Les titres composant l'univers d'investissement du Fonds sont évalués à l'aide d'un système propriétaire et du cadre ESG de MSCI afin de déterminer la notation ESG de l'univers d'investissement global et de chaque émetteur individuel et de ses titres, puis le gestionnaire de portefeuille sélectionne les investissements pour le Fonds en tenant compte de la politique d'investissement du Fonds et des notations ESG des émetteurs des titres concernés. Bien que les données MSCI soient la principale source de notation ESG, lorsque les données de notation ESG MSCI ne sont pas disponibles, le gestionnaire de portefeuille peut s'appuyer sur une notation ESG Western Asset pertinente pour l'émetteur. Dans le cadre de cette évaluation, le Fonds utilise des données ESG de tiers, provenant mais sans s'y limiter de MSCI et de la banque mondiale, pour mesurer, entre autres, l'intensité carbone des entreprises et des émetteurs souverains, respectivement. L'alignement sur les UNSDG est mesuré à l'aide d'un cadre propriétaire de Western Asset basé sur des données obtenues auprès de fournisseurs de données tiers.

Le Fonds cherche à investir dans des titres d'émetteurs qui, dans l'ensemble, atteignent une intensité carbone moyenne pondérée du portefeuille inférieure d'au moins 20 % à celle de l'indice Bloomberg US Corporate High Yield, 2 % Issuer Cap (l'« indice de référence »). L'intensité moyenne pondérée des émissions de carbone fait référence au carbone des Champs 1 et 2 du Protocole des gaz à effet de serre (« GES ») émis par un émetteur. De plus, le Fonds cherche à obtenir une réduction annuelle absolue de l'intensité de carbone.

En outre, le Fonds cherchera à s'aligner, mieux que l'Indice de référence, en ce qui concerne les investissements sur titres d'émetteurs dont les activités contribuent à au moins 1 des 8 objectifs de développement durable sélectionnés des Nations Unies (« UNSDG ») (collectivement, les « émetteurs UNSDG »).

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund^ (a cessé ses activités le 10 Octobre 2022)

Objectif de placement – Maximiser le rendement total, constitué de revenu et d'appréciation du capital.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit au moins 80 % de sa valeur liquidative dans (i) des titres de créance d'émetteurs situés dans des pays émergents (ci-après les « Titres de créance des marchés émergents ») qui sont cotés ou négociés sur des marchés réglementés tels qu'ils sont répertoriés dans l'Annexe III du Prospectus, et (ii) des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens de l'article 68(1)(e) de la réglementation sur les OPCVM et ces investissements auront pour but d'obtenir une exposition aux types d'instruments décrits dans le présent document ou de poursuivre l'objectif et les politiques d'investissement du Fonds. Le Fonds peut investir dans les types de titres suivants qui sont cotés ou négociés sur un marché réglementé : les titres de créance émis ou garantis par les gouvernements nationaux des pays développés et des pays émergents, leurs agences ou instruments et leurs subdivisions politiques (y compris des titres protégés contre l'inflation) ; les titres de créance de sociétés d'émetteurs situés dans des pays développés et émergents dont les titres sont cotés ou négociés sur des marchés réglementés, y compris les billets à ordre librement transférables, les débentures, les obligations (y compris les obligations à coupon zéro), les obligations convertibles et non convertibles, les obligations convertibles conditionnelles (un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des obligations convertibles contingentes), les billets de trésorerie, les certificats de dépôt et les acceptations bancaires émis par des

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^] (a cessé ses activités le 10 Octobre 2022) – (suite)

organisations industrielles, de services publics, financières, de banques commerciales ou de holdings ; des titres adossés à des créances hypothécaires (y compris des titres de créance garantis), des participations titrisées dans des prêts qui sont des titres librement cessibles, des obligations structurées qui sont des valeurs mobilières dont l'exposition sous-jacente peut être des titres à revenu fixe ; des titres adossés à des actifs ; des actions privilégiées et d'autres organismes de placement collectif ouverts au sens de l'article 68(1)(e) de la réglementation sur les OPCVM ; et à condition qu'au moins deux tiers de la valeur liquidative du Fonds soient investis dans des titres de créance non convertibles.

Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres OPCVM ou d'autres organismes de placement collectif au sens de l'article 68(1)(e) de la réglementation sur les OPCVM. Le Fonds peut acheter des participations non titrisées ou des cessions de prêts hypothécaires à taux variable ou d'autres prêts commerciaux qui sont liquides et prévoient des ajustements de taux d'intérêt au moins tous les 397 jours et qui peuvent être garantis par des biens immobiliers ou d'autres actifs. Ces participations, combinées à tout autre investissement soumis à la clause 2.1 de l'annexe II.A. du prospectus, ne dépasseront pas 10 % de la valeur liquidative du Fonds au total. Les investissements du Fonds peuvent être libellés dans des devises autres que la devise de base. Le Fonds peut être exposé à des accords de prise en pension à des fins de gestion efficace de portefeuille et sous réserve des exigences de la Banque centrale. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement sur titres (SFT), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative.

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] (a cessé ses activités le 21 Juin 2022)

Objectif de placement – Maximiser le rendement total, constitué de revenu et d'appréciation du capital.

Politiques d'investissement – Le Fonds investit au moins 70 % de sa valeur liquidative dans des obligations d'entreprises des marchés émergents libellées dans n'importe quelle devise, qui sont cotées ou négociées sur des marchés réglementés, y compris (i) des billets à ordre librement cessibles, des débentures, des obligations à taux fixe et variable (y compris des obligations à coupon zéro), des obligations convertibles et non convertibles, des billets de trésorerie, des certificats de dépôt et des acceptations bancaires émis par des organisations industrielles, de services publics, financières, de banques commerciales ou de holdings ; (ii) des titres adossés à des créances hypothécaires (y compris les titres de créance garantis) ; (iii) des participations titrisées dans des prêts qui sont des titres librement cessibles ; (iv) des obligations structurées qui sont des valeurs mobilières dont l'exposition sous-jacente peut être des titres à revenu fixe ; et (v) des titres adossés à des actifs.

Le Fonds peut investir jusqu'à 30 % de sa valeur liquidative dans les types de titres suivants qui sont cotés ou négociés sur des marchés réglementés (les titres suivants peuvent être libellés dans n'importe quelle devise) et lorsqu'il ne s'agit pas d'obligations d'entreprises de marchés émergents : (i) des titres de créance émis ou garantis par des gouvernements nationaux situés dans un pays, leurs agences ou instruments et leurs subdivisions politiques (y compris les titres protégés contre l'inflation) ; (ii) les titres de créance de sociétés d'émetteurs situés dans des pays autres que les pays émergents dont les titres sont cotés ou négociés sur des marchés réglementés, y compris les billets à ordre librement transférables, les débentures, les obligations à taux fixe et variable (y compris les obligations à coupon zéro), les obligations convertibles et non convertibles, les billets de trésorerie, les certificats de dépôt et les acceptations bancaires émis par des entreprises industrielles, des entreprises de services publics, des établissements financiers, des banques commerciales ou des holdings bancaires ; (iii) des titres adossés à des créances hypothécaires (y compris les titres de créance garantis) ; (iv) des participations titrisées dans des prêts qui sont des titres librement cessibles ; (v) des notes structurées qui sont des valeurs mobilières dont l'exposition sous-jacente peut être des titres à revenu fixe ; (vi) des titres adossés à des actifs ; (vii) des actions privilégiées ; et (viii) d'autres organismes de placement collectif ouverts au sens de l'article 68(1)(e) de la réglementation sur les OPCVM.

Le Fonds peut investir dans des actions ordinaires, des titres privilégiés, des titres convertibles, des bons de souscription, des droits et leurs équivalents. Le Fonds n'investira pas plus de 25 % de sa valeur liquidative dans des titres de créance convertibles émis dans le cadre d'offres indépendantes et pas plus de 10 % de sa valeur liquidative dans des actions privilégiées émises dans le cadre d'offres indépendantes. Les investissements dans des actions ordinaires, des titres privilégiés, des bons de souscription, des droits et leurs équivalents (y compris par le biais d'offres indépendantes ou autres) ne dépasseront pas au total 30 % de la valeur liquidative du Fonds. Comme restrictions à ce qui précède, le Fonds ne peut investir plus de 10 % de sa valeur liquidative, respectivement, dans les types de titres suivants : (i) titres adossés à des créances hypothécaires (y compris les titres de créance garantis) ; (ii) obligations structurées qui sont des valeurs mobilières dont l'exposition sous-jacente peut être des titres à revenu fixe ; et (iii) des titres adossés à des actifs. Les titres adossés à des créances hypothécaires, les titres adossés à des actifs, les obligations structurées et les obligations liées à la valeur du crédit dans lesquels le Fonds peut investir peuvent contenir des dérivés intégrés et/ou un effet de levier. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres OPCVM ou d'autres organismes de placement collectif au sens de l'article 68(1)(e) de la réglementation sur les OPCVM.

Le Fonds pourra avoir un effet de levier pouvant atteindre jusqu'à 100 % de sa valeur liquidative (telle que calculée selon l'approche par les engagements) en raison de l'utilisation d'instruments dérivés. Le Fonds peut être exposé à des accords de prise en pension à des fins de gestion efficace de portefeuille et sous réserve des exigences de la Banque centrale. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement sur titres (SFT), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative.

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Objectif d'investissement - Générer un rendement total. La génération d'un revenu courant élevé est un objectif secondaire.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit au moins 70 % de sa valeur liquidative dans des titres de créance à haut rendement cotés ou négociés sur des marchés réglementés tels qu'énumérés à l'annexe III du prospectus. Des rendements plus élevés peuvent généralement être obtenus par le biais de valeurs notées au maximum BB+ par S&P ou l'équivalent par une autre NRSRO, ou sur des titres non notés de qualité équivalente. Les titres de créance dont la notation est inférieure à Investment Grade sont considérés par ces agences comme essentiellement spéculatifs en ce qui concerne la capacité de l'émetteur à payer les intérêts et à rembourser le principal et peuvent comporter un risque important d'exposition à des conditions défavorables. Le Fonds peut investir dans des titres de créance notés aussi bas que D par S&P ou d'une note équivalente par une autre NRSRO, ce qui indique que les obligations sont hautement spéculatives et qu'elles peuvent être en défaut ou en danger de défaut quant au principal et aux intérêts. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds pourra être investi en obligations convertibles contingentes. Il n'est pas prévu que le Fonds investisse plus de 45 % de sa valeur liquidative dans des titres à haut rendement émis dans des pays émergents, des pays européens émergents et/ou des pays émergents d'Asie/Pacifique. Il est prévu que le Fonds investisse dans au moins dans 10 pays différents. Le Fonds est un Fonds mondial et ne se limite pas à investir dans un pays ou une région spécifique. Le Fonds peut acheter des participations non titrisées ou des cessions de prêts hypothécaires à taux variable ou d'autres prêts commerciaux qui sont liquides et prévoient des ajustements de taux d'intérêt au moins tous les 397 jours et qui peuvent être garantis par des biens immobiliers ou d'autres actifs. Ces participations, combinées à tout autre investissement soumis à la clause 2.1 de l'annexe II.A. du prospectus, ne dépasseront pas 10 % de la valeur liquidative du Fonds au total. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM.

Le Fonds pourra avoir un effet de levier pouvant atteindre jusqu'à 100 % de sa valeur liquidative (telle que calculée selon l'approche par les engagements) en raison de l'utilisation d'instruments dérivés. Le Fonds peut être exposé à des accords de prise en pension à des fins de gestion efficace de portefeuille et sous réserve des exigences de la Banque centrale. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement sur titres (SFT), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé comme un article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement Taxonomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement Taxonomie est égale à zéro. Cependant, le Fonds peut détenir des investissements qui visent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation à celui-ci conformément à la méthodologie ESG.

Les titres composant l'univers d'investissement du Fonds sont évalués à l'aide d'un système propriétaire et du cadre ESG de MSCI afin de déterminer la notation ESG de l'univers d'investissement global et de chaque émetteur individuel et de ses titres, puis le gestionnaire de portefeuille sélectionne les investissements pour le Fonds en tenant compte de la politique d'investissement du Fonds et des notations ESG des émetteurs des titres concernés. Bien que les données MSCI soient la principale source de notation ESG, lorsque les données de notation ESG MSCI ne sont pas disponibles, le gestionnaire de portefeuille peut s'appuyer sur une notation ESG Western Asset pertinente pour l'émetteur. Dans le cadre de cette évaluation, le Fonds utilise des données ESG de tiers, provenant mais sans s'y limiter de MSCI et de la banque mondiale, pour mesurer, entre autres, l'intensité carbone des entreprises et des émetteurs souverains, respectivement. L'alignement sur les UNSDG est mesuré à l'aide d'un cadre propriétaire de Western Asset basé sur des données obtenues auprès de fournisseurs de données tiers.

Le Fonds cherche à investir dans des titres d'émetteurs qui, dans l'ensemble, atteignent une intensité carbone moyenne pondérée du portefeuille inférieure d'au moins 20 % à celle de l'indice Bloomberg Barclays Global High Yield (Hedged) USD (« l'indice de référence »). L'intensité moyenne pondérée des émissions de carbone fait référence au carbone des Champs 1 et 2 du Protocole des gaz à effet de serre (« GES ») émis par un émetteur.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

FTGF Western Asset Global High Yield Fund - (suite)

En outre, le Fonds cherchera à s'aligner, mieux que l'Indice de référence, sur les investissements en titres d'émetteurs dont les activités contribuent à au moins 1 des 8 Objectifs de développement durable des Nations Unies (« UNSDG ») (collectivement, les « émetteurs UNSDG »). Cela implique que le Fonds aura une allocation plus élevée aux émetteurs de l'UNSDG que l'indice de référence.

Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^ (a cessé ses activités le 5 décembre 2022)

Objectif d'investissement - Générer un rendement total. La génération d'un revenu courant est un objectif secondaire.

Politiques d'investissement - Le Fonds cherche à atteindre son objectif d'investissement en investissant à tout moment au moins 80 % de sa valeur liquidative dans des titres protégés contre l'inflation ou d'autres titres dont le Gestionnaire de portefeuille et le Gestionnaire de portefeuille délégué estiment qu'ils offrent une protection contre l'inflation et qui sont émis par des gouvernements nationaux de pays membres de l'OCDE, leurs agences, instruments et subdivisions politiques, des organisations supranationales et des sociétés émettrices, tels que des billets à ordre, des débentures et des obligations librement cessibles, et qui sont cotés ou négociés sur des marchés réglementés, comme indiqué dans l'Annexe III du Prospectus. Le Fonds peut également investir jusqu'à 20 % de sa valeur liquidative dans tout autre type de titres de créance cotés ou négociés sur les marchés réglementés énumérés à l'annexe III du Prospectus, qui peuvent ou non être indexés sur l'inflation, y compris les titres de créance émis ou garantis par les gouvernements nationaux, leurs agences, instruments et subdivisions politiques (y compris les titres STRIP) ; les titres de créance de société tels que les billets à ordre librement cessibles, les débentures, les obligations (y compris les obligations à coupon zéro, les titres à taux progressif et les titres à paiement en nature), les billets de trésorerie, les certificats de dépôt et les acceptations bancaires émis par des organisations industrielles, de services publics, financières, de banques commerciales ou de holdings bancaires ; les titres adossés à des créances hypothécaires et à des actifs structurés comme des titres de créances ; les accords de prise en pension avec des titres de créance comme instruments sous-jacents (uniquement à des fins de gestion efficace de portefeuille et sous réserve des exigences de la Banque centrale) ; les obligations structurées qui sont des valeurs mobilières dont l'exposition sous-jacente peut être constituée de titres à revenu fixe ; les participations titrisées dans des prêts qui sont des valeurs mobilières librement cessibles ; les instruments du marché monétaire ; des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif ouverts selon l'article 68(1)(e) de la réglementation sur les OPCVM ; et (dans la limite de 10 % de la valeur liquidative du Fonds) des actions privilégiées et d'autres actions et titres liés à des actions. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens de l'article 68(1)(e) de la réglementation sur les OPCVM. Le Fonds n'investira pas dans des titres dont la notation est inférieure à l'« Investment Grade ». Un maximum de 5 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des titres cotés ou négociés sur un marché réglementé d'un pays émergent, d'un pays européen émergent ou d'un pays émergent d'Asie/Pacifique. Le Fonds devrait maintenir une qualité de crédit moyenne comprise entre A et AAA (S&P) / A2 et Aaa (Moody's). La durée moyenne du portefeuille du Fonds devrait être comprise entre un et quinze ans. Toutefois, le Fonds peut investir dans des titres individuels de toute durée.

Le Fonds peut investir dans certains types d'instruments dérivés et peut bénéficier d'un effet de levier pouvant atteindre jusqu'à 100 % de sa valeur liquidative (telle que calculée selon l'approche par les engagements) en raison de l'utilisation d'instruments dérivés. Le Fonds peut être exposé à des accords de prise en pension à des fins de gestion efficace de portefeuille et sous réserve des exigences de la Banque centrale. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement sur titres (SFT), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative.

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

Objectif d'investissement – Maximiser le rendement total par le biais de revenu et d'appréciation du capital.

Politiques d'investissement – Le Fonds investit au moins 70 % de sa valeur liquidative dans des titres de créance émis par des émetteurs asiatiques et dans des dérivés sur les taux d'intérêt et les devises asiatiques, ces titres de créance et dérivés sont cotés ou négociés sur des marchés réglementés, comme indiqué dans l'Annexe III du Prospectus. Le Fonds investit principalement dans (i) des titres de créance émis ou garantis par des gouvernements nationaux situés dans des pays asiatiques, leurs agences, instruments ou subdivisions politiques ; (ii) des titres de créance émis par des sociétés asiatiques tels que des billets à ordre librement cessibles, des débentures, des obligations (y compris des obligations à coupon zéro), des obligations convertibles contingentes (un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des obligations convertibles contingentes), des billets de trésorerie, des certificats de dépôt et des acceptations bancaires émis par des organisations industrielles, de services publics, financières, de banques commerciales ou de holdings bancaires ; (iii) des participations titrisées dans des prêts qui sont des titres librement cessibles ; (iv) des obligations structurées qui sont des valeurs mobilières dont l'exposition sous-jacente peut être des titres à revenu fixe ; (v) des titres adossés à des créances hypothécaires et à des actifs qui sont structurés comme des titres de créance ; (vi) des dérivés sur les taux d'intérêt et obligations asiatiques conclus avec des établissements de crédit asiatiques ou mondiaux bénéficiant d'une notation élevée ; (vii) des devises asiatiques et dérivés sur ces devises. Aux fins du présent Fonds, une société asiatique est une société dont le siège social est situé dans un pays asiatique ou qui exerce la majeure partie de ses activités économiques en Asie.

Le Fonds ne peut investir plus de 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif ouverts au sens de l'article 68(1)(e) de la réglementation sur les OPCVM. Un maximum de 25 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des obligations convertibles et jusqu'à 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des actions privilégiées, d'autres titres de participation et/ou des bons de souscription. Un maximum de 5 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des bons de souscription.

Le Fonds pourra avoir un effet de levier pouvant atteindre jusqu'à 100 % de sa valeur liquidative (telle que calculée selon l'approche par les engagements) en raison de l'utilisation d'instruments dérivés. Le Fonds peut être exposé à des accords de prise en pension à des fins de gestion efficace de portefeuille et sous réserve des exigences de la Banque centrale. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement sur titres (SFT), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative.

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Objectif d'investissement - Réaliser un rendement total, par le biais d'un revenu et d'une appréciation du capital.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit principalement dans des titres de créance qui sont (i) notés A- ou plus par S&P ou l'équivalent par une autre NRSRO, ou s'ils ne sont pas notés, considérés comme étant de qualité comparable ; (ii) (a) émis par des sociétés émettrices domiciliées dans une juridiction autre qu'un pays émergent et qui sont, au moment de l'achat et de l'avis des Gestionnaires de portefeuille délégués, des sociétés de premier ordre, c'est-à-dire dont la dette à long terme est notée A- ou plus par S&P ou l'équivalent par une autre NRSRO, ou qui, si elles ne sont pas notées, sont considérées comme étant de qualité comparable ; et/ou (b) émis par des organisations supranationales dont la dette à long terme est notée A- ou plus par S&P ou l'équivalent par une autre NRSRO, ou, s'ils ne sont pas notés, sont réputés de qualité comparable ; et (iii) cotés ou négociés sur les Marchés réglementés indiqués à l'Annexe III du Prospectus.

Le Fonds n'investira que dans les titres de créance d'entreprise qui, de l'avis du Gestionnaire de portefeuille et du Gestionnaire de portefeuille délégué concernés, sont classés au moins comme des titres de créance d'entreprise non garantis de premier rang de l'émetteur concerné. En outre, le Fonds peut investir dans des titres émis ou garantis par des gouvernements nationaux (y compris des STRIPS et des titres indexés sur l'inflation), leurs agences, instruments et subdivisions politiques, des titres d'organisations supranationales tels que des billets à ordre, des obligations et des débentures librement cessibles, des accords de prise de pension avec des titres de créance comme instruments sous-jacents (à des fins de gestion efficace de portefeuille uniquement et sous réserve des exigences de la Banque centrale d'Irlande) et d'autres organismes de placement collectif ouverts de l'article 68(1)(e) de la réglementation sur les OPCVM. Le Fonds ne peut investir plus de 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou actions d'autres OPCVM ou d'autres organismes de placement collectif au sens du Règlement 68(1)(e) de la Réglementation sur les OPCVM.

Le Fonds peut investir dans certains types de dérivés, et l'effet de levier du Fonds découlant des dérivés ne devrait pas dépasser 50 % (calculé selon l'approche par les engagements) de sa valeur liquidative totale. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement sur titres (SFT), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé en tant que Fonds régi par l'article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement Taxonomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement Taxonomie. Cependant, le Fonds peut détenir des investissements qui visent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation à celui-ci conformément à la méthodologie ESG.

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

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

Les titres composant l'univers d'investissement du Fonds sont évalués à l'aide d'un système propriétaire et du cadre ESG de MSCI afin de déterminer la notation ESG de l'univers d'investissement global et de chaque émetteur individuel et de ses titres, puis le gestionnaire de portefeuille sélectionne les investissements pour le Fonds en tenant compte de la politique d'investissement du Fonds et des notations ESG des émetteurs des titres concernés.

Le Fonds cherche à investir dans des titres d'émetteurs qui, dans l'ensemble, atteignent une intensité carbone moyenne pondérée du portefeuille inférieure d'au moins 20 % à l'indice ICE BofA Global Corporate 1 - 5 years AAA-A Global Large Cap Corporate 30 % Financial Constrained (l'« Indice de référence »). Le gestionnaire de portefeuille définit l'empreinte carbone comme la moyenne pondérée de l'intensité des émissions de carbone des titres détenus dans le portefeuille. L'intensité moyenne pondérée des émissions de carbone fait référence au carbone des Champs 1 et 2 du Protocole des gaz à effet de serre (« GES ») émis par un émetteur.

Le portefeuille du Fonds maintiendra une notation MSCI ESG moyenne de BBB ou mieux qui, selon la méthodologie de MSCI, est une notation moyenne ou meilleure par rapport aux pairs du secteur, indiquant un alignement crédible sur les caractéristiques ESG. Le Fonds peut ne pas investir plus de 10 % de sa valeur liquidative dans des titres d'émetteurs affichant une notation MSCI ESG de BB ou moins au moment de l'acquisition. Grâce à l'approche intégrée de l'ESG, le gestionnaire de portefeuille applique des notations ESG à au moins 90 % des titres dans lesquels le Fonds investit. Le Fonds maintient une notation ESG de portefeuille supérieure à celle de l'univers d'investissement. En outre, le Fonds cherchera à investir au moins 20 % de sa valeur liquidative dans des titres d'émetteurs dont les activités contribuent au moins à 1 des 8 objectifs de développement durable sélectionnés des Nations unies (UNSDG).

Le Fonds exclura les investissements dans les titres des émetteurs suivants :

- Émetteurs qui ne suivent pas de bonnes pratiques de gouvernance, telles que déterminées par le gestionnaire de portefeuille ;
- Émetteurs tirant plus de 5 % de leurs revenus de la production et/ou de la distribution de tabac ;
- Émetteurs tirant plus de 10 % de leurs revenus de :
 - les armes à feu civiles (fabrication/fourniture),
 - toute implication dans les armes conventionnelles,
 - l'extraction de charbon thermique (production/distribution),
- Émetteurs dont plus de 5 % des revenus proviennent de la production d'armes nucléaires ;
- Émetteurs qui produisent des armes controversées (p. ex. mines antipersonnel, armes chimiques, armes à laser aveuglantes, uranium appauvri, armes incendiaires et éclats non localisables), qui détiennent une société active dans les armes controversées ou qui sont détenues par une telle société ;
- Émetteurs évalués comme « en échec » en vertu du Pacte mondial des Nations Unies ; et
- Émetteurs étatiques et/ou souverains dont le score est insuffisant selon l'indice de Freedom House.

Le gestionnaire de portefeuille s'engagera auprès des émetteurs sur les pratiques environnementales, sociales et de gouvernance par le biais de conversations avec la direction. Le processus d'engagement du gestionnaire de portefeuille vise à s'aligner sur les principes du Pacte mondial des Nations Unies.

Le Fonds répond aux caractéristiques ESG qu'il promeut à travers la mise en œuvre des processus décrits ci-dessus.

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Objectif d'investissement – Maximiser le rendement total par le biais de revenu et d'appréciation du capital.

Politiques d'investissement – Le Fonds investit au moins deux tiers de sa valeur liquidative sur les marchés mondiaux des titres à revenu fixe. Le Fonds investit principalement dans des titres de créance (directement ou indirectement dans d'autres organismes de placement collectif qui investissent principalement dans de tels titres, sous réserve des restrictions énoncées dans le présent document) libellés en dollars américains, en euros, en yens japonais, en livres sterling et dans diverses autres devises et cotés ou négociés sur des marchés réglementés de pays développés et de pays émergents, avec une préférence pour les titres de créance non souverains, en particulier les titres de créance de sociétés et les titres adossés à des créances hypothécaires. Le Fonds peut investir dans des titres, des devises et des produits dérivés non libellés en dollars américains, à condition que l'exposition globale aux devises autres que le dollar américain (après couverture) ne dépasse pas 50 % de la valeur liquidative du Fonds.

Le Fonds investit dans des titres émis ou garantis par des gouvernements nationaux, leurs agences, instruments et subdivisions politiques (y compris les STRIPS et les titres indexés sur l'inflation) ; des titres d'organisations supranationales tels que des billets à ordre librement transférables, des obligations et des débentures ; des titres de créance de sociétés tels que les billets à ordre librement transférables, les débentures, les Brady Bonds, les obligations à taux variable, les obligations à amortissement planifié, les obligations à amortissement ciblé, les obligations à capital seul, les euro-obligations, les obligations en eurodollars et les instruments en dollars Yankee, les obligations à paiement en nature, les obligations à coupon zéro, les obligations non convertibles, les obligations convertibles contingentes (un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des obligations convertibles contingentes), les billets de trésorerie, les certificats de dépôt et les acceptations bancaires émis par des organisations industrielles, de services publics, financières, de banques commerciales ou de holdings bancaires ; des titres adossés à des créances hypothécaires et à des actifs qui sont structurés comme des titres de créance ; et des accords de prise en pension dont les instruments sous-jacents sont des titres de créance (à des fins de gestion efficace de portefeuille uniquement et sous réserve des exigences de la Banque centrale). Le Fonds ne peut investir plus de 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou actions d'autres OPCVM ou d'autres organismes de placement collectif au sens du Règlement 68(1)(e) de la Réglementation sur les OPCVM.

Le Fonds peut acheter des participations non titrisées ou des cessions de prêts hypothécaires à taux variable ou d'autres prêts commerciaux qui sont liquides et prévoient des ajustements de taux d'intérêt au moins tous les 397 jours et qui peuvent être garantis par des biens immobiliers ou d'autres actifs. Le Fonds peut investir dans certains types de produits dérivés et peut avoir un effet de levier allant jusqu'à 100 % de sa valeur liquidative du fait de l'utilisation de produits dérivés. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement de titres (SFT), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé comme un article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement Taxonomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement Taxonomie. Cependant, le Fonds peut détenir des investissements qui visent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation à celui-ci conformément à la méthodologie ESG.

Les titres composant l'univers d'investissement du Fonds sont évalués à l'aide d'un système propriétaire et du cadre ESG de MSCI afin de déterminer la notation ESG de l'univers d'investissement global et de chaque émetteur individuel et de ses titres, puis le gestionnaire de portefeuille sélectionne les investissements pour le Fonds en tenant compte de la politique d'investissement du Fonds et des notations ESG des émetteurs des titres concernés. Bien que les données MSCI soient la principale source de notation ESG, lorsque les données de notation ESG MSCI ne sont pas disponibles, le gestionnaire de portefeuille peut s'appuyer sur une notation ESG Western Asset pertinente pour l'émetteur. Dans le cadre de cette évaluation, le Fonds utilise des données ESG de tiers, provenant notamment de MSCI et de la Banque mondiale, pour mesurer, entre autres, l'intensité carbone des émetteurs privés et souverains, respectivement. L'alignement sur les UNSDG est mesuré à l'aide d'un cadre propriétaire de Western Asset basé sur des données obtenues auprès de fournisseurs de données tiers.

Le Fonds cherche à investir dans des titres d'émetteurs qui, dans l'ensemble, atteignent une intensité carbone moyenne pondérée du portefeuille inférieure d'au moins 20 % à celle de l'indice Bloomberg Global Aggregate Index (Hedged) USD (l'« Indice de référence »). L'intensité moyenne pondérée des émissions de carbone fait référence au carbone des Champs 1 et 2 du Protocole des gaz à effet de serre (« GES ») émis par un émetteur.

Comme indiqué dans la politique d'investissement, le portefeuille du Fonds conservera une note ESG MSCI moyenne de BBB ou supérieure qui, selon la méthodologie de MSCI, est une note moyenne ou supérieure par rapport aux pairs du secteur, ce qui indique un alignement crédible sur les caractéristiques ESG.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

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

En outre, le Fonds cherchera à s'aligner, mieux que l'Indice de référence, sur les investissements en titres d'émetteurs dont les activités contribuent à au moins 1 des 8 Objectifs de développement durable des Nations Unies (« UNSDG ») (collectivement, les « émetteurs UNSDG »).

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

Objectif d'investissement – Maximiser le rendement total par le biais de revenu et d'appréciation du capital.

Politiques d'investissement – Le Fonds investit au moins deux tiers de sa valeur liquidative dans des titres de créance de sociétés et des titres de créance émis par des organisations supranationales qui sont (i) libellés en dollars américains, en yens japonais, en euros, en livres sterling et dans diverses autres devises, et (ii) cotés ou négociés sur les marchés réglementés énumérés à l'Annexe III du Prospectus. Les types de titres de créance de sociétés dans lesquels le Fonds peut investir comprennent les billets à ordre librement transférables, les obligations à taux fixe et variable, les obligations à coupon zéro, les débetures, les billets non convertibles, les obligations convertibles contingentes (un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des obligations convertibles contingentes), les billets de trésorerie, les certificats de dépôt et les acceptations bancaires émis par des organisations industrielles, de services publics, financières, de banques commerciales ou de sociétés de portefeuille bancaires. En outre, le Fonds peut investir dans des titres émis ou garantis par des gouvernements nationaux (y compris des STRIPS et des titres indexés sur l'inflation), leurs agences, instruments et subdivisions politiques, des titres d'organisations supranationales tels que des billets à ordre, des obligations et des débetures librement transférables, des participations titrisées dans des prêts qui sont des titres librement transférables, des billets structurés qui sont des titres librement transférables ; les titres adossés à des créances hypothécaires (y compris les obligations hypothécaires garanties) ; les titres adossés à des actifs structurés comme des titres de créance ; les accords de prise en pension dont les titres de créance sont les instruments sous-jacents (uniquement à des fins de gestion efficace de portefeuille et sous réserve des exigences de la Banque centrale) ; et d'autres organismes de placement collectif ouverts au sens du Règlement 68(1)(e) de la Réglementation sur les OPCVM.

Le Fonds n'achètera pas de titres de participation ou d'intérêts bénéficiaires dans des titres de participation, à l'exception d'actions privilégiées ou de warrants, à condition qu'un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds puisse être investi dans des actions privilégiées et/ou des warrants, et des titres de participation acquis par le biais de conversions de titres de créance convertibles ou par le biais d'actions de sociétés des émetteurs. Le Fonds ne peut investir plus de 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou actions d'autres OPCVM ou d'autres organismes de placement collectif au sens du Règlement 68(1)(e) de la Réglementation sur les OPCVM.

Le Fonds peut acheter des titres qui, au moment de l'achat, sont notés en dessous de la catégorie Investment Grade ou, s'ils ne sont pas notés, sont considérés par le gestionnaire de portefeuille et les gestionnaires de portefeuille délégués comme étant de qualité comparable, pour autant que cet achat ne fasse pas en sorte que le biais de 10 % de la valeur liquidative du Fonds soit composée d'investissements notés en dessous de la catégorie Investment Grade ou, s'ils ne sont pas notés, sont considérés par le gestionnaire de portefeuille et les gestionnaires de portefeuille délégués comme étant de qualité comparable. Le Fonds peut investir dans certains types de produits dérivés et peut avoir un effet de levier allant jusqu'à 100 % de sa valeur liquidative (calculée selon l'approche par les engagements) en raison de son utilisation de produits dérivés. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement de titres (SFT), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative.

Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] (cessation d'activités le 21 juin 2022)

Objectif d'investissement – Fournir un revenu courant élevé.

Politiques d'investissement – Le Fonds investit au moins deux tiers de sa valeur liquidative dans des titres de créance à haut rendement libellés en euros, cotés ou négociés sur les marchés réglementés énumérés à l'Annexe III du Prospectus et provenant d'émetteurs situés dans le monde entier.

Le Fonds cherche à atteindre son objectif d'investissement en investissant dans des titres de créance émis ou garantis par des gouvernements nationaux, leurs agences, instruments et subdivisions politiques ; des titres de créance de sociétés, y compris des billets à ordre librement transférables, des débetures, des obligations Brady, des obligations à taux variable, des obligations à amortissement planifié, des obligations à amortissement ciblé, des obligations à capital unique, des euro-obligations, des obligations en eurodollars et des instruments en dollars Yankee, des obligations à paiement en nature, des obligations à coupon zéro, des billets non convertibles, des billets de trésorerie, des certificats de dépôt et des acceptations bancaires émis par des organisations industrielles, de services publics, financières, de banques commerciales ou de sociétés de portefeuille bancaires ; les participations titrisées dans des prêts qui sont des valeurs mobilières ; les billets structurés qui sont des valeurs mobilières ; les titres adossés à des créances hypothécaires ; et les titres adossés à des actifs qui sont structurés comme des titres de créance.

Sous réserve des restrictions susmentionnées, les actifs restants du Fonds (soit au maximum un tiers de sa valeur liquidative) peuvent être détenus dans (i) des titres de créance notés au-dessus de BB+ par S&P ou l'équivalent par une autre NRSRO, ou des titres non notés jugés de qualité équivalente par le gestionnaire de portefeuille et les gestionnaires de portefeuille délégués ; (ii) actions privilégiées et warrants lorsque ces investissements sont compatibles avec l'objectif d'investissement du Fonds, à savoir un revenu courant élevé, ainsi que (iii) liquidités ou instruments du marché monétaire à court terme dont l'échéance résiduelle est inférieure ou égale à 13 mois, qui sont des instruments normalement négociés sur le marché monétaire et qui sont liquides (c'est-à-dire capables d'être convertis en liquidités dans un délai de 7 jours ouvrables à un prix très proche de leur évaluation actuelle et peuvent inclure l'un des investissements suivants dont l'échéance est inférieure ou égale à 13 mois : (a) titres de créance émis ou garantis par les gouvernements nationaux, leurs agences, instruments ou subdivisions politiques ; (b) titres de créance de sociétés, y compris les billets à ordre librement transférables, les débetures, les obligations (y compris les obligations à coupon zéro), les billets convertibles et non convertibles, les billets de trésorerie, les certificats de dépôt et les acceptations bancaires émis par des organisations industrielles, de services publics, financières, de banques commerciales ou de sociétés de portefeuille bancaires ; (c) titres adossés à des créances hypothécaires ; (d) billets structurés qui sont des valeurs mobilières ; (e) participations titrisées dans des prêts qui sont des valeurs mobilières ; (f) warrants ; (g) titres adossés à des actifs ; et (h) accords de prise en pension (à des fins de gestion efficace de portefeuille uniquement et sous réserve des exigences de la Banque centrale). Le Fonds ne peut investir plus de 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou actions d'autres OPCVM ou d'autres organismes de placement collectif au sens du Règlement 68(1)(e) de la Réglementation sur les OPCVM.

Le Fonds peut investir dans certains types de produits dérivés et peut avoir un effet de levier allant jusqu'à 100 % de sa valeur liquidative (calculée selon l'approche par les engagements) du fait de son utilisation de produits dérivés. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement de titres (SFT), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 25 % de sa valeur liquidative.

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Objectif de placement – Maximiser le rendement total, constitué de revenu et d'appréciation du capital.

Politiques d'investissement – Le Fonds investit dans (i) des titres de créance, des obligations convertibles, des actions privilégiées et des warrants cotés ou négociés sur des marchés réglementés situés partout dans le monde, y compris dans les pays émergents ; (ii) des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du Règlement 68(1)(e) de la Réglementation sur les OPCVM et ces investissements auront pour but d'obtenir une exposition aux types d'instruments décrits dans le présent document ou de poursuivre l'objectif et les politiques d'investissement du Fonds, et (iii) des produits dérivés. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou des actions d'organismes de placement collectif ouverts au sens du Règlement 68(1)(e) de la Réglementation sur les OPCVM.

Le Fonds peut investir dans des titres de créance d'entreprise tels que des billets à ordre librement transférables, des débetures, des obligations à taux fixe et variable, des obligations à coupon zéro, des billets non convertibles, des obligations convertibles conditionnelles (un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des obligations convertibles contingentes), des billets de trésorerie, des certificats de dépôt et des acceptations bancaires émises par des organisations industrielles, de services publics, financières, de banques commerciales ou de sociétés de portefeuille bancaires ; des billets structurés qui sont des valeurs mobilières, dont l'exposition sous-jacente peut être des titres à revenu fixe, à condition que le Fonds soit autorisé à investir directement dans ces titres à revenu fixe sous-jacents ; les participations titrisées dans des prêts qui sont des valeurs mobilières ; les titres adossés à des créances hypothécaires et à des actifs qui sont structurés comme des titres de créance ; et les accords de prise en pension dont les instruments sous-jacents sont des titres de créance (à des fins de gestion efficace de portefeuille uniquement) ; les titres de créance émis ou garantis par des gouvernements nationaux et leurs agences, instruments et subdivisions politiques ; les STRIPS et les titres indexés sur l'inflation ; et les titres de créance d'organisations supranationales tels que les billets à ordre, les obligations et les débetures librement transférables.

Le Fonds peut investir de manière importante (à des fins d'investissement ou de gestion efficace de portefeuille) dans certains types d'instruments financiers dérivés. Le Fonds est assorti d'une limite élevée en matière d'effet de levier. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement de titres (SFT), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Objectif d'investissement – Générer un rendement total par le biais d'un revenu et d'une appréciation du capital.

Politiques d'investissement – Le Fonds investit dans un portefeuille mondialement diversifié de titres de créance et de produits dérivés qui peuvent offrir une exposition aux titres de créance, aux taux d'intérêt, aux devises et aux indices. Le Fonds peut investir dans des titres de créance de sociétés tels que des billets à ordre librement transférables, des débentures, des obligations à taux fixe et variable, des obligations à coupon zéro, des billets non convertibles, des obligations convertibles contingentes (un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des obligations convertibles contingentes), des obligations indexées sur le crédit, des billets de trésorerie, des certificats de dépôt et des acceptations bancaires ; des instruments du marché monétaire ; des participations titrisées dans des prêts qui sont des titres transférables ; des titres adossés à des créances hypothécaires et à des actifs qui sont structurés comme des titres de créance ; et des accords de prise en pension dont les instruments sous-jacents sont des titres de créance (uniquement à des fins de gestion efficace de portefeuille) ; des titres de créance émis ou garantis par des gouvernements nationaux et leurs agences, instruments et subdivisions politiques ; des STRIPS et des titres indexés sur l'inflation ; et des titres de créance d'organisations supranationales tels que des billets à ordre, des obligations et des débentures librement transférables. Les participations titrisées dans des prêts sont des titres cotés en bourse et les investissements dans ces titres seront limités à 50 % de la valeur liquidative du Fonds.

Le gestionnaire de portefeuille et les gestionnaires de portefeuille délégués prévoient que la durée moyenne des investissements du Fonds sera comprise entre 0 et 10 ans, en fonction des prévisions du gestionnaire de portefeuille et des gestionnaires de portefeuille délégués concernant les taux d'intérêt et les rendements. Le Fonds peut investir jusqu'à 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou des actions d'autres OPCVM ou d'autres organismes de placement collectif au sens du Règlement 68(1)(e) de la Réglementation sur les OPCVM, y compris des Fonds négociés en bourse de type ouvert (y compris des Fonds négociés en bourse d'actions).

Le Fonds peut investir largement dans certains types de produits dérivés. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement de titres (SFT), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative.

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Objectif d'investissement – Maximiser le rendement total, constitué de revenu et d'appréciation du capital.

Politiques d'investissement – Le Fonds investit au moins 65 % de sa valeur liquidative dans des titres adossés à des créances hypothécaires (« MBS ») et des titres adossés à des actifs (« ABS ») qui sont émis par des émetteurs non gouvernementaux et ne sont pas garantis par des entités parrainées par le gouvernement américain telles que la FNMA ou la FHLMC et/ou par des agences du gouvernement américain telles que la GNMA. Ces titres seront cotés ou négociés sur des marchés réglementés situés partout dans le monde, y compris dans les pays émergents.

Les types de MBS dans lesquels le Fonds peut investir comprennent les MBS résidentiels à intérêts seulement, à intérêts inversés seulement ou à capital seulement, les MBS commerciaux, les obligations hypothécaires garanties (« CMO »), les titres émis par les Real Estate Mortgage Investment Conduits (« REMIC »), les Re-securitized Real Estate Mortgage Investment Conduits (« Re-REMIC ») (qui respectent les exigences du règlement sur la titrisation, jusqu'à un maximum de 7,5 % de la valeur liquidative du Fonds), des certificats pass-through, des contrats hypothécaires à terme ou des transactions « à annoncer », des obligations de prêt garanties par des prêts commerciaux, des obligations indexées sur le crédit et des titres de droits de gestion de prêts hypothécaires. Les certificats pass-through sont des titres à revenu fixe dans lesquels sont émis des certificats représentant des intérêts dans un ensemble de prêts hypothécaires ou de titres adossés à des prêts hypothécaires.

Le Fonds peut investir jusqu'à 35 % de sa valeur liquidative au total dans : des titres adossés à des créances hypothécaires émis ou garantis par une agence ; des titres adossés à des actifs garantis par une agence ; des titres de créance émis ou garantis par des sociétés, tels que des billets à ordre, des obligations (y compris des obligations à coupon zéro), des billets et débentures convertibles et non convertibles, des participations titrisées dans des prêts qui sont des valeurs mobilières, des billets structurés, des actions privilégiées, des billets de trésorerie, des certificats de dépôt, des dépôts à terme, des accords de mise en pension et des accords de prise en pension (qui peuvent être utilisés à des fins de gestion efficace de portefeuille) et des rouleaux d'argent ; les acceptations bancaires, y compris les titres de créance de sociétés détenues, partiellement détenues ou dont les obligations sont garanties par un gouvernement fédéral, ses agences ou d'autres entités du gouvernement fédéral ; des titres de créance émis ou garantis par des gouvernements fédéraux, étatiques, locaux et municipaux et leurs agences, instruments, municipalités et subdivisions ; les billets de trésorerie ; des liquidités et des instruments du marché monétaire. Le Fonds ne peut investir plus de 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou des actions d'autres OPCVM ou d'autres organismes de placement collectif (y compris les Fonds négociés en bourse ouverts) au sens du Règlement 68(1)(e) de la Réglementation sur les OPCVM.

Le Fonds peut investir largement (à des fins d'investissement ou de gestion efficace de portefeuille) dans certains types de produits dérivés. L'exposition maximale du Fonds aux opérations de financement de titres (SFT) et aux swaps de rendement total, sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de la valeur liquidative du Fonds.

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

Objectif d'investissement – Maximiser le rendement total, constitué de revenu et d'appréciation du capital.

Politiques d'investissement – Le Fonds investit au moins 80 % de sa valeur liquidative dans des titres adossés à des créances hypothécaires (y compris des obligations hypothécaires garanties) qui sont (i) libellés en dollars américains, (ii) émis ou garantis par le gouvernement américain, ses agences, ses instruments et ses subdivisions politiques, ainsi que par des entités parrainées par le gouvernement américain, et (iii) cotés ou négociés sur des marchés réglementés situés aux États-Unis et indiqués dans l'Annexe III du Prospectus. Le Fonds peut investir ou détenir jusqu'à 20 % de sa valeur liquidative dans des obligations du Trésor américain, des obligations émises ou garanties par des agences gouvernementales américaines et des quasi-espèces libellées en dollars américains, y compris des Fonds du marché monétaire et des contrats de prise en pension (à des fins de gestion efficace de portefeuille uniquement). Le Fonds acquerra uniquement des titres de créance notés au minimum B- par S&P ou équivalent par une autre NRSRO ou, s'ils ne sont pas notés, qui sont considérés de qualité comparable par le gestionnaire de portefeuille et les gestionnaires de portefeuille délégués. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou des actions d'autres organismes de placement collectif au sens du Règlement 68(1)(e) de la Réglementation sur les OPCVM.

L'effet de levier du Fonds ne dépassera pas 100 % de sa valeur liquidative. L'exposition maximale du Fonds aux opérations de financement de titres (SFT) et aux swaps de rendement total, sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de la valeur liquidative du Fonds.

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]

Objectif d'investissement – Maximiser le rendement total par le biais de revenu et d'appréciation du capital.

Politiques d'investissement – Le Fonds investit au moins 70 % de sa valeur liquidative dans des titres de créance de sociétés et des titres de créance émis par des organisations supranationales qui sont cotés ou négociés sur des marchés réglementés au Royaume-Uni et sur d'autres marchés réglementés et qui sont libellés en livres sterling.

Le Fonds peut investir dans des titres de créance de sociétés, y compris des billets à ordre librement transférables, des obligations à taux fixe et variable, des obligations à coupon zéro, des débentures, des billets non convertibles, des obligations convertibles contingentes (un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des obligations convertibles contingentes), des billets de trésorerie, des certificats de dépôt et des acceptations bancaires émis par des organisations industrielles, de services publics, financières, de banques commerciales ou de sociétés de portefeuille bancaires.

En outre, le Fonds peut investir dans des titres émis ou garantis par des gouvernements nationaux et leurs agences, instruments et subdivisions politiques ; des STRIPS et des titres indexés sur l'inflation ; des titres d'organisations supranationales tels que des billets à ordre, des obligations et des débentures librement transférables, des participations titrisées dans des prêts qui sont des titres librement transférables ; des billets structurés qui sont des titres librement transférables dont l'exposition sous-jacente peut être des titres à revenu fixe ; des titres adossés à des créances hypothécaires (y compris des obligations hypothécaires garanties) et des titres adossés à des actifs qui sont structurés en tant que titres de créance. Le Fonds ne peut investir plus de 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou des actions d'autres OPCVM ou d'autres organismes de placement collectif au sens du Règlement 68(1)(e) de la Réglementation sur les OPCVM. Le Fonds peut être exposé à des accords de prise en pension à des fins de gestion efficace de portefeuille et sous réserve des exigences de la Banque centrale. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement de titres (SFT), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé comme un article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement Taxonomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement Taxonomie. Cependant, le Fonds peut détenir des investissements qui visent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation à celui-ci conformément à la méthodologie ESG.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

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

Les titres composant l'univers d'investissement du Fonds sont évalués à l'aide d'un système propriétaire et du cadre ESG de MSCI afin de déterminer la notation ESG de l'univers d'investissement global et de chaque émetteur individuel et de ses titres, puis le gestionnaire de portefeuille sélectionne les investissements pour le Fonds en tenant compte de la politique d'investissement du Fonds et des notations ESG des émetteurs des titres concernés. Bien que les données MSCI soient la principale source de notation ESG, lorsque les données de notation ESG MSCI ne sont pas disponibles, le gestionnaire de portefeuille peut s'appuyer sur une notation ESG Western Asset pertinente pour l'émetteur. Dans le cadre de cette évaluation, le Fonds utilise des données ESG de tiers, provenant notamment de MSCI et de la Banque mondiale, pour mesurer, entre autres, l'intensité carbone des émetteurs privés et souverains, respectivement. L'alignement sur les UNSDG est mesuré à l'aide d'un cadre propriétaire de Western Asset basé sur des données obtenues auprès de fournisseurs de données tiers.

Le Fonds cherche à investir dans des titres d'émetteurs qui, dans l'ensemble, atteignent une intensité carbone moyenne pondérée du portefeuille inférieure d'au moins 20 % à celle de l'indice ICE BofA Sterling Non-Gilts (l'« Indice de référence »). L'intensité moyenne pondérée des émissions de carbone fait référence au carbone des Champs 1 et 2 du Protocole des gaz à effet de serre (« GES ») émis par un émetteur. En outre, le Fonds cherche à réduire chaque année l'intensité moyenne pondérée des émissions de carbone.

Comme indiqué dans la politique d'investissement, le portefeuille du Fonds conservera une note ESG MSCI moyenne de BBB ou supérieure qui, selon la méthodologie de MSCI, est une note moyenne ou supérieure par rapport aux pairs du secteur, ce qui indique un alignement crédible sur les caractéristiques ESG.

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

Objectif d'investissement – Maximiser le rendement total par le biais de revenu et d'appréciation du capital.

Politiques d'investissement – Le Fonds investit à tout moment au moins deux tiers de sa valeur liquidative dans des titres de créance de sociétés qui sont (i) libellés en dollars américains et (ii) cotés ou négociés sur les marchés réglementés énumérés à l'Annexe III du Prospectus.

Les types de titres de créance de sociétés dans lesquels le Fonds peut investir comprennent les billets à ordre librement transférables, les obligations à taux fixe et variable, les obligations à coupon zéro, les débentures, les billets non convertibles, les obligations convertibles contingentes (un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des obligations convertibles contingentes), les billets de trésorerie, les certificats de dépôt et les acceptations bancaires émis par des organisations industrielles, de services publics, financières, de banques commerciales ou de sociétés de portefeuille bancaires.

En outre, le Fonds peut investir dans des titres émis ou garantis par des gouvernements nationaux (y compris des STRIPS et des titres indexés sur l'inflation), leurs agences, instruments et subdivisions politiques, des titres d'organisations supranationales tels que des billets à ordre, des obligations et des débentures librement transférables ; des participations titrisées dans des prêts qui sont des titres librement transférables ; des billets structurés qui sont des titres librement transférables ; des titres adossés à des créances hypothécaires (y compris des obligations hypothécaires garanties) ; titres adossés à des actifs structurés comme des titres de créance ; accords de prise en pension avec des titres de créance comme instruments sous-jacents (à des fins de gestion efficace de portefeuille uniquement et sous réserve des exigences de la Banque centrale) ; et autres organismes de placement collectif ouverts au sens du Règlement 68(1)(e) de la Réglementation sur les OPCVM, et ces investissements auront pour but d'obtenir une exposition aux types d'instruments décrits dans le présent document ou de poursuivre l'objectif et les politiques d'investissement du Fonds. Le Fonds ne peut investir plus de 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou actions d'autres OPCVM ou d'autres organismes de placement collectif au sens du Règlement 68(1)(e) de la Réglementation sur les OPCVM.

Le Fonds peut investir dans certains types de produits dérivés et peut avoir un effet de levier allant jusqu'à 100 % de sa valeur liquidative du fait de l'utilisation d'instruments dérivés. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement de titres (SFT), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé comme un article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement Taxonomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement Taxonomie. Cependant, le Fonds peut détenir des investissements qui visent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation à celui-ci conformément à la méthodologie ESG.

Les titres composant l'univers d'investissement du Fonds sont évalués à l'aide d'un système propriétaire et du cadre ESG de MSCI afin de déterminer la notation ESG de l'univers d'investissement global et de chaque émetteur individuel et de ses titres, puis le gestionnaire de portefeuille sélectionne les investissements pour le Fonds en tenant compte de la politique d'investissement du Fonds et des notations ESG des émetteurs des titres concernés. Bien que les données MSCI soient la principale source de notation ESG, lorsque les données de notation ESG MSCI ne sont pas disponibles, le gestionnaire de portefeuille peut s'appuyer sur une notation ESG Western Asset pertinente pour l'émetteur. Dans le cadre de cette évaluation, le Fonds utilise des données ESG de tiers, provenant notamment de MSCI et de la Banque mondiale, pour mesurer, entre autres, l'intensité carbone des émetteurs privés et souverains, respectivement. L'alignement sur les UNSDG est mesuré à l'aide d'un cadre propriétaire de Western Asset basé sur des données obtenues auprès de fournisseurs de données tiers.

Le Fonds cherche à investir dans des titres d'émetteurs qui, dans l'ensemble, atteignent une intensité carbone moyenne pondérée du portefeuille inférieure d'au moins 20 % à celle de l'indice Bloomberg US Credit (l'« Indice de référence »). L'intensité moyenne pondérée des émissions de carbone fait référence au carbone des Champs 1 et 2 du Protocole des gaz à effet de serre (« GES ») émis par un émetteur. En outre, le Fonds cherche à réduire chaque année l'intensité moyenne pondérée des émissions de carbone.

Comme indiqué dans la politique d'investissement, le portefeuille du Fonds conservera une note ESG MSCI moyenne de BBB ou supérieure qui, selon la méthodologie de MSCI, est une note moyenne ou supérieure par rapport aux pairs du secteur, ce qui indique un alignement crédible sur les caractéristiques ESG.

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

Objectif d'investissement – Maximiser le rendement total, composé d'une appréciation du capital et d'un revenu.

Politiques d'investissement – Le Fonds investit au moins 70 % de sa valeur liquidative dans des titres de créance cotés ou négociés sur des marchés réglementés des États-Unis énumérés dans l'Annexe III du Prospectus et émis par des émetteurs situés partout dans le monde. Les types de titres de créance dans lesquels le Fonds peut investir comprennent : les titres de créance émis ou garantis par le gouvernement des États-Unis, ses agences, ses instruments et ses subdivisions politiques ; les titres de créance émis par d'autres gouvernements nationaux, leurs agences, leurs instruments et leurs subdivisions politiques ; les titres de créance d'organisations supranationales tels que les billets à ordre librement transférables, les obligations et les débentures ; les titres de créance de sociétés, y compris les billets à ordre librement transférables, les obligations non garanties, les obligations à taux fixe ou variable, les titres de créance convertibles, les billets non convertibles, les obligations indexées sur le crédit, les billets de trésorerie, les certificats de dépôt et les acceptations bancaires émis par des organisations industrielles, de services publics, financières, de banques commerciales ou de sociétés de portefeuille bancaires, et les titres adossés à des créances hypothécaires et à des actifs structurés comme des titres de créance.

Le Fonds peut avoir une exposition de jusqu'à 75 % de sa valeur liquidative en titres adossés à des créances hypothécaires et à des actifs. Les titres adossés à des créances hypothécaires et à des actifs et les obligations indexées sur le crédit dans lesquels le Fonds investit peuvent contenir des produits dérivés intégrés et/ou un effet de levier, et le Fonds peut donc avoir un effet de levier, sous réserve des limites globales d'effet de levier indiquées ci-dessous.

Un maximum de 25 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des titres de créance convertibles. Jusqu'à 10 % de la valeur liquidative du Fonds peuvent être investis dans des actions privilégiées ou d'autres titres de participation, y compris des warrants (un maximum de 5 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des warrants). Un maximum de 20 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du Règlement 68(1)(e) de la Réglementation sur les OPCVM. Sous réserve des restrictions susmentionnées, le Fonds peut également investir au total 30 % maximum de sa valeur liquidative dans des titres non cotés en bourse, des titres relevant de la règle 144A, des titres à coupon zéro (à l'exclusion des titres émis par le gouvernement des États-Unis et ses agences) et des instruments du marché monétaire.

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]

Objectif d'investissement – Maximiser le rendement total par le biais de revenu et d'appréciation du capital.

Politiques d'investissement – Le Fonds investit au moins 70 % de sa valeur liquidative dans des titres de créance de sociétés et des titres de créance émis par des organisations supranationales qui sont (i) libellés en dollars américains, en yens japonais, en euros, en livres sterling et dans diverses autres devises, et (ii) cotés ou négociés sur les marchés réglementés énumérés à l'Annexe III du Prospectus. En outre, le Fonds peut investir dans des titres émis ou garantis par des gouvernements nationaux (y compris des STRIPS et des titres indexés sur l'inflation), leurs agences, instruments et subdivisions politiques, des titres d'organisations supranationales tels que des obligations et des débentures

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^a – (suite)

librement transférables, des accords de prise de pension avec des titres de créance comme instruments sous-jacents (à des fins de gestion efficace de portefeuille uniquement et sous réserve des exigences de la Banque centrale) et d'autres organismes de placement collectif ouverts au sens du Règlement 68(1)(e) de la Réglementation sur les OPCVM.

Sous réserve de la restriction susmentionnée, un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des titres de créance convertibles et/ou des titres de créance assortis d'une option d'acquisition de titres de participation. Le Fonds n'achètera pas de titres de participation ou d'intérêts bénéficiaires dans des titres de participation, à l'exception (1) d'actions privilégiées, à condition qu'un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds puisse être investi dans des actions privilégiées ; et (2) de titres de participation acquis par le biais de conversions de titres de créance convertibles ou par le biais d'actions de sociétés des émetteurs (telles que l'émission d'actions pour remplacer des titres de créance précédemment émis). Un maximum de 5 % de la valeur liquidative du Fonds peut être exposé à des devises autres que le dollar américain. Sous réserve des restrictions susmentionnées, le Fonds ne peut investir plus de 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou actions d'autres OPCVM ou d'autres organismes de placement collectif au sens du Règlement 68(1)(e) de la réglementation sur les OPCVM.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé en tant que Fonds régi par l'article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement Taxonomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement Taxonomie. Cependant, le Fonds peut détenir des investissements qui visent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation à celui-ci conformément à la méthodologie ESG.

Les titres composant l'univers d'investissement du Fonds sont évalués à l'aide d'un système propriétaire et du cadre ESG de MSCI afin de déterminer la notation ESG de l'univers d'investissement global et de chaque émetteur individuel et de ses titres, puis le gestionnaire de portefeuille sélectionne les investissements pour le Fonds en tenant compte de la politique d'investissement du Fonds et des notations ESG des émetteurs des titres concernés.

Le Fonds cherche à investir dans des titres d'émetteurs qui visent une baisse absolue annualisée de l'empreinte carbone d'une année sur l'autre et qui, dans l'ensemble, atteignent une intensité carbone moyenne pondérée du portefeuille inférieure d'au moins 20 % à celle de l'indice Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (Hedged) USD (l'« Indice de référence »). Le gestionnaire de portefeuille définit l'empreinte carbone comme la moyenne pondérée de l'intensité des émissions de carbone des titres détenus dans le portefeuille. Les émissions de carbone font référence au carbone des Champs 1 et 2 du Protocole des gaz à effet de serre (« GES ») émis par un émetteur.

Comme indiqué dans la politique d'investissement, le portefeuille du Fonds conservera une note ESG MSCI moyenne de BBB ou supérieure qui, selon la méthodologie de MSCI, est une note moyenne ou supérieure par rapport aux pairs du secteur, ce qui indique un alignement crédible sur les caractéristiques ESG. Le Fonds ne peut investir plus de 10 % de sa valeur liquidative dans des titres d'émetteurs dont la notation ESG de MSCI est égale ou inférieure à BB au moment de l'achat. En raison de l'approche intégrée de l'ESG, le gestionnaire de portefeuille applique les notations ESG à au moins 90 % des titres dans lesquels le Fonds investit, à l'exception des obligations à haut rendement et des instruments de dette des marchés émergents pour lesquels les notations ESG s'appliqueront à au moins 75 % de ces investissements particuliers. Le Fonds maintient une notation ESG de portefeuille supérieure à celle de l'univers d'investissement.

En outre, le Fonds cherchera à s'aligner, mieux que l'Indice de référence, sur les investissements en titres d'émetteurs dont les activités contribuent à au moins 1 des 8 Objectifs de développement durable des Nations Unies (« UNSDG ») (collectivement, les « émetteurs UNSDG »).

Le Fonds exclura les investissements dans les titres des émetteurs suivants :

- Émetteurs qui ne suivent pas de bonnes pratiques de gouvernance selon l'évaluation du gestionnaire de portefeuille, au regard des facteurs de gouvernance indiqués dans la section « Risques de durabilité » du Prospectus ;
- Émetteurs tirant plus de 5 % de leurs revenus de la production et/ou de la distribution de tabac ;
- Émetteurs tirant plus de 10 % de leurs revenus de :
 - les armes à feu civiles (fabrication/fourniture),
 - toute implication dans les armes conventionnelles,
 - l'extraction de charbon thermique (production/distribution) ;
- Émetteurs dont plus de 5 % des revenus proviennent de la production d'armes nucléaires ;
- Émetteurs qui produisent des armes controversées (mines antipersonnel, armes chimiques, armes à laser aveuglantes, uranium appauvri, armes incendiaires et éclats non localisables), qui détiennent une société active dans les armes controversées ou qui sont détenues par une telle société ;
- Émetteurs évalués comme « en échec » en vertu du Pacte mondial des Nations Unies ; et
- Émetteurs étatiques et/ou souverains dont le score est insuffisant selon l'indice de Freedom House.

Le gestionnaire de portefeuille s'engagera auprès des émetteurs sur les pratiques environnementales, sociales et de gouvernance par le biais de conversations avec la direction. Le processus d'engagement du gestionnaire de portefeuille vise à s'aligner sur les principes du Pacte mondial des Nations Unies.

Le Fonds répond aux caractéristiques ESG qu'il promeut à travers la mise en œuvre des processus décrits ci-dessus.

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Objectif d'investissement – Maximiser le rendement total, constitué de revenu et d'appréciation du capital.

Politiques d'investissement – Le Fonds investit à tout moment au moins deux tiers de sa valeur liquidative dans des titres de créance qui sont (i) cotés ou négociés sur des marchés réglementés principalement dans les pays suivants ; et (ii) libellés dans des devises de, ou d'émetteurs situés dans, principalement les pays suivants : États-Unis, Canada, Australie, Japon, Autriche, Belgique, Finlande, France, Allemagne, Grèce, Irlande, Italie, Pays-Bas, Portugal, Espagne, Danemark, Suède, Suisse, Royaume-Uni, Nouvelle-Zélande, Norvège, Hongrie, Pologne et République tchèque. Le Fonds peut également investir dans des titres de créance cotés ou négociés sur des marchés réglementés situés dans d'autres pays développés, comme indiqué dans l'Annexe III du Prospectus.

Tous les titres de créance achetés par le Fonds seront soit notés Investment Grade soit, s'ils ne sont pas notés, considérés par le gestionnaire de portefeuille comme étant doté d'une qualité comparable au moment de l'achat. Si un investissement ainsi acheté est par la suite déclassé en dessous de la catégorie Investment Grade après le moment de l'achat, le gestionnaire de portefeuille peut, à sa discrétion, continuer à détenir le titre de créance s'il estime que cela est dans le meilleur intérêt des actionnaires. Le Fonds peut investir jusqu'à 20 % de sa valeur liquidative dans des titres de créance d'émetteurs situés dans des pays où les deux critères suivants s'appliquent : (i) la dette à long terme du pays libellée en monnaie locale est notée en dessous de A- par S&P ou l'équivalent par toutes les NRSRO qui notent la dette et (ii) le pays n'est pas représenté dans l'indice Citigroup World Government Bond. Un maximum de 25 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des titres de créance convertibles et un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des titres de participation et/ou des warrants. Un maximum de 5 % de la valeur liquidative du Fonds sera investi dans des warrants. Le Fonds ne peut investir plus de 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du Règlement 68(1)(e) de la Réglementation sur les OPCVM. Le Fonds peut être exposé à des accords de prise de pension à des fins de gestion efficace de portefeuille et sous réserve des exigences de la Banque centrale. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement de titres (SFT), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 25 % de sa valeur liquidative. L'effet de levier du Fonds, y compris les positions courtes synthétiques, ne dépassera pas 100 % de sa valeur liquidative (calculée selon l'approche par les engagements).

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé en tant que Fonds régi par l'article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement Taxonomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement Taxonomie. Cependant, le Fonds peut détenir des investissements qui visent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation à celui-ci conformément à la méthodologie ESG.

Le gestionnaire de portefeuille utilise une approche multidimensionnelle pour évaluer les facteurs ESG pour au moins 90 % de ses participations actuelles et futures. Ce processus implique l'utilisation d'un système propriétaire pour la notation et le classement des émetteurs, ainsi que l'utilisation de données brutes, de mesures et d'analyses de fournisseurs externes. Les résultats de cette analyse forment la base de l'exclusion du portefeuille où le décile inférieur, tel que défini par les facteurs environnementaux et sociaux pour les questions souveraines, de l'univers d'investissement sera exclu et l'avant-dernier décile deviendra automatiquement un candidat à l'engagement.

^a Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – (suite)

Le Fonds n'a pas d'exclusion sectorielle spécifique pour les émetteurs gouvernementaux qui dépendent des exportations de combustibles fossiles et/ou de ressources naturelles ; toutefois, les émetteurs souverains qui dépendent de ces secteurs de matières premières peuvent être exclus si leurs scores environnementaux et sociaux se situent dans le dernier décile selon la méthodologie ESG utilisée.

Le Fonds répond aux caractéristiques ESG qu'il promeut à travers la mise en œuvre des processus décrits ci-dessus.

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

Objectif d'investissement – Générer des rendements positifs indépendants des cycles du marché.

Politiques d'investissement – Le Fonds investit au moins 70 % de sa valeur liquidative dans (i) des titres de créance, des titres convertibles et des actions privilégiées cotés ou négociés sur des marchés réglementés situés partout dans le monde (ii) des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du Règlement 68(1)(e) de la Réglementation sur les OPCVM ; et (iii) des produits dérivés offrant une exposition à tout ou partie des éléments suivants : titres de créance, taux d'intérêt, devises et indices de titres à revenu fixe répondant aux critères d'éligibilité de la Banque centrale. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi en parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du Règlement 68(1)(e) de la Réglementation sur les OPCVM, et ces investissements auront pour but d'obtenir une exposition aux types d'instruments décrits dans les présentes ou de mettre en pratique l'objectif et la politique d'investissement du Fonds.

Le Fonds peut investir massivement dans certains types de produits dérivés, que ce soit à des fins d'investissement ou à des fins de gestion efficace de portefeuille, comme décrit dans la section « Techniques et instruments d'investissement et Instruments financiers dérivés » du Prospectus, y compris, mais sans s'y limiter, les options, contrats à terme et options sur contrats à terme, contrats de change à terme et warrants. Les contrats de prise en pension dont les instruments sous-jacents sont des titres de créance peuvent être utilisés à des fins de gestion efficace du portefeuille. Le Fonds peut également utiliser des swaps, y compris, mais sans s'y limiter, des swaps de taux d'intérêt, de rendement total et d'inflation. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement de titres (SFT), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 25 % de sa valeur liquidative.

FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]

Objectif d'investissement – Générer des revenus élevés. La génération de plus-values est un objectif secondaire.

Politiques d'investissement – Le Fonds investit à tout moment au moins 80 % de sa valeur liquidative dans des titres de créance de sociétés considérés comme à haut rendement par le gestionnaire de portefeuille et cotés ou négociés sur des marchés réglementés situés dans le monde entier. Des rendements plus élevés sont généralement disponibles pour les titres notés BB+ ou moins par S&P, ou Ba1 ou moins par Moody's, ou l'équivalent ou moins par une autre NRSRO, ou, s'ils ne sont pas notés, jugés de qualité comparable par le gestionnaire de portefeuille. Les titres de créance dont la notation est inférieure à Investment Grade sont considérés par les agences de notation comme essentiellement spéculatifs en ce qui concerne la capacité de l'émetteur à payer les intérêts et à rembourser le principal et peuvent comporter un risque important d'exposition à des conditions défavorables. Le Fonds peut investir dans des titres de créance notés C par Moody's ou D par S&P, ces notations indiquant que les obligations sont hautement spéculatives et qu'elles peuvent être en défaut ou en danger de défaut de paiement du principal et des intérêts. Le gestionnaire de portefeuille ne s'appuie pas uniquement sur les notations des titres notés pour prendre ses décisions d'investissement, mais utilise plutôt un processus quantitatif et qualitatif pour déterminer quels titres offrent de la valeur. Les facteurs qui aident à déterminer quels titres de créance d'entreprise offrent de la valeur comprennent la vigueur de l'économie souveraine de l'émetteur, la valeur relative de la devise des titres, la qualité du modèle d'entreprise de l'émetteur, la position des titres dans la structure du capital de l'émetteur, la qualité des clauses des titres et le taux de recouvrement probable des titres en cas de tensions. Un maximum de 5 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des obligations convertibles contingentes. La stratégie d'investissement du gestionnaire de portefeuille intègre l'analyse des facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG) significatifs qui peuvent influencer la performance de l'investissement. Le Fonds pourra investir jusqu'à 100 % de sa valeur liquidative dans des titres émis dans des pays émergents. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM. Le Fonds peut être exposé à des accords de prise en pension à des fins de gestion efficace de portefeuille et sous réserve des exigences de la Banque centrale. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement de titres (SFT selon ses sigles en anglais), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative. En ce qui concerne l'exposition aux devises, le gestionnaire de portefeuille ne peut pas être net vendeur d'une devise, ou acheteur de plus de 105 % de la valeur liquidative du Fonds.

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Objectif d'investissement – Maximiser le rendement total, constitué de revenu et d'appréciation du capital.

Politiques d'investissement – Le Fonds investit au moins deux tiers de sa valeur liquidative dans des titres de créance cotés ou négociés sur des marchés réglementés situés partout dans le monde, y compris dans les pays émergents, et tels que décrits dans l'annexe III du prospectus.

Les investissements du Fonds peuvent comprendre : - (i) les titres de créance émis ou garantis par les gouvernements nationaux, leurs agences ou instruments et leurs subdivisions politiques (y compris les titres protégés contre l'inflation) ; (ii) les titres de créance d'organisations supranationales tels que les billets à ordre librement transférables, les obligations à taux fixe ou variable et les débentures ; (iii) les titres de créance d'entreprises d'émetteurs (diversifiés dans une variété de secteurs industriels, y compris, mais sans s'y limiter, les communications, la consommation, l'énergie, la finance, l'industrie, la technologie et les services publics, etc.) situés dans des marchés réglementés ou dont les titres sont cotés ou négociés sur ces marchés, y compris les billets à ordre librement transférables, les débentures, les obligations à taux fixe ou variable (y compris les obligations à coupon zéro), les obligations convertibles et non convertibles, les billets de trésorerie, les certificats de dépôt et les acceptations bancaires émis par des entreprises industrielles, des entreprises de services publics, des établissements financiers, des banques commerciales ou des sociétés de portefeuille bancaire ; et (iv) les titres adossés à des hypothèques (y compris les obligations adossées à des créances ou CDO selon ses sigles en anglais) et titres adossés à des actifs ; les actions privilégiées et autres organismes de placement collectif de type ouvert au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM. La stratégie d'investissement du gestionnaire de portefeuille intègre l'analyse des facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG) significatifs qui peuvent influencer la performance de l'investissement. Le Fonds ne peut investir plus de 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM. Le Fonds peut être exposé à des accords de prise en pension à des fins de gestion efficace de portefeuille et sous réserve des exigences de la Banque centrale. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement de titres (SFT selon ses sigles en anglais), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 25 % de sa valeur liquidative. L'effet de levier du Fonds, y compris les positions courtes synthétiques, ne dépassera pas 100 % de sa valeur liquidative. Sous réserve de cette limite, le Fonds devrait avoir une exposition longue nette. En ce qui concerne l'exposition aux devises, le gestionnaire de portefeuille ne peut pas être net vendeur d'une devise, ou acheteur de plus de 105 % de la valeur liquidative du Fonds.

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Objectif de l'investissement – Maximiser le rendement dans toutes les conditions de marché, tout en préservant le capital.

Politiques d'investissement – Le Fonds investit dans : (i) des titres de créance et des titres convertibles cotés ou négociés sur des marchés réglementés du monde entier ; (ii) des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens de l'article 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM ; et (iii) des dérivés offrant une exposition à tout ou partie des instruments suivants : titres de créance, taux d'intérêt, devises, actions et indices (y compris indices de produits à revenu fixe et indices de participations et de matières premières) remplissant les critères de qualification de la Banque centrale. Le Fonds investit au moins 70 % de sa valeur liquidative dans des titres de créance et des produits dérivés offrant une exposition aux titres de créance. Un maximum de 5 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des obligations convertibles contingentes. Le Fonds investira au moins 85 % de sa valeur liquidative dans des dollars américains. Cependant, lorsque des opportunités se présentent, cela peut ponctuellement être une proportion minimale de 80 % en dollars américains. Le Fonds ne peut investir plus de 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM. Les contrats de prise en pension dont les instruments sous-jacents sont des titres de créance peuvent être utilisés à des fins de gestion efficace du portefeuille. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement de titres (SFT selon ses sigles en anglais), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé en tant que Fonds régi par l'article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement sur la taxinomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement sur la taxinomie. Cependant, le Fonds peut détenir des investissements qui visent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation à celui-ci conformément à la méthodologie ESG.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – (suite)

Le gestionnaire de portefeuille utilise une stratégie multidimensionnelle pour évaluer les facteurs ESG pour au moins 90 % de ses participations actuelles et 80 % de ses participations futures. Ce processus implique l'utilisation d'un système exclusif pour la notation et le classement des émetteurs, ainsi que l'utilisation de données brutes, de mesures et d'analyses de fournisseurs externes. Les résultats de cette analyse forment la base de l'exclusion du portefeuille où le décile inférieur, tel que défini par les facteurs environnementaux et sociaux pour les questions souveraines et d'entreprises, de l'univers d'investissement sera exclu et l'avant-dernier décile deviendra automatiquement un candidat à l'engagement. Le gestionnaire de portefeuille surveille également les participations actuelles et potentielles pour détecter toute détérioration ou amélioration en regard des facteurs environnementaux et sociaux.

Le Fonds n'a pas d'exclusion sectorielle spécifique pour les combustibles fossiles ; toutefois, les sociétés émettrices du secteur des combustibles fossiles sont exclues si leurs scores environnementaux et sociaux se situent dans le décile inférieur selon la méthodologie ESG utilisée.

Le Fonds répond aux caractéristiques ESG qu'il promeut à travers la mise en œuvre des processus décrits ci-dessus.

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]

Objectif d'investissement - Maximiser le rendement total par le biais d'un niveau élevé de revenu et d'appréciation du capital.

Politiques d'investissement - Le Fonds cherche à atteindre son objectif d'investissement principalement en adoptant une stratégie d'investissement flexible des titres de créance d'émetteurs domiciliés dans tout pays, par le biais d'une exposition longue et d'une exposition courte (via des produits dérivés). Le Fonds investira au maximum 25 % de sa valeur liquidative dans des titres adossés à des hypothèques dans un seul pays autre que les États-Unis. Le Fonds investira également, au total, un maximum de 40 % de sa valeur liquidative dans des titres adossés à des hypothèques de pays autres que les États-Unis. Le Fonds investira au maximum 10 % de sa valeur liquidative dans des obligations adossées à des créances (CDO) ou des obligations adossées à des prêts (CLO). La stratégie d'investissement du gestionnaire de portefeuille intègre l'analyse des facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG) significatifs qui peuvent influencer la performance de l'investissement. Les types de titres de créance dans lesquels le Fonds peut investir comprennent : les titres adossés à des créances hypothécaires d'agences et de non-agences qui sont structurés comme des titres de créance ; les titres adossés à des actifs ; les titres de créance d'entreprises, y compris les billets à ordre librement transférables ; les obligations convertibles et non convertibles ; les billets de trésorerie, les certificats de dépôt et les acceptations bancaires émis par des organisations industrielles, de services publics, financières, de banques commerciales ou de holdings bancaires ; les titres de créance émis ou garantis par des gouvernements nationaux, leurs agences, leurs instruments et leurs subdivisions politiques ; les titres de créance d'organisations supranationales tels que les billets à ordre, les obligations et les débiteurs librement transférables ; les obligations structurées qui sont des valeurs mobilières dont l'exposition sous-jacente peut être des titres à revenu fixe ; les participations titrisées dans des prêts qui sont des valeurs mobilières ; les obligations en euros et les instruments en dollars yankees (y compris les obligations de premier rang et les obligations subordonnées) ; et les titres relevant de l'article 144A du règlement. Les obligations structurées dans lesquelles le Fonds investira peuvent contenir des produits dérivés intégrés, ce qui peut entraîner un effet de levier pour le Fonds. L'effet de levier du Fonds, calculé à partir de la somme des valeurs nominales des produits dérivés détenus par le Fonds, sera inférieur à 700 % de la valeur liquidative du Fonds. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement de titres (SFT selon ses sigles en anglais), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative. Le Fonds ne peut investir plus de 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM.

FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]

Objectif d'investissement - Générer des revenus et des plus-values à long terme.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit à tout moment au moins 80 % de sa valeur liquidative dans des titres de créance d'entreprise considérés comme à haut rendement par le gestionnaire de portefeuille et cotés ou négociés sur des Marchés réglementés situés partout dans le monde, tels que définis dans l'Annexe III du Prospectus, y compris des investissements directs ou indirects par le biais de produits dérivés sur ces titres, à condition que le Fonds investisse au moins 70 % de sa valeur liquidative directement dans de tels titres.

Le Fonds peut investir au total jusqu'à 20 % de sa valeur liquidative dans des instruments du marché monétaire cotés ou négociés sur un marché réglementé et dans des titres de créance, des types énumérés dans le prospectus, qui ne sont pas cotés ou négociés sur un marché réglementé, à condition toutefois qu'un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds puisse être investi dans des titres de créance non cotés ou négociés sur un marché réglementé. Un maximum de 20 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des titres de créance convertibles. Jusqu'à 20 % de la valeur liquidative du Fonds peuvent être investis dans des actions privilégiées. Un maximum de 20 % peut être investi dans des titres de participation, y compris des bons de souscription (un maximum de 15 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des bons de souscription). Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM. Le Fonds peut être exposé à des accords de prise en pension à des fins de gestion efficace de portefeuille et sous réserve des exigences de la Banque centrale. L'exposition maximale du Fonds aux swaps de rendement total et aux opérations de financement de titres (SFT selon ses sigles en anglais), sur la base de la valeur notionnelle de ces instruments, est de 100 % de sa valeur liquidative. En ce qui concerne l'exposition aux devises, le gestionnaire de portefeuille ne peut pas être net vendeur d'une devise, ou acheteur de plus de 105 % de la valeur liquidative du Fonds.

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

Objectif d'investissement - Générer des rendements positifs indépendants des cycles du marché.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit au moins 80 % de sa valeur liquidative dans : (i) des titres de créance, des titres convertibles et des actions privilégiées cotés ou négociés sur des marchés réglementés du monde entier, tels que définis dans l'Annexe III du Prospectus ; (ii) des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens de l'article 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM ; et (iii) des produits dérivés offrant une exposition à tout ou partie des instruments suivants : titres de créance, taux d'intérêt, devises et indices de titres à revenu fixe remplissant les critères de qualification de la Banque centrale. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi en parts ou actions d'autres organismes de placement collectif, et ces investissements auront pour but d'obtenir une exposition aux types d'instruments décrits dans les présentes ou de mettre en pratique l'objectif et la politique d'investissement du Fonds. Les contrats de prise en pension dont les instruments sous-jacents sont des titres de créance peuvent être utilisés à des fins de gestion efficace du portefeuille.

Le Fonds peut investir largement dans certains types de produits dérivés, que ce soit à des fins d'investissement ou de gestion efficace de portefeuille, à savoir les options, les contrats à terme et les options sur contrats à terme, les contrats de change à terme et les bons de souscription. Le Fonds peut également utiliser des swaps, y compris, mais sans s'y limiter, des swaps de taux d'intérêt, de rendement total, de défaut de crédit et d'inflation.

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]

Objectif de l'investissement – Maximiser le rendement dans toutes les conditions de marché tout en préservant le capital.

Politiques d'investissement – Le Fonds investit dans : (i) des titres de créance et des titres convertibles (y compris des obligations convertibles contingentes jusqu'à 5 % de la valeur liquidative) cotés ou négociés sur des marchés réglementés du monde entier, tels que définis à l'Annexe III du Prospectus ; (ii) des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) du règlement sur les OPCVM ; et (iii) des dérivés offrant une exposition à tout ou partie des instruments suivants : titres de créance, taux d'intérêt, devises et indices (y compris indices de titres à revenu fixe et indices de matières premières) remplissant les critères de qualification de la Banque centrale. Le Fonds investit au moins 70 % de sa valeur liquidative dans des titres de créance et des produits dérivés offrant une exposition aux titres de créance. Le Fonds investira au moins 85 % de sa valeur liquidative dans des dollars américains. Cependant, lorsque des opportunités se présentent, cela peut ponctuellement être une proportion minimale de 80 % en dollars américains. Le Fonds ne peut pas investir plus de 10 % de sa valeur liquidative en parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du Règlement 68(1)(e) du Règlement sur les OPCVM, et ces investissements auront pour but d'obtenir une exposition aux types d'instruments décrits dans les présentes ou de mettre en pratique l'objectif et la politique d'investissement du Fonds.

Le Gestionnaire de portefeuille cherche à atteindre l'objectif d'investissement en investissant dans la dette et/ou les émissions liées à la dette de sociétés et de pays (comme indiqué ci-dessus) qui mettent actuellement en œuvre, ou vont mettre en œuvre, des plans clairs pour promouvoir une économie durable et équitable, tel que déterminé par le gestionnaire de portefeuille.

Le Fonds peut investir massivement dans certains types de produits dérivés, que ce soit à des fins d'investissement ou à des fins de gestion efficace de portefeuille, comme décrit dans la section « Techniques et instruments d'investissement et Instruments financiers dérivés » du Prospectus, y compris, mais sans s'y limiter, les options, contrats à terme et options sur contrats à terme, titres liés à un crédit, contrats de change à terme et bons de souscription. Le Fonds peut également utiliser des swaps, à savoir des swaps de taux d'intérêt, de rendement total, d'inflation et de défaut de crédit. Dans la mesure où le Fonds a recours à des produits dérivés, et sous réserve des limites susmentionnées, ce dernier peut le faire à des fins d'exposition à ce qui suit, en tout ou en partie : titres de créance, taux d'intérêt, devises, indices (y compris les indices de titres à revenu fixe

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

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

et les indices de matières premières) remplissant les critères de qualification de la Banque centrale. En ce qui concerne ces types d'actifs, le Fonds peut prendre des positions dérivées courtes ou des positions dérivées longues lorsqu'un achat direct ne serait pas possible ou serait moins efficace.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé comme un article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement sur la taxinomie à l'heure actuelle et, par conséquent, la proportion minimale d'investissements pouvant être qualifiés d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement sur la taxinomie est égale à zéro. Cependant, le Fonds peut détenir des investissements qui contribuent à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation à celui-ci conformément à la méthodologie ESG.

FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]

Objectif d'investissement - Fournir une appréciation du capital à long terme.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit au moins 80 % de sa valeur liquidative dans des titres de participation de sociétés à forte capitalisation boursière qui (1) ont leur siège social aux États-Unis ou exercent une part prépondérante de leurs activités aux États-Unis et (2) sont cotées ou négociées sur des marchés réglementés tels que définis dans l'Annexe III du Prospectus.

Le Fonds investit en actions ordinaires et actions privilégiées. Sous réserve de la limite susmentionnée concernant les investissements dans des titres de participation, le Fonds peut également investir dans des titres de créance émis ou garantis par des émetteurs domiciliés aux États-Unis, y compris le gouvernement américain, ses agences, ses instruments et ses subdivisions politiques ; dans des titres de créance d'entreprise cotés ou négociés sur des marchés réglementés, y compris des billets à ordre librement transférables, des débentures, des billets de trésorerie, des certificats de dépôt et des acceptations bancaires émis par des organisations industrielles, de services publics, financières, de banques commerciales ou de holdings bancaires ; et dans des bons de souscription. Le Fonds n'achètera que des titres de créance notés « de premier ordre » au moment de l'achat. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM.

FTGF ClearBridge Value Fund

Objectif d'investissement - Réaliser une appréciation du capital à long terme.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit principalement dans des titres d'émetteurs américains que le gestionnaire de portefeuille estime sous-évalués. Le Fonds peut également investir jusqu'à 20 % de sa valeur liquidative dans des titres d'émetteurs non américains. Au moins 50 % de la valeur liquidative du Fonds seront investis dans des titres de participation. Le Fonds peut également investir jusqu'à 5 % de sa valeur liquidative dans des parts ou des actions d'organismes de placement collectif ouverts au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé en tant que Fonds régi par l'article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement sur la taxinomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement sur la taxinomie. Cependant, le Fonds peut détenir des investissements qui visent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation à celui-ci conformément à la méthodologie ESG.

Le gestionnaire de portefeuille utilise un processus de recherche et d'engagement exclusif établi pour déterminer le profil d'une entreprise sur les questions ESG. Il s'agit notamment d'attribuer une note ESG, par le biais de son système de notation ESG, en procédant à une évaluation à la fois quantitative et qualitative. Ce système comporte quatre niveaux de notation : AAA, AA, A et B attribués aux sociétés en fonction de leur performance sur les questions principales ESG. Les sociétés notées B selon ce système exclusif de notation ESG peuvent être ajoutées au Fonds, mais elles doivent représenter une proportion inférieure du Fonds par rapport aux sociétés notées A ou plus. De plus, le gestionnaire de portefeuille prend un engagement direct avec les sociétés notées B apportées au Fonds, dans l'optique d'améliorer leurs caractéristiques environnementales et/ou sociales significatives.

De plus, le Fonds n'investira pas dans :

- des sociétés qui génèrent 10 % ou plus de leur chiffre d'affaires à partir de la production et/ou distribution d'armes interdites et des sociétés qui génèrent tout chiffre d'affaires (a) d'armes prohibées conformément (i) à la Convention sur l'interdiction de l'emploi, du stockage, de la production et du transfert des mines antipersonnel et sur leur destruction et (ii) à la Convention sur l'interdiction des armes à sous-munitions, et (b) d'armes classées en tant qu'armes B ou C conformément à la Convention des Nations Unies sur l'interdiction des armes biologiques et à la Convention des Nations Unies sur l'interdiction des armes chimiques respectivement ; et
- les sociétés qui génèrent 5 % ou plus de leur chiffre d'affaires dans le secteur du tabac.

Le gestionnaire de portefeuille applique son processus ESG (tel que défini ci-dessus) à 100 % du portefeuille du Fonds afin de maintenir une note ESG du portefeuille supérieure à celle de l'univers d'investissement du Fonds.

Le Fonds répond aux caractéristiques ESG qu'il promeut à travers la mise en œuvre des processus décrits ci-dessus.

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

Objectif d'investissement - Générer une appréciation du capital à long terme.

Politiques d'investissement - Le Fonds investira au moins 70 % de sa valeur liquidative dans des titres de participation de sociétés américaines cotées ou négociées sur des marchés réglementés aux États-Unis, dont la liste figure à l'Annexe III du Prospectus. Les investissements du Fonds comprendront des actions ordinaires, des actions privilégiées et des titres liés à des participations. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM. Le Fonds peut également investir dans certains types de produits dérivés, mais uniquement à des fins de gestion efficace de portefeuille. Le gestionnaire de portefeuille peut augmenter l'allocation du Fonds aux instruments du marché monétaire et aux liquidités à titre accessoire lorsque, de l'avis du gestionnaire de portefeuille, les niveaux d'évaluation du marché deviennent excessifs.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé en tant que Fonds régi par l'article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement sur la taxinomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement sur la taxinomie. Cependant, le Fonds peut détenir des investissements qui visent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation à celui-ci conformément à la méthodologie ESG.

Le gestionnaire de portefeuille utilise un processus de recherche et d'engagement exclusif établi pour déterminer le profil d'une entreprise sur les questions ESG. Il s'agit notamment d'attribuer une note ESG, par le biais de son système de notation ESG, en procédant à des évaluations quantitatives et qualitatives. Ce système comporte quatre niveaux de notation : AAA, AA, A et B attribués aux sociétés en fonction de leur performance sur les questions principales ESG. Les sociétés qui reçoivent une note B selon le système de notation ESG exclusif ne sont pas prises en considération pour un investissement dans ce Fonds.

De plus, le Fonds n'investira pas dans :

- Les sociétés fortement impliquées dans l'extraction de combustibles fossiles et l'exploitation minière qui, selon les analystes, ne présentent pas de caractéristiques ESG nettement mieux que celles d'autres entreprises similaires ; et
- des sociétés qui génèrent 10 % ou plus de leur chiffre d'affaires à partir de la production et/ou distribution d'armes interdites et des sociétés qui génèrent tout chiffre d'affaires (a) d'armes prohibées conformément (i) à la Convention sur l'interdiction de l'emploi, du stockage, de la production et du transfert des mines antipersonnel et sur leur destruction et (ii) à la Convention sur l'interdiction des armes à sous-munitions, et (b) d'armes classées en tant qu'armes B ou C conformément à la Convention des Nations Unies sur l'interdiction des armes biologiques et à la Convention des Nations Unies sur l'interdiction des armes chimiques respectivement ; et

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund – (suite)

Le Fonds n'est pas exposé aux sociétés qui produisent du tabac et ses produits, mais peut investir dans des sociétés qui génèrent indirectement 5 % ou moins de leur chiffre d'affaires à partir du tabac. Le gestionnaire de portefeuille applique son processus ESG (tel que défini ci-dessus) à 100 % du portefeuille du Fonds afin de maintenir une note ESG du portefeuille supérieure à celle de l'univers d'investissement du Fonds.

Le Fonds répond aux caractéristiques ESG qu'il promeut à travers la mise en œuvre des processus décrits ci-dessus.

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

Objectif d'investissement - Générer une appréciation du capital à long terme.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit au moins 70 % de sa valeur liquidative dans des titres de participation d'un groupe concentré de sociétés américaines à forte capitalisation boursière, qui sont cotées ou négociées sur des marchés réglementés aux États-Unis, dont la liste figure à l'Annexe III du Prospectus. Le Fonds détiendra essentiellement des sociétés américaines à forte capitalisation boursière qui occupent une position dominante dans leurs secteurs respectifs, qui ont une envergure mondiale et qui ont un historique de performance à long terme. Les investissements du Fonds consisteront en actions ordinaires et, dans une moindre mesure, en actions privilégiées et en titres liés à des participations émises par des sociétés américaines à forte capitalisation boursière ou liés à celles-ci, dont on estime qu'elles offrent des opportunités attrayantes de croissance de l'investissement. Le Fonds n'investira pas dans des titres cotés ou négociés sur des marchés réglementés de pays émergents, de pays européens émergents ou de pays émergents d'Asie/Pacifique. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé en tant que Fonds régi par l'article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement sur la taxinomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement sur la taxinomie. Cependant, le Fonds peut détenir des investissements qui visent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation à celui-ci conformément à la méthodologie ESG.

Le gestionnaire de portefeuille utilise un processus de recherche et d'engagement exclusif établi pour déterminer le profil d'une entreprise sur les questions ESG. Il s'agit notamment d'attribuer une note ESG, par le biais de son système de notation ESG, en procédant à des évaluations quantitatives et qualitatives. Ce système comporte quatre niveaux de notation : AAA, AA, A et B attribués aux sociétés en fonction de leur performance sur les questions principales ESG. Les sociétés qui reçoivent une note B selon le système de notation ESG exclusif ne sont pas prises en considération pour un investissement dans ce Fonds.

De plus, le Fonds n'investira pas dans :

- Les sociétés fortement impliquées dans l'extraction de combustibles fossiles et l'exploitation minière qui, selon les analystes, ne présentent pas de caractéristiques ESG nettement mieux que celles d'autres entreprises similaires ; et
- des sociétés qui génèrent 10 % ou plus de leur chiffre d'affaires à partir de la production et/ou distribution d'armes interdites et des sociétés qui génèrent tout chiffre d'affaires (a) d'armes prohibées conformément (i) à la Convention sur l'interdiction de l'emploi, du stockage, de la production et du transfert des mines antipersonnel et sur leur destruction et (ii) à la Convention sur l'interdiction des armes à sous-munitions, et (b) d'armes classées en tant qu'armes B ou C conformément à la Convention des Nations Unies sur l'interdiction des armes biologiques et à la Convention des Nations Unies sur l'interdiction des armes chimiques respectivement ; et

Le Fonds n'est pas exposé aux sociétés qui produisent du tabac et ses produits, mais peut investir dans des sociétés qui génèrent indirectement 5 % ou moins de leur chiffre d'affaires à partir du tabac. Le gestionnaire de portefeuille applique son processus ESG (tel que défini ci-dessus) à 100 % du portefeuille du Fonds afin de maintenir une note ESG du portefeuille supérieure à celle de l'univers d'investissement du Fonds.

Le Fonds répond aux caractéristiques ESG qu'il promeut à travers la mise en œuvre des processus décrits ci-dessus.

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Objectif d'investissement - Générer une appréciation du capital à long terme.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit au moins 70 % de sa valeur liquidative dans des actions ordinaires de sociétés américaines cotées ou négociées sur des marchés réglementés aux États-Unis, énumérées à l'Annexe III du Prospectus, et dont le gestionnaire de portefeuille estime qu'elles enregistrent, ou ont le potentiel d'enregistrer, une croissance des bénéfices et/ou des flux de trésorerie supérieure au taux de croissance moyen des bénéfices et/ou des flux de trésorerie des sociétés dont les titres sont inclus dans l'indice quotidien Standard & Poor's de 500 actions ordinaires (l'« Indice S&P 500 »). Le gestionnaire de portefeuille concentre sa sélection d'actions pour le Fonds sur un groupe diversifié de sociétés de croissance émergentes qui peuvent avoir dépassé leur phase de « démarrage » et affichent des bénéfices positifs et la perspective de réaliser des gains importants dans les deux à trois ans suivant l'acquisition de leurs actions par le Fonds. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé en tant que Fonds régi par l'article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement sur la taxinomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement sur la taxinomie. Cependant, le Fonds peut détenir des investissements qui visent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation à celui-ci conformément à la méthodologie ESG.

Le gestionnaire de portefeuille utilise un processus de recherche et d'engagement exclusif établi pour déterminer le profil d'une entreprise sur les questions ESG. Il s'agit notamment d'attribuer une note ESG, par le biais de son système de notation ESG, en procédant à une évaluation à la fois quantitative et qualitative. Ce système comporte quatre niveaux de notation : AAA, AA, A et B attribués aux sociétés en fonction de leur performance sur les questions principales ESG. Les sociétés qui reçoivent une note B selon le système de notation ESG exclusif ne sont pas prises en considération pour un investissement dans ce Fonds.

De plus, le Fonds n'investira pas dans :

- Les sociétés fortement impliquées dans l'extraction de combustibles fossiles et l'exploitation minière qui, selon les analystes, ne présentent pas de caractéristiques ESG nettement mieux que celles d'autres entreprises similaires ; et
- des sociétés qui génèrent 10 % ou plus de leur chiffre d'affaires à partir de la production et/ou distribution d'armes interdites et des sociétés qui génèrent tout chiffre d'affaires (a) d'armes prohibées conformément (i) à la Convention sur l'interdiction de l'emploi, du stockage, de la production et du transfert des mines antipersonnel et sur leur destruction et (ii) à la Convention sur l'interdiction des armes à sous-munitions, et (b) d'armes classées en tant qu'armes B ou C conformément à la Convention des Nations Unies sur l'interdiction des armes biologiques et à la Convention des Nations Unies sur l'interdiction des armes chimiques respectivement ; et

Le Fonds n'est pas exposé aux sociétés qui produisent du tabac et ses produits, mais peut investir dans des sociétés qui génèrent indirectement 5 % ou moins de leur chiffre d'affaires à partir du tabac. Le gestionnaire de portefeuille applique son processus ESG (tel que défini ci-dessus) à 100 % du portefeuille du Fonds afin de maintenir une note ESG du portefeuille supérieure à celle de l'univers d'investissement du Fonds.

Le Fonds répond aux caractéristiques ESG qu'il promeut à travers la mise en œuvre des processus décrits ci-dessus.

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Objectif d'investissement - Fournir un niveau de revenu élevé. L'appréciation du capital à long terme est un objectif secondaire.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit au moins 80 % de sa valeur liquidative dans des actions et des titres liés à des participations dont on attend un revenu d'investissement, des paiements de dividendes ou d'autres distributions, qui sont cotés ou négociés sur les marchés réglementés énumérés à l'Annexe III du Prospectus et qui proviennent d'émetteurs situés partout dans le monde. Le Fonds peut investir dans des actions et des titres liés à des participations d'émetteurs de toute capitalisation boursière. Pour sélectionner les titres, le gestionnaire de portefeuille utilise une stratégie fondamentale et macroéconomique combinée afin d'identifier les actifs dont les dividendes et les perspectives de bénéfices futurs sont attrayants. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM.

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]

Objectif d'investissement - Fournir une appréciation du capital à long terme.

Politique d'investissement - Le gestionnaire de portefeuille cherche à investir à long terme dans des sociétés qu'il considère comme étant de grande qualité et présentant des avantages concurrentiels durables attestés par des rendements élevés du capital, des bilans solides et des équipes de gestion compétentes qui allouent le capital de manière efficace. Le Fonds n'investira pas dans des sociétés ayant une implication directe significative dans l'extraction de combustibles fossiles et l'exploitation minière, et recherchera plutôt d'autres opportunités durables attrayantes dans les secteurs de l'énergie, de l'industrie et des matériaux.

Bien que les actifs du Fonds soient normalement investis principalement dans des actions ordinaires de sociétés américaines, le Fonds peut également investir au total jusqu'à 15 % de sa valeur liquidative dans des titres convertibles (qui peuvent contenir des produits dérivés intégrés et/ou un effet de levier), des actions privilégiées, des bons de souscription, des FPI, des titres relevant de la règle 144A et des instruments du marché monétaire, qui sont cotés ou négociés sur des marchés réglementés aux États-Unis. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé en tant que Fonds régi par l'article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement sur la taxinomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement sur la taxinomie. Cependant, le Fonds peut détenir des investissements qui visent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation à celui-ci conformément à la méthodologie ESG.

Le Fonds investit en permanence au moins 85 % de sa valeur liquidative dans des titres de participation américains (y compris des actions ordinaires et des actions privilégiées) cotés ou négociés sur des marchés réglementés aux États-Unis, tels que définis à l'Annexe III du Prospectus de la Société, et émis par des sociétés qui satisfont aux critères financiers du gestionnaire de portefeuille et à ses critères en matière de politiques ESG (« Leaders en matière de durabilité »). Le gestionnaire de portefeuille applique ses critères de leader en matière de durabilité ESG à 100 % du portefeuille du Fonds. Le processus de construction du portefeuille du gestionnaire de portefeuille restreint les sociétés de l'univers d'investissement du Fonds d'au moins 20 % afin de n'accueillir que les sociétés qui sont des leaders en matière de durabilité.

Le gestionnaire de portefeuille utilise un processus de recherche et d'engagement exclusif établi pour déterminer si une société est un leader en matière de durabilité. Ce processus exclusif du gestionnaire de portefeuille comprend la constitution d'un système de notation ESG basé sur la longue expérience du gestionnaire de portefeuille en matière de gestion de stratégies d'investissement ESG et d'identification des meilleures pratiques ESG. La qualité de leader en matière de durabilité peut être évaluée à la fois quantitativement et qualitativement, par le biais du système de notation ESG du gestionnaire de portefeuille et de son processus de recherche et d'engagement direct. Le système de notation ESG du gestionnaire de portefeuille comprend quatre niveaux de notation : AAA, AA, A et B, qui sont attribués aux sociétés en fonction de leur stratégie de durabilité et de leur performance sur les questions principales ESG.

Le Fonds n'est pas exposé aux producteurs de combustibles fossiles, aux fabricants d'armes controversées (à savoir les mines antipersonnel, les armes nucléaires, les armes biologiques et chimiques et les armes à sous-munitions) et aux sociétés qui génèrent au moins 5 % de leur chiffre d'affaires dans le tabac ou plus de 5 % de leur chiffre d'affaires dans les armes classiques ou 15 % de leur chiffre d'affaires dans la production d'énergie nucléaire.

Le Fonds répond aux caractéristiques ESG qu'il promeut à travers la mise en œuvre des processus décrits ci-dessus.

FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]

Objectif d'investissement – Fournir une appréciation du capital à long terme.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit au moins 80 % de sa valeur liquidative dans des titres de participation cotés ou négociés sur des marchés réglementés situés partout dans le monde, tels que définis à l'Annexe III du Prospectus. Jusqu'à 25 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investie dans des titres de participation d'émetteurs situés dans des pays émergents. L'exposition du Fonds aux titres russes ne dépassera pas 15 % de la valeur liquidative du Fonds. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi en parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du Règlement 68(1)(e) du Règlement sur les OPCVM, et ces investissements auront pour but d'obtenir une exposition aux types d'instruments décrits dans les présentes ou de mettre en pratique l'objectif et la politique d'investissement du Fonds. Pas plus de 5 % de la valeur liquidative du Fonds ne seront investis dans des bons de souscription. Pour gérer les flux de capitaux, le Fonds peut détenir des liquidités ou investir dans des instruments du marché monétaire.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé en tant que Fonds régi par l'article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement sur la taxinomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement sur la taxinomie. Cependant, le Fonds peut détenir des investissements qui visent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation à celui-ci conformément à la méthodologie ESG.

Le gestionnaire de portefeuille utilise un processus de recherche et d'engagement exclusif établi pour déterminer le profil d'une entreprise sur les questions ESG. Il s'agit notamment d'attribuer une note ESG, par le biais de son système de notation ESG, en procédant à une évaluation à la fois quantitative et qualitative. Ce système comporte quatre niveaux de notation : AAA, AA, A et B, attribués aux sociétés en fonction de leur performance sur les questions principales ESG. Les sociétés qui reçoivent une note B selon le système de notation ESG exclusif ne sont pas prises en considération pour un investissement dans ce Fonds.

De plus, le Fonds n'investira pas dans :

- Les sociétés fortement impliquées dans l'extraction et/ou la production de combustibles fossiles et l'exploitation minière ;
- des sociétés qui génèrent 10 % ou plus de leur chiffre d'affaires à partir de la production et/ou distribution d'armes interdites et des sociétés qui génèrent tout chiffre d'affaires (a) d'armes prohibées conformément (i) à la Convention sur l'interdiction de l'emploi, du stockage, de la production et du transfert des mines antipersonnel et sur leur destruction et (ii) à la Convention sur l'interdiction des armes à sous-munitions, et (b) d'armes classées en tant qu'armes B ou C conformément à la Convention des Nations Unies sur l'interdiction des armes biologiques et à la Convention des Nations Unies sur l'interdiction des armes chimiques respectivement ; et
- les sociétés qui génèrent 15 % ou plus de leur chiffre d'affaires de la production d'énergie nucléaire ;

Le Fonds n'est pas exposé aux sociétés qui produisent du tabac et ses produits, mais peut investir dans des sociétés qui génèrent indirectement 5 % ou moins de leur chiffre d'affaires à partir du tabac. Le gestionnaire de portefeuille applique son processus ESG (tel que défini ci-dessus) à 100 % du portefeuille du Fonds afin de maintenir une note ESG du portefeuille supérieure à celle de l'univers d'investissement du Fonds.

Le Fonds répond aux caractéristiques ESG qu'il promeut à travers la mise en œuvre des processus décrits ci-dessus.

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]

Objectif d'investissement - Réaliser une croissance stable à long terme, composée de revenus réguliers et constants provenant de dividendes et d'intérêts, ainsi que d'une croissance du capital, à partir d'un portefeuille de titres d'infrastructure mondiaux.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit au moins 80 % de sa valeur liquidative dans des sociétés d'infrastructure par le biais d'actions et de titres liés à des participations cotées ou négociées sur les marchés réglementés des pays du G7 (États-Unis, Royaume-Uni, Japon, Allemagne, France, Italie et Canada), ainsi que d'actions et de titres liés à des participations cotées ou négociées sur les marchés réglementés d'autres pays développés et de pays émergents, y compris l'Inde. Les actions et les titres liés à des participations dans lesquels le Fonds peut investir comprennent des actions ordinaires, des actions privilégiées, des certificats de dépôt, des droits, des bons de souscription et des billets de participation de sociétés d'infrastructure. Le Fonds peut investir dans des certificats de dépôt américains et mondiaux (ADR / GDR) de sociétés cotées ou négociées sur un marché réglementé, tel que défini à l'Annexe III du Prospectus.

Le Fonds peut investir jusqu'à 20 % de sa valeur liquidative dans des organismes de placement collectif fermés tels que les FPI. Tout FPI dans lequel le Fonds investira sera coté ou négocié sur un marché réglementé. Le Fonds peut investir jusqu'à 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou actions d'autres OPCVM ouverts ou d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM, à condition que les politiques d'investissement et les dispositions relatives à la liquidité de ces organismes de placement collectif soient compatibles avec celles du Fonds.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – (suite)

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé en tant que Fonds régi par l'article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement sur la taxinomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement sur la taxinomie. Cependant, le Fonds peut détenir des investissements qui visent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation à celui-ci conformément à la méthodologie ESG.

Pour ce Fonds, les risques et opportunités ESG sont, dans la mesure du possible, pris en compte de deux manières principales. Premièrement, lors de l'évaluation des flux de trésorerie prévus par le gestionnaire de portefeuille en ce qui concerne les sociétés détenues éligibles dans le cadre d'une évaluation fondamentale des titres. Deuxièmement, si les facteurs ESG ne peuvent pas être pris en compte dans ces flux de trésorerie prévus, ils le sont par le biais d'un ajustement du rendement exigé, ou taux de rendement minimal, de l'investissement. Dans ce cas, les facteurs ESG pertinents et la gestion de ces facteurs par la direction de la société sont évalués à partir d'une grille de notation exclusive par l'analyste compétent, qui détermine l'ajustement du rendement exigé, ou du taux de rendement minimal, applicable à chaque investissement éventuel.

En conséquence de la stratégie intégrée des paramètres ESG, le gestionnaire de portefeuille applique son processus ESG à au moins 90 % du portefeuille du Fonds. Le Fonds maintiendra une notation ESG de portefeuille supérieure à celle de l'univers d'investissement du Fonds.

Conformément à la stratégie d'évaluation du Fonds qui préconise une période de détention de cinq ans, la durabilité est évaluée à l'aide d'un score qui note la performance ESG actuelle en fonction des processus, politiques et pratiques en cours, et sur cinq ans en fonction des objectifs et politiques de la direction. Cette stratégie permet à l'équipe de distinguer les sociétés dont les pratiques de durabilité devraient s'améliorer.

Les scores ESG sont ensuite comparés à l'ensemble des sociétés. Les sociétés du premier quartile bénéficie d'une réduction du rendement exigé, ou taux de rendement minimal, selon une échelle mobile. Sur la base des scores ESG, les trois quartiles inférieurs sont pénalisés par une augmentation du rendement exigé, ou taux de rendement minimal, selon une échelle mobile.

Près de 600 sociétés sont notées en fonction de leur liquidité, de leur exposition aux infrastructures et de leur qualité d'infrastructure. Une fois que l'analyse de liquidité a réduit cet univers d'environ 50 %, environ 10 % des sociétés restantes sont exclues en raison de leur faible exposition aux infrastructures, et les sociétés dont l'exposition aux activités non liées aux infrastructures est inacceptable sont exclues. En outre, 20 % des sociétés sont exclues en raison de la mauvaise qualité des infrastructures.

De plus, le Fonds n'investira pas dans :

- des sociétés qui tirent une majorité de leur évaluation de l'extraction ou de la production de combustibles fossiles ;
- des sociétés qui génèrent 10 % ou plus de leur chiffre d'affaires à partir de la production et/ou distribution d'armes interdites et des sociétés qui génèrent tout chiffre d'affaires (a) d'armes prohibées conformément (i) à la Convention sur l'interdiction de l'emploi, du stockage, de la production et du transfert des mines antipersonnel et sur leur destruction et (ii) à la Convention sur l'interdiction des armes à sous-munitions, et (b) d'armes classées en tant qu'armes B ou C conformément à la Convention des Nations Unies sur l'interdiction des armes biologiques et à la Convention des Nations Unies sur l'interdiction des armes chimiques respectivement ; et
- les sociétés qui génèrent 5 % ou plus de leur chiffre d'affaires dans le secteur du tabac.

Le Fonds répond aux caractéristiques ESG qu'il promeut à travers la mise en œuvre des processus décrits ci-dessus.

Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^ (cessation d'activités le 17 novembre 2022)

Objectif d'investissement - Réaliser une croissance stable à long terme, composée de revenus réguliers et constants provenant de dividendes et d'intérêts, ainsi que d'une croissance du capital, à partir d'un portefeuille de titres d'infrastructure des marchés émergents.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit au moins 80 % de sa valeur liquidative dans des sociétés d'infrastructure par le biais d'actions et de titres liés à des participations cotées ou négociées sur des marchés réglementés et émis par des sociétés qui tirent au moins 50 % de leurs bénéfices avant intérêts, impôts et amortissements d'actifs situés dans des pays émergents, y compris l'Inde. Il est prévu qu'aucun pays émergent ne représente à lui seul plus de 40 % de la valeur liquidative du Fonds. Les actions et les titres liés à des participations dans lesquels le Fonds peut investir comprennent des actions ordinaires, des actions privilégiées, des certificats de dépôt, des droits, des bons de souscription et des billets de participation de sociétés d'infrastructure.

Le Fonds peut investir jusqu'à 20 % de sa valeur liquidative dans des titres négociés sur les marchés russes et les investissements dans des titres négociés sur les marchés russes ne seront effectués que dans des titres de participation qui sont cotés et/ou négociés à la Bourse de Moscou. Le Fonds peut investir dans des certificats de dépôt américains, internationaux et mondiaux (ADR / GDR) de sociétés cotées ou négociées sur un marché réglementé, tel que défini à l'Annexe III du Prospectus. Le Fonds peut investir jusqu'à 20 % de sa valeur liquidative dans des organismes de placement collectif fermés, tels que les FPI, dont les politiques d'investissement sont conformes à celles du Fonds. Les FPI dans lesquels le Fonds investira seront cotés ou négociés sur un marché réglementé. Le Fonds peut investir jusqu'à 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou actions d'autres OPCVM ouverts ou d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM, à condition que les politiques d'investissement et les dispositions relatives à la liquidité de ces organismes de placement collectif soient compatibles avec celles du Fonds.

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

Objectif d'investissement - Générer un revenu composé de dividendes et d'intérêts tout en faisant augmenter le capital à long terme.

Politiques d'investissement - Le Fonds investira au moins 80 % de sa valeur liquidative dans des sociétés d'infrastructure par l'intermédiaire d'actions et de titres apparentés aux actions cotés ou négociés sur les marchés réglementés des pays du G7 (États-Unis, Royaume-Uni, Japon, Allemagne, France, Italie et Canada), ainsi que d'actions et de titres apparentés aux actions cotés ou négociés sur les marchés réglementés d'autres pays développés et de pays émergents (ces derniers pouvant représenter jusqu'à 20 % de la valeur liquidative du Fonds). Les actions et les titres apparentés aux actions dans lesquels le Fonds peut investir comprennent des actions ordinaires, des actions privilégiées, des certificats de dépôt, des droits, des bons de souscription et des titres participatifs de sociétés d'infrastructure. Les titres participatifs ne sont généralement utilisés que lorsque l'accès direct aux actions d'un marché particulier est limité ou retardé, ce qui peut être le cas, par exemple, de l'Inde.

Le Fonds peut investir jusqu'à 20 % de sa valeur liquidative dans des FPI. Tout FPI dans lequel le Fonds investira sera coté ou négocié sur un marché réglementé. Le Fonds peut investir jusqu'à 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou actions d'autres OPCVM ouverts ou d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM, à condition que les politiques d'investissement et les dispositions en matière de liquidité de ces organismes de placement collectif soient compatibles avec celles du Fonds.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé en tant que Fonds régi par l'article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement Taxonomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement Taxonomie. Cependant, conformément à sa méthodologie ESG, le Fonds peut détenir des investissements qui cherchent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation au changement climatique.

Pour ce Fonds, les risques et opportunités ESG sont, dans la mesure du possible, pris en compte de deux manières principales. Premièrement, lors de l'évaluation des flux de trésorerie projetés par le gestionnaire de portefeuille en ce qui concerne les sociétés émettrices éligibles dans le cadre d'une évaluation fondamentale des titres. Deuxièmement, si les facteurs ESG ne peuvent pas être pris en compte dans ces flux de trésorerie prévisionnels, ils le seront par le biais d'un ajustement du rendement exigé, ou hurdle rate (taux de rendement minimum), de l'investissement. Dans ce cas, les facteurs ESG pertinents et la gestion de ces facteurs par la direction de la société sont évalués à partir d'une grille de notation exclusive élaborée par l'analyste compétent, qui déterminera l'ajustement du rendement exigé, ou taux directeur, applicable à chaque investissement éventuel.

Le gestionnaire de portefeuille appliquera son approche ESG à au moins 90 % du portefeuille du Fonds. Le Fonds maintient une notation ESG de portefeuille supérieure à celle de l'univers d'investissement. Conformément à l'approche d'évaluation du Fonds qui préconise une période de détention de cinq ans, la durabilité est évaluée à l'aide d'un score qui note la performance ESG actuelle en fonction des processus, politiques et pratiques en cours, et sur cinq ans en fonction des objectifs et politiques de l'entreprise. Cette approche permet de distinguer les sociétés dont les pratiques de durabilité devraient s'améliorer.

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – (suite)

Les scores ESG sont ensuite comparés à l'ensemble des sociétés. Les sociétés du premier quartile bénéficie d'une réduction du rendement exigé, ou taux directeur, selon une échelle mobile. Sur la base des scores ESG, les trois quartiles inférieurs sont pénalisés par une augmentation du rendement exigé, ou hurdle rate (taux de rendement minimum), selon une échelle mobile.

Près de 600 entreprises seront notées en fonction de leur liquidité, de leur exposition aux infrastructures et de leur qualité. Une fois que l'analyse de liquidité aura réduit cet univers d'environ 50 %, environ 10 % des sociétés restantes seront exclues en raison de leur faible exposition aux infrastructures, et les sociétés dont l'exposition aux activités non liées aux infrastructures est inacceptable seront exclues. En outre, 20 % des sociétés sont exclues en raison de la mauvaise qualité des infrastructures.

De plus, le Fonds n'investira pas dans :

- des sociétés qui tirent plus de 10 % de leur chiffre d'affaires de l'extraction ou de la production de combustibles fossiles ;
- des sociétés qui génère 10 % ou plus de leur chiffre d'affaires à partir de la production et/ou distribution d'armes interdites et des sociétés qui tirent des tout genre de bénéfice (a) d'armes prohibées conformément(i) à la Convention sur l'interdiction de l'emploi, du stockage, de la production et du transfert des mines antipersonnel et sur leur destruction et (ii) à la Convention sur l'interdiction des armes à sous-munitions, et (b) d'armes classées en tant qu'armes B ou C conformément à la Convention des Nations Unies sur l'interdiction des armes biologiques et à la Convention des Nations Unies sur l'interdiction des armes chimiques, respectivement ;
- les entreprises qui réalisent 5 % ou plus de leur chiffre d'affaires dans le secteur du tabac.

Le Fonds répond aux caractéristiques ESG qu'il promeut à travers la mise en œuvre des processus décrits ci-dessus.

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Objectif d'investissement - Réaliser une appréciation du capital à long terme.

Politiques d'investissement - Le Fonds investira au moins 70 % de sa valeur liquidative dans un portefeuille diversifié de titres participatifs émis par des sociétés américaines à faible capitalisation (c'est-à-dire des sociétés américaines dont la capitalisation boursière est inférieure à 3 milliards de dollars US) qui sont cotées ou négociées sur des marchés réglementés aux États-Unis. Le gestionnaire de portefeuille investira les actifs du Fonds dans ces sociétés afin de tirer parti de ce qu'il estime être des situations opportunistes pour des titres sous-évalués. Ces situations opportunistes pourraient inclure des redressements, des sociétés de croissance émergentes dont les bénéfices sont interrompus, des sociétés dont la valeur des actifs n'est pas reconnue ou des sociétés de croissance sous-évaluées. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM. Le gestionnaire de portefeuille utilisera une méthode fondée sur la valeur pour gérer les actifs du Fonds.

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

Objectif d'investissement - Réaliser une appréciation du capital à long terme.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit au moins deux tiers de sa valeur liquidative dans des titres participatifs émis par des sociétés américaines dont la capitalisation boursière est inférieure à 5 milliards de dollars américains, calculée au moment de l'investissement, et qui sont cotées ou négociées sur des marchés réglementés, comme indiqué dans l'annexe III du prospectus. Jusqu'à un tiers de la valeur liquidative du Fonds pourra être investi dans (i) des titres participatifs (y compris des actions ordinaires, des actions privilégiées et des titres convertibles) de sociétés dont la capitalisation boursière dépasse 5 milliards de dollars américains, calculée au moment de l'investissement, et qui sont cotées ou négociées sur des marchés réglementés, (ii) des titres de créance émis ou garantis par des gouvernements nationaux et leurs agences, instruments et subdivisions politiques, (iii) des titres de créance de sociétés d'émetteurs situés sur des marchés réglementés ou dont les titres sont cotés ou négociés sur des marchés réglementés, et (iv) des liquidités à des fins de gestion efficace du portefeuille. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds, calculée au moment de l'investissement, sera investi dans des titres d'émetteurs cotés ou négociés sur des marchés réglementés en dehors des États-Unis. En outre, un maximum de 5 % de la valeur liquidative du Fonds pourra être investi dans des titres de créance dont la classification est inférieure à « Investment Grade » (catégorie investissement) au moment de l'achat. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM.

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund

Objectif d'investissement - Rechercher une appréciation du capital à long terme.

Politiques d'investissement - Le Fonds investira au moins 80 % de sa valeur liquidative dans des sociétés à faible capitalisation ayant leur siège social dans des pays du monde entier et qui sont cotées ou négociées sur des marchés réglementés. Le gestionnaire de portefeuille considérera les sociétés à faible capitalisation comme étant celles dont la capitalisation boursière n'est pas supérieure à celle de la plus grande société de l'indice MSCI ACWI Small-Cap (« indice de référence ») au moment de sa dernière reconstitution. Le gestionnaire de portefeuille adoptera une stratégie d'investissement qui met l'accent sur les sociétés qui, à son avis, bénéficieront d'avantages concurrentiels et de rendements durablement élevés sur le capital investi, ce qui, selon lui, augmentera la valeur de ces sociétés au fil du temps. En outre, le gestionnaire de portefeuille recherchera des sociétés qu'il considère comme ayant un profil financier attrayant, y compris des sociétés présentant les caractéristiques suivantes : (i) des bilans prudents ; (ii) une allocation prudente du capital ; et (iii) des opportunités de réinvestissement attrayantes.

Le Fonds investira au maximum 60 % de sa valeur liquidative dans des sociétés ayant leur siège aux États-Unis. Dans des conditions de marché normales, le Fonds investira au moins 40 % de sa valeur liquidative dans des sociétés ayant leur siège dans au moins trois pays différents en dehors des États-Unis. Le Fonds peut également investir jusqu'à 30 % de sa valeur liquidative dans des sociétés ayant leur siège dans des pays émergents.

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^a (a cessé ses activités le 11 juillet 2022)

Objectif d'investissement - Réaliser une appréciation du capital à long terme.

Politiques d'investissement - Le Fonds investira à tout moment au moins deux tiers de sa valeur liquidative dans des actions de sociétés cotées ou négociées sur des marchés réglementés et domiciliées ou exerçant une part prépondérante de leurs activités économiques en Europe, y compris, mais sans s'y limiter, en Autriche, en Belgique, au Danemark, en Finlande, en France, en Allemagne, en Grèce, en Hongrie, en Irlande, en Italie, aux Pays-Bas, en Norvège, en Pologne, au Portugal, en Espagne, en Suède, en Suisse et au Royaume-Uni, sous réserve des restrictions applicables aux investissements effectués par des étrangers. Le Fonds cherche à atteindre son objectif d'investissement en investissant principalement dans des titres de sociétés considérées comme offrant des opportunités attrayantes d'appréciation du capital à long terme. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM.

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

Objectif d'investissement - Réaliser une appréciation du capital à long terme.

Politiques d'investissement - Le Fonds investira au moins deux tiers de sa valeur liquidative dans des titres participatifs cotés ou négociés sur des marchés réglementés de sociétés domiciliées ou exerçant une part prépondérante de leurs activités économiques dans un ou plusieurs des pays asiatiques émergents suivants, sous réserve des restrictions applicables établies par ces pays en matière d'investissements par des investisseurs étrangers : Chine, Hong Kong, Indonésie, Malaisie, Philippines, Singapour, Corée du Sud, Taïwan, Inde, Thaïlande, Australie et Nouvelle-Zélande. En outre, le Fonds peut, de temps à autre, investir dans des titres participatifs de sociétés domiciliées au Pakistan et au Sri Lanka. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds pourra être investi dans des obligations indexées sur des actions ou des obligations structurées qui sont des valeurs mobilières dont l'exposition sous-jacente peut être des titres participatifs.

Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^a (a cessé ses activités le 27 avril 2022)

Objectif d'investissement - Générer une appréciation du capital à long terme.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit à tout moment au moins 70 % de sa valeur liquidative dans des titres participatifs (y compris des actions ordinaires et des actions privilégiées) de sociétés domiciliées et cotées ou négociées sur un marché réglementé dans n'importe quel pays du monde. Pour atteindre l'objectif d'investissement du Fonds, le gestionnaire de portefeuille investira principalement dans des sociétés domiciliées et cotées dans des pays développés et cherchera à investir dans des sociétés domiciliées dans des pays développés et des pays émergents, et ce en diversifiant les secteurs choisis. Bien qu'il n'y ait pas de restrictions en matière de capitalisation, le Fonds cherchera

^a Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] (a cessé ses activités le 27 avril 2022) – (suite)

à investir principalement dans des sociétés à forte capitalisation. Un maximum de 10 % de la valeur liquidative du Fonds peut être investi dans des parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM.

Le Fonds pourra avoir un effet de levier pouvant atteindre jusqu'à 100 % de sa valeur liquidative (telle que calculée selon l'approche par les engagements) en raison de l'utilisation d'instruments dérivés. L'exposition maximale du Fonds aux échanges de rendement total, sur la base de la valeur nominale de ces instruments, sera de 20 % de sa valeur liquidative.

Le Fonds peut investir dans certaines actions A chinoises éligibles par l'intermédiaire du Shanghai-Hong Kong Stock Connect et/ou du Shenzhen-Hong Kong Stock Connect (ensemble les « Stock Connect »). L'exposition aux actions A chinoises par l'intermédiaire des Stock Connects ne dépassera pas 10 % de la valeur liquidative du Fonds. Le Fonds peut également être exposé indirectement aux actions A chinoises. L'exposition globale aux titres russes et aux actions A chinoises ne dépassera pas 15 % de la valeur liquidative du Fonds.

FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund

Objectif d'investissement - Capter la croissance du produit intérieur brut (« PIB ») asiatique et offrir un profil risque/rendement attrayant dans un marché historiquement volatil en utilisant une stratégie d'actions uniquement à long terme.

Politiques d'investissement - Le Fonds investit au moins 80 % de sa valeur liquidative dans des actions, que ce soit directement ou indirectement par le biais de titres liés à des actions ou de positions à long terme sur des instruments financiers dérivés sur des actions et des titres liés à des actions, qui sont (i) cotées ou négociées sur des marchés réglementés situés en Chine continentale, à Hong Kong, en Inde, en Indonésie, en Malaisie, Malaisie, Philippines, Singapour, Corée du Sud, Taiwan et Thaïlande (ensemble, les « pays principaux ») ou (ii) cotés ou négociés sur des Marchés réglementés situés dans des pays autres que les pays principaux, mais émis par des sociétés dont les activités principales sont menées dans les pays principaux ou qui y réalisent la majorité de leurs bénéfices. Le Fonds peut investir dans des actions chinoises (c'est-à-dire des actions émises par des sociétés domiciliées en Chine ou tirant la majeure partie de leurs revenus de ce pays), y compris certaines actions A chinoises éligibles par l'intermédiaire du Shanghai-Hong Kong Stock Connect et/ou du Shenzhen-Hong Kong Stock Connect (ensemble les « Stock Connects »). Il n'y a pas de limite à l'exposition globale maximale aux actions chinoises, y compris par le biais des Stock Connects.

Le Fonds peut investir jusqu'à 20 % de sa valeur liquidative au total : Instruments du marché monétaire, dépôts, produits dérivés et parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM, à condition que le Fonds investisse pas plus de 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou actions de ces autres organismes de placement collectif. Le Fonds ne prendra aucune position courte.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé en tant que Fonds régi par l'article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement Taxonomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement Taxonomie. Cependant, conformément à sa méthodologie ESG, le Fonds peut détenir des investissements qui cherchent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation au changement climatique.

Le gestionnaire de portefeuille évalue les facteurs ESG qui pourraient avoir un impact sur la capacité de l'émetteur à générer des rendements durables futurs. Ces caractéristiques sont évaluées à la fois quantitativement et qualitativement, par le biais du système de notation ESG du gestionnaire de portefeuille et de son processus de recherche et d'engagement direct. Les notations ESG exclusives sont fondées sur une analyse prospective, les entreprises se voyant attribuer une note de risque pour la gouvernance et le développement durable (environnemental et social) allant de 1 (risque faible) à 5 (risque élevé), après examen des facteurs de durabilité liés à l'environnement, aux affaires sociales et à la gouvernance d'entreprise. Les sociétés dont la note de risque de durabilité est égale ou supérieure à 4 ne seront pas incluses dans le Fonds. Les sociétés dont la note de risque de durabilité est égale ou supérieure à 4 ne seront pas incluses dans le Fonds.

De plus, le Fonds n'investira pas dans :

- les entreprises qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production de tabac ;
- les entreprises qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de leur implication directe dans l'extraction de combustibles fossiles ;
- les entreprises qui tirent une partie de leur chiffre d'affaires de l'extraction de métaux et de minéraux tels que définis par les sous-industries GICS, des métaux et minéraux diversifiés, du cuivre, de l'or et des métaux précieux, et des minéraux ;
- les entreprises impliquées dans la production, la vente ou la distribution de composants dédiés et essentiels de mines antipersonnel et d'armes à sous-munitions ; et
- les entreprises évaluées comme « en échec » en vertu du Pacte mondial des Nations Unies.

Le gestionnaire de portefeuille applique son processus ESG (telle que décrit ci-dessus) à 100 % du portefeuille du Fonds. Le Fonds maintient une notation ESG de portefeuille supérieure à celle de l'univers d'investissement.

Le gestionnaire de portefeuille devra faire en sorte que le portefeuille du Fonds soit généralement composé de 20 à 40 émetteurs différents, bien que le Fonds puisse contenir moins de 20 émetteurs ou plus de 40 émetteurs dans certaines circonstances.

Le Fonds répond aux caractéristiques ESG qu'il promeut à travers la mise en œuvre des processus décrits ci-dessus.

FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund

Objectif d'investissement - Produire une appréciation du capital à long terme.

Politiques d'investissement – Le Fonds investira au moins 80 % de sa valeur liquidative dans des actions, que ce soit directement ou indirectement par le biais de titres liés à des actions ou de positions à long terme dans des instruments financiers dérivés sur des actions et des titres liés à des actions qui sont cotés ou négociés sur des marchés réglementés situés n'importe où dans le monde (y compris dans les pays émergents), comme indiqué dans l'Annexe III du Prospectus. Le gestionnaire de portefeuille s'intéressera principalement aux sociétés qui : (1) lui semblent être à même de générer ou de maintenir un rendement élevé du capital investi, supérieur au coût moyen pondéré du capital ; (2) dont le goodwill ne constitue pas le principal actif du bilan ; et (3) dont le flottant est supérieur à 3 milliards USD.

Le Fonds peut investir jusqu'à 20 % de sa valeur liquidative au total : Instruments du marché monétaire, dépôts et parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM, à condition que le Fonds investisse pas plus de 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou actions de ces autres organismes de placement collectif. Le Fonds peut investir dans des actions chinoises (c'est-à-dire des actions émises par des sociétés domiciliées en Chine ou tirant la majeure partie de leurs revenus de ce pays), y compris certaines actions A chinoises éligibles par l'intermédiaire du Shanghai-Hong Kong Stock Connect et/ou du Shenzhen-Hong Kong Stock Connect (ensemble les « Stock Connects »). L'investissement indirect maximum dans les actions A chinoises sera limité à 10 % de la valeur liquidative du Fonds. Il n'y a pas de limite à l'exposition globale maximale aux actions chinoises, y compris par le biais des Stock Connects.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé en tant que Fonds régi par l'article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement Taxonomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement Taxonomie. Cependant, conformément à sa méthodologie ESG, le Fonds peut détenir des investissements qui cherchent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation au changement climatique.

Le gestionnaire de portefeuille évalue les facteurs ESG qui pourraient avoir un impact sur la capacité de l'émetteur à générer des rendements durables futurs. Ces caractéristiques sont évaluées à la fois quantitativement et qualitativement, par le biais du système de notation ESG du gestionnaire de portefeuille et de son processus de recherche et d'engagement direct. Les notations ESG exclusives sont fondées sur une analyse prospective, les entreprises se voyant attribuer une note de risque pour la gouvernance et le développement durable (environnemental et social) allant de 1 (risque faible) à 5 (risque élevé), après examen des facteurs de durabilité liés à l'environnement, aux affaires sociales et à la gouvernance d'entreprise. Les sociétés dont la note de risque de durabilité ou de gouvernance est égale ou supérieure à 4 ne seront pas incluses dans le Fonds.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^] – (suite)

De plus, le Fonds n'investira pas dans :

- les entreprises qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production, de la distribution ou de la vente en gros de tabac ;
- les entreprises qui tirent un chiffre d'affaires de la production ou de la distribution d'armes controversées (p. ex. mines antipersonnel, armes nucléaires, armes chimiques ou biologiques et armes à sous-munitions) ;
- les entreprises qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production ou de la distribution d'armes conventionnelles ;
- les entreprises qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production de combustibles fossiles ;
- les entreprises qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production d'électricité à base de charbon, ou de l'exploitation minière ou de la distribution de charbon thermique ;
- les entreprises qui tirent une partie de leur chiffre d'affaires de l'extraction de métaux et de minéraux tels que définis par les sous-industries GICS, des métaux et minéraux divers, du cuivre, de l'or et des métaux précieux, et des minéraux ;
- les entreprises qui tirent 15 % ou plus de leur chiffre d'affaires de la production d'énergie nucléaire ; et
- les entreprises évaluées comme « en échec » en vertu du Pacte mondial des Nations Unies.

Le gestionnaire de portefeuille applique son processus ESG (telle que décrit ci-dessus) à 100 % du portefeuille du Fonds. Le Fonds maintient une notation ESG de portefeuille supérieure à celle de l'univers d'investissement.

Le Fonds répond aux caractéristiques ESG qu'il promeut à travers la mise en œuvre des processus décrits ci-dessus.

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund

Objectif d'investissement - Fournir un revenu. L'appréciation du capital à long terme est un objectif secondaire.

Politiques d'investissement - Le Fonds investira au moins 80 % de sa valeur liquidative dans des actions et des titres apparentés aux actions (y compris des actions privilégiées, des trusts australiens et des titres agrafés, des FPI, des certificats de dépôt et des bons de souscription d'actions à faible prix d'exercice) qui sont (i) cotés ou négociés sur des marchés réglementés (comme indiqué dans l'Annexe III du Prospectus) situés dans la région Asie-Pacifique (ex-Japon), qui comprend les pays représentés dans l'indice MSCI AC Asia Pacific ex Japan ou (ii) cotés ou négociés sur des marchés réglementés (comme indiqué dans l'annexe III du prospectus) situés en dehors de la région Asie-Pacifique (excepté le Japon), mais émis par des sociétés dont les activités principales sont menées dans des pays représentés dans l'indice MSCI AC Asia Pacific, excepté le Japon. Cet indice est actuellement composé d'environ 1 200 sociétés à forte et moyenne capitalisation de 13 pays de la région Asie-Pacifique (excepté le Japon). L'indice comprend actuellement quatre pays développés et neuf pays émergents, de sorte que le Fonds peut avoir une exposition significative aux titres des marchés émergents. La stratégie du gestionnaire de portefeuille se concentre sur les émetteurs de trois secteurs principaux : (1) les FPI, tels que les centres commerciaux, les immeubles de bureaux et les bâtiments industriels ; (2) les infrastructures, tels que les routes à péage, les ports de navigation, les aéroports et les chemins de fer ; et (3) les services publics, tels que les réseaux de gaz et d'électricité et les générateurs. De temps en temps, le Fonds pourra investir dans des actions privilégiées lorsque le gestionnaire de portefeuille estime que ces titres offrent une opportunité de rendement attrayante tout en respectant l'objectif d'investissement du Fonds. Le montant total investi dans ces actifs ne dépassera pas 20 % de la valeur liquidative du Fonds. Le Fonds peut investir un maximum de 50 % de sa valeur liquidative au total dans des actions et des titres apparentés aux actions (y compris des actions privilégiées, des fiducies australiennes et des titres agrafés, des FPI et bons à faible prix d'exercice sur des titres participatifs) (i) cotés ou négociés sur des marchés réglementés (comme indiqué dans l'Annexe III du Prospectus) situés en Australie ou en Nouvelle-Zélande ou (ii) cotés ou négociés sur des marchés réglementés (comme indiqué dans l'Annexe III du Prospectus) situés en dehors de l'Australie et de la Nouvelle-Zélande mais émis par des sociétés dont les activités principales sont menées en Australie ou en Nouvelle-Zélande. Le Fonds peut investir un maximum de 60 % de sa valeur liquidative au total dans des FPI et des titres liés à l'immobilier (actions et titres liés aux actions (y compris les actions privilégiées, les trusts australiens et les titres agrafés, ainsi que les bons de souscription d'actions à faible prix d'exercice) de sociétés immobilières telles qu'elles sont incluses dans le groupe d'industries 6010 - Immobilier du Global Industry Classification Standard (GICS) de MSCI). Le Fonds pourra investir jusqu'à 20 % de sa valeur liquidative au total dans le suivant : Instruments du marché monétaire, dépôts, produits dérivés et parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM, à condition que le Fonds ne puisse pas investir plus de 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou actions de ces autres organismes de placement collectif, et que les investissements dans ces organismes aient pour but d'obtenir une exposition aux types d'instruments décrits dans le présent document ou de poursuivre l'objectif et les politiques d'investissement du Fonds. Le Fonds peut investir dans des actions chinoises (c'est-à-dire des actions émises par des sociétés domiciliées en Chine ou tirant la majeure partie de leurs revenus de ce pays), y compris certaines actions A chinoises éligibles par l'intermédiaire du Shanghai-Hong Kong Stock Connect et/ou du Shenzhen-Hong Kong Stock Connect (ensemble les « Stock Connects »). L'exposition globale maximale du Fonds aux actions chinoises, y compris par l'intermédiaire des Stock Connects, ne dépassera pas 75 % de la valeur liquidative du Fonds.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé en tant que Fonds régi par l'article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement Taxonomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement Taxonomie. Cependant, conformément à sa méthodologie ESG, le Fonds peut détenir des investissements qui cherchent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation au changement climatique.

Le gestionnaire de portefeuille analysera les caractéristiques et les facteurs ESG. Ces caractéristiques et facteurs seront évalués à la fois quantitativement et qualitativement, par le biais du système de notation ESG du gestionnaire de portefeuille et de sa méthode de recherche et d'engagement direct. Le gestionnaire de portefeuille évalue les facteurs ESG qui pourraient avoir un impact sur la capacité de l'émetteur à générer des rendements durables futurs. Les notations ESG exclusives sont fondées sur une analyse prospective, les entreprises se voyant attribuer une note de risque pour la gouvernance et le développement durable (environnemental et social) allant de 1 (risque faible) à 5 (risque élevé), après examen des facteurs de durabilité liés à l'environnement, aux affaires sociales et à la gouvernance d'entreprise. Les sociétés dont la note de risque de durabilité est égale ou supérieure à 5 ne seront pas incluses dans le Fonds.

De plus, le Fonds n'investira pas dans :

- les entreprises qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production de tabac ;
- les entreprises qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production d'armes ;
- les entreprises qui font partie de la catégorie Pétrole, gaz et combustibles consommables du GICS ;
- les entreprises impliquées dans la production, la vente ou la distribution de composants spécialisés et essentiels de mines antipersonnel et d'armes à sous-munitions ; et
- les entreprises évaluées comme « en échec » en vertu du Pacte mondial des Nations Unies.

Le gestionnaire de portefeuille applique son processus ESG (telle que décrit ci-dessus) à 100 % du portefeuille du Fonds. Le Fonds maintient une notation ESG de portefeuille supérieure à celle de l'univers d'investissement.

Le Fonds répond aux caractéristiques ESG qu'il promeut à travers la mise en œuvre des processus décrits ci-dessus.

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]

Objectif d'investissement - Générer une croissance du capital à long terme.

Politiques d'investissement - Le Fonds investira au moins 80 % de sa valeur liquidative dans des actions (y compris des bons de souscription) cotées ou négociées sur un marché réglementé, dont l'émetteur est domicilié ou tire la majeure partie de ses revenus dans un pays inclus dans l'indice MSCI Emerging Markets, ou dont le marché réglementé sur lequel l'action est cotée ou négociée est situé dans un pays inclus dans l'indice MSCI Emerging Markets. L'indice MSCI Emerging Markets regroupe les sociétés à moyenne ou grande capitalisation dans plus de 20 marchés émergents, et est rééquilibré sur une base annuelle. Les investissements en actions du Fonds peuvent s'effectuer directement ou indirectement par le biais de titres apparentés (y compris les ADR et les GDR), ou de positions longues sous la forme de produits dérivés d'actions ou de titres apparentés. Les investissements dans les ADR et les GDR ne dépasseront pas 15 % de la valeur liquidative du Fonds.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^ – (suite)

Le Fonds peut investir jusqu'à 20 % de sa valeur liquidative au total : instruments du marché monétaire, dépôts et parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM, à condition que le Fonds investisse pas plus de 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou actions de ces autres organismes de placement collectif.

Le Fonds peut investir dans des actions chinoises (c'est-à-dire des actions émises par des sociétés domiciliées en Chine ou tirant la majeure partie de leurs revenus de ce pays), y compris certaines actions A chinoises éligibles par l'intermédiaire du Shanghai-Hong Kong Stock Connect et/ou du Shenzhen-Hong Kong Stock Connect (ensemble les « Stock Connects »). L'exposition maximale aux actions chinoises, y compris par l'intermédiaire des Stock Connects, correspond à la représentation des actions chinoises dans l'indice MSCI Emerging Markets, majorée de 10 %.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé en tant que Fonds régi par l'article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement Taxonomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement Taxonomie. Cependant, conformément à sa méthodologie ESG, le Fonds peut détenir des investissements qui cherchent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation au changement climatique.

Le gestionnaire de portefeuille analysera les caractéristiques et les facteurs ESG. Ces caractéristiques et facteurs seront évalués à la fois quantitativement et qualitativement, par le biais du système de notation ESG du gestionnaire de portefeuille et de sa méthode de recherche et d'engagement direct. Le gestionnaire de portefeuille évaluera les facteurs ESG qui pourraient avoir un impact sur la capacité de l'émetteur à générer des rendements durables futurs. Ces caractéristiques sont évaluées à la fois quantitativement et qualitativement, par le biais du système de notation ESG du gestionnaire de portefeuille et de son processus de recherche et d'engagement direct. Les notations ESG exclusives sont fondées sur une analyse prospective, les entreprises se voyant attribuer une note de risque pour la gouvernance et le développement durable (environnemental et social) allant de 1 (risque faible) à 5 (risque élevé), après examen des facteurs de durabilité liés à l'environnement, aux affaires sociales et à la gouvernance d'entreprise. Les sociétés dont la note de risque de durabilité ou de gouvernance est égale ou supérieure à 4 ne seront pas incluses dans le Fonds.

De plus, le Fonds n'investira pas dans :

- les entreprises qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production, de la distribution ou de la vente en gros de tabac ;
- les entreprises qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production ou de la distribution d'armes ;
- les entreprises qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production d'électricité à base de charbon, ou de l'exploitation minière ou de la distribution de charbon thermique ;
- les entreprises impliquées dans la production, la vente ou la distribution de composants spécialisés et essentiels à la production d'armes controversées (mines antipersonnel, biologiques, chimiques et armes à sous-munitions) ;
- les entreprises évaluées comme « en échec » en vertu du Pacte mondial des Nations Unies.

Le gestionnaire de portefeuille applique son processus ESG (telle que décrit ci-dessus) à 100 % du portefeuille du Fonds. Le Fonds maintient une notation ESG de portefeuille supérieure à celle de l'univers d'investissement.

Le Fonds répond aux caractéristiques ESG qu'il promeut à travers la mise en œuvre des processus décrits ci-dessus.

FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^

Objectif d'investissement - Offrir une appréciation du capital à long terme en investissant dans un portefeuille concentré composé principalement d'actions européennes.

Politiques d'investissement – Le Fonds investira au moins 80 % de sa valeur liquidative dans des actions de sociétés domiciliées ou cotées en Europe, ou qui exercent la majeure partie de leur activité économique en Europe. Cet investissement peut être direct ou indirect par le biais de titres assimilés à des actions, de certificats de dépôt ou d'organismes de placement collectif, ou de positions longues par le biais d'instruments dérivés. Le Fonds investira dans des sociétés qui, selon le gestionnaire de portefeuille et conformément à sa stratégie d'investissement, (i) ont le potentiel de générer ou de maintenir un rendement élevé du capital investi (ROIC) supérieur à leur coût moyen pondéré du capital ; (ii) ont le potentiel d'offrir un profil de croissance et/ou de génération de trésorerie attractif à long terme ; et (iii) sont censées avoir des pratiques comptables et des pratiques environnementales, sociales et de gouvernance favorables. Le Fonds pourra investir dans des contrats à terme sur indices boursiers européens à des fins de gestion efficace de portefeuille et dans des bons de souscription à faible prix d'exercice à des fins d'investissement, par exemple lorsque l'accès au marché local par le biais d'un compte-titres local n'est pas possible ou n'est pas souhaitable. Les contrats de change à terme ne peuvent être utilisés que pour les catégories d'actions couvertes proposées par le Fonds. Le Fonds n'investira pas dans d'autres types de produits dérivés.

Le Fonds peut investir jusqu'à 20 % de sa valeur liquidative au total : instruments du marché monétaire, dépôts, produits dérivés, actions non-européennes et parts ou actions d'autres organismes de placement collectif au sens du règlement 68(1)(e) des règlements sur les OPCVM, à condition que le Fonds ne puisse pas investir plus de 10 % de sa valeur liquidative dans des parts ou actions de ces autres organismes de placement collectif, et que les investissements dans ces organismes aient pour but d'obtenir une exposition à des actions européennes ou de poursuivre l'objectif et les politiques d'investissement du Fonds. Le Fonds pourra investir jusqu'à 10 % de sa valeur liquidative dans des titres émis par des émetteurs russes.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé en tant que Fonds régi par l'article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement Taxonomie à l'heure actuelle et, par conséquent, il peut n'y avoir aucun investissement dont les activités économiques sont qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement Taxonomie. Cependant, conformément à sa méthodologie ESG, le Fonds peut détenir des investissements qui cherchent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation au changement climatique.

Le gestionnaire de portefeuille analysera les caractéristiques et les facteurs ESG. Ces caractéristiques sont évaluées à la fois quantitativement et qualitativement, par le biais du système de notation ESG du gestionnaire de portefeuille et de son processus de recherche et d'engagement direct.

Une prise en compte supplémentaire des caractéristiques environnementales et sociales des investissements est obtenue en examinant les investissements au niveau d'un portefeuille pour y déceler d'éventuelles expositions positives ou négatives.

Les notations ESG exclusives sont fondées sur une analyse prospective, les entreprises se voyant attribuer une note de risque pour la gouvernance et le développement durable (environnemental et social) allant de 1 (risque faible) à 5 (risque élevé), après examen des facteurs de durabilité liés à l'environnement, aux affaires sociales et à la gouvernance d'entreprise (comme décrit dans la section du Prospectus intitulée Risques liés au développement durable). Les sociétés dont la note de risque de durabilité ou de gouvernance est égale ou supérieure à 4 ne seront pas incluses dans le Fonds.

De plus, le Fonds n'investira pas dans :

- les entreprises qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production, de la distribution ou de la vente en gros de tabac ;
- les entreprises qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production ou de la distribution d'armes ;
- les entreprises qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production de combustibles fossiles ;
- les entreprises qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production d'électricité à base de charbon, ou de l'exploitation minière ou de la distribution de charbon thermique ;
- les entreprises qui fabriquent ou distribuent des armes controversées (p. ex. mines antipersonnel, armes nucléaires, armes chimiques ou biologiques et armes à sous-munitions) ;
- les entreprises qui tirent plus de 15 % de leur chiffre d'affaires de la production d'énergie nucléaire ; et
- les entreprises qui tirent une partie de leur chiffre d'affaires de l'extraction de métaux et de minéraux tels que définis par les sous-industries GICS, des métaux et minerais divers, du cuivre, de l'or et des métaux précieux, et des minéraux.

Le Fonds répond aux caractéristiques ESG qu'il promeut à travers la mise en œuvre des processus décrits ci-dessus.

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Rapport des Administrateurs (révisé) – (suite)

Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]

Objectif d'investissement – Générer des revenus tout en cherchant à préserver le capital.

Politiques d'investissement – Le Fonds investira dans un portefeuille diversifié de titres de créance à revenu fixe de pays développés et émergents libellés en euros, à savoir des billets à ordre librement transférables, des obligations non garanties, des obligations à taux fixe et variable, des obligations à coupon zéro, des billets non convertibles (c'est-à-dire des billets qui peuvent ne pas être convertis en titres de capital de l'émetteur concerné), des Credit linked notes, des billets de trésorerie, des certificats de dépôt et des acceptations bancaires ; des opérations de pension avec des titres de créance comme instruments sous-jacents (uniquement à des fins de gestion efficace de portefeuille) ; des titres à coupon détaché de type STRIPS et titres indexés sur l'inflation (c'est-à-dire des titres ajustés périodiquement en fonction des mouvements généraux de l'inflation dans le pays d'émission, veuillez consulter la section du Prospectus de Base intitulée « Titres protégés contre l'inflation ») ; libellés en euros, émis par des émetteurs souverains, quasi souverains, supranationaux et privés cotés ou négociés sur des Marchés Réglementés. Le Fonds pourra investir jusqu'à 30 % de sa valeur liquidative dans des obligations émises par des pays émergents. Les titres de créance dans lesquels le Fonds investira seront principalement de nature non convertible.

La stratégie consistera à générer un revenu au cours d'une période donnée, en veillant à minimiser le risque d'émetteur unique grâce à un portefeuille très diversifié. Les titres sont sélectionnés afin de maintenir un niveau de diversification prudent parmi les secteurs et les émetteurs qui, selon le Gestionnaire de portefeuille, présentent des fondamentaux intéressants ; plus précisément, lorsque les titres ont un rendement intéressant par rapport à la perception du Gestionnaire de portefeuille du crédit sous-jacent ainsi que des niveaux de rendement généraux disponibles sur le marché, et que leur solvabilité est jugée suffisante pour effectuer des versements de revenu et rembourser le capital à échéance. Le Fonds poursuivra son objectif et sa politique d'investissement pendant une période de cinq ans suivant son lancement (la « Date d'échéance »).

Le Fonds investira au moins 60 % de sa valeur liquidative, conformément au deuxième paragraphe, dans des titres de créance notés en dessous de BBB par S&P, au dessus de Baa3 par Moody's ou en dessous de BBB par Fitch ou, s'ils ne sont pas notés, considérés comme étant de qualité comparable par le Gestionnaire de portefeuille, tout en visant également à obtenir une notation moyenne d'au moins d'Investment Grade. Le Fonds acquerra uniquement des titres de créance, tels que mentionnés au deuxième paragraphe, notés au minimum B- par S&P, B3 par Moody's ou B- par Fitch ou, s'ils ne sont pas notés, considérés comme étant de qualité comparable par le Gestionnaire de portefeuille. Le Fonds pourra investir jusqu'à 10 % de sa valeur liquidative dans des titres de créance notés B- par S&P, B3 par Moody's ou B- par Fitch (y compris les sous-catégories ou les grades).

Le Fonds pourra également acquérir des titres convertibles (à l'exclusion des obligations convertibles contingentes) jusqu'à 10 % maximum de sa valeur liquidative. Le Fonds pourra investir dans des instruments du marché monétaire, y compris dans des OPCVM du marché monétaire ou dans des organismes de placement collectif éligibles au sens du Règlement 68(1)(e) du Règlement sur les OPCVM libellés en euros. Le Fonds pourra également investir dans certains types d'instruments dérivés, tel que décrit à la section intitulée « Techniques et instruments d'investissement et Instruments financiers dérivés » du Prospectus de Base, mais uniquement à des fins de gestion efficace de portefeuille.

Le Fonds promeut les caractéristiques environnementales et est classé en tant qu'Article 8 conformément au Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité ((UE) 2019/2088).

Les investissements sous-jacents au Fonds ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du Règlement Taxonomie à l'heure actuelle et, par conséquent, la proportion d'investissements pouvant être qualifiés d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du Règlement Taxonomie est égale à zéro. Cependant, conformément à sa méthodologie ESG, le Fonds peut détenir des investissements qui cherchent à contribuer à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation au changement climatique.

Taxonomie

Transparence des investissements durables dans les rapports périodiques

Conformément à sa méthodologie d'investissement en matière d'ESG, un Fonds relevant de l'article 8 peut être composé de titres contribuant à l'atténuation et à l'adaptation au changement climatique. En raison du manque de données fiables, opportunes et vérifiables, il n'est actuellement pas possible de déterminer comment et dans quelle mesure les activités des investissements sous-jacents relèvent d'activités économiques qualifiées d'écologiquement durables en vertu du règlement (UE) 2020/852 du Parlement européen et du Conseil du 18 juin 2020 relatif à l'établissement d'un cadre pour favoriser l'investissement durable, et modifiant le règlement (UE) 2019/2088, tel qu'il peut être modifié de temps à autre (le « règlement relatif à la taxonomie ») et il n'est donc pas possible de s'engager sur une proportion minimale d'investissements sous-jacents d'un Fonds relevant de l'article 8 qui tiennent compte des critères de l'UE pour les activités économiques écologiquement durables, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du règlement relatif à la taxonomie.

Les investissements sous-jacents aux Fonds visés par le présent rapport périodique « RTS » ne tiennent pas compte des critères de l'UE relatifs aux activités économiques durables sur le plan environnemental, y compris les activités habilitantes ou transitoires, au sens du règlement (UE) 2020/852 (le « règlement relatif à la taxonomie ») à l'heure actuelle ; par conséquent, il est possible qu'il n'y ait aucun investissement dont les activités économiques soient qualifiées d'activités économiques durables sur le plan environnemental en vertu du règlement relatif à la taxonomie (veuillez vous référer aux sections consacrées à la taxonomie de l'UE dans les rapports périodiques RTS ci-dessous). Cependant, conformément à sa méthodologie d'investissement en matière d'ESG, un Fonds relevant de l'article 8 peut être composé de titres contribuant à l'atténuation et à l'adaptation au changement climatique. Les investisseurs sont invités à noter que le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu du règlement Taxonomie s'applique uniquement aux investissements du Fonds régis par l'article 8 qui prennent en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents de la part restante du d'un Fonds relevant de l'article 8 ne prennent pas en compte les critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental aux termes du Règlement Taxonomie. La déclaration ci-dessus s'applique aux Fonds suivants relevant de l'article 8 : FTGF Western Asset US Core Bond Fund, FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund, FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund, FTGF Western Asset US High Yield Fund, FTGF Western Asset Global High Yield Fund, FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund, FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^], FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^], FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^], FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund, FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^], FTGF ClearBridge Value Fund, FTGF ClearBridge US Appreciation Fund, FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund, FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund, FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^], FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund, FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] et Franklin Responsible Income 2028[^].

Les investissements sous-jacents aux autres Fonds, non énumérés ci-dessus, ne tiennent pas compte des critères de l'UE en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Une description plus détaillée des politiques d'investissement de chaque Fonds est présentée dans le Prospectus concerné.

Au nom du Conseil d'administration

Fionnuala Doris
Administratrice

Joseph Keane
Administrateur

30 juin 2023

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Rapport des Auditeurs indépendants

Rapport des Auditeurs indépendants aux membres de Franklin Templeton Funds Plc

Rapport de l'audit des états financiers

Avis

À notre avis, les états financiers de Templeton Global Funds Plc :

- sont représentatifs de l'actif, du passif et de la position financière de la Société et des compartiments au 28 février 2023 ainsi que de leurs résultats constatés sur l'exercice clos ;
- ont été dûment établis conformément aux pratiques comptables généralement admises en Irlande (les normes comptables publiées par le Financial Reporting Council du Royaume-Uni, y compris la norme d'information financière 102, « la norme d'information financière applicable au Royaume-Uni et en République d'Irlande » et le droit irlandais) ;
- ont été dûment établis conformément aux obligations de la Loi sur les sociétés de 2014 et aux réglementations de 2011 sur les OPCVM « European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 », dans leur version en vigueur.

Nous avons vérifié les états financiers, inclus dans le Rapport annuel et les États financiers vérifiés, qui comprennent :

- l'état de la situation financière au 28 février 2023 ;
- l'état du résultat global pour l'exercice clos à cette date ;
- l'état des variations de l'actif net imputables aux détenteurs d'actions participatives rachetables pour l'exercice clos à cette date ;
- le portefeuille d'investissements pour chacun des compartiments au 28 février 2023 ;
- les notes aux états financiers de la Société et de chacun de ses compartiments, lesquelles incluent une description des principales méthodes comptables.

Fondement de notre opinion

Nous avons procédé à notre audit conformément aux normes internationales d'audit (Irlande) (« ISA (Irlande) ») et à la loi applicable.

Nos responsabilités en vertu des ISA (Irlande) sont décrites plus en détail dans la section de notre rapport Responsabilités des auditeurs concernant l'audit des états financiers. Nous estimons que les éléments que nous avons collectés sont suffisants et appropriés pour fonder notre opinion.

Indépendance

Nous sommes restés indépendants de la Société conformément aux exigences en matière de déontologie. Ces exigences sont pertinentes pour l'audit des états financiers en Irlande et incluent les normes de déontologie de l'IAASA. Nous avons également assumé nos autres responsabilités dans ce domaine conformément à ces exigences.

Points essentiels - Rapport des Administrateurs (révisé)

Comme indiqué dans le Rapport des Administrateurs (révisé), le Rapport original des administrateurs signé le 15 juin 2023 a été révisé, car les informations contenues dans l'Annexe originale - Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (non vérifié), qui faisait partie du Rapport annuel original référencé dans le Rapport original des administrateurs, ont été révisées, car les Administrateurs ont déterminé que des informations supplémentaires requises devaient être incluses dans l'Annexe originale : Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (non vérifié). Nous ne sommes pas tenus de procéder à un examen des événements postérieurs pour la période allant du 15 juin 2023 (date de notre précédent rapport d'audit) à la date du présent rapport, et nous ne l'avons donc pas effectué.

Emphasis of matter - Note importante sur l'établissement des états financiers sur une base autre que le principe de continuité d'exploitation

Pour formuler notre opinion sur les états financiers, qui n'est pas modifiée, nous attirons l'attention sur la note 2 aux états financiers qui décrit les raisons pour lesquelles les états financiers des fonds Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund, Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund, Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund and Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund, FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund, FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund et Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund ont été préparés sur une base autre que le principe de continuité d'exploitation.

Conclusions relatives à la continuité d'exploitation

À l'exception des fonds Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund, Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund, Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund and Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund, FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund, FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund, Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund, pour lesquels un fondement de la comptabilité autre que la continuité d'exploitation a été adopté, comme indiqué dans la section ci-dessus « Emphasis of matter - Note importante sur l'établissement des états financiers sur une base autre que le principe de continuité d'exploitation », sur la base des travaux que nous avons effectués, nous n'avons pas identifié d'incertitudes significatives relatives à des événements ou conditions qui, individuellement ou collectivement, pourraient jeter un doute important sur la capacité de la Société et des compartiments à poursuivre leur activité pendant une période d'au moins douze mois à compter de la date d'autorisation de publication des états financiers.

À l'exception des fonds Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund, Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund, Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund and Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund, FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund, FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund, Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund, pour lesquels un fondement de la comptabilité autre que la continuité d'exploitation a été adopté, comme indiqué dans la section ci-dessus « Emphasis of matter - Note importante sur l'établissement des états financiers sur une base autre que le principe de continuité d'exploitation », lors de l'audit des états financiers, nous avons conclu que la prise pour fondement de la comptabilité par les Administrateurs d'une situation de continuité d'exploitation pour la préparation des états financiers est appropriée.

Cependant, dans la mesure où il est impossible de prévoir tous les événements ou circonstances futurs, cette conclusion ne saurait garantir la capacité de la Société et des compartiments à poursuivre leurs activités.

Nos responsabilités et les responsabilités des administrateurs en ce qui concerne la continuité de l'exploitation sont décrites dans les sections concernées de ce rapport.

Rapport concernant les autres informations

Les informations complémentaires comprennent la totalité des informations figurant dans le Rapport annuel et les États financiers vérifiés, à l'exclusion des états financiers et du rapport afférent de nos commissaires aux comptes. La responsabilité de ces informations complémentaires incombe aux administrateurs. Notre opinion sur les états financiers ne couvre pas les informations complémentaires, et nous n'exprimons par conséquent aucune opinion d'audit ou, sauf dans la mesure explicitement contraire énoncée dans le présent rapport, une quelconque forme de garantie y afférente. Concernant notre audit des états financiers, notre responsabilité consiste à lire les autres informations et, à cette occasion, évaluer si les autres informations présentent des incohérences importantes par rapport aux états financiers ou aux informations que nous avons obtenues lors

Rapport des Auditeurs indépendants – (suite)

Rapport concernant les autres informations – (suite)

de l'audit, ou bien si elles semblent comporter des inexactitudes majeures. Si nous identifions une inexactitude majeure ou une incohérence importante manifeste, nous sommes tenus d'appliquer des procédures visant à déterminer s'il s'agit d'inexactitudes majeures relatives aux états financiers ou aux informations complémentaires. Si, sur la base du travail que nous avons réalisé, nous arrivons à la conclusion que ces informations complémentaires contiennent des inexactitudes majeures, nous sommes tenus de le signaler. Nous n'avons pas d'observation à formuler à l'égard de ces responsabilités.

Eu égard au Rapport des Administrateurs (révisé), nous avons également vérifié si les informations requises par la Loi sur les sociétés de 2014 avaient été fournies.

Sur la base des responsabilités qui nous incombent, décrites ci-dessus et d'après les travaux entrepris dans le cadre de notre audit, nous sommes également tenus en vertu des ISA (Irlande) et de la Loi sur les sociétés de 2014 de rapporter certaines opinions et certaines questions comme suit :

- Selon nous, et à partir de l'analyse menée lors de l'audit, les informations présentées dans le Rapport des Administrateurs (révisé) pour l'exercice clos le 28 février 2023 sont cohérentes avec les états financiers et ont été établies conformément aux dispositions légales applicables.
- Selon les informations dont nous disposons sur la Société et son environnement et que nous avons obtenues dans le cadre de notre audit, nous n'avons pas identifié d'erreurs significatives dans le Rapport des Administrateurs (révisé).

Responsabilités des états financiers et de l'audit

Responsabilités des administrateurs concernant les états financiers

Comme indiqué plus en détail dans la Déclaration de responsabilité des Administrateurs en page 17, les administrateurs sont chargés de préparer les états financiers conformément au référentiel applicable, en veillant à donner une image exacte et fidèle.

Les administrateurs sont également responsables du contrôle interne qu'ils jugent nécessaire pour préparer des états financiers exempts d'incohérences importantes, qu'elles soient intentionnelles ou non.

En préparant les états financiers, les Administrateurs sont chargés d'évaluer la capacité de la Société et des compartiments à préserver une situation de continuité d'exploitation, de faire connaître, s'il y a lieu, les questions relatives à la situation de continuité d'exploitation et de prendre pour fondement de la comptabilité une situation de continuité d'exploitation, à moins qu'ils aient l'intention, ou qu'ils n'aient d'autre choix que de liquider la Société ou de cesser les opérations.

Responsabilités des auditeurs concernant l'audit des états financiers

Nous avons pour objectif d'obtenir l'assurance raisonnable que les états financiers sont, dans leur ensemble, exempts d'anomalies importantes résultant d'erreurs ou d'actes frauduleux, et de produire un rapport de commissaires aux comptes faisant état de notre opinion. L'assurance raisonnable est un niveau élevé d'assurance, mais ne garantit pas que l'audit conduit conformément aux normes ISA (Irlande) découvre systématiquement une éventuelle inexactitude majeure. Les inexactitudes peuvent être de nature intentionnelle ou non, et sont considérées comme majeures si, au cas par cas ou dans leur ensemble, l'on peut raisonnablement s'attendre à ce qu'elles influencent les décisions économiques des utilisateurs prises sur la base des présents états financiers.

Nos tests d'audit peuvent inclure le test de populations complètes de certains soldes et transactions, éventuellement à l'aide de techniques d'audit de données. Cependant, il comprend généralement la sélection d'un nombre limité d'éléments à tester, plutôt que de tester des populations complètes. Nous chercherons souvent à cibler des éléments particuliers à tester en fonction de leur taille ou des caractéristiques de risque. Dans d'autres cas, nous utiliserons l'échantillonnage d'audit pour pouvoir tirer une conclusion sur la population à partir de laquelle l'échantillon a été sélectionné.

La description plus détaillée de nos responsabilités concernant l'audit des états financiers se trouve sur le site Internet de l'IAASA :

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

Cette description fait partie de notre rapport d'audit.

Utilisation faite de ce rapport

Le présent rapport, y compris les opinions, a été préparé à la seule intention des actionnaires de la Société en tant qu'organe de décision, conformément à l'article 391 de la Loi sur les sociétés de 2014, et à aucune autre fin. En formulant ces opinions, nous n'acceptons ni n'assumons aucune responsabilité à quelque autre fin que ce soit ou envers quelque autre personne à laquelle ce rapport serait montré ou qui entrerait en sa possession, sauf accord exprès, préalable et écrit de notre part.

Autres déclarations obligatoires

Opinions à fournir sur les autres questions selon la Loi sur les sociétés de 2014

- Nous avons obtenu toutes les informations et explications que nous jugions nécessaires pour mener à bien notre audit.
- Selon nous, les livres comptables de la Société étaient suffisants pour permettre la tenue en bonne et due forme de notre audit des états financiers.
- Les états financiers sont conformes aux livres comptables.

Déclaration des exceptions en vertu de la Loi sur les sociétés de 2014

Rémunération et transactions des Administrateurs

En vertu de la Loi sur les sociétés de 2014, nous sommes tenus d'indiquer notre opinion sur le respect des obligations de communication des éléments de rémunération et des transactions concernant les administrateurs conformément aux articles 305 à 312 de la Loi. Nous n'avons pas d'exception à signaler au titre de cette responsabilité.

Andrew O'Callaghan
pour et au nom de PricewaterhouseCoopers
Experts-comptables et cabinet d'audit statutaire
Dublin

30 juin 2023

Rapport du Dépositaire

Rapport du dépositaire aux actionnaires en date du 30 juin 2023

Pour la période allant du 1er mars 2022 au 28 février 2023 (la « période »)

The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch (le « **Dépositaire** » ou « **nous** », ou « **notre** »), a enquêté sur la conduite de Franklin Templeton Global Funds plc (la « **Société** ») pour la Période, en sa qualité de Dépositaire de la Société.

Le présent rapport, y compris l'opinion exprimée, a été préparé à la seule intention des actionnaires de la Société, conformément à nos responsabilités en tant que Dépositaire de la Société et à aucune autre fin. L'avis que nous émettons n'implique nullement que nous acceptons ou assumons une responsabilité dans un autre but ni à l'égard d'une autre personne à qui ce rapport est présenté.

Responsabilités du Dépositaire

Nos obligations et responsabilités sont stipulées dans la Réglementation 34 des Réglementations de 2011 (S.I. No 352 de 2011) des Communautés européennes concernant les Organismes de placement collectif en valeurs mobilières (les « Réglementations »).

Notre rapport doit établir si, au cours de ladite période et selon nous, la gestion de la Société a été conforme aux dispositions prévues par les documents constitutifs de la Société et les Réglementations. C'est la responsabilité globale de la Société de se conformer à ces dispositions. Si la Société n'a pas respecté ces dispositions, il nous incombe, en notre qualité de Dépositaire, d'indiquer la raison du non-respect et les mesures que nous avons prises afin de remédier à la situation.

Fondement de l'opinion du Dépositaire

Le Dépositaire réalise les examens qu'il estime raisonnablement nécessaires aux fins d'exécuter ses obligations et afin de garantir que, à tous égards significatifs, la Société a été gérée (i) conformément aux restrictions sur les capacités d'investissement et d'emprunt prévues par les dispositions de ses documents constitutifs et des réglementations appropriées, et (ii) par ailleurs, conformément aux documents constitutifs de la Société et aux réglementations appropriées.

Avis

À notre avis, au cours de la période, la Société a été gérée, pour l'essentiel :

- (i) conformément aux restrictions en matière de capacités d'investissement et d'emprunt imposées à la Société par les documents constitutifs et les réglementations ;
- (ii) à d'autres égards conformément aux dispositions des documents constitutifs et des réglementations.

Pour et au nom de The Bank of New York Mellon SA/NV,
Dublin Branch,
Riverside Two,
Sir John Rogerson's Quay Dublin 2,
D02 KV60,
Dublin 2, D02 KV60, Irlande

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'État — 71,90 % (28 février 2022 : 72,82 %)			10 000 United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,064 %, échéance le 31/07/2023 *		
États-Unis — 71,90 % (28 février 2022 : 72,82 %)			599 348 71,90		
13 500 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,565 %, échéance le 20/03/2023 *	13 500	1,62	Total des obligations et bons d'État (Coût 599 348\$)		
15 000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,580 %, échéance le 19/04/2023 *	15 000	1,80	Accords de prise en pension — 29,37 % (28 février 2022 : 29,37 %)		
5 100 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,930 %, échéance le 08/05/2023 *	5 103	0,61	États-Unis — 29,37 % (28 février 2022 : 29,37 %)		
10 000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,950 %, échéance le 11/05/2023 *	10 007	1,20	35 000 Banque canadienne impériale de commerce, accord de prise en pension à racheter pour 35 004 385 USD (garanti par des obligations et billets du Trésor américain d'une valeur totale de 35 704 490 USD), 4,510 %, échéance le 01/03/2023	35 000	4,20
19 000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,870 %, échéance le 09/06/2023 *	19 013	2,28	55 000 HSBC Bank (USA), accord de prise en pension à racheter pour 55 006 890 USD (garanti par des obligations et bons du Trésor américain pour une valeur totale de 56 107 049 USD), 4,510 %, échéance le 01/03/2023	55 000	6,60
10 000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,565 %, échéance le 23/06/2023 *	9 999	1,20	75 000 JP Morgan Securities, LLC, accord de prise en pension à racheter pour 75 009 417 USD (garanti par des obligations et bons du Trésor américain pour une valeur totale de 76 509 696 USD), 4,520 %, échéance le 01/03/2023	75 000	8,99
10 000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, série 0000, 4,600 %, échéance le 26/07/2023 *	9 999	1,20	50 000 Royal Bank du Canada, accord de prise en pension à racheter pour 50 006 236 USD (garanti par des obligations et bons du Trésor américain pour une valeur totale de 51 000 064 USD), 4,490 %, échéance le 01/03/2023	50 000	6,00
10 000 Federal Farm Credit Discount Notes, coupon zéro, échéance le 06/03/2023	9 994	1,20	29 848 TD Securities (USA) LLC, accord de prise en pension à racheter pour 29 851 772 USD (garanti par des obligations et bons du Trésor américain pour une valeur totale de 30 444 960 USD), 4,550 %, échéance le 01/03/2023	29 848	3,58
20 000 Federal Farm Credit Discount Notes, zero coupon, échéance le 08/03/2023	19 982	2,40	244 848 29,37		
10 000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, coupon zéro, échéance le 01/03/2023	10 000	1,20	Total des accords de prise en pension (coût 244 848\$)		
15 000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, échéance le 03/03/2023	14 996	1,80	Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
17 957 Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, échéance le 10/03/2023	17 937	2,15	844 196 101,27		
10 000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, coupon zéro, échéance le 16/03/2023	9 982	1,20	Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
15 000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, échéance le 05/04/2023	14 934	1,79	844 196 101,27		
10 000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, échéance le 26/04/2023	9 928	1,19	Excédent du passif par rapport aux autres éléments de l'actif		
10 000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, échéance le 28/04/2023	9 925	1,19	-10 581 -1,27		
10 000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, échéance le 24/05/2023	9 889	1,19	Total des actifs nets		
10 000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, échéance le 31/05/2023	9 879	1,19	833 615\$ 100,00		
10 000 Federal Home Loan Banks, 4,595 %, échéance le 01/03/2023 *	10 000	1,20	— Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.		
22 900 Federal Home Loan Banks, série 0000, 4,600 %, échéance le 01/03/2023 *	22 900	2,75	* Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.		
12 000 Federal Home Loan Banks, série 0000, 4,595 %, échéance le 06/03/2023 *	12 000	1,44			
10 000 Federal Home Loan Banks, série 0001, 4,605 %, échéance le 10/03/2023 *	10 000	1,20	Analyse de l'actif total		
14 100 Federal Home Loan Banks, série 0001, 4,570 %, échéance le 13/03/2023 *	14 100	1,69			
6 700 Federal Home Loan Banks, 4,565 %, échéance le 15/03/2023 *	6 700	0,80	Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé		
15 000 Federal Home Loan Banks, série 0001, 4,560 %, échéance le 23/03/2023 *	15 000	1,80	Instruments du marché monétaire		
10 000 Federal Home Loan Banks, série 0002, 4,620 %, échéance le 03/04/2023 *	10 000	1,20	Autres actifs		
10 000 Federal Home Loan Banks, 4,600 %, échéance le 04/04/2023 *	10 000	1,20	Actif total		
10 000 Federal Home Loan Banks, série 0000, 4,620 %, échéance le 06/04/2023 *	10 000	1,20	100,00		
1 300 Federal Home Loan Banks, 4,610 %, échéance le 04/10/2023 *	1 300	0,15			
10 000 Federal Home Loan Banks, 4,610 %, échéance le 18/04/2023 *	10 000	1,20			
10 000 Federal Home Loan Banks, 4,605 %, échéance le 05/01/2023 *	10 000	1,20			
10 000 Federal Home Loan Banks, série 0000, 4,590 %, échéance le 03/05/2023 *	10 000	1,20			
10 000 Federal Home Loan Banks, série 0000, 4,580 %, échéance le 04/05/2023 *	10 000	1,20			
18 000 Federal Home Loan Banks, 4,580 %, échéance le 05/10/2023 *	18 000	2,16			
10 000 Federal Home Loan Banks, 4,580 %, échéance le 05/11/2023 *	10 000	1,20			
15 000 Federal Home Loan Banks, série 0000, 4,590 %, échéance le 23/05/2023 *	15 000	1,80			
10 000 Federal Home Loan Banks, série 0001, 4,590 %, échéance le 26/05/2023 *	10 000	1,20			
10 000 Federal Home Loan Banks, 4,620 %, échéance le 25/07/2023 *	10 000	1,20			
10 000 Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 03/07/2023	9 993	1,20			
15 000 Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 03/09/2023	14 985	1,80			
25 000 Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 14/03/2023	24 959	2,99			
10 000 United States Treasury Bill, zero coupon, échéance le 21/03/2023	9 975	1,20			
10 000 United States Treasury Bill, zero coupon, échéance le 28/03/2023	9 966	1,19			
10 000 Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 04/04/2023	9 957	1,19			
10 000 United States Treasury Bill, zero coupon, échéance le 13/04/2023	9 945	1,19			
10 000 United States Treasury Bill, zero coupon, échéance le 18/04/2023	9 938	1,19			
10 000 United States Treasury Bill, zero coupon, échéance le 25/04/2023	9 929	1,19			
15 000 United States Treasury Bill, zero coupon, échéance le 27/04/2023	14 891	1,79			
10 000 Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 05/04/2023	9 918	1,19			
10 000 United States Treasury Bill, zero coupon, échéance le 13/07/2023	9 825	1,18			

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des actifs — 9,59 % (28 février 2022 : 9,40 %)			Titres adossés à des hypothèques — 36,20 % (28 février 2022 : 25,49 %)		
167 ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust série 2003-NC1, série 2003 NC1, catégorie A1, 5,297 %, échéance le 25/07/2033 *	161	0,12	510 AREIT 2022-CRE7 LLC, série 2022 CRE7, catégorie A, 144A, 6,806 %, échéance le 17/06/2039 *	511	0,39
307 Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, série 2019 1A, catégorie A2I, 144A, 4,194 %, échéance le 05/06/2049	299	0,23	27 Banc of America Mortgage 2003-C Trust, série 2003 C, catégorie B1, 2,735 %, échéance le 25/04/2033 *	6	—
415 Argent Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Certificates série 2003-W7, série 2003 W3, catégorie M1, 3,734 %, échéance le 25/09/2033 *	381	0,29	23 Bear Stearns ALT-A Trust 2004-6, série 2004 6, catégorie M1, 5,442 %, échéance le 25/07/2034 *	23	0,02
500 Benefit Street Partners CLO VIII Ltd, série 2015 8A, catégorie A1AR, 144A, 5,908 %, échéance le 20/01/2031 *	496	0,38	10 841 Benchmark 2018-B5 Mortgage Trust, série 2018 B5, catégorie XA, 0,471 %, échéance le 15/07/2051 *	197	0,15
630 Canyon CLO 2020-1 Ltd, série 2020 1A, catégorie AR, 144A, 5,972 %, échéance le 15/07/2034 *	619	0,47	879 BHMS 2018-ATLS, série 2018 ATLS, catégorie A, 144A, 5,838 %, échéance le 15/07/2035 *	864	0,65
270 Cayuga Park CLO Ltd, série 2020 1A, catégorie AR, 144A, 5,912 %, échéance le 17/07/2034 *	266	0,20	254 BXMT 2020-FL2 Ltd, série 2020 FL2, catégorie A, 144A, 5,578 %, échéance le 15/02/2038 *	251	0,19
490 CBAM 2017-1 Ltd, série 2017 1A, catégorie A1, 144A, 6,058 %, échéance le 20/07/2030 *	488	0,37	100 CD 2017-CD3 Mortgage Trust, série 2017 CD3, catégorie A4, 3,631 %, échéance le 10/02/2050	93	0,07
77 Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, série 2001 HE22, catégorie A1, 5,097 %, échéance le 25/02/2032 *	74	0,05	130 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, série 2014 GC23, catégorie B, 4,175 %, échéance le 10/07/2047 *	124	0,09
32 CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2007-13, série 2007 13, catégorie 2A2, 5,417 %, échéance le 25/10/2047 *	30	0,02	3 846 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C3, série 2016 C3, catégorie XA, 1,001 %, échéance le 15/11/2049 *	112	0,08
148 CWABS Inc Asset-Backed Certificates Trust 2004-5, série 2004 5, catégorie 2A, 5,117 %, échéance le 25/10/2034 *	140	0,11	385 COLT 2021-RPL1 Trust, série 2021 RPL1, catégorie A1, 144A, 1,665 %, échéance le 25/09/2061 *	340	0,26
30 CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust série 2006-F, série 2006 F, catégorie 2A1A, 4,728 %, échéance le 15/07/2036 *	28	0,02	10 COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, série 2013 CR12, catégorie AM, 4,300 %, échéance le 10/10/2046	9	0,01
227 CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-I, série 2006 I, catégorie 1A, 4,728 %, échéance le 15/01/2037 *	211	0,16	139 Comm 2014-UBS2 Mortgage Trust, série 2014 UBS2, catégorie XA, 1,057 %, échéance le 10/03/2047 *	1	—
159 CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-I, série 2006 I, catégorie 2A, 4,728 %, échéance le 15/01/2037 *	147	0,11	54 COMM 2015-LC19 Mortgage Trust, série 2015 LC19, catégorie ASB, 3,040 %, échéance le 10/02/2048	52	0,04
174 EFS Volunteer No 2 LLC, série 2012 1, catégorie A2, 144A, 5,967 %, échéance le 25/03/2036 *	172	0,13	200 COMM 2015-PC1 Mortgage Trust, série 2015 PC1, catégorie A5, 3,902 %, échéance le 10/07/2050	193	0,15
420 Golub Capital Partners Clo 57M Ltd, série 2021 57A, catégorie A1, 144A, 6,308 %, échéance le 25/10/2034 *	410	0,31	340 Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, série 2022 R04, catégorie 1M2, 144A, 7,584 %, échéance le 25/03/2042 *	344	0,26
250 Greenwood Park CLO Ltd, série 2018 1A, catégorie A2, 144A, 5,802 %, échéance le 15/04/2031 *	247	0,19	100 CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, série 2015 C1, catégorie A5, 3,791 %, échéance le 15/04/2050 *	93	0,07
320 Greywolf CLO V Ltd, série 2015 1A, catégorie A1R, 144A, 5,978 %, échéance le 27/01/2031 *	318	0,24	340 CSMC 2014-USA OA LLC, série 2014 USA, catégorie A2, 144A, 3,953 %, échéance le 15/09/2037	307	0,23
769 Home Equity Asset Trust 2006-4, série 2006 4, catégorie 2A4, 5,177 %, échéance le 25/08/2036 *	750	0,57	420 CSMC 2014-USA OA LLC, série 2014 USA, catégorie B, 144A, 4,185 %, échéance le 15/09/2037	360	0,27
339 Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, série 2021 1GS, catégorie A, 144A, 2,290 %, échéance le 20/01/2048	264	0,20	371 CSMC Trust 2018-J1 Trust, série 2018 J1, catégorie A2, 144A, 3,500 %, échéance le 25/02/2048 *	331	0,25
656 Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1, série 2004 1, catégorie M1, 5,367 %, échéance le 25/02/2034 *	627	0,48	1 001 CSMC Trust 2018-J1 Trust, série 2018 J1, catégorie B2, 144A, 3,591 %, échéance le 25/02/2048 *	848	0,64
274 Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-4, série 2004 4, catégorie M1, 5,517 %, échéance le 25/10/2034 *	255	0,19	143 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2014 C03, catégorie 1M2, 7,617 %, échéance le 25/07/2024 *	146	0,11
454 Merrill Lynch Mortgage Investors Trust série 2004-WMCS, série 2004 WMCS, catégorie M1, 5,547 %, échéance le 25/07/2035 *	438	0,33	3 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2014 C04, catégorie 2M2, 9,617 %, échéance le 25/11/2024 *	4	—
500 MKS CLO 2017-2 Ltd, série 2017 2A, catégorie A, 144A, 5,998 %, échéance le 20/01/2031 *	495	0,38	1 Fannie Mae Interest Strip 390, catégorie C3, 6,000 %, échéance le 25/07/2038	—	—
422 Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2004-NC8, série 2004 NC8, catégorie M1, 5,532 %, échéance le 25/09/2034 *	399	0,30	4 Fannie Mae Interest Strip 407, catégorie 41, 6,000 %, échéance le 25/01/2038	1	—
96 Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2005-NC2, série 2005 NC2, catégorie M4, 5,532 %, échéance le 25/03/2035 *	94	0,07	8 Fannie Mae Interest Strip 409, catégorie C13, 3,500 %, échéance le 25/11/2041	1	—
395 Mosaic Solar Loan Trust 2021-3, série 2021 3A, catégorie B, 144A, 1,920 %, échéance le 20/06/2052	306	0,23	8 Fannie Mae Interest Strip 409, catégorie C18, 4,000 %, échéance le 25/04/2042	2	—
359 Navient Student Loan Trust 2017-3, série 2017 3A, catégorie A3, 144A, 5,667 %, échéance le 26/07/2066 *	357	0,27	6 Fannie Mae Interest Strip 409, catégorie C2, 3,000 %, échéance le 25/04/2027	—	—
350 Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 Ltd, série 2018 29A, catégorie A1, 144A, 5,928 %, échéance le 19/10/2031 *	348	0,26	100 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,000 % ±	81	0,06
102 NovaStar Mortgage Funding Trust série 2003-3, série 2003 3, catégorie A1, 5,327 %, échéance le 25/12/2033 *	99	0,07	2 400 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 % ±	2 034	1,54
480 Ocean Trails Clo X, série 2020 10A, catégorie AR, 144A, 6,012 %, échéance le 15/10/2034 *	474	0,36	1 100 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 3,000 % ±	968	0,73
240 Ocean Trails Clo XI, série 2021 11A, catégorie A, 144A, 6,028 %, échéance le 20/07/2034 *	237	0,18	1 000 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 3,500 % ±	911	0,69
440 OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 35 Ltd, série 2018 1A, catégorie A1A, 144A, 5,868 %, échéance le 20/01/2031 *	438	0,33	300 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 4,000 % ±	282	0,21
67 SBA Small Business Investment Cos, série 2018 10B, catégorie 1, 3,548 %, échéance le 10/09/2028	63	0,05	700 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 4,500 % ±	675	0,51
376 Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2005-OP1, série 2005 OP1, catégorie M1, 5,232 %, échéance le 25/01/2035 *	349	0,27	300 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 5,000 % ±	295	0,22
86 SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A, série 2007 A, catégorie A4A, 5,009 %, échéance le 16/12/2041 *	82	0,06	500 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 5,500 % ±	499	0,38
357 SLM Private Education Loan Trust 2010-C, série 2010 C, catégorie A5, 144A, 9,338 %, échéance le 15/10/2041 *	383	0,29	1 Fannie Mae Pool '888795', 5,500 %, échéance le 01/11/2036	2	—
166 SMB Private Education Loan Trust 2020-A, série 2020 A, catégorie A2A, 144A, 2,230 %, échéance le 15/09/2037	152	0,12	34 Fannie Mae Pool '890604', 4,500 %, échéance le 01/10/2044	34	0,03
464 Stonepeak 2021-1 ABS, série 2021 1A, catégorie AA, 144A, 2,301 %, échéance le 28/02/2033	424	0,32	41 Fannie Mae Pool '890827', 3,500 %, échéance le 01/12/2037	39	0,03
490 Trinitas CLO XVI Ltd, série 2021 16A, catégorie A1, 144A, 5,988 %, échéance le 20/07/2034 *	481	0,36	24 Fannie Mae Pool 'AB9594', 4,000 %, échéance le 01/06/2043	23	0,02
660 Voya CLO 2016-3 Ltd, série 2016 3A, catégorie A1R, 144A, 5,985 %, échéance le 18/10/2031 *	655	0,50	209 Fannie Mae Pool 'AH4536', 4,000 %, échéance le 01/02/2041	206	0,16
Total des titres adossés à des actifs (coût 12 904\$)	12 657	9,59	9 Fannie Mae Pool 'AL4324', 6,500 %, échéance le 01/05/2040	9	0,01
			68 Fannie Mae Pool 'AL9397', 3,000 %, échéance le 01/10/2046	62	0,05
			53 Fannie Mae Pool 'AL9546', 3,500 %, échéance le 01/11/2046	50	0,04
			39 Fannie Mae Pool 'AL9631', 3,000 %, échéance le 01/12/2046	36	0,03
			20 Fannie Mae Pool 'AM8674', 2,810 %, échéance le 01/04/2025	19	0,01
			95 Fannie Mae Pool 'AM8700', 2,930 %, échéance le 01/06/2030	86	0,07
			57 Fannie Mae Pool 'AN4927', 3,450 %, échéance le 01/03/2029	54	0,04
			58 Fannie Mae Pool 'AN5386', 3,250 %, échéance le 01/05/2029	55	0,04
			44 Fannie Mae Pool 'AO7501', 4,000 %, échéance le 01/06/2042	43	0,03
			25 Fannie Mae Pool 'AP4781', 3,000 %, échéance le 01/09/2042	22	0,02
			19 Fannie Mae Pool 'AR7399', 3,000 %, échéance le 01/06/2043	17	0,01
			42 Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, échéance le 01/07/2043	38	0,03
			44 Fannie Mae Pool 'AS6328', 3,500 %, échéance le 01/12/2045	41	0,03
			250 Fannie Mae Pool 'AS7313', 3,500 %, échéance le 01/06/2046	233	0,18
			94 Fannie Mae Pool 'AS7738', 3,000 %, échéance le 01/08/2046	83	0,06
			59 Fannie Mae Pool 'AS7844', 3,000 %, échéance le 01/09/2046	53	0,04
			22 Fannie Mae Pool 'AS8740', 3,500 %, échéance le 01/02/2037	21	0,02
			40 Fannie Mae Pool 'AS8745', 3,000 %, échéance le 01/02/2047	36	0,03
			45 Fannie Mae Pool 'AS9588', 4,000 %, échéance le 01/05/2047	43	0,03
			19 Fannie Mae Pool 'AT4281', 4,000 %, échéance le 01/06/2043	19	0,01
			27 Fannie Mae Pool 'AU6735', 3,000 %, échéance le 01/10/2043	24	0,02
			60 Fannie Mae Pool 'AW9453', 3,500 %, échéance le 01/08/2044	56	0,04

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques — (suite)					
43 Fannie Mae Pool 'BC0884', 3,000 %, échéance le 01/05/2046	38	0,03	69 Fannie Mae Pool 'MA2579', 3,000 %, échéance le 01/04/2036	64	0,05
68 Fannie Mae Pool 'BC1509', 3,000 %, échéance le 01/08/2046	61	0,05	166 Fannie Mae Pool 'MA2672', 3,000 %, échéance le 01/07/2036	152	0,11
96 Fannie Mae Pool 'BC2817', 3,000 %, échéance le 01/09/2046	87	0,07	110 Fannie Mae Pool 'MA2707', 3,000 %, échéance le 01/08/2036	100	0,08
38 Fannie Mae Pool 'BD2455', 3,000 %, échéance le 01/01/2047	34	0,03	79 Fannie Mae Pool 'MA4306', 2,500 %, échéance le 01/04/2051	67	0,05
41 Fannie Mae Pool 'BD8104', 3,000 %, échéance le 01/10/2046	37	0,03	171 Fannie Mae Pool 'MA4364', 2,000 %, échéance le 01/06/2041	146	0,11
197 Fannie Mae Pool 'BF0104', 4,000 %, échéance le 01/02/2056	190	0,14	9 Fannie Mae REMICS, série 2001 81, catégorie GE, 6,000 %, échéance le 25/01/2032	9	0,01
221 Fannie Mae Pool 'BF0133', 4,000 %, échéance le 01/08/2056	212	0,16	18 Fannie Mae REMICS, série 2005 29, catégorie ZA, 5,500 %, échéance le 25/04/2035	19	0,01
48 Fannie Mae Pool 'BF0163', 5,000 %, échéance le 01/11/2046	48	0,04	5 Fannie Mae REMICS, série 2011 87, catégorie SG, 1,933 %, échéance le 25/04/2040 *	–	–
88 Fannie Mae Pool 'BF0183', 4,000 %, échéance le 01/01/2057	84	0,06	16 Fannie Mae REMICS, série 2012 101, catégorie AI, 3,000 %, échéance le 25/06/2027	–	–
190 Fannie Mae Pool 'BF0191', 4,000 %, échéance le 01/06/2057	181	0,14	75 Fannie Mae REMICS, série 2012 134, catégorie SK, 1,533 %, échéance le 25/12/2042 *	7	0,01
39 Fannie Mae Pool 'BF0301', 4,500 %, échéance le 01/08/2058	38	0,03	6 Fannie Mae REMICS, série 2012 46, catégorie BA, 6,000 %, échéance le 25/05/2042	6	–
38 Fannie Mae Pool 'BL2454', 3,160 %, échéance le 01/05/2029	35	0,03	7 Fannie Mae REMICS, série 2012 75, catégorie NS, 1,983 %, échéance le 25/07/2042 *	1	–
148 Fannie Mae Pool 'BM3473', 3,500 %, échéance le 01/11/2047	137	0,10	379 Fannie Mae REMICS, série 2012 96, catégorie SB, 1,433 %, échéance le 25/09/2042 *	26	0,02
15 Fannie Mae Pool 'BM3904', 2,000 %, échéance le 01/05/2048	15	0,01	9 Fannie Mae REMICS, série 2013 9, catégorie BC, 6,500 %, échéance le 25/07/2042	9	0,01
420 Fannie Mae Pool 'BM4579', 3,000 %, échéance le 01/04/2047	375	0,28	12 Fannie Mae REMICS, série 2013 9, catégorie CB, 5,500 %, échéance le 25/04/2042	12	0,01
38 Fannie Mae Pool 'BM4751', 3,000 %, échéance le 01/03/2043	35	0,03	105 Fannie Mae REMICS, série 2020 47, catégorie GZ, 2,000 %, échéance le 25/07/2050	63	0,05
617 Fannie Mae Pool 'BN3898', 4,500 %, échéance le 01/12/2048	608	0,46	159 Fannie Mae REMICS, série 2020 56, catégorie DI, 2,500 %, échéance le 25/08/2050	25	0,02
82 Fannie Mae Pool 'BQ5876', 2,500 %, échéance le 01/11/2050	71	0,05	77 Fannie Mae REMICS, série 2020 74, catégorie EI, 2,500 %, échéance le 25/10/2050	13	0,01
83 Fannie Mae Pool 'BQ9226', 2,000 %, échéance le 01/01/2051	68	0,05	543 Fannie Mae REMICS, série 2020 89, catégorie DI, 2,500 %, échéance le 25/12/2050	79	0,06
79 Fannie Mae Pool 'BR2641', 2,000 %, échéance le 01/02/2051	66	0,05	448 Fannie Mae REMICS, série 2020 97, catégorie AI, 2,000 %, échéance le 25/01/2051	61	0,05
75 Fannie Mae Pool 'BR2643', 2,000 %, échéance le 01/02/2051	62	0,05	733 Fannie Mae REMICS, série 2021 3, catégorie QI, 2,500 %, échéance le 25/02/2051	112	0,08
74 Fannie Mae Pool 'BR2644', 2,000 %, échéance le 01/02/2051	61	0,05	49 Fannie Mae-Aces, série 2013 M6, catégorie 1AC, 3,352 %, échéance le 25/02/2043 *	46	0,03
75 Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, échéance le 01/02/2051	63	0,05	400 Fannie Mae-Aces, série 2018 M15, catégorie 1A2, 3,700 %, échéance le 25/01/2036	367	0,28
79 Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, échéance le 01/02/2051	66	0,05	166 Fannie Mae-Aces, série 2018 M9, catégorie APT2, 3,106 %, échéance le 25/04/2028 *	155	0,12
78 Fannie Mae Pool 'BR3286', 2,000 %, échéance le 01/03/2051	65	0,05	553 Fannie Mae-Aces, série 2020 M36, catégorie X1, 1,498 %, échéance le 25/09/2034 *	36	0,03
76 Fannie Mae Pool 'BR4722', 2,000 %, échéance le 01/03/2051	63	0,05	23 Freddie Mac Gold Pool 'C91240', 4,500 %, échéance le 01/01/2029	23	0,02
83 Fannie Mae Pool 'BR4753', 2,000 %, échéance le 01/03/2051	69	0,05	10 Freddie Mac Gold Pool 'G06409', 6,000 %, échéance le 01/11/2039	10	0,01
74 Fannie Mae Pool 'BR4756', 2,000 %, échéance le 01/03/2051	61	0,05	4 Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500 %, échéance le 01/09/2039	4	–
84 Fannie Mae Pool 'BR5577', 2,000 %, échéance le 01/03/2051	69	0,05	160 Freddie Mac Gold Pool 'G61637', 3,000 %, échéance le 01/09/2047	143	0,11
83 Fannie Mae Pool 'BR5587', 2,000 %, échéance le 01/03/2051	69	0,05	22 Freddie Mac Gold Pool 'Q17792', 3,500 %, échéance le 01/05/2043	20	0,02
85 Fannie Mae Pool 'BR5633', 2,000 %, échéance le 01/03/2051	70	0,05	39 Freddie Mac Gold Pool 'Q29184', 4,000 %, échéance le 01/10/2044	38	0,03
85 Fannie Mae Pool 'BR5634', 2,000 %, échéance le 01/03/2051	70	0,05	40 Freddie Mac Gold Pool 'Q45560', 3,000 %, échéance le 01/01/2047	36	0,03
88 Fannie Mae Pool 'BR5649', 2,000 %, échéance le 01/03/2051	72	0,05	82 Freddie Mac Gold Pool 'Q45737', 3,000 %, échéance le 01/01/2047	74	0,06
87 Fannie Mae Pool 'BT0846', 2,500 %, échéance le 01/07/2051	75	0,06	45 Freddie Mac Gold Pool 'Q45819', 3,000 %, échéance le 01/01/2047	41	0,03
89 Fannie Mae Pool 'BT3270', 2,500 %, échéance le 01/08/2051	76	0,06	16 Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000 %, échéance le 01/10/2042	15	0,01
87 Fannie Mae Pool 'BT3303', 2,500 %, échéance le 01/08/2051	75	0,06	50 Freddie Mac Gold Pool 'U99124', 3,500 %, échéance le 01/03/2045	47	0,04
91 Fannie Mae Pool 'BU2599', 2,500 %, échéance le 01/01/2052	78	0,06	90 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates Q006, catégorie A2, 4,233 %, échéance le 25/04/2028 *	82	0,06
92 Fannie Mae Pool 'BV3089', 2,500 %, échéance le 01/02/2052	79	0,06	75 Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 2,091 %, échéance le 01/03/2047 *	71	0,05
94 Fannie Mae Pool 'BV8546', 3,500 %, échéance le 01/05/2052	87	0,07	375 Freddie Mac Non Gold Pool '841076', 3,007 %, échéance le 01/11/2048 *	354	0,27
323 Fannie Mae Pool 'CA1692', 4,000 %, échéance le 01/05/2048	310	0,23	120 Freddie Mac Non Gold Pool '841077', 2,877 %, échéance le 01/11/2047 *	115	0,09
171 Fannie Mae Pool 'CB0470', 2,500 %, échéance le 01/05/2041	150	0,11	120 Freddie Mac Non Gold Pool '841081', 3,096 %, échéance le 01/02/2050 *	115	0,09
96 Fannie Mae Pool 'CB3044', 2,500 %, échéance le 01/03/2052	82	0,06	80 Freddie Mac Pool 'Q85092', 2,500 %, échéance le 11/01/2050	69	0,05
198 Fannie Mae Pool 'CB5497', 6,500 %, échéance le 01/01/2053	205	0,16	78 Freddie Mac Pool 'Q85093', 2,500 %, échéance le 11/01/2050	67	0,05
52 Fannie Mae Pool 'FM0068', 3,500 %, échéance le 01/02/2040	49	0,04	75 Freddie Mac Pool 'Q88604', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	62	0,05
42 Fannie Mae Pool 'FM0071', 3,500 %, échéance le 01/02/2040	40	0,03	313 Freddie Mac Pool 'Q89087', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	260	0,20
205 Fannie Mae Pool 'FM1727', 5,000 %, échéance le 01/09/2049	205	0,16	78 Freddie Mac Pool 'Q89482', 2,000 %, échéance le 01/03/2051	64	0,05
102 Fannie Mae Pool 'FM2761', 5,000 %, échéance le 01/03/2050	102	0,08	90 Freddie Mac Pool 'QC3690', 2,500 %, échéance le 07/01/2051	77	0,06
148 Fannie Mae Pool 'FM3347', 3,500 %, échéance le 01/05/2047	138	0,10	91 Freddie Mac Pool 'QC4690', 2,500 %, échéance le 08/01/2051	78	0,06
210 Fannie Mae Pool 'FM3773', 3,500 %, échéance le 01/11/2048	195	0,15	90 Freddie Mac Pool 'QC4824', 2,500 %, échéance le 08/01/2051	77	0,06
282 Fannie Mae Pool 'FM4650', 2,500 %, échéance le 01/10/2040	248	0,19	267 Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500 %, échéance le 08/01/2051	229	0,17
47 Fannie Mae Pool 'FM4737', 3,500 %, échéance le 01/09/2050	44	0,03	93 Freddie Mac Pool 'QC9154', 3,000 %, échéance le 10/01/2051	83	0,06
53 Fannie Mae Pool 'FM5783', 3,500 %, échéance le 01/06/2038	49	0,04	93 Freddie Mac Pool 'QD3960', 2,000 %, échéance le 01/01/2052	76	0,06
63 Fannie Mae Pool 'FM5904', 2,500 %, échéance le 01/02/2051	54	0,04	94 Freddie Mac Pool 'QD5827', 2,000 %, échéance le 02/01/2052	77	0,06
79 Fannie Mae Pool 'FM6460', 2,500 %, échéance le 01/03/2051	69	0,05	93 Freddie Mac Pool 'QD6079', 2,500 %, échéance le 02/01/2052	80	0,06
74 Fannie Mae Pool 'FM7675', 2,500 %, échéance le 01/06/2051	64	0,05	75 Freddie Mac Pool 'RA2114', 3,500 %, échéance le 01/02/2050	69	0,05
56 Fannie Mae Pool 'FM7786', 4,000 %, échéance le 01/01/2049	53	0,04	163 Freddie Mac Pool 'RA3882', 2,000 %, échéance le 11/01/2050	135	0,10
64 Fannie Mae Pool 'FM7796', 4,000 %, échéance le 01/06/2048	61	0,05			
88 Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500 %, échéance le 01/07/2051	76	0,06			
66 Fannie Mae Pool 'FM7929', 3,500 %, échéance le 01/08/2050	61	0,05			
164 Fannie Mae Pool 'FM8577', 3,000 %, échéance le 01/08/2051	147	0,11			
174 Fannie Mae Pool 'FM8864', 2,500 %, échéance le 01/10/2051	150	0,11			
87 Fannie Mae Pool 'FM9365', 3,000 %, échéance le 01/11/2051	78	0,06			
84 Fannie Mae Pool 'FS0024', 3,500 %, échéance le 01/09/2051	72	0,05			
91 Fannie Mae Pool 'FS0034', 3,000 %, échéance le 01/12/2051	81	0,06			
79 Fannie Mae Pool 'FS0037', 3,000 %, échéance le 01/08/2051	71	0,05			
90 Fannie Mae Pool 'FS0240', 3,000 %, échéance le 01/01/2052	81	0,06			
187 Fannie Mae Pool 'FS0349', 2,000 %, échéance le 01/01/2052	153	0,12			
93 Fannie Mae Pool 'FS0366', 2,500 %, échéance le 01/01/2052	81	0,06			
184 Fannie Mae Pool 'FS0424', 2,500 %, échéance le 01/01/2052	158	0,12			
94 Fannie Mae Pool 'FS0582', 2,500 %, échéance le 01/02/2052	81	0,06			
92 Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, échéance le 01/02/2052	76	0,06			
93 Fannie Mae Pool 'FS1014', 2,000 %, échéance le 01/02/2052	77	0,06			
188 Fannie Mae Pool 'FS1015', 2,000 %, échéance le 01/02/2052	154	0,12			
556 Fannie Mae Pool 'FS1074', 3,000 %, échéance le 01/03/2052	496	0,38			
379 Fannie Mae Pool 'FS1112', 2,000 %, échéance le 01/03/2052	314	0,24			
89 Fannie Mae Pool 'FS1237', 3,500 %, échéance le 01/12/2051	82	0,06			
92 Fannie Mae Pool 'FS1289', 3,000 %, échéance le 01/03/2052	83	0,06			
93 Fannie Mae Pool 'FS1462', 3,500 %, échéance le 01/01/2052	85	0,06			
170 Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, échéance le 01/06/2049	157	0,12			
100 Fannie Mae Pool 'FS3672', 5,500 %, échéance le 01/02/2053	100	0,08			
100 Fannie Mae Pool 'FS4000', 6,000 %, échéance le 01/07/2041	103	0,08			
31 Fannie Mae Pool 'MA1217', 4,000 %, échéance le 01/10/2042	29	0,02			
16 Fannie Mae Pool 'MA1253', 4,000 %, échéance le 01/11/2042	15	0,01			
22 Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500 %, échéance le 01/09/2043	22	0,02			
44 Fannie Mae Pool 'MA2110', 3,500 %, échéance le 01/12/2034	42	0,03			
30 Fannie Mae Pool 'MA2138', 3,500 %, échéance le 01/01/2035	28	0,02			
58 Fannie Mae Pool 'MA2320', 3,000 %, échéance le 01/07/2035	54	0,04			
93 Fannie Mae Pool 'MA2523', 3,000 %, échéance le 01/02/2036	86	0,07			

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques — (suite)					
454 Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, échéance le 11/01/2050	392	0,30	111 Ginnie Mae II Pool 'BT0812', 3,000 %, échéance le 20/03/2050	97	0,07
247 Freddie Mac Pool 'RA4703', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	203	0,15	29 Ginnie Mae II Pool 'MA1995', 3,500 %, échéance le 20/06/2044	27	0,02
486 Freddie Mac Pool 'RA5117', 2,000 %, échéance le 01/05/2051	399	0,30	10 Ginnie Mae II Pool 'MA2678', 3,500 %, échéance le 20/03/2045	10	0,01
88 Freddie Mac Pool 'RA5373', 2,000 %, échéance le 01/06/2051	72	0,05	110 Ginnie Mae II Pool 'MA3521', 3,500 %, échéance le 20/03/2046	103	0,08
90 Freddie Mac Pool 'RA6562', 2,500 %, échéance le 01/01/2052	77	0,06	59 Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500 %, échéance le 20/04/2046	55	0,04
378 Freddie Mac Pool 'RA6694', 2,000 %, échéance le 01/01/2052	308	0,23	15 Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500 %, échéance le 20/05/2046	14	0,01
352 Freddie Mac Pool 'RB5125', 2,000 %, échéance le 01/09/2041	299	0,23	46 Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500 %, échéance le 20/06/2046	43	0,03
108 Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, échéance le 01/10/2041	87	0,07	15 Ginnie Mae II Pool 'MA3803', 3,500 %, échéance le 20/07/2046	14	0,01
55 Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, échéance le 01/11/2041	44	0,03	88 Ginnie Mae II Pool 'MA3873', 3,000 %, échéance le 20/08/2046	80	0,06
93 Freddie Mac Pool 'RB5145', 2,000 %, échéance le 02/01/2042	79	0,06	17 Ginnie Mae II Pool 'MA3937', 3,500 %, échéance le 20/09/2046	16	0,01
75 Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, échéance le 04/01/2051	63	0,05	19 Ginnie Mae II Pool 'MA4068', 3,000 %, échéance le 20/11/2046	17	0,01
91 Freddie Mac Pool 'SD0745', 2,000 %, échéance le 01/11/2051	75	0,06	22 Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000 %, échéance le 20/02/2047	20	0,01
92 Freddie Mac Pool 'SD0849', 2,500 %, échéance le 01/01/2052	79	0,06	158 Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, échéance le 20/06/2047	151	0,11
999 Freddie Mac Pool 'SD1218', 2,500 %, échéance le 01/07/2049	955	0,72	133 Ginnie Mae II Pool 'MA4719', 3,500 %, échéance le 20/09/2047	124	0,09
99 Freddie Mac Pool 'SD2284', 6,000 %, échéance le 12/01/2052	101	0,08	91 Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000 %, échéance le 20/11/2047	87	0,07
49 Freddie Mac Pool 'SD7509', 3,000 %, échéance le 01/11/2049	44	0,03	12 Ginnie Mae II Pool 'MA4899', 3,000 %, échéance le 20/12/2047	11	0,01
148 Freddie Mac Pool 'SD7525', 2,500 %, échéance le 01/10/2050	127	0,10	60 Ginnie Mae II Pool 'MA4901', 4,000 %, échéance le 20/12/2047	57	0,04
157 Freddie Mac Pool 'SD7534', 2,500 %, échéance le 02/01/2051	135	0,10	11 Ginnie Mae II Pool 'MA5018', 3,000 %, échéance le 20/02/2048	10	0,01
590 Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, échéance le 01/11/2051	507	0,38	106 Ginnie Mae II Pool 'MA5019', 3,500 %, échéance le 20/02/2048	99	0,07
48 Freddie Mac Pool 'ZA2489', 3,500 %, échéance le 01/01/2038	45	0,03	28 Ginnie Mae II Pool 'MA5020', 4,000 %, échéance le 20/02/2048	27	0,02
8 Freddie Mac Pool 'Z17269', 5,000 %, échéance le 03/01/2038	8	0,01	38 Ginnie Mae II Pool 'MA5078', 4,000 %, échéance le 20/03/2048	36	0,03
25 Freddie Mac Pool 'ZN0538', 3,500 %, échéance le 01/11/2042	24	0,02	83 Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500 %, échéance le 20/06/2048	82	0,06
16 Freddie Mac Pool 'ZN1436', 5,000 %, échéance le 11/01/2048	16	0,01	40 Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, échéance le 20/07/2048	39	0,03
4 Freddie Mac Pool 'ZS3059', 5,500 %, échéance le 01/12/2038	4	—	63 Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500 %, échéance le 20/10/2048	62	0,05
7 Freddie Mac Pool 'ZS3569', 6,000 %, échéance le 10/01/2036	7	0,01	28 Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500 %, échéance le 20/12/2048	27	0,02
100 Freddie Mac Pool 'ZS9316', 3,500 %, échéance le 01/01/2038	94	0,07	278 Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500 %, échéance le 20/01/2049	270	0,20
49 Freddie Mac Pool 'ZT1257', 3,000 %, échéance le 01/01/2046	44	0,03	15 Ginnie Mae II Pool 'MA5762', 3,500 %, échéance le 20/02/2049	14	0,01
4 Freddie Mac REMICS 3621, catégorie SB, 1,642 %, échéance le 15/01/2040 *	—	—	93 Ginnie Mae II Pool 'MA6933', 3,500 %, échéance le 20/10/2050	86	0,07
22 Freddie Mac REMICS 3947, catégorie SG, 1,362 %, échéance le 15/10/2041 *	2	—	217 Ginnie Mae II Pool 'MA7056', 4,500 %, échéance le 20/12/2050	213	0,16
12 Freddie Mac REMICS 4194, catégorie BI, 3,500 %, échéance le 15/04/2043	2	—	67 Ginnie Mae II Pool 'MA7193', 2,500 %, échéance le 20/02/2051	59	0,04
3 Freddie Mac REMICS 4298, catégorie PI, 4,000 %, échéance le 15/04/2043	—	—	332 Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, échéance le 20/09/2051	298	0,23
29 Freddie Mac REMICS 4813, catégorie CJ, 3,000 %, échéance le 15/08/2048	25	0,02	2 100 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 2,500 % ±	1 817	1,38
69 Freddie Mac REMICS 5010, catégorie IK, 2,500 %, échéance le 25/09/2050	10	0,01	800 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 3,000 % ±	714	0,54
245 Freddie Mac REMICS 5010, catégorie JL, 2,500 %, échéance le 25/09/2050	38	0,03	300 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 3,500 % ±	276	0,21
83 Freddie Mac REMICS 5013, catégorie IN, 2,500 %, échéance le 25/09/2050	13	0,01	300 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 4,500 % ±	291	0,22
172 Freddie Mac REMICS 5018, catégorie MI, 2,000 %, échéance le 25/10/2050	23	0,02	900 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 5,000 % ±	889	0,67
74 Freddie Mac REMICS 5040, catégorie IB, 2,500 %, échéance le 25/11/2050	11	0,01	400 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 5,500 % ±	402	0,30
349 Freddie Mac REMICS 5059, catégorie IB, 2,500 %, échéance le 25/01/2051	55	0,04	5 Government National Mortgage Association, série 2007 51, catégorie SG, 1,982 %, échéance le 20/08/2037 *	—	—
79 Freddie Mac REMICS 5069, catégorie MI, 2,500 %, échéance le 25/02/2051	12	0,01	9 Government National Mortgage Association, série 2009 H01, catégorie FA, 5,748 %, échéance le 20/11/2059 *	9	0,01
440 Freddie Mac REMICS 5085, catégorie NI, 2,000 %, échéance le 25/03/2051	50	0,04	1 Government National Mortgage Association, série 2010 85, catégorie HS, 2,052 %, échéance le 20/01/2040 *	—	—
182 Freddie Mac REMICS 5140, catégorie NI, 2,500 %, échéance le 25/05/2049	26	0,02	20 Government National Mortgage Association, série 2010 H26, catégorie LF, 4,742 %, échéance le 20/08/2058 *	20	0,02
200 Freddie Mac REMICS 5224, catégorie HL, 4,000 %, échéance le 25/04/2052	182	0,14	33 Government National Mortgage Association, série 2011 H01, catégorie AF, 4,842 %, échéance le 20/11/2060 *	33	0,02
420 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, série 2022 DNA3, catégorie M1B, 144A, 7,384 %, échéance le 25/04/2042 *	421	0,32	37 Government National Mortgage Association, série 2011 H09, catégorie AF, 4,892 %, échéance le 20/03/2061 *	37	0,03
71 Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates, série T 56, catégorie 2AF, 5,017 %, échéance le 25/05/2043 *	70	0,05	92 Government National Mortgage Association, série 2012 112, catégorie IO, 0,130 %, échéance le 16/02/2053 *	—	—
17 Ginnie Mae I Pool '557522', 7,000 %, échéance le 15/07/2031	18	0,01	44 Government National Mortgage Association, série 2012 27, catégorie IO, 0,271 %, échéance le 16/04/2053 *	—	—
10 Ginnie Mae I Pool '565347', 7,000 %, échéance le 15/08/2031	10	0,01	18 Government National Mortgage Association, série 2012 34, catégorie SA, 1,452 %, échéance le 20/03/2042 *	2	—
3 Ginnie Mae I Pool '584344', 7,000 %, échéance le 15/04/2032	3	—	21 Government National Mortgage Association, série 2012 44, catégorie IO, 0,029 %, échéance le 16/03/2049 *	—	—
66 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, échéance le 15/06/2048	62	0,05	15 Government National Mortgage Association, série 2012 H18, catégorie NA, 4,912 %, échéance le 20/08/2062 *	15	0,01
38 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, échéance le 15/09/2042	35	0,03	36 Government National Mortgage Association, série 2012 H27, catégorie AL, 1,621 %, échéance le 20/10/2062 *	1	—
54 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, échéance le 15/09/2042	50	0,04	16 Government National Mortgage Association, série 2012 H30, catégorie GA, 4,742 %, échéance le 20/12/2062 *	16	0,01
122 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, échéance le 15/10/2042	113	0,09	77 Government National Mortgage Association, série 2013 107, catégorie AD, 2,845 %, échéance le 16/11/2047 *	70	0,05
7 Ginnie Mae II Pool '4837', 6,000 %, échéance le 20/10/2040	8	0,01	20 Government National Mortgage Association, série 2013 163, catégorie IO, 1,018 %, échéance le 16/02/2046 *	—	—
7 Ginnie Mae II Pool '4923', 4,500 %, échéance le 20/01/2041	7	—	70 Government National Mortgage Association, série 2013 H08, catégorie BF, 4,792 %, échéance le 20/03/2063 *	70	0,05
4 Ginnie Mae II Pool '4961', 6,000 %, échéance le 20/02/2041	4	—	41 Government National Mortgage Association, série 2014 105, catégorie IO, 0,121 %, échéance le 16/06/2054 *	—	—
16 Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500 %, échéance le 20/03/2041	16	0,01	8 Government National Mortgage Association, série 2014 17, catégorie AM, 3,537 %, échéance le 16/06/2048 *	8	0,01
8 Ginnie Mae II Pool '5240', 6,000 %, échéance le 20/11/2041	8	0,01	12 Government National Mortgage Association, série 2014 47, catégorie IA, 0,147 %, échéance le 16/02/2048 *	—	—
14 Ginnie Mae II Pool '784106', 3,500 %, échéance le 20/01/2046	13	0,01	50 Government National Mortgage Association, série 2014 50, catégorie IO, 0,629 %, échéance le 16/09/2055 *	1	—
464 Ginnie Mae II Pool '784577', 4,000 %, échéance le 20/07/2047	446	0,34	250 Government National Mortgage Association, série 2014 92, catégorie IX, 0,102 %, échéance le 16/05/2054 *	1	—
11 Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500 %, échéance le 20/10/2049	10	0,01	443 Government National Mortgage Association, série 2014 H20, catégorie FA, 4,822 %, échéance le 20/10/2064 *	441	0,33
126 Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000 %, échéance le 20/01/2050	113	0,09	46 Government National Mortgage Association, série 2015 167, catégorie OI, 4,000 %, échéance le 16/04/2045	8	0,01
26 Ginnie Mae II Pool '784985', 3,500 %, échéance le 20/09/2048	24	0,02	31 Government National Mortgage Association, série 2015 36, catégorie MI, 5,500 %, échéance le 20/03/2045	5	—
59 Ginnie Mae II Pool '785359', 2,000 %, échéance le 20/03/2051	49	0,04	569 Government National Mortgage Association, série 2015 5, catégorie IK, 0,296 %, échéance le 16/11/2054 *	5	—
88 Ginnie Mae II Pool '785360', 2,000 %, échéance le 20/03/2051	71	0,05	265 Government National Mortgage Association, série 2016 128, catégorie IO, 0,737 %, échéance le 16/09/2056 *	9	0,01
94 Ginnie Mae II Pool '785944', 3,000 %, échéance le 20/02/2052	84	0,06	79 Government National Mortgage Association, série 2020 123, catégorie IL, 2,500 %, échéance le 20/08/2050	11	0,01
97 Ginnie Mae II Pool '786095', 3,000 %, échéance le 20/04/2052	84	0,06			
96 Ginnie Mae II Pool '786108', 3,500 %, échéance le 20/03/2052	88	0,07			
183 Ginnie Mae II Pool '786134', 3,000 %, échéance le 20/04/2052	159	0,12			
27 Ginnie Mae II Pool 'BC4732', 3,500 %, échéance le 20/10/2047	25	0,02			
30 Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500 %, échéance le 20/02/2050	28	0,02			
80 Ginnie Mae II Pool 'BM9743', 4,000 %, échéance le 20/11/2049	75	0,06			
34 Ginnie Mae II Pool 'B51742', 4,000 %, échéance le 20/02/2050	33	0,02			

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques — (suite)					
160 Government National Mortgage Association, série 2020 123, catégorie NI, 2,500 %, échéance le 20/08/2050	22	0,02	460 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C41, série 2017 C41, catégorie B, 4,188 %, échéance le 15/11/2050 *	413	0,31
78 Government National Mortgage Association, série 2020 127, catégorie IN, 2,500 %, échéance le 20/08/2050	11	0,01	1 529 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C23, série 2014 C23, catégorie XA, 0,550 %, échéance le 15/10/2057 *	10	0,01
81 Government National Mortgage Association, série 2020 129, catégorie IE, 2,500 %, échéance le 20/09/2050	12	0,01	15 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14, série 2014 LC14, catégorie ASB, 3,522 %, échéance le 15/03/2047	15	0,01
83 Government National Mortgage Association, série 2020 160, catégorie IH, 2,500 %, échéance le 20/10/2050	12	0,01	Total des titres adossés à des hypothèques (coût 51 9155)	47 750	36,20
81 Government National Mortgage Association, série 2020 160, catégorie VI, 2,500 %, échéance le 20/10/2050	11	0,01	Obligations et bons d'entreprises — 37,25 % (28 février 2022 : 39,60 %)		
330 Government National Mortgage Association, série 2020 160, catégorie YI, 2,500 %, échéance le 20/10/2050	45	0,03	Australie — 0,05 % (28 février 2022 : 0,30 %)		
4 429 Government National Mortgage Association, série 2020 178, catégorie IO, 1,422 %, échéance le 16/10/2060 *	408	0,31	70 BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000 %, échéance le 30/09/2043	68	0,05
3 245 Government National Mortgage Association, série 2020 179, catégorie IO, 1,008 %, échéance le 16/09/2062 *	226	0,17	Belgique — 0,45 % (28 février 2022 : 0,61 %)		
392 Government National Mortgage Association, série 2020 181, catégorie WI, 2,000 %, échéance le 20/12/2050	42	0,03	120 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,650 %, échéance le 01/02/2026	115	0,09
1 669 Government National Mortgage Association, série 2020 195, catégorie IO, 0,926 %, échéance le 16/12/2062 *	113	0,09	140 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,000 %, échéance le 13/04/2028	134	0,10
269 Government National Mortgage Association, série 2020 47, catégorie MI, 3,500 %, échéance le 20/04/2050	44	0,03	60 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, échéance le 01/06/2030	55	0,04
73 Government National Mortgage Association, série 2020 47, catégorie NI, 3,500 %, échéance le 20/04/2050	12	0,01	180 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, échéance le 01/06/2040	158	0,12
184 Government National Mortgage Association, série 2020 H04, catégorie FP, 4,892 %, échéance le 20/06/2069 *	182	0,14	15 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, échéance le 15/04/2048	13	0,01
191 Government National Mortgage Association, série 2020 H09, catégorie FL, 5,542 %, échéance le 20/05/2070 *	190	0,14	100 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,439 %, échéance le 06/10/2048	87	0,07
117 Government National Mortgage Association, série 2020 H09, catégorie NF, 5,642 %, échéance le 20/04/2070 *	118	0,09	30 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, échéance le 23/01/2049	30	0,02
65 Government National Mortgage Association, série 2020 H13, catégorie FA, 3,084 %, échéance le 20/07/2070 *	63	0,05		592	0,45
5 961 Government National Mortgage Association, série 2021 10, catégorie IO, 0,983 %, échéance le 16/05/2063 *	433	0,33	Brésil — 0,57 % (28 février 2022 : 0,81 %)		
171 Government National Mortgage Association, série 2021 115, catégorie MI, 2,500 %, échéance le 20/05/2051	19	0,01	10 Petrosbras Global Finance BV, 6,250 %, échéance le 17/03/2024	10	0,01
5 043 Government National Mortgage Association, série 2021 5, catégorie IO, 1,112 %, échéance le 16/01/2061 *	378	0,29	50 Petrosbras Global Finance BV, 6,850 %, échéance le 05/06/2115	42	0,03
200 Government National Mortgage Association, série 2022 3, catégorie B, 1,850 %, échéance le 16/02/2061	118	0,09	490 Suzano Austria GmbH, 6,000 %, échéance le 15/01/2029	481	0,36
882 Government National Mortgage Association, série 2022 3, catégorie IO, 0,640 %, échéance le 16/02/2061 *	44	0,03	20 Vale Overseas Ltd, 6,875 %, échéance le 21/11/2036	21	0,02
100 Government National Mortgage Association, série 2022 63, catégorie LM, 3,500 %, échéance le 20/10/2050	85	0,06	200 Vale Overseas Ltd, 6,875 %, échéance le 10/11/2039	204	0,15
570 GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-3PCK, série 2018 3PCK, catégorie B, 144A, 7,338 %, échéance le 15/09/2031 *	535	0,41		758	0,57
471 GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, série 2018 SRP5, catégorie A, 144A, 6,388 %, échéance le 15/09/2031 *	404	0,31	Canada — 0,83 % (28 février 2022 : 0,63 %)		
10 GS Mortgage Securities Trust 2013-GC16, série 2013 GC16, catégorie B, 5,161 %, échéance le 10/11/2046 *	10	0,01	90 Banque de Montréal, 1,850 %, échéance le 01/05/2025	83	0,06
75 HarborView Mortgage Loan Trust 2005-9, série 2005 9, catégorie 2A1B, 5,331 %, échéance le 20/06/2035 *	68	0,05	30 Bank of Montreal, 3,803 %, échéance le 15/12/2032 *	27	0,02
450 Independence Plaza Trust 2018-INDP, série 2018 INDP, catégorie A, 144A, 3,763 %, échéance le 10/07/2035	423	0,32	80 Bank of Nova Scotia/The, 3,450 %, échéance le 11/04/2025	77	0,06
10 JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17, série 2013 C17, catégorie B, 4,883 %, échéance le 15/01/2047 *	10	0,01	130 Bank of Nova Scotia/The, 1,300 %, échéance le 11/06/2025	119	0,09
120 JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23, série 2014 C23, catégorie AS, 4,202 %, échéance le 15/09/2047 *	116	0,09	70 Bank of Nova Scotia/The, 4,588 %, échéance le 04/05/2037 *	61	0,05
430 Mill City Mortgage Trust 2015-2, série 2015 2, catégorie M3, 144A, 3,688 %, échéance le 25/09/2057 *	416	0,31	40 Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, échéance le 30/05/2041	40	0,03
100 Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C18, série 2014 C18, catégorie AS, 4,110 %, échéance le 15/10/2047 *	96	0,07	40 Barrick PD Australia Finance Pty Ltd, 5,950 %, échéance le 15/10/2039	41	0,03
227 Morgan Stanley Capital I Trust 2017-ASHF, série 2017 ASHF, catégorie A, 144A, 5,563 %, échéance le 15/11/2034 *	223	0,17	350 Canadian Pacific Railway Co, 2,450 %, échéance le 02/12/2031	292	0,22
550 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, série 2019 FAME, catégorie A, 144A, 3,047 %, échéance le 15/08/2036	514	0,39	80 Canadian Pacific Railway Co, 3,000 %, échéance le 02/12/2041	61	0,05
172 New Residential Mortgage Loan Trust 2015-2, série 2015 2A, catégorie A1, 144A, 3,750 %, échéance le 25/08/2055 *	159	0,12	130 Royal Bank of Canada, 1,600 %, échéance le 17/04/2023	129	0,10
258 New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, série 2016 3A, catégorie A1B, 144A, 3,250 %, échéance le 25/09/2056 *	234	0,18	60 Banque Royale du Canada, 1,150 %, échéance le 10/06/2025	55	0,04
255 New Residential Mortgage Loan Trust 2017-2, série 2017 2A, catégorie B1, 144A, 4,500 %, échéance le 25/03/2057 *	236	0,18	120 Banque Royale du Canada, 3,875 %, échéance le 05/04/2032	108	0,08
288 New Residential Mortgage Loan Trust 2018-3, série 2018 3A, catégorie A1, 144A, 4,500 %, échéance le 25/05/2058 *	268	0,20		1 093	0,83
200 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, série 2021 NQ2R, catégorie A3, 144A, 1,353 %, échéance le 25/10/2058 *	180	0,14	Chili — 0,28 % (28 février 2022 : 0,35 %)		
5 Thornburg Mortgage Securities Trust 2007-4, série 2007 4, catégorie 1A1, 3,275 %, échéance le 25/09/2037 *	5	—	400 Corp Nacional del Cobre de Chile, 3,625 %, échéance le 01/08/2027	374	0,28
300 UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C15, série 2018 C15, catégorie C, 5,152 %, échéance le 15/12/2051 *	262	0,20	Chine — 0,45 % (28 février 2022 : 0,24 %)		
324 WaMu Mortgage Pass-Through Certificated série 2005-AR6 Trust, série 2005 AR6, catégorie 2A1A, 5,077 %, échéance le 25/04/2045 *	313	0,24	80 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2,700 %, échéance le 01/05/2025	75	0,06
1 001 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1, série 2015 NXS1, Classe XA, 1,072 %, échéance le 15/05/2048 *	16	0,01	420 Prosus NV, 144A, 4,027 %, échéance le 03/08/2050	266	0,20
150 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, série 2016 C36, catégorie A3, 2,807 %, échéance le 15/11/2059	137	0,10	250 Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd, 4,375 %, échéance le 10/04/2024	248	0,19
1 436 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, série 2016 C36, catégorie XA, 1,182 %, échéance le 15/11/2059 *	47	0,04		589	0,45
			Colombie — 0,33 % (28 février 2022 : 0,24 %)		
			650 Ecopetrol SA, 5,875 %, échéance le 28/05/2045	429	0,33
			Danemark — 0,30 % (28 février 2022 : 0,18 %)		
			200 Danske Bank A/S, 144A, 3,875 %, échéance le 12/09/2023	198	0,15
			200 Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, échéance le 12/01/2024	200	0,15
				398	0,30
			France — 0,73 % (28 février 2022 : 0,64 %)		
			230 Telefonica Chile SA, 144A, 4,705 %, échéance le 10/01/2025 *	198	0,15
			400 BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, échéance le 09/06/2026 *	370	0,28
			200 BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, échéance le 14/08/2028	189	0,14
			210 BNP Paribas SA, 144A, 5,125 %, échéance le 13/01/2029 *	206	0,16
				963	0,73
			Inde — 0,14 % (28 février 2022 : 0,11 %)		
			270 Reliance Industries Ltd, 144A, 3,625 %, échéance le 12/01/2052	189	0,14
			Irlande — 0,29 % (28 février 2022 : 0,18 %)		
			230 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 2,450 %, échéance le 29/10/2026	203	0,15
			210 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,000 %, échéance le 29/10/2028	179	0,14
				382	0,29
			Japon — 0,15 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
			200 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3,837 %, échéance le 17/04/2026 *	192	0,15

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
Kazakhstan — 0,44 % (28 février 2022 : 0,30 %)					
650 KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, échéance le 24/04/2030	588	0,44	40 Alphabet Inc, 2,050 %, échéance le 15/08/2050	24	0,02
Macao — 0,15 % (28 février 2022 : 0,08 %)					
200 Sands China Ltd, 5,625 %, échéance le 08/08/2025	194	0,15	200 Amazon.com Inc, 3,150 %, échéance le 22/08/2027	187	0,14
Mexique — 0,62 % (28 février 2022 : 0,55 %)					
400 Comision Federal de Electricidad, 144A, 3,875 %, échéance le 26/07/2033	304	0,23	60 Amazon.com Inc, 3,450 %, échéance le 13/04/2029	56	0,04
200 Orbia Advance Corp SAB de CV, 144A, 2,875 %, échéance le 11/05/2031	158	0,12	100 Amazon.com Inc, 1,500 %, échéance le 03/06/2030	80	0,06
380 Southern Copper Corp, 5,250 %, échéance le 08/11/2042	356	0,27	80 Amazon.com Inc, 2,100 %, échéance le 12/05/2031	66	0,05
	818	0,62	250 Amazon.com Inc, 3,600 %, échéance le 13/04/2032	229	0,17
Pays-Bas — 0,65 % (28 février 2022 : 0,64 %)					
250 Cooperative Rabobank UA, 4,375 %, échéance le 04/08/2025	242	0,18	80 Amazon.com Inc, 4,950 %, échéance le 05/12/2044	79	0,06
260 Cooperative Rabobank UA/NY, 3,375 %, échéance le 21/05/2025	250	0,19	410 Amazon.com Inc, 2,500 %, échéance le 03/06/2050	264	0,20
120 Shell International Finance BV, 2,750 %, échéance le 06/04/2030	105	0,08	30 Amazon.com Inc, 4,250 %, échéance le 22/08/2057	26	0,02
10 Shell International Finance BV, 4,550 %, échéance le 12/08/2043	9	0,01	210 American Express Co, 2,500 %, échéance le 30/07/2024	202	0,15
140 Shell International Finance BV, 4,000 %, échéance le 10/05/2046	117	0,09	90 American Express Co, 4,050 %, échéance le 03/05/2029	85	0,07
180 Shell International Finance BV, 3,250 %, échéance le 06/04/2050	133	0,10	16 American International Group Inc, 2,500 %, échéance le 30/06/2025	15	0,01
	856	0,65	20 American International Group Inc, 4,750 %, échéance le 01/04/2048	18	0,01
Pérou — 0,33 % (28 février 2022 : 0,58 %)					
400 Petroleos del Peru SA, 4,750 %, échéance le 19/06/2032	307	0,23	30 American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, échéance le 15/01/2032	25	0,02
200 Petroleos del Peru SA, 144A, 5,625 %, échéance le 19/06/2047	133	0,10	11 Amgen Inc, 4,663 %, échéance le 15/06/2051	10	0,01
	440	0,33	260 Apple Inc, 1,125 %, échéance le 11/05/2025	240	0,18
Afrique du Sud — 0,21 % (28 février 2022 : 0,13 %)					
290 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, échéance le 10/04/2027	282	0,21	200 Applied Materials Inc, 1,750 %, échéance le 01/06/2030	163	0,12
Espagne — 0,52 % (28 février 2022 : 0,42 %)					
600 Banco Santander SA, 2,746 %, échéance le 28/05/2025	563	0,43	70 AT&T Inc, 3,800 %, échéance le 15/02/2027	66	0,05
150 Telefonica Emisiones SA, 5,213 %, échéance le 08/03/2047	126	0,09	190 AT&T Inc, 2,300 %, échéance le 01/06/2027	169	0,13
	689	0,52	130 AT&T Inc, 1,650 %, échéance le 01/02/2028	110	0,08
Suède — 0,15 % (28 février 2022 : 0,08 %)					
200 Swedbank AB, 144A, 1,300 %, échéance le 02/06/2023	198	0,15	40 AT&T Inc, 2,250 %, échéance le 01/02/2032	31	0,02
Suisse — 1,25 % (28 février 2022 : 0,84 %)					
310 Credit Suisse AG/New York NY, 1,000 %, échéance le 05/05/2023	307	0,23	60 AT&T Inc, 2,550 %, échéance le 01/12/2033	46	0,04
370 Credit Suisse AG/New York NY, 7,950 %, échéance le 01/09/2025	374	0,28	10 AT&T Inc, 5,350 %, échéance le 01/09/2040	10	0,01
250 Credit Suisse AG/New York NY, 2,950 %, échéance le 09/04/2025	227	0,17	10 AT&T Inc, 5,550 %, échéance le 15/08/2041	10	0,01
500 Credit Suisse Group AG, 144A, 4,194 %, échéance le 01/04/2031 *	397	0,30	37 AT&T Inc, 4,350 %, échéance le 15/06/2045	30	0,02
250 Credit Suisse Group AG, 144A, 3,091 %, échéance le 14/05/2032 *	176	0,14	28 AT&T Inc, 4,500 %, échéance le 09/03/2048	23	0,02
200 UBS Group AG, 144A, 3,126 %, échéance le 13/08/2030 *	171	0,13	40 AT&T Inc, 3,500 %, échéance le 15/09/2053	27	0,02
	1 652	1,25	116 AT&T Inc, 3,550 %, échéance le 15/09/2055	79	0,06
Taiwan — 0,36 % (28 février 2022 : 0,23 %)					
570 TSMC Arizona Corp, 2,500 %, échéance le 25/10/2031	473	0,36	10 AT&T Inc, 3,800 %, échéance le 01/12/2057	7	0,01
Émirats arabes unis — 0,54 % (28 février 2022 : 0,63 %)					
730 DP World Ltd/Emirats Arabes Unis, 144A, 5,625 %, échéance le 25/09/2048	707	0,54	63 AT&T Inc, 3,650 %, échéance le 15/09/2059	43	0,03
Royaume-Uni — 1,57 % (28 février 2022 : 1,45 %)					
200 Barclays Plc, 4,972 %, échéance le 16/05/2029 *	191	0,14	90 Bank of America Corp, 3,550 %, échéance le 05/03/2024 *	90	0,07
200 HSBC Holdings Plc, 2,633 %, échéance le 07/11/2025 *	189	0,14	310 Bank of America Corp, 4,000 %, échéance le 22/01/2025	302	0,23
350 HSBC Holdings Plc, 4,300 %, échéance le 08/03/2026	339	0,26	10 Bank of America Corp, 4,450 %, échéance le 03/03/2026	10	0,01
400 HSBC Holdings Plc, 4,041 %, échéance le 13/03/2028 *	374	0,28	50 Bank of America Corp, 3,500 %, échéance le 19/04/2026	48	0,04
200 Lloyds Banking Group Plc, 4,650 %, échéance le 24/03/2026	193	0,15	260 Bank of America Corp, 1,319 %, échéance le 19/06/2026 *	236	0,18
200 Nationwide Building Society, 144A, 4,363 %, échéance le 01/08/2024 *	198	0,15	160 Bank of America Corp, 4,250 %, échéance le 22/10/2026	154	0,12
200 Natwest Group Plc, 4,519 %, échéance le 25/06/2024 *	199	0,15	180 Bank of America Corp, 3,593 %, échéance le 21/07/2028 *	166	0,13
200 NatWest Group Plc, 4,269 %, échéance le 22/03/2025 *	196	0,15	193 Bank of America Corp, 3,419 %, échéance le 20/12/2028 *	176	0,13
200 NatWest Group Plc, 4,892 %, échéance le 18/05/2029 *	191	0,15	220 Bank of America Corp, 3,970 %, échéance le 05/03/2029 *	204	0,16
	2 070	1,57	200 Bank of America Corp, 3,974 %, échéance le 07/02/2030 *	183	0,14
États-Unis — 25,89 % (28 février 2022 : 28,00 %)					
10 3M Co, 2,375 %, échéance le 26/08/2029	8	0,01	210 Bank of America Corp, 2,592 %, échéance le 29/04/2031 *	174	0,13
90 3M Co, 3,700 %, échéance le 15/04/2050	70	0,05	130 Bank of America Corp, 2,572 %, échéance le 20/10/2032 *	104	0,08
10 Abbott Laboratories, 4,750 %, échéance le 30/11/2036	10	0,01	130 Bank of America Corp, 2,972 %, échéance le 04/02/2033 *	106	0,08
100 Abbott Laboratories, 4,900 %, échéance le 30/11/2046	98	0,07	140 Bank of America Corp, 5,000 %, échéance le 21/01/2044	133	0,10
100 AbbVie Inc, 3,800 %, échéance le 15/03/2025	97	0,07	130 Bank of America Corp, 3,946 %, échéance le 23/01/2049 *	103	0,08
20 AbbVie Inc, 3,600 %, échéance le 14/05/2025	19	0,01	250 Bank of America Corp, 4,083 %, échéance le 20/03/2051 *	201	0,15
90 AbbVie Inc, 2,950 %, échéance le 21/11/2026	83	0,06	30 Bank of New York Mellon Corp/The, 1,600 %, échéance le 24/04/2025	28	0,02
760 AbbVie Inc, 3,200 %, échéance le 21/11/2029	672	0,51	83 Becton Dickinson and Co, 4,685 %, échéance le 15/12/2044	74	0,06
10 AbbVie Inc, 4,875 %, échéance le 14/11/2048	9	0,01	80 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, échéance le 15/01/2049	71	0,05
20 AbbVie Inc, 4,250 %, échéance le 21/11/2049	17	0,01	340 Boston Properties LP, 3,400 %, échéance le 21/06/2029	292	0,22
210 Adobe Inc, 2,300 %, échéance le 01/02/2030	180	0,14	40 BP Capital Markets America Inc, 3,410 %, échéance le 11/02/2026	38	0,03
10 Aetna Inc, 2,800 %, échéance le 15/06/2023	10	0,01	110 BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, échéance le 04/05/2026	104	0,08
10 Aetna Inc, 3,875 %, échéance le 15/08/2047	8	0,01	80 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, échéance le 06/04/2030	73	0,06
90 Air Lease Corp, 3,375 %, échéance le 01/07/2025	85	0,06	170 BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, échéance le 24/02/2050	115	0,09
70 Air Lease Corp, 5,300 %, échéance le 01/02/2028	68	0,05	19 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, arrivant à échéance le 26/07/2029	17	0,01
210 Alphabet Inc, 1,100 %, échéance le 15/08/2030	166	0,13	110 Bristol-Myers Squibb Co, 4,250 %, échéance le 26/10/2049	95	0,07
70 Alphabet Inc, 1,900 %, échéance le 15/08/2040	47	0,04	290 Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, échéance le 15/11/2035	214	0,16
			410 Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, échéance le 15/01/2035	342	0,26
			10 Carrier Global Corp, 3,577 %, échéance le 05/04/2050	7	0,01
			180 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, échéance le 23/07/2025	176	0,13
			310 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, échéance le 15/03/2028	285	0,22
			80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, échéance le 30/03/2029	75	0,06
			100 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,400 %, échéance le 01/04/2033	86	0,07
			90 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, échéance le 01/04/2038	75	0,06
			40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, échéance le 01/03/2042	26	0,02
			90 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, échéance le 23/10/2045	82	0,06
			10 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, échéance le 01/05/2047	8	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)			40 Diamondback Energy Inc, 3,125 %, échéance le 24/03/2031	34	0,03
États-Unis — (suite)			50 Eaton Corp, 4,150 %, échéance le 02/11/2042	43	0,03
100 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, échéance le 01/04/2048	84	0,06	40 Elevance Health Inc, 4,100 %, échéance le 15/05/2032	37	0,03
40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, échéance le 01/07/2049	31	0,02	210 Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, échéance le 16/10/2028	199	0,15
40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, échéance le 01/03/2050	29	0,02	160 Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, échéance le 31/01/2030	137	0,10
60 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,500 %, échéance le 01/04/2063	47	0,04	20 Enterprise Products Operating LLC, 7,550 %, échéance le 15/04/2038	23	0,02
100 Chevron Corp, 2,954 %, échéance le 16/05/2026	94	0,07	60 Enterprise Products Operating LLC, 5,700 %, échéance le 15/02/2042	59	0,05
30 Chevron USA Inc, 3,850 %, échéance le 15/01/2028	29	0,02	20 Enterprise Products Operating LLC, 4,850 %, échéance le 15/03/2044	18	0,01
150 Cigna Group/The, 4,125 %, échéance le 15/11/2025	146	0,11	20 Enterprise Products Operating LLC, 4,800 %, échéance le 01/02/2049	18	0,01
320 Cigna Group/The, 4,375 %, échéance le 15/10/2028	307	0,23	170 Enterprise Products Operating LLC, 4,200 %, échéance le 31/01/2050	137	0,10
20 Cigna Group/The, 4,900 %, échéance le 15/12/2048	18	0,01	20 Enterprise Products Operating LLC, 3,700 %, échéance le 31/01/2051	15	0,01
30 Cintas Corp No 2, 3,700 %, échéance le 01/04/2027	29	0,02	10 Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, échéance le 31/01/2060	7	0,01
60 Cintas Corp No 2, 4,000 %, échéance le 01/05/2032	56	0,04	30 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, échéance le 15/02/2078 *	25	0,02
80 Citigroup Inc, 1,678 %, échéance le 15/05/2024 *	79	0,06	140 EOG Resources Inc, 4,375 %, échéance le 15/04/2030	135	0,10
190 Citigroup Inc, 0,776 %, échéance le 30/10/2024 *	184	0,14	160 EOG Resources Inc, 3,900 %, échéance le 01/04/2035	141	0,11
60 Citigroup Inc, 4,400 %, échéance le 10/06/2025	59	0,04	190 EOG Resources Inc, 4,950 %, échéance le 15/04/2050	183	0,14
60 Citigroup Inc, 5,500 %, échéance le 13/09/2025	60	0,05	100 EQT Corp, 7,000 %, échéance le 01/02/2030	103	0,08
90 Citigroup Inc, 3,106 %, échéance le 08/04/2026 *	85	0,07	50 FirstEnergy Corp, série A, 1,600 %, échéance le 15/01/2026	45	0,03
30 Citigroup Inc, 4,300 %, échéance le 20/11/2026	29	0,02	180 FirstEnergy Corp, série B, 4,150 %, échéance le 15/07/2027	168	0,13
180 Citigroup Inc, 4,450 %, échéance le 29/09/2027	172	0,13	200 FirstEnergy Corp, série C, 5,100 %, échéance le 15/07/2047	179	0,14
90 Citigroup Inc, 4,658 %, échéance le 17/03/2033 *	87	0,07	40 Freeport-McMoRan Inc, 5,400 %, échéance le 14/11/2034	38	0,03
150 Citigroup Inc, 3,520 %, échéance le 27/10/2028 *	137	0,10	30 Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, échéance le 15/03/2043	27	0,02
200 Citigroup Inc, 3,980 %, échéance le 20/03/2030 *	183	0,14	30 General Motors Co, 5,600 %, échéance le 15/10/2032	29	0,02
220 Citigroup Inc, 4,412 %, échéance le 31/03/2031 *	205	0,16	10 General Motors Co, 6,600 %, échéance le 01/04/2036	10	0,01
280 Citigroup Inc, 2,572 %, échéance le 03/06/2031 *	230	0,17	10 General Motors Co, 5,150 %, échéance le 01/04/2038	9	0,01
120 Citigroup Inc, 3,785 %, échéance le 17/03/2033 *	104	0,08	30 General Motors Co, 6,250 %, échéance le 02/10/2043	28	0,02
30 Citigroup Inc, 4,910 %, échéance le 24/05/2033 *	28	0,02	10 General Motors Co, 5,950 %, échéance le 01/04/2049	9	0,01
90 Citigroup Inc, 8,125 %, échéance le 15/07/2039	114	0,09	100 Gilead Sciences Inc, 3,650 %, échéance le 01/03/2026	96	0,07
77 Citigroup Inc, 4,650 %, échéance le 30/07/2045	68	0,05	3 Goldman Sachs Capital II, 5,730 %, perpétuelle *	2	—
10 Citigroup Inc, 4,750 %, échéance le 18/05/2046	9	0,01	150 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, échéance le 01/04/2025	145	0,11
60 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, échéance le 01/06/2040	44	0,03	140 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250 %, échéance le 21/10/2025	136	0,10
30 Coca-Cola Co/The, 2,600 %, échéance le 01/06/2050	20	0,02	330 Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, échéance le 12/02/2026 *	300	0,23
120 Comcast Corp, 3,300 %, échéance le 01/04/2027	112	0,09	90 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, échéance le 16/11/2026	85	0,06
140 Comcast Corp, 4,150 %, échéance le 15/10/2028	134	0,10	40 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,615 %, échéance le 15/03/2028 *	37	0,03
80 Comcast Corp, 3,400 %, échéance le 01/04/2030	72	0,06	180 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,814 %, échéance le 23/04/2029 *	165	0,13
120 Comcast Corp, 4,250 %, échéance le 15/10/2030	123	0,09	450 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223 %, échéance le 01/05/2029 *	422	0,32
121 Comcast Corp, 7,050 %, échéance le 15/03/2033	138	0,10	30 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, échéance le 01/02/2041	32	0,02
80 Comcast Corp, 3,900 %, échéance le 01/03/2038	69	0,05	200 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, échéance le 22/05/2045	186	0,14
10 Comcast Corp, 3,250 %, échéance le 01/11/2039	8	0,01	10 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750 %, échéance le 21/10/2045	9	0,01
40 Comcast Corp, 3,750 %, échéance le 01/04/2040	33	0,03	50 Guardian Life Global Funding, 144A, 1,100 %, échéance le 23/06/2025	45	0,03
20 Comcast Corp, 3,400 %, échéance le 15/07/2046	15	0,01	4 Halliburton Co, 3,800 %, échéance le 15/11/2025	4	—
20 Comcast Corp, 4,000 %, échéance le 15/08/2047	16	0,01	30 Home Depot Inc/The, 2,500 %, échéance le 15/04/2027	27	0,02
20 Comcast Corp, 3,969 %, échéance le 01/11/2047	16	0,01	80 Home Depot Inc/The, 2,700 %, échéance le 15/04/2030	69	0,05
20 Comcast Corp, 4,000 %, échéance le 01/03/2048	16	0,01	40 Home Depot Inc/The, 3,250 %, échéance le 15/04/2032	35	0,03
10 Comcast Corp, 3,999 %, échéance le 01/11/2049	8	0,01	110 Home Depot Inc/The, 3,300 %, échéance le 15/04/2040	88	0,07
90 Comcast Corp, 2,800 %, échéance le 15/01/2051	57	0,04	20 Home Depot Inc/The, 3,900 %, échéance le 15/06/2047	17	0,01
111 Comcast Corp, 2,887 %, échéance le 01/11/2051	72	0,05	60 Home Depot Inc/The, 3,350 %, échéance le 15/04/2050	45	0,03
54 Comcast Corp, 2,937 %, échéance le 01/11/2056	34	0,03	20 Humana Inc, 4,500 %, échéance le 01/04/2025	20	0,02
10 Comcast Corp, 4,950 %, échéance le 15/10/2058	9	0,01	130 Humana Inc, 3,950 %, échéance le 15/03/2027	124	0,09
20 ConocoPhillips Co, 6,950 %, échéance le 15/04/2029	22	0,02	90 Humana Inc, 3,700 %, échéance le 23/03/2029	82	0,06
50 Consolidated Edison Co of New York Inc, série 20A, 3,350 %, échéance le 01/04/2030	45	0,03	30 Humana Inc, 2,150 %, échéance le 03/02/2032	23	0,02
30 Consolidated Edison Co of New York Inc, série 20B, 3,950 %, échéance le 01/04/2050	24	0,02	50 Intel Corp, 5,125 %, échéance le 10/02/2030	49	0,04
70 Constellation Brands Inc, 4,350 %, échéance le 09/05/2027	68	0,05	40 Intel Corp, 5,200 %, échéance le 10/02/2033	39	0,03
90 Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, échéance le 15/01/2028	83	0,06	90 Intel Corp, 4,750 %, échéance le 25/03/2050	78	0,06
170 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, échéance le 15/01/2031	161	0,12	20 Intel Corp, 3,050 %, échéance le 12/08/2051	13	0,01
100 Costco Wholesale Corp, 1,750 %, échéance le 20/04/2032	79	0,06	130 Johnson & Johnson, 3,700 %, échéance le 01/03/2046	110	0,08
210 Coterra Energy Inc, 3,900 %, échéance le 15/05/2027	197	0,15	300 Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA, 1,750 %, échéance le 15/09/2030	240	0,18
390 Coterra Energy Inc, 4,375 %, échéance le 15/03/2029	360	0,27	70 JPMorgan Chase & Co, 1,514 %, échéance le 01/06/2024 *	69	0,05
40 CVS Health Corp, 3,625 %, échéance le 01/04/2027	38	0,03	230 JPMorgan Chase & Co, 4,023 %, échéance le 05/12/2024 *	227	0,17
100 CVS Health Corp, 4,300 %, échéance le 25/03/2028	96	0,07	190 JPMorgan Chase & Co, 0,563 %, échéance le 16/02/2025 *	180	0,14
110 CVS Health Corp, 3,750 %, échéance le 01/04/2030	99	0,08	100 JPMorgan Chase & Co, 2,083 %, échéance le 22/04/2026 *	93	0,07
20 CVS Health Corp, 1,875 %, échéance le 28/02/2031	16	0,01	70 JPMorgan Chase & Co, 4,125 %, échéance le 15/12/2026	68	0,05
90 CVS Health Corp, 2,125 %, échéance le 15/09/2031	71	0,05	100 JPMorgan Chase & Co, 4,250 %, échéance le 01/10/2027	96	0,07
100 CVS Health Corp, 4,780 %, échéance le 25/03/2038	91	0,07	110 JPMorgan Chase & Co, 3,625 %, échéance le 01/12/2027	103	0,08
40 CVS Health Corp, 4,125 %, échéance le 01/04/2040	33	0,03	130 JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, échéance le 23/07/2029 *	122	0,09
40 CVS Health Corp, 5,125 %, échéance le 20/07/2045	36	0,03	110 JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, échéance le 05/12/2029 *	104	0,08
250 CVS Health Corp, 5,050 %, échéance le 25/03/2048	225	0,17	210 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, échéance le 22/04/2031 *	174	0,13
3 CVS Pass-Through Trust, 5,880 %, échéance le 10/01/2028	3	—	40 JPMorgan Chase & Co, 2,580 %, échéance le 22/04/2032 *	32	0,02
110 Deere & Co, 3,750 %, échéance le 15/04/2050	94	0,07	115 JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, échéance le 01/06/2045	106	0,08
220 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, échéance le 20/10/2025	214	0,16	50 JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, échéance le 22/04/2051 *	34	0,03
220 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, échéance le 20/10/2028	209	0,16			
160 Devon Energy Corp, 5,850 %, échéance 15/12/2025	161	0,12			
18 Devon Energy Corp, 5,250 %, échéance 15/10/2027	18	0,01			
30 Devon Energy Corp, 4,500 %, échéance 15/01/2030	28	0,02			
40 Devon Energy Corp, 5,600 %, échéance 15/07/2041	37	0,03			
70 Devon Energy Corp, 4,750 %, échéance 15/05/2042	58	0,04			
200 Devon Energy Corp, 5,000 %, échéance 15/06/2045	170	0,13			
170 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, échéance le 01/12/2029	150	0,11			

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
États-Unis — (suite)					
30 Kimberly-Clark Corp, 3,100 %, échéance le 26/03/2030	27	0,02	110 T-Mobile USA Inc, 3,000 %, échéance le 15/02/2041	77	0,06
70 KLA Corp, 4,650 %, échéance le 15/07/2032	68	0,05	30 T-Mobile USA Inc, 3,300 %, échéance le 15/02/2051	20	0,02
240 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, échéance le 08/08/2024	231	0,18	170 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, échéance le 01/02/2026	180	0,14
20 Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, échéance le 25/06/2025	19	0,01	140 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,250 %, échéance le 15/05/2030	122	0,09
104 Lehman Swap Receipt, coupon zéro, perpétuelle t=0	—	—	150 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,950 %, échéance le 15/05/2050	116	0,09
70 Lowe's Cos Inc, 1,700 %, échéance le 15/09/2028	58	0,04	140 Union Pacific Corp, 2,400 %, échéance le 05/02/2030	119	0,09
50 Lowe's Cos Inc, 4,500 %, échéance le 15/04/2030	48	0,04	130 Union Pacific Corp, 3,750 %, échéance le 05/02/2070	95	0,07
260 Mars Inc, 144A, 3,200 %, échéance le 01/04/2030	234	0,18	30 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, échéance le 15/12/2028	28	0,02
400 MassMutual Global Funding II, 144A, 0,850 %, échéance le 09/06/2023	395	0,30	40 UnitedHealth Group Inc, 4,000 %, échéance le 15/05/2029	38	0,03
190 Mastercard Inc, 3,850 %, échéance le 26/03/2050	160	0,12	30 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, échéance le 15/05/2030	25	0,02
30 McDonald's Corp, 3,500 %, échéance le 01/03/2027	28	0,02	20 UnitedHealth Group Inc, 2,300 %, échéance le 15/05/2031	16	0,01
50 McDonald's Corp, 3,500 %, échéance le 01/07/2027	47	0,04	50 UnitedHealth Group Inc, 4,200 %, échéance le 15/05/2032	47	0,04
30 McDonald's Corp, 3,800 %, échéance le 01/04/2028	28	0,02	20 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, échéance le 15/05/2040	15	0,01
80 McDonald's Corp, 2,125 %, échéance le 01/03/2030	66	0,05	50 UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, échéance le 15/03/2043	44	0,03
80 McDonald's Corp, 3,600 %, échéance le 01/07/2030	73	0,06	40 UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, échéance le 15/06/2048	35	0,03
110 McDonald's Corp, 4,875 %, échéance le 09/12/2045	100	0,08	20 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, échéance le 15/12/2048	18	0,01
20 McDonald's Corp, 3,625 %, échéance le 01/09/2049	15	0,01	50 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, échéance le 15/08/2049	39	0,03
40 McDonald's Corp, 4,200 %, échéance le 01/04/2050	33	0,03	110 UnitedHealth Group Inc, 2,900 %, échéance le 15/05/2050	75	0,06
15 Medtronic Inc, 4,625 %, échéance le 15/03/2045	14	0,01	60 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, échéance le 15/08/2059	47	0,04
80 Merck & Co Inc, 1,450 %, échéance le 24/06/2030	64	0,05	20 UnitedHealth Group Inc, 3,125 %, échéance le 15/05/2060	14	0,01
215 MetLife Inc, 6,400 %, échéance le 15/12/2036	216	0,16	150 USAA Capital Corp, 144A, 2,125 %, échéance le 01/05/2030	124	0,09
270 Metropolitan Life Global Funding I, 144A, 0,900 %, échéance le 08/06/2023	267	0,20	40 Verizon Communications Inc, 2,625 %, échéance le 15/08/2026	37	0,03
70 Micron Technology Inc, 5,875 %, échéance le 09/02/2033	68	0,05	40 Verizon Communications Inc, 4,125 %, échéance le 16/03/2027	39	0,03
60 Microsoft Corp, 2,525 %, échéance le 01/06/2050	40	0,03	30 Verizon Communications Inc, 3,000 %, échéance le 22/03/2027	28	0,02
100 Microsoft Corp, 2,921 %, échéance le 17/03/2052	72	0,05	100 Verizon Communications Inc, 2,100 %, échéance le 22/03/2028	86	0,07
20 Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC, 144A, 4,100 %, échéance le 15/05/2028	19	0,01	105 Verizon Communications Inc, 4,329 %, échéance le 21/09/2028	101	0,08
90 Mondelez International Inc, 1,500 %, échéance le 04/05/2025	83	0,06	30 Verizon Communications Inc, 3,875 %, échéance le 08/02/2029	28	0,02
260 Morgan Stanley, série I, 0,864 %, échéance le 21/10/2025 *	240	0,18	100 Verizon Communications Inc, 3,150 %, échéance le 22/03/2030	88	0,07
150 Morgan Stanley, 2,188 %, échéance le 28/04/2026 *	140	0,11	310 Verizon Communications Inc, 2,550 %, échéance le 21/03/2031	254	0,19
160 Morgan Stanley, 3,772 %, échéance le 24/01/2029 *	148	0,11	146 Verizon Communications Inc, 2,355 %, échéance le 15/03/2032	115	0,09
210 Morgan Stanley, 2,699 %, échéance le 22/01/2031 *	175	0,13	290 Verizon Communications Inc, 4,500 %, échéance le 10/08/2033	270	0,20
200 Morgan Stanley, 3,622 %, échéance le 01/04/2031 *	177	0,13	60 Verizon Communications Inc, 4,400 %, échéance le 01/11/2034	55	0,04
120 MPLX LP, 4,000 %, échéance le 15/03/2028	112	0,09	20 Verizon Communications Inc, 5,250 %, échéance le 16/03/2037	20	0,02
100 MPLX LP, 4,500 %, échéance le 15/04/2038	85	0,07	180 Verizon Communications Inc, 2,650 %, échéance le 20/11/2040	122	0,09
40 MPLX LP, 5,200 %, échéance le 01/03/2047	35	0,03	30 Verizon Communications Inc, 3,400 %, échéance le 22/03/2041	23	0,02
60 MPLX LP, 5,200 %, échéance le 01/12/2047	52	0,04	70 Verizon Communications Inc, 4,125 %, échéance le 15/08/2046	57	0,04
80 MPLX LP, 4,700 %, échéance le 15/04/2048	64	0,05	70 Verizon Communications Inc, 4,862 %, échéance le 21/08/2046	63	0,05
100 New York Life Global Funding, 144A, 0,950 %, échéance le 24/06/2025	90	0,07	130 Verizon Communications Inc, 4,000 %, échéance le 22/03/2050	103	0,08
110 NIKE Inc, 2,850 %, échéance le 27/03/2030	98	0,07	70 Verizon Communications Inc, 2,875 %, échéance le 20/11/2050	44	0,03
60 NIKE Inc, 3,250 %, échéance le 27/03/2040	48	0,04	30 Visa Inc, 3,150 %, échéance le 14/12/2025	29	0,02
10 NIKE Inc, 3,375 %, échéance le 27/03/2050	8	0,01	30 Visa Inc, 4,300 %, échéance le 14/12/2045	27	0,02
180 NVIDIA Corp, 3,500 %, échéance le 01/04/2040	148	0,11	50 Visa Inc, 3,650 %, échéance le 15/09/2047	41	0,03
110 NVIDIA Corp, 3,700 %, échéance le 01/04/2060	84	0,06	30 Walmart Inc, 1,800 %, échéance le 22/09/2031	24	0,02
270 Oracle Corp, 1,650 %, échéance le 25/03/2026	241	0,18	20 Walt Disney Co/The, 6,650 %, échéance le 15/11/2037	23	0,02
20 Oracle Corp, 2,950 %, échéance le 01/04/2030	17	0,01	30 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 3,755 %, échéance le 15/03/2027	28	0,02
50 Oracle Corp, 4,650 %, échéance le 06/05/2030	47	0,04	60 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 4,054 %, échéance le 15/03/2029	54	0,04
160 Oracle Corp, 2,875 %, échéance le 25/03/2031	133	0,10	210 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 4,279 %, échéance le 15/03/2032	181	0,14
60 Otis Worldwide Corp, 2,056 %, échéance le 05/04/2025	56	0,04	20 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,050 %, échéance le 15/03/2042	16	0,01
50 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, échéance le 01/08/2027	43	0,03	240 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,141 %, échéance le 15/03/2052	188	0,14
70 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, échéance le 01/02/2031	55	0,04	61 Wells Fargo & Co, 4,480 %, échéance le 16/01/2024	60	0,05
20 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, échéance le 01/08/2040	14	0,01	140 Wells Fargo & Co, 1,654 %, échéance le 02/06/2024 *	139	0,11
30 Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, échéance le 01/08/2050	19	0,01	90 Wells Fargo & Co, 2,188 %, échéance le 30/04/2026 *	84	0,06
40 PayPal Holdings Inc, 4,400 %, échéance le 01/06/2032	38	0,03	50 Wells Fargo & Co, 4,100 %, échéance le 03/06/2026	48	0,04
40 PepsiCo Inc, 1,625 %, échéance le 01/05/2030	33	0,03	30 Wells Fargo & Co, 3,000 %, échéance le 23/10/2026	28	0,02
40 PepsiCo Inc, 2,875 %, échéance le 15/10/2049	29	0,02	120 Wells Fargo & Co, 4,300 %, échéance le 22/07/2027	116	0,09
110 Pfizer Inc, 2,625 %, échéance le 01/04/2030	96	0,07	60 Wells Fargo & Co, 2,393 %, échéance le 02/06/2028 *	53	0,04
110 Pfizer Inc, 1,700 %, échéance le 28/05/2030	90	0,07	80 Wells Fargo & Co, 4,150 %, échéance le 24/01/2029	75	0,06
120 Pfizer Inc, 2,550 %, échéance le 28/05/2040	87	0,07	130 Wells Fargo & Co, 2,879 %, échéance le 30/10/2030 *	111	0,08
110 Pfizer Inc, 2,700 %, échéance le 28/05/2050	75	0,06	120 Wells Fargo & Co, 4,478 %, échéance le 04/04/2031 *	113	0,09
30 Pioneer Natural Resources Co, 1,125 %, échéance le 15/01/2026	27	0,02	60 Wells Fargo & Co, 3,350 %, échéance le 03/02/2033 *	51	0,04
100 Pioneer Natural Resources Co, 1,900 %, échéance le 15/08/2030	78	0,06	20 Wells Fargo & Co, 4,650 %, échéance le 04/11/2044	17	0,01
160 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, échéance le 15/01/2031	126	0,10	50 Wells Fargo & Co, 4,900 %, échéance le 17/11/2045	44	0,03
50 Principal Life Global Funding II, 144A, 1,250 %, échéance le 23/06/2025	45	0,03	430 Wells Fargo & Co, 4,400 %, échéance le 14/06/2046	353	0,27
50 Procter & Gamble Co/The, 3,000 %, échéance le 25/03/2030	45	0,03	200 Wells Fargo & Co, 4,750 %, échéance le 07/12/2046	172	0,13
390 Prologis LP, 1,250 %, échéance le 15/10/2030	299	0,23	630 Wells Fargo & Co, 5,013 %, échéance le 04/04/2051 *	581	0,44
100 Salesforce Inc, 3,700 %, échéance le 11/04/2028	95	0,07	40 Workday Inc, 3,500 %, échéance le 01/04/2027	37	0,03
100 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, échéance le 01/03/2032	111	0,08	60 Workday Inc, 3,700 %, échéance le 01/04/2029	55	0,04
130 Targa Resources Corp, 5,200 %, échéance le 01/07/2027	128	0,10	30 Wyeth LLC, 5,950 %, échéance le 01/04/2037	32	0,02
30 Targa Resources Corp, 4,950 %, échéance le 15/04/2052	24	0,02		34	151
2 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, échéance le 16/12/2039	2	—			25,89
170 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, échéance le 01/03/2030	144	0,11	Total des obligations et bons d'entreprises (coût 56 488\$)		
50 Texas Instruments Inc, 2,250 %, échéance le 04/09/2029	43	0,03	Obligations et bons d'État — 21,89 % (28 février 2022 : 24,00 %)		
70 Texas Instruments Inc, 1,750 %, échéance le 04/05/2030	57	0,04	Chili — 0,12 % (28 février 2022 : 0,40 %)		
80 Texas Instruments Inc, 4,150 %, échéance le 15/05/2048	71	0,05	250 Obligation internationale de l'État chilien, 3,100 %, échéance le 22/01/2061	156	0,12
170 The Vanguard Group Inc, 3,050 %, échéance 22/08/2050 t=0	111	0,08	Colombie — 0,48 % (28 février 2022 : 0,47 %)		
30 Time Warner Cable LLC, 6,550 %, échéance le 01/05/2037	29	0,02	220 Obligation internationale de l'État colombien, 3,125 %, échéance le 15/04/2031	160	0,12
100 Time Warner Cable LLC, 5,875 %, échéance le 15/11/2040	88	0,07	260 Obligation internationale de l'État colombien, 3,250 %, échéance le 22/04/2032	185	0,14
130 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, échéance le 15/04/2025	125	0,09	400 Obligation internationale de l'État colombien, 5,625 %, échéance le 26/02/2044	290	0,22
20 T-Mobile USA Inc, 3,750 %, échéance le 15/04/2027	19	0,01		635	0,48
190 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, échéance le 15/04/2030	172	0,13			
80 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, échéance le 15/02/2031	65	0,05			
100 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, échéance le 15/11/2031	78	0,06			

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Contrats (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'État — (suite)					
Inde — 0,14 % (28 février 2022 : 0,09 %)					
200 Export-Import Bank of India, 3,375 %, échéance le 05/08/2026	186	0,14			
Israël — 0,54 % (28 février 2022 : 0,35 %)					
800 Obligation internationale de l'État israélien, 2,750 %, échéance le 03/07/2030	708	0,54			
Kazakhstan — 0,14 % (28 février 2022 : 0,09 %)					
200 Obligation internationale de l'État kazakh, 4,875 %, échéance le 14/10/2044	181	0,14			
Mexique — 0,83 % (28 février 2022 : 0,65 %)					
940 Obligation internationale de l'État mexicain, 4,750 %, échéance le 08/03/2044	782	0,59			
420 Obligation internationale de l'État mexicain, 4,400 %, échéance le 12/02/2052	320	0,24			
	1 102	0,83			
Panama — 0,20 % (28 février 2022 : 0,45 %)					
370 Obligation internationale de l'État panaméen, 4,300 %, échéance le 29/04/2053	268	0,20			
Pérou — 0,13 % (28 février 2022 : 0,30 %)					
40 Obligation internationale de l'État péruvien, 3,550 %, échéance le 10/03/2051	28	0,02			
210 Obligation internationale de l'État péruvien, 3,600 %, échéance le 15/01/2072	137	0,11			
	165	0,13			
Corée du Sud — 0,20 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
270 Korea Housing Finance Corp, 144A, 4,625 %, échéance le 24/02/2033	266	0,20			
États-Unis — 18,58 % (28 février 2022 : 18,21 %)					
1 290 Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 28/03/2023	1 286	0,97			
2 050 Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 18/04/2023	2 037	1,54			
750 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125 %, arrivant à échéance le 15/01/2033 β	721	0,55			
20 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 30/04/2024	19	0,02			
70 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 31/03/2026	66	0,05			
1 490 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,125 %, échéance le 31/10/2027	1 483	1,12			
5 770 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,875 %, échéance le 31/12/2027	5 686	4,31			
900 United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, arrivant à échéance le 31/01/2028	873	0,66			
630 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 15/08/2032	573	0,43			
900 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,125 %, échéance le 15/11/2032	914	0,69			
170 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,250 %, échéance le 15/05/2042	150	0,11			
1 370 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,000 %, échéance le 15/11/2042	1 351	1,02			
320 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,875 %, échéance le 15/02/2043	310	0,24			
110 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/08/2045	90	0,07			
640 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/02/2048	534	0,40			
3 870 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,000 %, échéance le 15/02/2050	2 620	1,99			
1 030 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,375 %, échéance le 15/08/2050	591	0,45			
850 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,625 %, échéance le 15/11/2050	521	0,40			
280 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/02/2052	200	0,15			
1 860 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2052	1 524	1,16			
3 450 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/08/2052	2 901	2,20			
60 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,000 %, échéance le 15/11/2052	61	0,05			
	24 511	18,58			
Uruguay — 0,53 % (28 février 2022 : 0,38 %)					
80 Obligation internationale de l'État uruguayen, 4,375 %, échéance le 23/01/2031	78	0,06			
300 Obligation internationale de l'État uruguayen, 5,750 %, échéance le 28/10/2034	323	0,25			
300 Obligation internationale de l'État uruguayen, 5,100 %, échéance le 18/06/2050	294	0,22			
	695	0,53			
Total des obligations et bons d'État (Coût 32 962\$)					
	28 873	21,89			
Organismes de placement collectif — 1,32 % (28 février 2022 : 2,35 %)					
1 741 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribution)	1 741	1,32			
Total des organismes de placement collectif (Coût 1 741\$)					
	1 741	1,32			
Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat (Coût 156 010\$)					
	140 166	106,25			
Options achetées — 0,05 % (28 février 2022 : 0,03 %)					
– Futures SOFR 3 mois à 1 an Mid-Curve décembre 2023					
Put 96,00, échéance le 15/12/2023 - Goldman Sachs	55	0,04			
– U.S. 5 Year April 2023 Call 107.25, échéance le 24/03/2023 – Goldman Sachs	9	0,01			
Total des options achetées (coût 60\$)					
	64	0,05			
Swaps sur risque de crédit — 0,23 % (28 février 2022 : 0,21 %)					
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	304	0,23			
Swaps d'indices — 1,66 % (28 février 2022 : 0,68 %)					
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	2 192	1,66			
Swaps de taux d'intérêt — 0,03 % (28 février 2022 : 0,12 %)					
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	38	0,03			
Contrats à terme standardisés — 0,23 % (28 février 2022 : 0,31 %)					
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	303	0,23			
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat					
	143 067	108,45			
Options souscrites — -0,05 % (28 février 2022 : -0,10 %)					
– Futures SOFR 3 mois à 1 an Mid-Curve décembre 2023					
Put 95,3750, échéance le 15/12/2023 - Goldman Sachs	-52	-0,04			
– U.S. 10 Year April 2023 Call 118.00, échéance le 24/03/2023 – Goldman Sachs	–	–			
– U.S. 10 Year April 2023 Put 110.00, échéance le 24/03/2023 – Goldman Sachs	-4	–			
– U.S. 5 Year April 2023 Call 108.25, échéance le 24/03/2023 – Goldman Sachs	-3	–			
– U.S. 5 Year April 2023 Call 110.00, échéance le 24/03/2023 – Goldman Sachs	–	–			
– U.S. 5 Year April 2023 Put 107.75, échéance le 24/03/2023 – Goldman Sachs	-11	-0,01			
Total des options souscrites (coût -63 \$)					
	-70	-0,05			
Swaps sur risque de crédit — -0,03 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	-44	-0,03			
Swaps d'indices — 0,00 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	-2	–			
Contrats à terme standardisés — -0,14 % (28 février 2022 : -0,65 %)					
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	-180	-0,14			
Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat					
	-296	-0,22			
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat					
	142 771	108,23			
Excédent du passif par rapport aux autres éléments de l'actif					
	-10 852	-8,23			
Total des actifs nets					
	131 919\$	100,00			
–	Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.				
144A	Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 24 299 000 \$, soit 18,40 % de l'actif net.				
*	Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.				
†	Illiquide.				
∞	Le titre est évalué de bonne foi à sa juste valeur par le comité d'évaluation ou à sa discrétion.				
ε	Le titre est en défaillance au 28 février 2023 (principal et/ou intérêts).				
±	Titres achetés sur la base d'une détermination future.				
β	Le taux d'intérêt de ce type de titre est lié à l'indice des prix à la consommation (IPC)/indice des prix de détail (Retail Price Index - RPI). Le taux du coupon est celui au 28 février 2023.				
ABRÉVIATIONS :					
Perpétuelle	– Obligation sans date d'échéance. Les obligations perpétuelles ne sont pas rachetables, mais paient des intérêts réguliers.				
REMIC	– Société relais de placements immobiliers hypothécaires (Real Estate Mortgage Investment Conduit).				
TBA	– À communiquer.				
Analyse de l'actif total					% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé					93,71
Organismes de placement collectif					1,18
Instruments financiers dérivés					1,96
Autres actifs					3,15
Actif total					100,00

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des swaps sur risque de crédit

Contrepartie	Entité de référence – protection achat/vente	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % - vente	20 déc 2027	29 233	\$ 304
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % - vente	20 déc.2032	3 880	-44
Plus-value latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : 489 \$)				\$ 304
Moins-value latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				-44
Plus-value nette des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : 489 \$)				\$ 260

Tableau des swaps sur taux d'intérêt

Contrepartie	Taux	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Goldman Sachs	Paie fixe 3,150 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15 mai 2048	1 089	\$ 38
Plus-value latente des swaps de taux d'intérêt (28 février 2022 (en milliers) : 288 \$)				\$ 38
Moins-value latente des swaps de taux d'intérêt (28 février 2022 (en milliers) : -329 \$)				–
Plus-value nette des swaps de taux d'intérêt (28 février 2022 (en milliers) : -41 \$)				\$ 38

Tableau des swaps d'indices

Contrepartie	Entité de référence	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Goldman Sachs	Paie fixe 1,130 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15 août-2028	2 084	\$ 282
Goldman Sachs	Paie fixe 1,220 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15 août-2028	2 574	337
Goldman Sachs	Paie fixe 1,630 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15 mai 2047	1 390	397
Goldman Sachs	Paie fixe 1,650 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15 août-2047	153	43
Goldman Sachs	Paie fixe 1,729 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15 fév 2047	1 315	353
Goldman Sachs	Paie fixe 2,000 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	18 mars 2032	1 215	154
Goldman Sachs	Paie fixe 2,500 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	21 avril 2052	559	79
Goldman Sachs	Paie fixe 2,510 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15 fév 2048	892	127
Goldman Sachs	Paie fixe 2,620 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15 fév 2048	952	119
Goldman Sachs	Paie fixe 2,850 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15 fév 2029	2 092	111
Goldman Sachs	Paie fixe 3,270 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	30 avril 2029	6 140	190
Goldman Sachs	Compound	30 juin 2029	1 668	-2
Plus-value latente des swaps d'indices (28 février 2022 (en milliers) : 1 592 \$)				\$ 2 192
Moins-value latente des swaps d'indices (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				-2
Moins-value nette des swaps d'indices (28 février 2022 (en milliers) : 1 592 \$)				\$ 2 190

Tableau des contrats à terme standardisés

	Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
Indice SOFR 3 mois décembre 2023	Goldman Sachs	-132	\$ -31 268	\$ 272
Indice SOFR 3 mois décembre 2024	Goldman Sachs	-53	-12 744	22
Indice SOFR 3 mois décembre 2025	Goldman Sachs	14	3 381	8
Indice SOFR 3 mois juin 2023	Goldman Sachs	1	237	-5
Indice SOFR 3 mois septembre 2023	Goldman Sachs	12	2 838	-20
90 Day Euro\$, mars 2023	Goldman Sachs	19	4 509	-7
U.S. 10 Year Note (CBT), juin 2023	Goldman Sachs	4	447	1
U.S. 2 Year Note (CBT), juin 2023	Goldman Sachs	3	611	-1
U.S. 5 Year Note (CBT), juin 2023	Goldman Sachs	311	33 294	-81
U.S. Long Bond (CBT), juin 2023	Goldman Sachs	14	1 753	-4
U.S. Ultra Bond (CBT) juin 2023	Goldman Sachs	63	8 509	-62
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 726 \$)				\$ 303
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : -1 522 \$)				-180
Plus-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : -796 \$)				\$ 123

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des actifs — 6,51 % (28 février 2022 : 9,12 %)					
122 Aegis Asset Backed Sec Corp Mort Pass Thr Certs Series 2003-3, série 2003 3, catégorie M2, 7,092 %, échéance le 25/01/2034 *	113	0,01	1 184 Structured Asset Investment Loan Trust 2005-HE1, série 2005 HE1, catégorie M2, 5,337 %, échéance le 25/07/2035 *	1 108	0,10
3 060 Amerquest Mortgage Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Cfts Ser 2005-R8, série 2005 R8, catégorie M4, 5,487 %, échéance le 25/10/2035 *	2 944	0,26	Total des titres adossés à des actifs (coût 80 1725)		
2 059 Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, série 2019 1A, catégorie A21, 144A, 4,194 %, échéance le 05/06/2049	2 005	0,18	Titres adossés à des hypothèques — 32,48 % (28 février 2022 : 19,60 %)		
2 859 Asset Backed Securities Corp Home Equity Loan Trust Series RFC 2007-HE1, série 2007 HE1, catégorie A4, 3,538 %, échéance le 25/12/2036 *	2 764	0,24	57 Alternative Loan Trust 2005-14, série 2005 14, catégorie 2A2, 4,867 %, échéance le 25/05/2035 *	43	—
2 390 BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust, série 1996 1, catégorie B1, 7,875 %, échéance le 10/10/2026	80	0,01	197 Alternative Loan Trust 2005-56, série 2005 56, catégorie 4A1, 5,237 %, échéance le 25/11/2035 *	174	0,02
1 500 BCREd MML CLO 2021-1 LLC, série 2021 1A, catégorie A, 144A, 6,272 %, échéance le 15/01/2035 *	1 465	0,13	38 Alternative Loan Trust 2006-18CB, série 2006 18CB, catégorie A6, 10,132 %, échéance le 25/07/2036 *	34	—
1 630 BCREd MML CLO 2022-1 LLC, série 2022 1A, catégorie A1, 144A, 6,289 %, échéance le 20/04/2035 *	1 563	0,14	3 660 AREIT 2022-CRE7 LLC, série 2022 CRE7, catégorie A, 144A, 6,806 %, échéance le 17/06/2039 *	3 664	0,32
1 740 Cayuga Park CLO Ltd, série 2020 1A, catégorie AR, 144A, 5,912 %, échéance le 17/07/2034 *	1 711	0,15	1 198 BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, série 2016 GG10, catégorie AJA, 144A, 5,648 %, échéance le 10/08/2045 *	306	0,03
15 ContiMortgage Home Equity Loan Trust 1999-1, série 1999 1, catégorie B, 9,000 %, échéance le 25/04/2030	18	—	2 145 Banc of America Funding 2014-R2 Trust, série 2014 R2, catégorie 2A2, 144A, 4,845 %, échéance le 26/05/2037 *	1 836	0,16
2 701 Certificats adossés à des actifs nationaux, série 2004 3, catégorie 1A, 5,037 %, échéance le 25/08/2034 *	2 543	0,22	780 BANK 2017-BNK7, série 2017 BNK7, catégorie A5, 3,435 %, échéance le 15/09/2060	721	0,06
849 DB Master Finance LLC, série 2021 1A, catégorie A23, 144A, 2,791 %, échéance le 20/11/2051	685	0,06	12 173 BANK 2017-BNK7, série 2017 BNK7, Classe XA, 0,718 %, échéance le 15/09/2060 *	296	0,03
2 922 Educational Funding Co LLC/The, série 2006 1A, catégorie A3, 144A, 5,168 %, échéance le 25/04/2033 *	2 036	0,18	1 500 BANK 2018-BNK15, série 2018 BN15, catégorie B, 4,657 %, échéance le 15/11/2061 *	1 378	0,12
2 672 Encore Credit Receivables Trust 2005-3, série 2005 3, catégorie M5, 5,577 %, échéance le 25/10/2035 *	2 458	0,21	2 570 BBCCRE Trust 2015-GTP, série 2015 GTP, catégorie E, 144A, 4,563 %, échéance le 10/08/2033 *	2 134	0,19
179 Fannie Mae Grantor Trust 2017-T1, série 2017 T1, Catégorie A, 2,898 %, échéance le 25/06/2027	166	0,02	261 Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR1, série 2007 AR1, catégorie 1A1, 4,777 %, échéance le 25/01/2037 *	223	0,02
8 581 Fieldstone Mortgage Investment Trust Series 2005-2, série 2005 2, catégorie M3, 5,397 %, échéance le 25/12/2035 *	7 246	0,63	3 100 BXP Trust 2017-CQHP, série 2017 CQHP, catégorie A, 144A, 5,438 %, échéance le 15/11/2034 *	2 990	0,26
2 278 First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF15, série 2006 FF15, catégorie A2, 4,737 %, échéance le 25/11/2036 *	2 112	0,18	54 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-3, série 2005 3, catégorie 1A2, 5,197 %, échéance le 25/04/2035 *	48	—
2 060 Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, série 2018 4, catégorie A, 4,060 %, échéance le 15/11/2030	1 958	0,17	300 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27, série 2015 GC27, catégorie AS, 3,571 %, échéance le 10/02/2048	285	0,02
188 Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates FRESR 2017-SR01, série 2017 SR01, catégorie A3, 3,089 %, échéance le 25/11/2027	174	0,02	73 652 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C3, série 2016 C3, catégorie XA, 1,001 %, échéance le 15/11/2049 *	2 141	0,19
2 579 GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, série 2021 4GS, catégorie A, 144A, 1,930 %, échéance le 20/07/2048	1 972	0,17	8 968 Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-AR6, série 2006 AR6, catégorie 2A4, 5,057 %, échéance le 25/09/2036 *	2 957	0,26
1 890 GSAA Home Equity Trust 2005-6, série 2005 6, catégorie M4, 5,667 %, échéance le 25/06/2035 *	1 519	0,13	2 403 COLT 2021-RPL1 Trust, série 2021 RPL1, catégorie A1, 144A, 1,665 %, échéance le 25/09/2061 *	2 121	0,18
3 386 Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, série 2021 1GS, catégorie A, 144A, 2,290 %, échéance le 20/01/2048	2 639	0,23	20 COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, série 2013 CR12, catégorie B, 4,762 %, échéance le 10/10/2046 *	17	—
1 408 Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1, série 2004 1, catégorie M1, 5,367 %, échéance le 25/02/2034 *	1 346	0,12	10 COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, série 2013 CR12, catégorie C, 5,020 %, échéance le 10/10/2046 *	7	—
2 000 Magnétite XIV-R Ltd, série 2015 14RA, catégorie A2, 144A, 5,912 %, échéance le 18/10/2031 *	1 976	0,17	484 COMM 2013-CCRE6 Mortgage Trust, série 2013 CR6, catégorie B, 144A, 3,397 %, échéance le 10/03/2046	454	0,04
1 776 Magnolia Finance, 3,114 %, échéance le 09/08/2024	1 736	0,15	90 COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, série 2015 DC1, catégorie B, 4,035 %, échéance le 10/02/2048 *	84	0,01
3 140 MF1 2021-FL6 Ltd, série 2021 FL6, catégorie A, 144A, 5,701 %, échéance le 16/07/2036 *	3 068	0,27	70 COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, série 2015 DC1, catégorie C, 4,297 %, échéance le 02/10/2048 *	61	0,01
3 552 Mosaic Solar Loan Trust 2021-3, série 2021 3A, catégorie B, 144A, 1,920 %, échéance le 20/06/2052	2 752	0,24	1 450 COMM 2015-PC1 Mortgage Trust, série 2015 PC1, catégorie A5, 3,902 %, échéance le 10/07/2050	1 396	0,12
3 000 National Collegiate II Commutation Trust, série 2005 AR15, catégorie AR15, 0,000 %, échéance le 01/06/2045	445	0,04	184 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, série 2019 R07, catégorie 1M2, 144A, 6,717 %, échéance le 25/10/2039 *	184	0,02
3 300 National Collegiate Student Loan Trust 2006-3, série 2006 3, catégorie B, 4,977 %, échéance le 26/01/2032 *	2 569	0,22	500 CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, série 2015 C1, catégorie AS, 3,791 %, échéance le 15/04/2050 *	466	0,04
2 000 Nelnet Student Loan Trust 2014-2, série 2014 2A, catégorie B, 144A, 6,117 %, échéance le 25/06/2041 *	1 857	0,16	1 050 CSMC 2014-USA OA LLC, série 2014 USA, catégorie A2, 144A, 3,953 %, échéance le 15/09/2037	949	0,08
2 000 Neuberger Berman Loan Advisers CLO 42 Ltd, série 2021 42A, catégorie ER, 144A, 5,892 %, échéance le 20/01/2035 *	1 973	0,17	140 CSMC 2014-USA OA LLC, série 2014 USA, catégorie E, 144A, 4,373 %, échéance le 15/09/2037	82	0,01
1 500 Ocean Trails Clo X, série 2020 10A, catégorie AR, 144A, 6,012 %, échéance le 15/10/2034 *	1 482	0,13	5 170 CSMC 2014-USA OA LLC, série 2014 USA, catégorie F, 144A, 4,373 %, échéance le 15/09/2037	2 753	0,24
1 280 Ocean Trails Clo XI, série 2021 11A, catégorie A, 144A, 6,028 %, échéance le 20/07/2034 *	1 265	0,11	1 960 CSMC 2017-RPL1 Trust, série 2017 RPL1, catégorie M2, 144A, 2,954 %, échéance le 25/07/2057 *	1 505	0,13
1 171 Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, série 2007 FXD1, catégorie 1A1, 5,866 %, échéance le 25/01/2037	951	0,08	2 482 CSMC 2021-NQM8, série 2021 NQM8, catégorie A1, 144A, 1,841 %, échéance le 25/10/2066 *	2 111	0,18
295 Origen Manufactured Housing Contract Trust 2006-A, série 2006 A, catégorie A2, 6,224 %, échéance le 15/10/2037 *	270	0,02	600 CSMC Trust 2017-CHOP, série 2017 CHOP, classe G, 144A, 9,938 %, échéance le 15/07/2032 *	559	0,05
1 000 Point Au Roche Park CLO Ltd, série 2021 1A, catégorie A, 144A, 5,888 %, échéance le 20/07/2034 *	985	0,08	1 680 DBCG 2017-BBG Mortgage Trust, série 2017 BBG, catégorie A, 144A, 5,288 %, échéance le 15/06/2034 *	1 660	0,14
3 188 RASC Series 2007-KS1 Trust, série 2007 KS1, catégorie A4, 4,837 %, échéance le 25/01/2037 *	3 059	0,27	159 Deutsche Mortgage Securities Inc Mortgage Loan Trust Series 2006-PR1, série 2006 PR1, catégorie 3AF1, 144A, 4,868 %, échéance le 15/04/2036 *	147	0,01
1 954 Renaissance Home Equity Loan Trust 2004-1, série 2004 1, catégorie AV3, 5,557 %, échéance le 25/05/2034 *	1 789	0,16	340 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2014 C03, catégorie 1M2, 7,617 %, échéance le 25/07/2024 *	348	0,03
2 010 Saxon Asset Securities Trust 2006-3, série 2006 3, catégorie A4, 5,097 %, échéance le 25/10/2046 *	1 729	0,15	2 554 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2018 C03, catégorie 1B1, 8,367 %, échéance le 25/10/2030 *	2 688	0,23
2 821 SLM Private Education Loan Trust 2010-C, série 2010 C, catégorie A5, 144A, 9,338 %, échéance le 15/10/2041 *	3 028	0,26	560 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2018 C05, catégorie 1B1, 8,867 %, échéance le 25/01/2031 *	596	0,05
340 SMB Private Education Loan Trust 2014-A, série 2014 A, catégorie A3, 144A, 6,088 %, échéance le 15/04/2032 *	339	0,03	12 Fannie Mae Interest Strip 390, catégorie C3, 6,000 %, échéance le 25/07/2038	3	—
2 SMB Private Education Loan Trust 2015-A, série 2015 A, catégorie R, 144A, 0,000 %, échéance le 15/10/2048	474	0,04	6 Fannie Mae Interest Strip 407, catégorie 22, 5,000 %, échéance le 25/01/2039	1	—
390 SMB Private Education Loan Trust, série 2020 B, catégorie A1A, 144A, 1,290 %, échéance le 15/07/2053	346	0,03	3 Fannie Mae Interest Strip 407, catégorie 23, 5,000 %, échéance le 25/01/2039 *	1	—
2 253 Stonepeak 2021-1 ABS, série 2021 1A, catégorie A, 144A, 2,675 %, échéance le 28/02/2033	1 998	0,17	7 Fannie Mae Interest Strip 407, catégorie 27, 5,500 %, échéance le 25/01/2039 *	1	—
			6 Fannie Mae Interest Strip 407, catégorie 34, 5,000 %, échéance le 25/01/2038	1	—
			16 Fannie Mae Interest Strip 407, catégorie 41, 6,000 %, échéance le 25/01/2038	3	—

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques — (suite)					
50 Fannie Mae Interest Strip 409, catégorie C13, 3,500 %, échéance le 25/11/2041	8	–	231 Fannie Mae Pool 'BC9077', 3,500 %, échéance le 12/01/2046	214	0,02
58 Fannie Mae Interest Strip 409, catégorie C18, 4,000 %, échéance le 25/04/2042	11	–	612 Fannie Mae Pool 'BD2455', 3,000 %, échéance le 01/01/2047	551	0,05
66 Fannie Mae Interest Strip 409, catégorie C2, 3,000 %, échéance le 25/04/2027	3	–	248 Fannie Mae Pool 'BD8104', 3,000 %, échéance le 10/01/2046	223	0,02
57 Fannie Mae Interest Strip 409, catégorie C22, 4,500 %, échéance le 25/11/2039	11	–	829 Fannie Mae Pool 'BF0104', 4,000 %, échéance le 02/01/2056	796	0,07
679 Fannie Mae Interest Strip 427, catégorie C73, 3,000 %, échéance le 25/04/2027	110	0,01	594 Fannie Mae Pool 'BF0163', 5,000 %, échéance le 11/01/2046	594	0,05
13 700 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 % ±	11 610	1,01	481 Fannie Mae Pool 'BF0183', 4,000 %, échéance le 01/01/2057	462	0,04
2 300 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 3,000 % ±	2 024	0,18	835 Fannie Mae Pool 'BF0191', 4,000 %, échéance le 06/01/2057	797	0,07
6 600 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 3,500 % ±	6 010	0,52	716 Fannie Mae Pool 'BF0222', 4,500 %, échéance le 09/01/2057	694	0,06
9 500 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 4,000 % ±	8 920	0,78	39 Fannie Mae Pool 'BF0301', 4,500 %, échéance le 01/12/2047	38	–
5 000 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 4,500 % ±	4 819	0,42	279 Fannie Mae Pool 'BF0338', 4,500 %, échéance le 01/01/2059	272	0,02
2 300 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 5,000 % ±	2 262	0,20	75 Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000 %, échéance le 12/01/2037	69	0,01
5 000 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 5,500 % ±	4 993	0,43	702 Fannie Mae Pool 'BK7700', 4,500 %, échéance le 10/01/2048	693	0,06
8 Fannie Mae Pool '254793', 5,000 %, échéance le 07/01/2033	9	–	180 Fannie Mae Pool 'BL2454', 3,160 %, échéance le 05/01/2029	167	0,01
10 Fannie Mae Pool '555743', 5,000 %, échéance le 09/01/2033	11	–	721 Fannie Mae Pool 'BM1565', 3,000 %, échéance le 04/01/2047	649	0,06
6 Fannie Mae Pool '745000', 6,000 %, échéance le 10/01/2035	6	–	42 Fannie Mae Pool 'BM3799', 3,000 %, échéance le 08/01/2047	38	–
4 Fannie Mae Pool '843997', 4,238 %, échéance le 11/01/2035*	4	–	39 Fannie Mae Pool 'BM4750', 3,500 %, échéance le 02/01/2045	37	–
4 Fannie Mae Pool '865915', 4,497 %, échéance le 03/01/2036*	4	–	264 Fannie Mae Pool 'BM4751', 3,500 %, échéance le 03/01/2043	248	0,02
29 Fannie Mae Pool '889117', 5,000 %, échéance le 10/01/2035	29	–	378 Fannie Mae Pool 'BM4897', 3,500 %, échéance le 12/01/2046	355	0,03
362 Fannie Mae Pool '890604', 4,500 %, échéance le 10/01/2044	357	0,03	186 Fannie Mae Pool 'BM6623', 2,500 %, échéance le 10/01/2050	156	0,01
123 Fannie Mae Pool '890827', 3,500 %, échéance le 12/01/2037	117	0,01	578 Fannie Mae Pool 'BM6898', 2,149 %, échéance le 02/01/2032*	482	0,04
14 Fannie Mae Pool '995072', 5,500 %, échéance le 08/01/2038	14	–	191 Fannie Mae Pool 'BM6912', 2,500 %, échéance le 01/01/2052	159	0,01
34 Fannie Mae Pool 'AB9683', 4,000 %, échéance le 01/06/2043	33	–	315 Fannie Mae Pool 'BN1623', 4,500 %, échéance le 11/01/2048	311	0,03
31 Fannie Mae Pool 'AE0758', 7,000 %, échéance le 01/02/2039	33	–	1 002 Fannie Mae Pool 'BN3898', 4,500 %, échéance le 12/01/2048	988	0,09
27 Fannie Mae Pool 'AK8441', 4,000 %, échéance le 01/04/2042	26	–	121 Fannie Mae Pool 'BO1858', 3,000 %, échéance le 08/01/2049	109	0,01
– Fannie Mae Pool 'AL2931', 6,000 %, échéance le 01/06/2023	–	–	86 Fannie Mae Pool 'BP3484', 2,500 %, échéance le 06/01/2051	73	0,01
337 Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500 %, échéance le 01/01/2043	314	0,03	246 Fannie Mae Pool 'BQ5876', 2,500 %, échéance le 11/01/2050	212	0,02
32 Fannie Mae Pool 'AL3026', 3,500 %, échéance le 12/01/2042	30	–	97 Fannie Mae Pool 'BQ7435', 2,500 %, échéance le 09/01/2051	82	0,01
25 Fannie Mae Pool 'AL3508', 4,000 %, échéance le 04/01/2043	24	–	341 Fannie Mae Pool 'BQ9224', 2,000 %, échéance le 01/01/2051	279	0,02
18 Fannie Mae Pool 'AL4741', 4,500 %, échéance le 01/01/2044	18	–	413 Fannie Mae Pool 'BQ9226', 2,000 %, échéance le 01/01/2051	340	0,03
68 Fannie Mae Pool 'AL9397', 3,000 %, échéance le 10/01/2046	61	0,01	85 Fannie Mae Pool 'BR0663', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	70	0,01
360 Fannie Mae Pool 'AL9546', 3,500 %, échéance le 11/01/2046	337	0,03	2331 Fannie Mae Pool 'BR1001', 2,500 %, échéance le 05/01/2051	291	0,03
316 Fannie Mae Pool 'AL9631', 3,000 %, échéance le 12/01/2046	285	0,02	253 Fannie Mae Pool 'BR1823', 2,000 %, échéance le 01/01/2051	207	0,02
10 Fannie Mae Pool 'AM8674', 2,810 %, échéance le 04/01/2025	10	–	84 Fannie Mae Pool 'BR2303', 3,000 %, échéance le 08/01/2051	75	0,01
209 Fannie Mae Pool 'AM8700', 2,930 %, échéance le 06/01/2030	190	0,02	238 Fannie Mae Pool 'BR2641', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	197	0,02
90 Fannie Mae Pool 'AN4677', 3,200 %, échéance le 02/01/2029	84	0,01	373 Fannie Mae Pool 'BR2643', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	308	0,03
115 Fannie Mae Pool 'AN4927', 3,450 %, échéance le 03/01/2029	108	0,01	149 Fannie Mae Pool 'BR2644', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	122	0,01
136 Fannie Mae Pool 'AN5386', 3,250 %, échéance le 05/01/2029	127	0,01	226 Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	189	0,02
10 Fannie Mae Pool 'AO2711', 4,000 %, échéance le 05/01/2042	10	–	394 Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	328	0,03
21 Fannie Mae Pool 'AO6086', 4,000 %, échéance le 06/01/2042	8	–	234 Fannie Mae Pool 'BR3286', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	194	0,02
9 Fannie Mae Pool 'AO9859', 4,000 %, échéance le 07/01/2042	20	–	678 Fannie Mae Pool 'BR3290', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	555	0,05
15 Fannie Mae Pool 'AP0692', 4,000 %, échéance le 07/01/2042	14	–	335 Fannie Mae Pool 'BR4035', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	274	0,02
15 Fannie Mae Pool 'AP2530', 4,000 %, échéance le 08/01/2042	15	–	253 Fannie Mae Pool 'BR4080', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	207	0,02
52 Fannie Mae Pool 'AP4710', 3,500 %, échéance le 08/01/2042	48	–	229 Fannie Mae Pool 'BR4722', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	188	0,02
246 Fannie Mae Pool 'AP4781', 3,000 %, échéance le 09/01/2042	223	0,02	166 Fannie Mae Pool 'BR4753', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	137	0,01
25 Fannie Mae Pool 'AP4903', 4,000 %, échéance le 09/01/2042	24	–	298 Fannie Mae Pool 'BR4756', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	245	0,02
58 Fannie Mae Pool 'AP7399', 4,000 %, échéance le 09/01/2042	56	–	163 Fannie Mae Pool 'BR5487', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	134	0,01
17 Fannie Mae Pool 'AP9229', 4,000 %, échéance le 10/01/2042	16	–	253 Fannie Mae Pool 'BR5577', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	208	0,02
61 Fannie Mae Pool 'AP9766', 4,000 %, échéance le 10/01/2042	59	0,01	333 Fannie Mae Pool 'BR5587', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	276	0,02
49 Fannie Mae Pool 'AP9862', 4,000 %, échéance le 10/01/2042	47	–	161 Fannie Mae Pool 'BR5589', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	132	0,01
16 Fannie Mae Pool 'AQ0100', 4,000 %, échéance le 10/01/2042	16	–	427 Fannie Mae Pool 'BR5633', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	351	0,03
69 Fannie Mae Pool 'AQ1641', 4,000 %, échéance le 10/01/2042	67	0,01	341 Fannie Mae Pool 'BR5634', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	280	0,02
16 Fannie Mae Pool 'AQ3599', 4,000 %, échéance le 11/01/2042	16	–	438 Fannie Mae Pool 'BR5649', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	360	0,03
22 Fannie Mae Pool 'AQ4078', 4,000 %, échéance le 06/01/2043	21	–	249 Fannie Mae Pool 'BR6462', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	204	0,02
16 Fannie Mae Pool 'AQ4080', 4,000 %, échéance le 06/01/2043	16	–	83 Fannie Mae Pool 'BR6515', 2,000 %, échéance le 04/01/2051	69	0,01
28 Fannie Mae Pool 'AQ4555', 4,000 %, échéance le 12/01/2042	27	–	80 Fannie Mae Pool 'BR7744', 2,000 %, échéance le 04/01/2051	67	0,01
22 Fannie Mae Pool 'AQ5137', 4,000 %, échéance le 11/01/2042	22	–	231 Fannie Mae Pool 'BR7745', 2,000 %, échéance le 04/01/2051	191	0,02
46 Fannie Mae Pool 'AQ7003', 4,000 %, échéance le 12/01/2042	44	–	83 Fannie Mae Pool 'BR8478', 2,000 %, échéance le 04/01/2051	69	0,01
55 Fannie Mae Pool 'AQ7082', 4,000 %, échéance le 01/01/2043	53	–	154 Fannie Mae Pool 'BR8518', 2,000 %, échéance le 04/01/2051	128	0,01
114 Fannie Mae Pool 'AR7399', 3,000 %, échéance le 06/01/2043	103	0,01	100 Fannie Mae Pool 'BS5233', 3,520 %, échéance le 06/01/2032	94	0,01
272 Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, échéance le 07/01/2043	247	0,02	100 Fannie Mae Pool 'BS5754', 3,900 %, échéance le 06/01/2032	96	0,01
23 Fannie Mae Pool 'AS0070', 4,000 %, échéance le 08/01/2043	22	–	100 Fannie Mae Pool 'BS5808', 3,830 %, échéance le 07/01/2032	96	0,01
90 Fannie Mae Pool 'AS3253', 4,000 %, échéance le 09/01/2044	86	0,01	100 Fannie Mae Pool 'BS5955', 3,730 %, échéance le 06/01/2032	95	0,01
23 Fannie Mae Pool 'AS4271', 4,500 %, échéance le 01/01/2045	23	–	99 Fannie Mae Pool 'BS5964', 3,670 %, échéance le 06/01/2032	94	0,01
39 Fannie Mae Pool 'AS4347', 4,000 %, échéance le 01/01/2045	38	–	100 Fannie Mae Pool 'BS6002', 3,560 %, échéance le 07/01/2032	94	0,01
423 Fannie Mae Pool 'AS6328', 3,500 %, échéance le 12/01/2045	396	0,03	99 Fannie Mae Pool 'BS6023', 3,860 %, échéance le 07/01/2032	95	0,01
109 Fannie Mae Pool 'AS6340', 3,500 %, échéance le 12/01/2045	101	0,01	100 Fannie Mae Pool 'BS6084', 4,185 %, échéance le 07/01/2032	98	0,01
89 Fannie Mae Pool 'AS6541', 3,500 %, échéance le 01/01/2046	83	0,01	99 Fannie Mae Pool 'BS6103', 4,060 %, échéance le 07/01/2032	97	0,01
69 Fannie Mae Pool 'AS6562', 3,500 %, échéance le 01/01/2046	64	0,01	100 Fannie Mae Pool 'BS6130', 4,130 %, échéance le 07/01/2032	98	0,01
59 Fannie Mae Pool 'AS7844', 3,000 %, échéance le 09/01/2046	53	–	99 Fannie Mae Pool 'BS6147', 3,880 %, échéance le 07/01/2032	95	0,01
198 Fannie Mae Pool 'AS8623', 3,000 %, échéance le 01/01/2047	178	0,02	300 Fannie Mae Pool 'BS6149', 3,840 %, échéance le 08/01/2032	288	0,03
132 Fannie Mae Pool 'AS8740', 3,500 %, échéance le 02/01/2037	125	0,01	100 Fannie Mae Pool 'BS6169', 4,110 %, échéance le 07/01/2032	98	0,01
763 Fannie Mae Pool 'AS8745', 3,000 %, échéance le 02/01/2047	686	0,06	100 Fannie Mae Pool 'BS6188', 4,340 %, échéance le 07/01/2032	100	0,01
18 Fannie Mae Pool 'AT7208', 4,000 %, échéance le 06/01/2043	18	–	200 Fannie Mae Pool 'BS6215', 3,840 %, échéance le 07/01/2032	192	0,02
25 Fannie Mae Pool 'AT8394', 4,000 %, échéance le 06/01/2043	24	–	300 Fannie Mae Pool 'BS6565', 3,740 %, échéance le 09/01/2032	286	0,02
69 Fannie Mae Pool 'AT9637', 4,000 %, échéance le 07/01/2043	67	0,01	300 Fannie Mae Pool 'BS6894', 4,410 %, échéance le 12/01/2032	301	0,03
53 Fannie Mae Pool 'AT9653', 4,000 %, échéance le 07/01/2043	51	–	300 Fannie Mae Pool 'BS6896', 4,370 %, échéance le 11/01/2032	301	0,03
42 Fannie Mae Pool 'AT9657', 4,000 %, échéance le 07/01/2043	41	–	100 Fannie Mae Pool 'BS6914', 4,440 %, échéance le 11/01/2032	101	0,01
266 Fannie Mae Pool 'AU6735', 3,000 %, échéance le 10/01/2043	241	0,02	300 Fannie Mae Pool 'BS6917', 4,260 %, échéance le 11/01/2032	298	0,03
92 Fannie Mae Pool 'AW0318', 4,500 %, échéance le 02/01/2044	89	0,01	100 Fannie Mae Pool 'BS7424', 4,940 %, échéance le 12/01/2032	103	0,01
15 Fannie Mae Pool 'AW9453', 3,500 %, échéance le 08/01/2044	14	–	262 Fannie Mae Pool 'BT0846', 2,500 %, échéance le 07/01/2051	224	0,02
34 Fannie Mae Pool 'BC1509', 3,000 %, échéance le 08/01/2046	31	–	192 Fannie Mae Pool 'BT0972', 2,500 %, échéance le 05/01/2051	160	0,01
96 Fannie Mae Pool 'BC2817', 3,000 %, échéance le 09/01/2046	87	0,01	352 Fannie Mae Pool 'BT3244', 2,500 %, échéance le 07/01/2051	302	0,03
			89 Fannie Mae Pool 'BT3270', 2,500 %, échéance le 08/01/2051	76	0,01
			183 Fannie Mae Pool 'BT3290', 2,500 %, échéance le 08/01/2051	157	0,01
			174 Fannie Mae Pool 'BT3303', 2,500 %, échéance le 08/01/2051	150	0,01
			353 Fannie Mae Pool 'BU2599', 2,500 %, échéance le 01/01/2052	312	0,03
			81 Fannie Mae Pool 'BU3608', 3,000 %, échéance le 11/01/2051	72	0,01

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques — (suite)					
90 Fannie Mae Pool 'BU5925', 3,000 %, échéance le 12/01/2051	80	0,01	455 Fannie Mae Pool 'FS0034', 3,000 %, échéance le 12/01/2051	406	0,04
369 Fannie Mae Pool 'BV3089', 2,500 %, échéance le 02/01/2052	316	0,03	318 Fannie Mae Pool 'FS0037', 3,000 %, échéance le 08/01/2051	285	0,02
194 Fannie Mae Pool 'BV3167', 3,500 %, échéance le 05/01/2052	179	0,02	632 Fannie Mae Pool 'FS0240', 3,000 %, échéance le 01/01/2052	565	0,05
177 Fannie Mae Pool 'BV4142', 3,000 %, échéance le 03/01/2052	158	0,01	647 Fannie Mae Pool 'FS0331', 3,000 %, échéance le 01/01/2052	572	0,05
184 Fannie Mae Pool 'BV5373', 2,500 %, échéance le 04/01/2052	157	0,01	1 217 Fannie Mae Pool 'FS0349', 2,000 %, échéance le 01/01/2052	998	0,09
660 Fannie Mae Pool 'BV8546', 3,500 %, échéance le 05/01/2052	609	0,05	379 Fannie Mae Pool 'FS0352', 2,000 %, échéance le 01/01/2052	310	0,03
98 Fannie Mae Pool 'BV9900', 4,000 %, échéance le 05/01/2052	93	0,01	88 Fannie Mae Pool 'FS0357', 3,000 %, échéance le 12/01/2051	79	0,01
100 Fannie Mae Pool 'BX6441', 6,500 %, échéance le 02/01/2053	103	0,01	278 Fannie Mae Pool 'FS0366', 2,500 %, échéance le 01/01/2052	242	0,02
300 Fannie Mae Pool 'BX7702', 6,500 %, échéance le 02/01/2053	308	0,03	270 Fannie Mae Pool 'FS0408', 3,000 %, échéance le 01/01/2052	242	0,02
359 Fannie Mae Pool 'CA2047', 4,500 %, échéance le 07/01/2048	355	0,03	1 013 Fannie Mae Pool 'FS0424', 2,500 %, échéance le 01/01/2052	868	0,08
624 Fannie Mae Pool 'CA2199', 4,500 %, échéance le 08/01/2048	616	0,05	270 Fannie Mae Pool 'FS0434', 2,500 %, échéance le 11/01/2051	233	0,02
526 Fannie Mae Pool 'CA2798', 4,500 %, échéance le 12/01/2048	519	0,05	183 Fannie Mae Pool 'FS0483', 3,500 %, échéance le 01/01/2052	169	0,01
274 Fannie Mae Pool 'CA4819', 4,000 %, échéance le 12/01/2049	261	0,02	1 030 Fannie Mae Pool 'FS0523', 2,500 %, échéance le 02/01/2052	880	0,08
502 Fannie Mae Pool 'CA5522', 4,000 %, échéance le 04/01/2050	478	0,04	1 412 Fannie Mae Pool 'FS0549', 2,500 %, échéance le 02/01/2052	1 204	0,10
470 Fannie Mae Pool 'CA7257', 2,500 %, échéance le 10/01/2050	404	0,04	279 Fannie Mae Pool 'FS0551', 2,500 %, échéance le 02/01/2052	239	0,02
82 Fannie Mae Pool 'CA9358', 2,500 %, échéance le 03/01/2041	72	0,01	282 Fannie Mae Pool 'FS0582', 2,500 %, échéance le 02/01/2052	242	0,02
421 Fannie Mae Pool 'CB0100', 2,500 %, échéance le 04/01/2041	370	0,03	284 Fannie Mae Pool 'FS0583', 2,500 %, échéance le 02/01/2052	243	0,02
168 Fannie Mae Pool 'CB0101', 2,500 %, échéance le 04/01/2041	148	0,01	92 Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, échéance le 02/01/2052	76	0,01
85 Fannie Mae Pool 'CB0114', 2,500 %, échéance le 04/01/2041	75	0,01	95 Fannie Mae Pool 'FS0612', 2,000 %, échéance le 02/01/2052	78	0,01
2 413 Fannie Mae Pool 'CB0458', 2,500 %, échéance le 05/01/2051	2 052	0,18	465 Fannie Mae Pool 'FS1014', 2,000 %, échéance le 02/01/2052	383	0,03
1 453 Fannie Mae Pool 'CB0470', 2,500 %, échéance le 05/01/2041	1 276	0,11	1 412 Fannie Mae Pool 'FS1015', 2,000 %, échéance le 02/01/2052	1 158	0,10
901 Fannie Mae Pool 'CB1273', 2,000 %, échéance le 08/01/2051	738	0,06	3 520 Fannie Mae Pool 'FS1074', 3,000 %, échéance le 03/01/2052	3 140	0,27
1 340 Fannie Mae Pool 'CB1878', 3,000 %, échéance le 10/01/2051	1 182	0,10	357 Fannie Mae Pool 'FS1104', 2,500 %, échéance le 11/01/2051	307	0,03
270 Fannie Mae Pool 'CB2115', 2,500 %, échéance le 11/01/2041	237	0,02	275 Fannie Mae Pool 'FS1111', 2,500 %, échéance le 05/01/2051	234	0,02
183 Fannie Mae Pool 'CB2680', 3,500 %, échéance le 01/01/2052	167	0,01	423 Fannie Mae Pool 'FS1112', 2,000 %, échéance le 03/01/2052	1 177	0,10
1 385 Fannie Mae Pool 'CB3031', 2,500 %, échéance le 03/01/2052	1 175	0,10	534 Fannie Mae Pool 'FS1237', 3,500 %, échéance le 12/01/2051	493	0,04
771 Fannie Mae Pool 'CB3044', 2,500 %, échéance le 03/01/2052	659	0,06	832 Fannie Mae Pool 'FS1289', 3,000 %, échéance le 03/01/2052	744	0,06
96 Fannie Mae Pool 'CB3386', 3,500 %, échéance le 04/01/2042	89	0,01	266 Fannie Mae Pool 'FS1403', 3,000 %, échéance le 01/01/2045	241	0,02
941 Fannie Mae Pool 'CB3614', 4,000 %, échéance le 05/01/2052	893	0,08	576 Fannie Mae Pool 'FS1454', 3,500 %, échéance le 04/01/2052	529	0,05
575 Fannie Mae Pool 'CB3833', 3,000 %, échéance le 06/01/2052	508	0,04	555 Fannie Mae Pool 'FS1462', 3,500 %, échéance le 01/01/2052	512	0,04
1 484 Fannie Mae Pool 'CB5497', 6,500 %, échéance le 01/01/2053	1 536	0,13	363 Fannie Mae Pool 'FS1539', 3,000 %, échéance le 11/01/2048	328	0,03
362 Fannie Mae Pool 'FM0068', 3,500 %, échéance le 02/01/2040	340	0,03	477 Fannie Mae Pool 'FS1555', 3,500 %, échéance le 04/01/2052	438	0,04
127 Fannie Mae Pool 'FM0071', 3,500 %, échéance le 02/01/2040	118	0,01	2 001 Fannie Mae Pool 'FS1556', 3,500 %, échéance le 05/01/2052	1 844	0,16
1 051 Fannie Mae Pool 'FM1727', 5,000 %, échéance le 09/01/2049	1 051	0,09	763 Fannie Mae Pool 'FS1626', 2,500 %, échéance le 04/01/2052	650	0,06
102 Fannie Mae Pool 'FM2158', 4,000 %, échéance le 10/01/2049	97	0,01	95 Fannie Mae Pool 'FS1628', 2,500 %, échéance le 04/01/2052	82	0,01
927 Fannie Mae Pool 'FM3123', 2,500 %, échéance le 03/01/2038	835	0,07	187 Fannie Mae Pool 'FS1631', 2,500 %, échéance le 02/01/2051	159	0,01
841 Fannie Mae Pool 'FM3141', 3,500 %, échéance le 11/01/2048	781	0,07	93 Fannie Mae Pool 'FS1726', 2,000 %, échéance le 09/01/2041	79	0,01
179 Fannie Mae Pool 'FM3158', 4,000 %, échéance le 11/01/2048	171	0,02	586 Fannie Mae Pool 'FS1866', 3,500 %, échéance le 05/01/2052	535	0,05
1 940 Fannie Mae Pool 'FM3347', 3,500 %, échéance le 05/01/2047	1 806	0,16	833 Fannie Mae Pool 'FS1924', 2,500 %, échéance le 03/01/2051	709	0,06
78 Fannie Mae Pool 'FM3542', 4,000 %, échéance le 05/01/2049	75	0,01	1 253 Fannie Mae Pool 'FS2061', 4,000 %, échéance le 06/01/2052	1 186	0,10
280 Fannie Mae Pool 'FM3572', 4,500 %, échéance le 09/01/2049	276	0,02	1 067 Fannie Mae Pool 'FS2185', 4,000 %, échéance le 06/01/2052	1 009	0,09
2 709 Fannie Mae Pool 'FM3773', 3,500 %, échéance le 11/01/2048	2 514	0,22	5 782 Fannie Mae Pool 'FS2463', 3,000 %, échéance le 02/01/2052	5 109	0,44
451 Fannie Mae Pool 'FM4252', 2,000 %, échéance le 09/01/2050	369	0,03	384 Fannie Mae Pool 'FS2496', 4,500 %, échéance le 08/01/2052	371	0,03
284 Fannie Mae Pool 'FM4737', 3,500 %, échéance le 09/01/2050	261	0,02	486 Fannie Mae Pool 'FS2528', 1,500 %, échéance le 01/01/2051	377	0,03
80 Fannie Mae Pool 'FM4868', 2,000 %, échéance le 11/01/2050	66	0,01	97 Fannie Mae Pool 'FS2768', 2,000 %, échéance le 01/01/2052	80	0,01
188 Fannie Mae Pool 'FM4925', 3,000 %, échéance le 11/01/2050	167	0,01	290 Fannie Mae Pool 'FS3411', 6,000 %, échéance le 01/01/2053	296	0,03
97 Fannie Mae Pool 'FM5280', 3,500 %, échéance le 10/01/2050	90	0,01	399 Fannie Mae Pool 'FS3672', 5,500 %, échéance le 02/01/2053	401	0,03
51 Fannie Mae Pool 'FM5434', 4,500 %, échéance le 05/01/2046	50	–	300 Fannie Mae Pool 'FS4000', 6,000 %, échéance le 07/01/2041	310	0,04
199 Fannie Mae Pool 'FM5743', 2,500 %, échéance le 02/01/2051	172	0,02	10 Fannie Mae Pool 'MA0706', 4,500 %, échéance le 04/01/2031	10	–
51 Fannie Mae Pool 'FM5754', 3,500 %, échéance le 03/01/2037	49	–	40 Fannie Mae Pool 'MA0734', 4,500 %, échéance le 05/01/2031	40	–
478 Fannie Mae Pool 'FM5783', 3,000 %, échéance le 06/01/2038	437	0,04	12 Fannie Mae Pool 'MA0776', 4,500 %, échéance le 06/01/2031	12	–
251 Fannie Mae Pool 'FM5904', 2,500 %, échéance le 02/01/2051	216	0,02	18 Fannie Mae Pool 'MA0913', 4,500 %, échéance le 11/01/2031	17	–
501 Fannie Mae Pool 'FM5944', 2,500 %, échéance le 01/01/2051	426	0,04	18 Fannie Mae Pool 'MA0939', 4,500 %, échéance le 12/01/2031	17	–
106 Fannie Mae Pool 'FM6015', 3,500 %, échéance le 08/01/2039	101	0,01	68 Fannie Mae Pool 'MA1146', 4,000 %, échéance le 08/01/2042	65	0,01
416 Fannie Mae Pool 'FM6134', 3,000 %, échéance le 03/01/2040	380	0,03	17 Fannie Mae Pool 'MA1177', 3,500 %, échéance le 09/01/2042	16	–
318 Fannie Mae Pool 'FM6460', 2,500 %, échéance le 03/01/2051	274	0,02	488 Fannie Mae Pool 'MA1217', 4,000 %, échéance le 10/01/2042	469	0,04
2 540 Fannie Mae Pool 'FM6597', 2,000 %, échéance le 03/01/2041	2 168	0,19	110 Fannie Mae Pool 'MA1253', 4,000 %, échéance le 11/01/2042	105	0,01
249 Fannie Mae Pool 'FM7100', 3,500 %, échéance le 06/01/2050	231	0,02	302 Fannie Mae Pool 'MA1283', 3,500 %, échéance le 12/01/2042	281	0,02
99 Fannie Mae Pool 'FM7141', 4,000 %, échéance le 02/01/2047	95	0,01	212 Fannie Mae Pool 'MA1437', 3,500 %, échéance le 05/01/2043	197	0,02
140 Fannie Mae Pool 'FM7382', 3,000 %, échéance le 05/01/2051	124	0,01	24 Fannie Mae Pool 'MA1547', 4,000 %, échéance le 08/01/2043	23	–
447 Fannie Mae Pool 'FM7675', 2,500 %, échéance le 06/01/2051	384	0,03	44 Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500 %, échéance le 09/01/2043	44	–
174 Fannie Mae Pool 'FM7676', 2,500 %, échéance le 06/01/2051	149	0,01	41 Fannie Mae Pool 'MA1629', 4,500 %, échéance le 10/01/2043	40	–
83 Fannie Mae Pool 'FM7727', 2,500 %, échéance le 06/01/2051	73	0,01	19 Fannie Mae Pool 'MA1664', 4,500 %, échéance le 11/01/2043	19	–
843 Fannie Mae Pool 'FM7786', 4,000 %, échéance le 01/01/2049	806	0,07	43 Fannie Mae Pool 'MA1711', 4,500 %, échéance le 12/01/2043	42	–
127 Fannie Mae Pool 'FM7796', 4,000 %, échéance le 06/01/2048	122	0,01	131 Fannie Mae Pool 'MA2110', 3,500 %, échéance le 12/01/2034	125	0,01
81 Fannie Mae Pool 'FM7869', 2,500 %, échéance le 01/01/2051	70	0,01	89 Fannie Mae Pool 'MA2138', 3,500 %, échéance le 01/01/2035	85	0,01
337 Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500 %, échéance le 07/01/2051	289	0,03	58 Fannie Mae Pool 'MA2320', 3,000 %, échéance le 07/01/2035	54	–
440 Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500 %, échéance le 07/01/2051	379	0,03	542 Fannie Mae Pool 'MA2523', 3,000 %, échéance le 02/01/2036	499	0,04
344 Fannie Mae Pool 'FM8025', 2,500 %, échéance le 07/01/2051	296	0,03	414 Fannie Mae Pool 'MA2579', 3,000 %, échéance le 04/01/2036	381	0,03
236 Fannie Mae Pool 'FM8166', 3,000 %, échéance le 06/01/2051	212	0,02	831 Fannie Mae Pool 'MA2672', 3,000 %, échéance le 07/01/2036	759	0,07
1 557 Fannie Mae Pool 'FM8576', 3,000 %, échéance le 02/01/2050	1 405	0,12	345 Fannie Mae Pool 'MA2707', 3,000 %, échéance le 08/01/2036	315	0,03
1 068 Fannie Mae Pool 'FM8577', 3,000 %, échéance le 08/01/2051	958	0,08	1 810 Fannie Mae Pool 'MA2773', 3,000 %, échéance le 10/01/2036	1 653	0,14
759 Fannie Mae Pool 'FM8669', 3,500 %, échéance le 09/01/2047	707	0,06	393 Fannie Mae Pool 'MA2832', 3,000 %, échéance le 12/01/2036	816	0,07
167 Fannie Mae Pool 'FM8685', 3,000 %, échéance le 09/01/2051	147	0,01	291 Fannie Mae Pool 'MA4120', 2,500 %, échéance le 09/01/2050	198	0,02
2 138 Fannie Mae Pool 'FM8786', 2,500 %, échéance le 10/01/2051	1 832	0,16	3 130 Fannie Mae Pool 'MA4208', 2,000 %, échéance le 12/01/2050	2 564	0,22
218 Fannie Mae Pool 'FM8813', 3,500 %, échéance le 09/01/2051	200	0,02	1 914 Fannie Mae Pool 'MA4280', 1,500 %, échéance le 03/01/2051	1 485	0,13
698 Fannie Mae Pool 'FM8864', 2,500 %, échéance le 10/01/2051	599	0,05	711 Fannie Mae Pool 'MA4306', 2,500 %, échéance le 04/01/2051	604	0,05
172 Fannie Mae Pool 'FM8977', 2,500 %, échéance le 09/01/2051	149	0,01	867 Fannie Mae Pool 'MA4325', 2,000 %, échéance le 05/01/2051	710	0,06
183 Fannie Mae Pool 'FM9174', 2,000 %, échéance le 10/01/2051	150	0,01	171 Fannie Mae Pool 'MA4364', 2,000 %, échéance le 06/01/2041	146	0,01
173 Fannie Mae Pool 'FM9205', 2,500 %, échéance le 04/01/2051	149	0,01	91 Fannie Mae Pool 'MA4501', 2,000 %, échéance le 12/01/2041	77	0,01
441 Fannie Mae Pool 'FM9299', 2,000 %, échéance le 10/01/2051	362	0,03	278 Fannie Mae Pool 'MA4540', 2,000 %, échéance le 02/01/2042	236	0,02
272 Fannie Mae Pool 'FM9335', 2,500 %, échéance le 10/01/2051	231	0,02	74 Fannie Mae REMICS, série 2005 29, catégorie ZA, 5,500 %, échéance le 25/04/2035	76	0,01
261 Fannie Mae Pool 'FM9365', 3,000 %, échéance le 11/01/2051	234	0,02	297 Fannie Mae REMICS, série 2011 59, catégorie NZ, 5,500 %, échéance le 25/07/2041	303	0,03
366 Fannie Mae Pool 'FM9489', 2,000 %, échéance le 11/01/2051	299	0,03	79 Fannie Mae REMICS, série 2012 133, catégorie CS, 1,533 %, échéance le 25/12/2042 *	8	–
334 Fannie Mae Pool 'FS0024', 2,500 %, échéance le 09/01/2051	290	0,03			
820 Fannie Mae Pool 'FS0028', 2,500 %, échéance le 09/01/2051	702	0,06			

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques — (suite)				6 524	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K058, catégorie X1, 0,914 %, échéance le 25/08/2026 *		
6	Fannie Mae REMICS, série 2012 28, catégorie B, 6,500 %, échéance le 25/06/2039	6	—	56	Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 2,091 %, échéance le 01/03/2047 *	169	0,01
149	Fannie Mae REMICS, série 2012 35, catégorie SC, 1,883 %, échéance le 25/04/2042 *	15	—	1 660	Freddie Mac Non Gold Pool '841076', 3,007 %, échéance le 01/11/2048 *	53	—
40	Fannie Mae REMICS, série 2012 46, catégorie BA, 6,000 %, échéance le 25/05/2042	42	—	569	Freddie Mac Non Gold Pool '841077', 2,877 %, échéance le 01/11/2047 *	1 566	0,14
60	Fannie Mae REMICS, série 2012 51, catégorie B, 7,000 %, échéance le 25/05/2042	64	0,01	827	Freddie Mac Non Gold Pool '841081', 3,096 %, échéance le 01/02/2050 *	545	0,05
51	Fannie Mae REMICS, série 2012 74, catégorie SA, 2,033 %, échéance le 25/03/2042 *	3	—	46	Freddie Mac Pool 'QA5770', 3,000 %, échéance le 01/01/2050	790	0,07
156	Fannie Mae REMICS, série 2013 9, catégorie BC, 6,500 %, échéance le 25/07/2042	165	0,01	426	Freddie Mac Pool 'QA7256', 3,000 %, échéance le 02/01/2050	42	—
194	Fannie Mae REMICS, série 2013 9, catégorie CB, 5,500 %, échéance le 25/04/2042	197	0,02	398	Freddie Mac Pool 'QB5092', 2,500 %, échéance le 11/01/2050	379	0,03
1 088	Fannie Mae REMICS, série 2016 23, catégorie ST, 1,383 %, échéance le 25/11/2045 *	99	0,01	234	Freddie Mac Pool 'QB5093', 2,500 %, échéance le 11/01/2050	344	0,03
168	Fannie Mae REMICS, série 2016 61, catégorie BS, 1,483 %, échéance le 25/09/2046 *	10	—	65	Freddie Mac Pool 'QB5799', 2,500 %, échéance le 11/01/2050	201	0,02
802	Fannie Mae REMICS, série 2017 76, catégorie SB, 1,483 %, échéance le 25/10/2057 *	73	0,01	234	Freddie Mac Pool 'QB8602', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	56	—
215	Fannie Mae REMICS, série 2017 85, catégorie SC, 1,583 %, échéance le 25/11/2047 *	17	—	299	Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	195	0,02
633	Fannie Mae REMICS, série 2020 47, catégorie GZ, 2,000 %, échéance le 25/07/2050	378	0,03	145	Freddie Mac Pool 'QB8773', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	248	0,02
1 700	Fannie Mae REMICS, série 2020 56, catégorie AQ, 2,000 %, échéance le 25/08/2050	1 345	0,12	81	Freddie Mac Pool 'QB9057', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	120	0,01
714	Fannie Mae REMICS, série 2020 56, catégorie DI, 2,500 %, échéance le 25/08/2050	110	0,01	1 251	Freddie Mac Pool 'QB9087', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	66	0,01
387	Fannie Mae REMICS, série 2020 74, catégorie EI, 2,500 %, échéance le 25/10/2050	64	0,01	233	Freddie Mac Pool 'QB9482', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	1 038	0,09
2 172	Fannie Mae REMICS, série 2020 89, catégorie DI, 2,500 %, échéance le 25/12/2050	318	0,03	153	Freddie Mac Pool 'QB9484', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	192	0,02
1 345	Fannie Mae REMICS, série 2020 97, catégorie AI, 2,000 %, échéance le 25/01/2051	183	0,02	81	Freddie Mac Pool 'QB9485', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	127	0,01
2 117	Fannie Mae REMICS, série 2021 3, catégorie QI, 2,500 %, échéance le 25/02/2051	323	0,03	262	Freddie Mac Pool 'QB9961', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	67	0,01
2 058	Fannie Mae REMICS, série 2021 69, catégorie IJ, 2,500 %, échéance le 25/01/2049	267	0,02	221	Freddie Mac Pool 'QC0160', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	216	0,02
244	Fannie Mae-Aces, série 2013 M6, catégorie 1AC, 3,352 %, échéance le 25/02/2043 *	229	0,02	246	Freddie Mac Pool 'QC0161', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	183	0,02
800	Fannie Mae-Aces, série 2018 M15, catégorie 1A2, 3,700 %, échéance le 25/01/2036	735	0,06	86	Freddie Mac Pool 'QC0885', 2,000 %, échéance le 04/01/2051	202	0,02
745	Fannie Mae-Aces, série 2018 M9, catégorie APT2, 3,106 %, échéance le 25/04/2028 *	698	0,06	157	Freddie Mac Pool 'QC1164', 2,000 %, échéance le 04/01/2051	72	0,01
481	Fannie Mae-Aces, série 2019 M19, catégorie A2, 2,560 %, échéance le 25/09/2029	429	0,04	84	Freddie Mac Pool 'QC2044', 2,500 %, échéance le 05/01/2051	130	0,01
1 750	Fannie Mae-Aces, série 2020 M36, catégorie X1, 1,498 %, échéance le 25/09/2034 *	114	0,01	269	Freddie Mac Pool 'QC3690', 2,500 %, échéance le 07/01/2051	73	0,01
45	Flagstar Mortgage Trust 2018-2, série 2018 2, catégorie A4, 144A, 3,500 %, échéance le 25/04/2048 *	44	—	180	Freddie Mac Pool 'QC4818', 2,500 %, échéance le 08/01/2051	232	0,02
66	Freddie Mac Gold Pool 'C91987', 3,000 %, échéance le 04/01/2038	60	0,01	272	Freddie Mac Pool 'QC7411', 2,500 %, échéance le 09/01/2051	154	0,01
119	Freddie Mac Gold Pool 'G06409', 6,000 %, échéance le 11/01/2039	124	0,01	374	Freddie Mac Pool 'QC9154', 3,000 %, échéance le 10/01/2051	77	0,01
13	Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500 %, échéance le 09/01/2039	13	—	462	Freddie Mac Pool 'QD0350', 2,000 %, échéance le 11/01/2051	1 222	0,11
1	Freddie Mac Gold Pool 'G13888', 5,000 %, échéance le 06/01/2025	1	—	378	Freddie Mac Pool 'QD0652', 2,000 %, échéance le 11/01/2051	150	0,01
1 307	Freddie Mac Gold Pool 'G60985', 3,000 %, échéance le 05/01/2047	1 177	0,10	94	Freddie Mac Pool 'QD1954', 3,000 %, échéance le 11/01/2051	122	0,01
830	Freddie Mac Gold Pool 'G67701', 3,000 %, échéance le 10/01/2046	752	0,07	91	Freddie Mac Pool 'QD2260', 3,000 %, échéance le 12/01/2051	75	0,01
23	Freddie Mac Gold Pool 'Q19135', 4,000 %, échéance le 06/01/2043	23	—	87	Freddie Mac Pool 'QD4146', 2,500 %, échéance le 01/01/2052	83	0,01
23	Freddie Mac Gold Pool 'Q19254', 4,000 %, échéance le 06/01/2043	22	—	92	Freddie Mac Pool 'QD5620', 2,000 %, échéance le 02/01/2052	80	0,01
26	Freddie Mac Gold Pool 'Q19611', 4,000 %, échéance le 07/01/2043	25	—	96	Freddie Mac Pool 'QD5628', 2,000 %, échéance le 02/01/2052	75	0,01
23	Freddie Mac Gold Pool 'Q19615', 4,000 %, échéance le 07/01/2043	22	—	95	Freddie Mac Pool 'QD5960', 2,000 %, échéance le 02/01/2052	79	0,01
7	Freddie Mac Gold Pool 'Q27298', 4,000 %, échéance le 07/01/2044	7	—	92	Freddie Mac Pool 'QD5961', 2,000 %, échéance le 02/01/2052	78	0,01
324	Freddie Mac Gold Pool 'Q45560', 3,000 %, échéance le 01/01/2047	291	0,03	746	Freddie Mac Pool 'QD6079', 2,500 %, échéance le 02/01/2052	75	0,01
817	Freddie Mac Gold Pool 'Q45737', 3,000 %, échéance le 01/01/2047	736	0,06	95	Freddie Mac Pool 'QD6142', 2,500 %, échéance le 02/01/2052	640	0,06
226	Freddie Mac Gold Pool 'Q45819', 3,000 %, échéance le 01/01/2047	204	0,02	281	Freddie Mac Pool 'QD8675', 2,500 %, échéance le 03/01/2052	81	0,01
203	Freddie Mac Gold Pool 'Q45827', 3,000 %, échéance le 01/01/2047	183	0,02	187	Freddie Mac Pool 'QE1492', 3,500 %, échéance le 05/01/2052	240	0,02
78	Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000 %, échéance le 10/01/2042	75	0,01	396	Freddie Mac Pool 'QE6418', 4,000 %, échéance le 07/01/2052	172	0,02
47	Freddie Mac Gold Pool 'U91254', 4,000 %, échéance le 04/01/2043	46	—	200	Freddie Mac Pool 'QF6516', 6,500 %, échéance le 01/01/2053	373	0,03
20	Freddie Mac Gold Pool 'U95137', 4,000 %, échéance le 08/01/2043	19	—	200	Freddie Mac Pool 'QF6690', 6,500 %, échéance le 01/01/2053	205	0,02
571	Freddie Mac Gold Pool 'U99054', 4,000 %, échéance le 06/01/2043	549	0,05	200	Freddie Mac Pool 'QF8222', 6,500 %, échéance le 02/01/2053	206	0,02
				100	Freddie Mac Pool 'QF8298', 6,500 %, échéance le 03/01/2053	103	0,01
				77	Freddie Mac Pool 'QK0701', 2,500 %, échéance le 04/01/2041	68	0,01
				97	Freddie Mac Pool 'QU7914', 2,500 %, échéance le 07/01/2051	81	0,01
				732	Freddie Mac Pool 'RA3882', 2,000 %, échéance le 11/01/2050	606	0,05
				2 044	Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, échéance le 11/01/2050	1 763	0,15
				531	Freddie Mac Pool 'RA4142', 2,500 %, échéance le 12/01/2050	458	0,04
				1 316	Freddie Mac Pool 'RA4703', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	1 084	0,09
				2 986	Freddie Mac Pool 'RA5117', 2,000 %, échéance le 05/01/2051	2 452	0,21
				441	Freddie Mac Pool 'RA5373', 2,000 %, échéance le 06/01/2051	362	0,03
				184	Freddie Mac Pool 'RA6332', 2,000 %, échéance le 11/01/2051	151	0,01
				537	Freddie Mac Pool 'RA6562', 2,500 %, échéance le 01/01/2052	464	0,04
				166	Freddie Mac Pool 'RA6599', 3,500 %, échéance le 01/01/2052	152	0,01
				7 554	Freddie Mac Pool 'RA6694', 2,000 %, échéance le 01/01/2052	6 167	0,54
				2 025	Freddie Mac Pool 'RB5125', 2,000 %, échéance le 09/01/2041	1 718	0,15
				956	Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, échéance le 10/01/2041	765	0,07
				128	Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, échéance le 11/01/2041	103	0,01
				182	Freddie Mac Pool 'RB5138', 2,000 %, échéance le 12/01/2041	155	0,01
				93	Freddie Mac Pool 'SC0269', 2,000 %, échéance le 01/01/2042	79	0,01
				59	Freddie Mac Pool 'SD0247', 4,000 %, échéance le 07/01/2047	56	—
				834	Freddie Mac Pool 'SD0552', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	682	0,06
				226	Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, échéance le 04/01/2051	188	0,02
				260	Freddie Mac Pool 'SD0618', 3,000 %, échéance le 02/01/2051	231	0,02
				453	Freddie Mac Pool 'SD0745', 2,000 %, échéance le 11/01/2051	373	0,03
				543	Freddie Mac Pool 'SD0777', 2,500 %, échéance le 11/01/2051	464	0,04
				370	Freddie Mac Pool 'SD0849', 2,500 %, échéance le 01/01/2052	317	0,03
				289	Freddie Mac Pool 'SD0952', 3,000 %, échéance le 04/01/2052	258	0,02
				976	Freddie Mac Pool 'SD1132', 4,000 %, échéance le 06/01/2052	923	0,08
				89	Freddie Mac Pool 'SD1143', 4,500 %, échéance le 09/01/2050	87	0,01
				1 670	Freddie Mac Pool 'SD1305', 5,000 %, échéance le 07/01/2052	1 649	0,14
				1 278	Freddie Mac Pool 'SD1749', 2,500 %, échéance le 04/01/2052	1 091	0,10
				676	Freddie Mac Pool 'SD1751', 2,500 %, échéance le 10/01/2051	580	0,05
				199	Freddie Mac Pool 'SD2138', 5,500 %, échéance le 01/01/2053	200	0,02
				791	Freddie Mac Pool 'SD2284', 6,000 %, échéance le 12/01/2052	807	0,07

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques — (suite)					
489 Freddie Mac Pool 'SD7509', 3,000 %, échéance le 11/01/2049	437	0,04	77 Ginnie Mae II Pool '784985', 3,500 %, échéance le 20/09/2048	72	0,01
738 Freddie Mac Pool 'SD7525', 2,500 %, échéance le 10/01/2050	636	0,06	1 409 Ginnie Mae II Pool '785944', 3,000 %, échéance le 20/02/2052	1 264	0,11
1 331 Freddie Mac Pool 'SD7534', 2,500 %, échéance le 02/01/2051	1 152	0,10	367 Ginnie Mae II Pool '786077', 3,000 %, échéance le 20/03/2052	329	0,03
5 718 Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, échéance le 11/01/2051	4 916	0,43	468 Ginnie Mae II Pool '786082', 3,000 %, échéance le 20/11/2051	420	0,04
203 Freddie Mac Pool 'SD8129', 2,500 %, échéance le 02/01/2051	173	0,02	680 Ginnie Mae II Pool '786095', 3,000 %, échéance le 20/04/2052	590	0,05
2 148 Freddie Mac Pool 'SD8146', 2,000 %, échéance le 05/01/2051	1 757	0,15	278 Ginnie Mae II Pool '786107', 3,000 %, échéance le 20/03/2052	250	0,02
121 Freddie Mac Pool 'ZA5318', 3,500 %, échéance le 03/01/2048	112	0,01	289 Ginnie Mae II Pool '786108', 3,500 %, échéance le 20/03/2052	263	0,02
1 064 Freddie Mac Pool 'ZA6342', 4,500 %, échéance le 03/01/2049	1 049	0,09	1 004 Ginnie Mae II Pool '786134', 3,000 %, échéance le 20/04/2052	876	0,08
105 Freddie Mac Pool 'Z17269', 5,000 %, échéance le 03/01/2038	105	0,01	573 Ginnie Mae II Pool '786216', 3,500 %, échéance le 20/06/2052	516	0,04
169 Freddie Mac Pool 'ZM1278', 3,500 %, échéance le 06/01/2046	158	0,01	889 Ginnie Mae II Pool 'AP6338', 4,000 %, échéance le 20/10/2045	854	0,07
48 Freddie Mac Pool 'ZN0480', 3,500 %, échéance le 10/01/2042	45	–	219 Ginnie Mae II Pool 'BC4732', 3,500 %, échéance le 20/10/2047	204	0,02
3 Freddie Mac Pool 'ZS0823', 5,000 %, échéance le 12/01/2034	3	–	171 Ginnie Mae II Pool 'BD0384', 3,500 %, échéance le 20/10/2047	160	0,01
5 Freddie Mac Pool 'ZS2059', 5,500 %, échéance le 04/01/2038	5	–	91 Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500 %, échéance le 20/02/2050	84	0,01
19 Freddie Mac Pool 'ZS3059', 5,500 %, échéance le 12/01/2038	19	–	100 Ginnie Mae II Pool 'BM9734', 4,000 %, échéance le 20/10/2048	97	0,01
84 Freddie Mac Pool 'ZS3204', 5,000 %, échéance le 06/01/2041	84	0,01	80 Ginnie Mae II Pool 'BM9743', 4,000 %, échéance le 20/11/2045	74	0,01
52 Freddie Mac Pool 'ZS3412', 5,500 %, échéance le 12/01/2038	53	–	84 Ginnie Mae II Pool 'B51728', 4,000 %, échéance le 20/10/2050	82	0,01
106 Freddie Mac Pool 'ZS8669', 3,000 %, échéance le 09/01/2032	100	0,01	69 Ginnie Mae II Pool 'B51742', 4,000 %, échéance le 20/02/2050	66	0,01
111 Freddie Mac Pool 'ZS8673', 3,000 %, échéance le 10/01/2032	105	0,01	334 Ginnie Mae II Pool 'BT0812', 3,000 %, échéance le 20/03/2050	290	0,03
19 Freddie Mac Pool 'ZS8779', 5,000 %, échéance le 07/01/2025	19	–	96 Ginnie Mae II Pool 'CI1513', 3,000 %, échéance le 20/03/2052	85	0,01
566 Freddie Mac Pool 'ZS9316', 3,500 %, échéance le 01/01/2038	535	0,05	191 Ginnie Mae II Pool 'CL5523', 3,000 %, échéance le 20/04/2052	168	0,01
247 Freddie Mac Pool 'ZT1107', 3,500 %, échéance le 03/01/2043	231	0,02	155 Ginnie Mae II Pool 'MA1995', 3,500 %, échéance le 20/06/2044	146	0,01
23 Freddie Mac Pool 'ZT1159', 3,500 %, échéance le 02/01/2044	22	–	42 Ginnie Mae II Pool 'MA2678', 3,500 %, échéance le 20/03/2045	39	–
340 Freddie Mac Pool 'ZT1257', 3,000 %, échéance le 01/01/2046	306	0,03	65 Ginnie Mae II Pool 'MA3375', 3,000 %, échéance le 20/01/2046	59	0,01
616 Freddie Mac Pool 'ZT1970', 3,500 %, échéance le 04/01/2033	592	0,05	55 Ginnie Mae II Pool 'MA3521', 3,500 %, échéance le 20/03/2046	52	–
53 Freddie Mac Reference REMIC R007, catégorie ZA, 6,000 %, échéance le 15/05/2036	54	–	134 Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500 %, échéance le 20/04/2046	233	0,02
36 Freddie Mac REMICS 3621, catégorie SB, 1,642 %, échéance le 15/01/2040 *	3	–	250 Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500 %, échéance le 20/05/2046	126	0,01
189 Freddie Mac REMICS 4813, catégorie CJ, 3,000 %, échéance le 15/08/2048	164	0,01	228 Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500 %, échéance le 20/06/2046	213	0,02
413 Freddie Mac REMICS 5010, catégorie IK, 2,500 %, échéance le 25/09/2050	61	0,01	138 Ginnie Mae II Pool 'MA3803', 3,500 %, échéance le 20/04/2046	129	0,01
1 062 Freddie Mac REMICS 5010, catégorie JL, 2,500 %, échéance le 25/09/2050	167	0,01	84 Ginnie Mae II Pool 'MA3937', 3,500 %, échéance le 20/05/2046	79	0,01
417 Freddie Mac REMICS 5013, catégorie IN, 2,500 %, échéance le 25/09/2050	64	0,01	115 Ginnie Mae II Pool 'MA4068', 3,000 %, échéance le 20/11/2046	105	0,01
860 Freddie Mac REMICS 5018, catégorie MI, 2,000 %, échéance le 25/10/2050	116	0,01	87 Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000 %, échéance le 20/02/2047	79	0,01
221 Freddie Mac REMICS 5040, catégorie IB, 2,500 %, échéance le 25/11/2050	32	–	22 Ginnie Mae II Pool 'MA4381', 3,000 %, échéance le 20/04/2047	20	–
1 394 Freddie Mac REMICS 5059, catégorie IB, 2,500 %, échéance le 25/01/2051	221	0,02	1 485 Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, échéance le 20/06/2047	1 424	0,12
472 Freddie Mac REMICS 5069, catégorie MI, 2,500 %, échéance le 25/02/2051	70	0,01	258 Ginnie Mae II Pool 'MA4654', 4,500 %, échéance le 20/08/2047	255	0,02
1 277 Freddie Mac REMICS 5140, catégorie NI, 2,500 %, échéance le 25/05/2049	179	0,02	15 Ginnie Mae II Pool 'MA4836', 3,000 %, échéance le 20/11/2047	14	–
1 200 Freddie Mac REMICS 5224, catégorie HL, 4,000 %, échéance le 25/04/2052	1 090	0,09	591 Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000 %, échéance le 20/11/2047	567	0,05
728 Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, série 2020 DNA2, catégorie M2, 144A, 6,467 %, échéance le 25/02/2050 *	734	0,06	167 Ginnie Mae II Pool 'MA4899', 3,000 %, échéance le 20/12/2047	151	0,01
1 461 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA6, série 2020 DNA6, catégorie M2, 144A, 6,484 %, échéance le 25/12/2050 *	1 467	0,13	253 Ginnie Mae II Pool 'MA4901', 4,000 %, échéance le 20/12/2047	243	0,02
43 Freddie Mac Strips 334, catégorie S7, 1,512 %, échéance le 15/08/2044 *	4	–	222 Ginnie Mae II Pool 'MA5020', 4,000 %, échéance le 20/02/2048	214	0,02
345 Freddie Mac Strips 353, catégorie S1, 1,412 %, échéance le 15/12/2046 *	31	–	165 Ginnie Mae II Pool 'MA5078', 4,000 %, échéance le 20/03/2046	158	0,01
1 304 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, série 2015 HQ2, catégorie B, 12,567 %, échéance le 25/05/2025 *	1 331	0,12	213 Ginnie Mae II Pool 'MA5137', 4,000 %, échéance le 20/04/2048	204	0,02
30 Ginnie Mae I Pool '733600', 5,000 %, échéance le 15/04/2040	30	–	390 Ginnie Mae II Pool 'MA5138', 4,500 %, échéance le 20/04/2048	384	0,03
50 Ginnie Mae I Pool '733627', 5,000 %, échéance le 15/05/2040	50	–	470 Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500 %, échéance le 20/05/2048	463	0,04
52 Ginnie Mae I Pool '783669', 3,000 %, échéance le 15/09/2042	48	–	150 Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, échéance le 20/07/2048	147	0,01
395 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, échéance le 15/06/2048	374	0,03	294 Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500 %, échéance le 20/10/2048	289	0,03
75 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, échéance le 15/09/2042	70	0,01	169 Ginnie Mae II Pool 'MA5597', 5,000 %, échéance le 20/11/2048	170	0,01
174 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, échéance le 15/09/2042	160	0,01	130 Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500 %, échéance le 20/12/2048	126	0,01
381 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, échéance le 15/10/2042	352	0,03	207 Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500 %, échéance le 20/03/2049	203	0,02
240 Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000 %, échéance le 15/10/2042	222	0,02	194 Ginnie Mae II Pool 'MA5819', 5,000 %, échéance le 20/03/2049	195	0,02
1 Ginnie Mae I Pool 'AB9205', 3,000 %, échéance le 15/11/2042	1	–	97 Ginnie Mae II Pool 'MA5877', 4,500 %, échéance le 20/04/2049	95	0,01
210 Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000 %, échéance le 15/11/2042	194	0,02	324 Ginnie Mae II Pool 'MA6342', 5,000 %, échéance le 20/12/2049	325	0,03
17 Ginnie Mae II Pool '4040', 6,500 %, échéance le 20/10/2037	18	–	205 Ginnie Mae II Pool 'MA6413', 5,000 %, échéance le 20/01/2050	206	0,02
20 Ginnie Mae II Pool '4617', 4,500 %, échéance le 20/01/2041	20	–	181 Ginnie Mae II Pool 'MA6603', 5,000 %, échéance le 20/04/2050	182	0,02
23 Ginnie Mae II Pool '4696', 4,500 %, échéance le 20/05/2040	23	–	1 591 Ginnie Mae II Pool 'MA6711', 3,500 %, échéance le 20/06/2050	1 477	0,13
79 Ginnie Mae II Pool '4747', 5,000 %, échéance le 20/07/2040	80	0,01	1 792 Ginnie Mae II Pool 'MA6997', 3,500 %, échéance le 20/11/2050	1 672	0,15
15 Ginnie Mae II Pool '4772', 5,000 %, échéance le 20/08/2040	15	–	460 Ginnie Mae II Pool 'MA6999', 4,500 %, échéance le 20/11/2050	446	0,04
10 Ginnie Mae II Pool '4802', 5,000 %, échéance le 20/09/2040	11	–	87 Ginnie Mae II Pool 'MA7056', 4,500 %, échéance le 20/12/2050	85	0,01
6 Ginnie Mae II Pool '4871', 6,000 %, échéance le 20/11/2040	6	–	327 Ginnie Mae II Pool 'MA7136', 2,500 %, échéance le 20/01/2051	285	0,02
20 Ginnie Mae II Pool '4905', 6,000 %, échéance le 20/12/2040	21	–	111 Ginnie Mae II Pool 'MA7194', 3,000 %, échéance le 20/02/2051	100	0,01
3 Ginnie Mae II Pool '4928', 6,000 %, échéance le 20/01/2041	3	–	144 Ginnie Mae II Pool 'MA7255', 2,500 %, échéance le 20/03/2051	125	0,01
12 Ginnie Mae II Pool '4961', 6,000 %, échéance le 20/02/2041	13	–	1 211 Ginnie Mae II Pool 'MA7312', 2,500 %, échéance le 20/04/2051	1 053	0,09
173 Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500 %, échéance le 20/03/2041	172	0,02	2 239 Ginnie Mae II Pool, 'MA7590', 3,000 % le 20/09/2051	2 010	0,18
4 Ginnie Mae II Pool '783050', 5,000 %, échéance le 20/07/2040	4	–	3 396 Ginnie Mae II Pool 'MA7883', 3,500 %, échéance le 20/02/2053	3 133	0,27
52 Ginnie Mae II Pool '783368', 4,500 %, échéance le 20/07/2041	52	–	17 100 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 2,500 % ±	14 794	1,29
110 Ginnie Mae II Pool '784106', 3,500 %, échéance le 20/01/2046	103	0,01	12 600 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 3,000 % ±	11 253	0,98
1 228 Ginnie Mae II Pool '784674', 3,500 %, échéance le 20/04/2048	1 154	0,10	2 200 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 4,000 % ±	2 079	0,18
79 Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500 %, échéance le 20/10/2049	72	0,01	5 600 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 4,500 % ±	5 431	0,47
442 Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000 %, échéance le 20/01/2050	395	0,03	7 700 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 5,000 % ±	7 610	0,66
			3 400 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 5,500 % ±	3 413	0,30
			600 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 6,000 % ±	609	0,05
			160 Government National Mortgage Association, série 2009 H01, catégorie FA, 5,748 %, échéance le 20/11/2059 *	160	0,01
			4 Government National Mortgage Association, série 2010 42, catégorie BS, 1,882 %, échéance le 20/04/2040 *	–	–
			2 Government National Mortgage Association, série 2010 85, catégorie HS, 2,052 %, échéance le 20/01/2040 *	–	–
			341 Government National Mortgage Association, série 2010 H11, catégorie FA, 5,517 %, échéance le 20/06/2060 *	342	0,03
			291 Government National Mortgage Association, série 2010 H20, catégorie AF, 4,722 %, échéance le 20/10/2060 *	289	0,03
			2 Government National Mortgage Association, série 2010 H22, catégorie FE, 4,742 %, échéance le 20/05/2059 *	2	–
			474 Government National Mortgage Association, série 2010 H24, catégorie FA, 4,742 %, échéance le 20/10/2060 *	472	0,04
			20 Government National Mortgage Association, série 2010 H26, catégorie LF, 4,742 %, échéance le 20/08/2058 *	20	–
			180 Government National Mortgage Association, série 2011 H01, catégorie AF, 4,842 %, échéance le 20/11/2060 *	180	0,02

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative		
Titres adossés à des hypothèques — (suite)				1 764	Government National Mortgage Association, série 2022 3, catégorie IO, 0,640 %, échéance le 16/02/2061 *	89	0,01		
37	Government National Mortgage Association, série 2011 H09, catégorie AF, 4,892 %, échéance le 20/03/2061 *	37	—	200	Government National Mortgage Association, série 2022 63, catégorie LM, 3,500 %, échéance le 20/10/2050	170	0,01		
308	Government National Mortgage Association, série 2013 107, catégorie AD, 2,845 %, échéance le 16/11/2047 *	278	0,02	2 881	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, série 2018 SRP5, catégorie A, 144A, 6,388 %, échéance le 15/09/2031 *	2 472	0,22		
4 914	Government National Mortgage Association, série 2013 50, catégorie IO, 0,067 %, échéance le 16/10/2048 *	7	—	2 183	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, série 2018 SRP5, catégorie B, 144A, 7,588 %, échéance le 15/09/2031 *	1 622	0,14		
836	Government National Mortgage Association, série 2014 169, catégorie IO, 0,626 %, échéance le 16/10/2056 *	18	—	80	GS Mortgage Securities Trust 2013-GC16, série 2013 GC16, catégorie B, 5,161 %, échéance le 10/11/2046 *	79	0,01		
36	Government National Mortgage Association, série 2014 17, catégorie AM, 3,537 %, échéance le 16/06/2048 *	34	—	867	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20, série 2014 GC20, catégorie XA, 1,007 %, échéance le 10/04/2047 *	6	—		
217	Government National Mortgage Association, série 2014 176, catégorie IA, 4,000 %, échéance le 20/11/2044	39	—	16	HarborView Mortgage Loan Trust 2007-7, série 2007 7, catégorie 2A1A, 5,617 %, échéance le 25/10/2037 *	14	—		
1 741	Government National Mortgage Association, série 2014 H20, catégorie FA, 4,822 %, échéance le 20/10/2064 *	1 731	0,15	3 980	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHH, série 2018 PHH, catégorie F, 144A, 7,898 %, échéance le 15/06/2035 *	783	0,07		
484	Government National Mortgage Association, série 2015 167, catégorie OI, 4,000 %, échéance le 16/04/2045	88	0,01	4 070	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, série 2020 MKST, catégorie F, 144A, 7,688 %, échéance le 15/12/2036 *	2 509	0,22		
806	Government National Mortgage Association, série 2015 183, catégorie IO, 0,532 %, échéance le 16/09/2057 *	19	—	1 897	JP Morgan Mortgage Trust 2017-5, série 2017 5, catégorie A2, 144A, 3,257 %, échéance le 26/10/2048 *	1 828	0,16		
203	Government National Mortgage Association, série 2016 135, catégorie SB, 1,510 %, échéance le 16/10/2046 *	27	—	182	JP Morgan Mortgage Trust 2018-4, série 2018 4, catégorie A1, 144A, 3,500 %, échéance le 25/10/2048 *	159	0,01		
789	Government National Mortgage Association, série 2016 21, catégorie ST, 1,552 %, échéance le 20/02/2046 *	82	0,01	30	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17, série 2013 C17, catégorie B, 4,883 %, échéance le 15/01/2047 *	29	—		
377	Government National Mortgage Association, série 2016 84, catégorie IG, 4,500 %, échéance le 16/11/2045	76	0,01	160	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C31, série 2015 C31, catégorie B, 4,622 %, échéance le 15/08/2048 *	149	0,01		
938	Government National Mortgage Association, série 2017 111, catégorie IO, 0,526 %, échéance le 16/02/2059 *	31	—	72	ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, série 2007 5, catégorie AJ, 5,450 %, échéance le 12/08/2048 *	19	—		
931	Government National Mortgage Association, série 2017 157, catégorie IO, 0,503 %, échéance le 16/12/2059 *	30	—	14	ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-9, série 2007 9, catégorie AJ, 6,193 %, échéance le 12/09/2049 *	13	—		
905	Government National Mortgage Association, série 2017 28, catégorie IO, 0,681 %, échéance le 16/02/2057 *	33	—	20	Morgan Stanley Capital I Trust 2007-IQ16, série 2007 IQ16, catégorie AJ, 6,282 %, échéance le 12/12/2049 *	10	—		
516	Government National Mortgage Association, série 2017 41, catégorie IO, 0,595 %, échéance le 16/07/2058 *	15	—	280	MSCG Trust 2015-ALDR, série 2015 ALDR, catégorie A2, 144A, 3,462 %, échéance le 06/07/2035 *	255	0,02		
105	Government National Mortgage Association, série 2017 H15, classe KI, 1,717 %, échéance le 20/07/2067 *	5	—	2 870	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, série 2019 FAME, catégorie A, 144A, 3,047 %, échéance le 15/08/2036	2 682	0,23		
4 162	Government National Mortgage Association, série 2017 H18, catégorie BI, 0,163 %, échéance le 20/09/2067 *	179	0,02	367	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, série 2016 3A, catégorie A1B, 144A, 3,250 %, échéance le 25/09/2056 *	333	0,03		
54	Government National Mortgage Association, série 2017 H20, catégorie IB, 0,154 %, échéance le 20/10/2067 *	2	—	698	New Residential Mortgage Loan Trust 2017-6, Series 2017 6 A, catégorie A1, 144A, 4,000 %, échéance le 27/08/2057 *	651	0,06		
320	Government National Mortgage Association, série 2018 H06, classe PF, 4,692 %, échéance le 20/02/2068 *	316	0,03	935	Prime Mortgage Trust 2006-DR1, série 2006 DR1, catégorie 2A1, 144A, 5,500 %, échéance le 25/05/2035	814	0,07		
561	Government National Mortgage Association, série 2018 H07, catégorie FD, 4,692 %, échéance le 20/05/2068 *	560	0,05	113	Residential Asset Securitization Trust 2005-A15, série 2005 A15, catégorie 1A4, 5,750 %, échéance le 25/02/2036	104	0,01		
296	Government National Mortgage Association, série 2019 90, catégorie AB, 3,000 %, échéance le 20/07/2049	265	0,02	5	Sequoia Mortgage Trust 2004-10, série 2004 10, catégorie A1A, 5,218 %, échéance le 20/11/2034 *	4	—		
1 478	Government National Mortgage Association, série 2020 103, catégorie AD, 1,450 %, échéance le 16/01/2063	1 174	0,10	2 694	Towd Point Mortgage Trust 2017-5, série 2017 5, catégorie B1, 144A, 4,202 %, échéance le 25/02/2057 *	2 618	0,23		
317	Government National Mortgage Association, série 2020 123, catégorie IL, 2,500 %, échéance le 20/08/2050	44	—	690	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C2, série 2017 C2, catégorie A4, 3,487 %, échéance le 15/08/2050	635	0,06		
961	Government National Mortgage Association, série 2020 123, catégorie NI, 2,500 %, échéance le 20/08/2050	133	0,01	75 481	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C9, série 2018 C9, Classe XA, 0,927 %, échéance le 15/03/2051 *	2 832	0,25		
470	Government National Mortgage Association, série 2020 127, catégorie IN, 2,500 %, échéance le 20/08/2050	67	0,01	1 575	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates série 2005-AR6 Trust, série 2005 AR6, catégorie 2A1A, 5,077 %, échéance le 25/04/2045 *	1 522	0,13		
407	Government National Mortgage Association, série 2020 129, catégorie IE, 2,500 %, échéance le 20/09/2050	59	0,01	178	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA2 Trust, série 2007 OA2, catégorie 2A, 3,591 %, échéance le 25/03/2047 *	154	0,01		
16 184	Government National Mortgage Association, série 2020 157, catégorie IO, 0,940 %, échéance le 16/06/2062 *	1 057	0,09	75	Waterfall Commercial Mortgage Trust 2015-SBC5, série 2015 SBC5, catégorie A, 144A, 4,104 %, échéance le 14/09/2022 *	73	0,01		
250	Government National Mortgage Association, série 2020 160, catégorie IH, 2,500 %, échéance le 20/10/2050	36	—	20	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2013-LC12, série 2013 LC12, catégorie B, 4,283 %, échéance le 15/07/2046 *	19	—		
324	Government National Mortgage Association, série 2020 160, catégorie VI, 2,500 %, échéance le 20/10/2050	46	—	250	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-LC20, série 2015 LC20, catégorie AS, 3,467 %, échéance le 15/04/2050	236	0,02		
1 402	Government National Mortgage Association, série 2020 160, catégorie YI, 2,500 %, échéance le 20/10/2050	193	0,02	160	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1, série 2015 NX51, catégorie AS, 3,406 %, échéance le 15/05/2048	150	0,01		
1 518	Government National Mortgage Association, série 2020 173, catégorie MI, 2,500 %, échéance le 20/11/2050	199	0,02	4 856	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RB1, série 2017 RB1, Classe XA, 1,197 %, échéance le 15/03/2050 *	188	0,02		
12 344	Government National Mortgage Association, série 2020 178, catégorie IO, 1,422 %, échéance le 16/10/2060 *	1 137	0,10	2 330	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013-C14, série 2013 C14, catégorie B, 3,841 %, échéance le 15/06/2046 *	2 035	0,18		
3 056	Government National Mortgage Association, série 2020 181, catégorie WI, 2,000 %, échéance le 20/12/2050	331	0,03	2 010	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21, série 2014 C21, catégorie B, 4,213 %, échéance le 15/08/2047 *	1 891	0,16		
807	Government National Mortgage Association, série 2020 47, catégorie MI, 3,500 %, échéance le 20/04/2050	133	0,01	Total des titres adossés à des hypothèques (coût 409 159\$)			373 100	32,48	
291	Government National Mortgage Association, série 2020 47, catégorie NI, 3,500 %, échéance le 20/04/2050	48	—	Obligations et bons d'entreprises — 36,53 % (28 février 2022 : 32,53 %)					
829	Government National Mortgage Association, série 2020 H09, catégorie FL, 5,542 %, échéance le 20/05/2070 *	824	0,07	Australie — 0,04 % (28 février 2022 : 0,21 %)					
176	Government National Mortgage Association, série 2020 H09, classe NF, 5,642 %, échéance le 20/04/2070 *	178	0,02	300	BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000 %, échéance le 30/09/2043	291	0,03		
99	Government National Mortgage Association, série 2020 H12, catégorie F, 4,892 %, échéance le 20/07/2070 *	97	0,01	200	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 3,900 %, échéance le 12/07/2047	171	0,01		
390	Government National Mortgage Association, série 2020 H13, catégorie FA, 3,084 %, échéance le 20/07/2070 *	378	0,03			462	0,04		
103	Government National Mortgage Association, série 2020 H13, catégorie FC, 3,567 %, échéance le 20/07/2070 *	100	0,01	Belgique — 0,40 % (28 février 2022 : 0,36 %)					
953	Government National Mortgage Association, série 2021 14, catégorie AB, 1,340 %, échéance le 16/06/2063	756	0,07	1 220	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, échéance le 01/02/2046	1 120	0,10		
1 854	Government National Mortgage Association, série 2021 21, catégorie AH, 1,400 %, échéance le 16/06/2063	1 475	0,13	680	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,000 %, échéance le 13/04/2028	650	0,06		
25 777	Government National Mortgage Association, série 2021 5, catégorie IO, 1,112 %, échéance le 16/01/2061 *	1 931	0,17						
1 500	Government National Mortgage Association, série 2022 139, catégorie AL, 4,000 %, échéance le 20/07/2051	1 401	0,12						

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
Belgique — (suite)					
280 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, échéance le 01/06/2030	255	0,02	1 000 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,000 %, échéance le 29/10/2028	853	0,08
1 610 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, échéance le 01/06/2040	1 416	0,12	480 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, échéance le 30/01/2032	384	0,03
153 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, échéance le 15/04/2048	135	0,01	353 Avolon TLB Borrower 1 (US) LLC, 6,848 %, échéance le 01/12/2027 *	353	0,03
1 060 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, échéance le 23/01/2049	1 068	0,09	50 Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 4,500 %, échéance le 15/03/2023	50	0,01
	4 644	0,40	120 Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,500 %, échéance le 15/02/2024	119	0,01
				4 343	0,38
Brésil — 0,67 % (28 février 2022 : 0,73 %)					
57 Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, échéance le 17/03/2024	57	0,01	910 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, échéance le 21/07/2023	901	0,08
5 150 Petrobras Global Finance BV, 5,299 %, échéance le 27/01/2025	5 091	0,44	210 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,000 %, échéance le 15/04/2024	210	0,02
290 Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, échéance le 05/06/2115	242	0,02	590 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125 %, échéance le 31/01/2025	598	0,05
190 Suzano Austria GmbH, 3,750 %, échéance le 15/01/2031	161	0,01	1 570 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, échéance le 01/10/2026	1 373	0,12
2 050 Suzano Austria GmbH, série DM3N, 3,125 %, échéance le 15/01/2032	1 617	0,14	430 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, échéance le 09/05/2027	387	0,03
60 Vale Canada Ltd, 7,200 %, échéance le 15/09/2032	66	0,01	1 530 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, échéance le 09/05/2029	1 356	0,12
410 Vale Overseas Ltd, 6,875 %, échéance le 21/11/2036	421	0,04		4 825	0,42
	7 655	0,67			
Canada — 0,34 % (28 février 2022 : 0,17 %)					
120 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,875 %, échéance le 15/01/2028	107	0,01	Italie — 0,17 % (28 février 2022 : 0,20 %)		
110 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500 %, échéance le 15/02/2029	93	0,01	1 160 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, échéance le 26/06/2024	1 121	0,10
160 Bank of Montreal, 3,803 %, échéance le 15/12/2032 *	143	0,01	850 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, échéance le 15/01/2026	814	0,07
550 Bank of Nova Scotia/The, 4,588 %, échéance le 04/05/2037 *	482	0,04		1 935	0,17
290 Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, échéance le 30/05/2041	289	0,03	Japon — 0,37 % (28 février 2022 : 0,18 %)		
500 Barrick North America Finance LLC, 5,750 %, échéance le 01/05/2043	504	0,05	540 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3,837 %, échéance le 17/04/2026 *	519	0,04
650 Canadian Pacific Railway Co, 3,100 %, échéance le 02/12/2051	444	0,04	560 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 4,080 %, échéance le 19/04/2028 *	532	0,05
30 Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, échéance le 15/02/2030	25	—	580 Nissan Motor Co LLC, 144A, 3,043 %, échéance le 15/09/2023	570	0,05
40 Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, échéance le 01/12/2031	32	—	1 810 Nissan Motor Co LLC, 144A, 3,522 %, échéance le 17/09/2025	1 694	0,15
20 Teck Resources Ltd, 6,000 %, échéance le 15/08/2040	20	—	990 Nissan Motor Co LLC, 144A, 4,345 %, échéance le 17/09/2027	903	0,08
1 460 Toronto-Dominion Bank/The, 4,456 %, échéance le 08/06/2032	1 375	0,12		4 218	0,37
390 Yamana Gold Inc, 4,625 %, échéance le 15/12/2027	367	0,03			
	3 881	0,34	Kazakhstan — 0,05 % (28 février 2022 : 0,05 %)		
Chine — 0,30 % (28 février 2022 : 0,25 %)					
370 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2,700 %, échéance le 01/05/2025	347	0,03	200 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 5,750 %, échéance le 19/04/2047	160	0,01
2 650 Prosus SA, 144A, 3,061 %, échéance le 13/07/2031	2 036	0,18	520 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 6,375 %, échéance le 24/10/2048	439	0,04
1 660 Prosus NV, 144A, 3,832 %, échéance le 08/02/2051	1 008	0,09		599	0,05
	3 391	0,30	Koweït — 0,04 % (28 février 2022 : 0,04 %)		
Colombie — 0,13 % (28 février 2022 : 0,13 %)					
1 210 Ecopetrol SA, 4,625 %, échéance le 02/11/2031	903	0,08	520 Equate Petrochemical BV, 144A, 4,250 %, échéance le 03/11/2026	501	0,04
960 Ecopetrol SA, 5,875 %, échéance le 28/05/2045	634	0,05	Luxembourg — 0,01 % (28 février 2022 : 0,01 %)		
	1 537	0,13	150 ArcelorMittal SA, 7,000 %, échéance le 15/10/2039	153	0,01
Danemark — 0,19 % (28 février 2022 : 0,02 %)					
280 Danske Bank A/S, 144A, 3,244 %, échéance le 20/12/2025 *	266	0,02	Macao — 0,43 % (28 février 2022 : 0,22 %)		
2 040 Danske Bank A/S, 144A, 4,298 %, échéance le 01/04/2028 *	1 924	0,17	2 290 Sands China Ltd, 5,625 %, échéance le 08/08/2025	2 222	0,20
	2 190	0,19	710 Sands China Ltd, 2,800 %, échéance le 08/03/2027	605	0,05
France — 1,08 % (28 février 2022 : 0,53 %)					
700 Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, échéance le 15/10/2029	549	0,05	580 Sands China Ltd, 5,900 %, échéance le 08/08/2028	550	0,05
280 BNP Paribas SA, 144A, 3,375 %, échéance le 09/01/2025	269	0,02	730 Sands China Ltd, 3,350 %, échéance le 08/03/2029	597	0,05
310 Telefonica Chile SA, 144A, 4,705 %, échéance le 10/01/2025 *	307	0,03	1 090 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, échéance le 26/08/2028	934	0,08
1 660 BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, échéance le 09/06/2026 *	1 534	0,13		4 908	0,43
620 BNP Paribas SA, 144A, 4,625 %, échéance le 13/03/2027	595	0,05	Mexique — 0,11 % (28 février 2022 : 0,09 %)		
2 890 BNP Paribas SA, 144A, 1,675 %, échéance le 30/06/2027 *	2 541	0,22	20 America Movil SAB de CV, 6,375 %, échéance le 01/03/2035	21	—
1 580 BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, échéance le 14/08/2028	1 493	0,13	20 America Movil SAB de CV, 6,125 %, échéance le 15/11/2037	21	—
2 210 BNP Paribas SA, 144A, 5,125 %, échéance le 13/01/2029 *	2 174	0,19	1 320 Southern Copper Corp, 5,250 %, échéance le 08/11/2042	1 236	0,11
360 BNP Paribas SA, 144A, 5,198 %, échéance le 10/01/2030 *	350	0,03		1 278	0,11
550 BNP Paribas SA, 144A, 4,375 %, échéance le 01/03/2033 *	500	0,04	Maroc — 0,12 % (28 février 2022 : 0,14 %)		
500 BPCE SA, 144A, 5,150 %, échéance le 21/07/2024	492	0,04	310 OCP SA, 144A, 4,500 %, échéance le 22/10/2025	298	0,03
590 Credit Agricole SA, 144A, 4,000 %, échéance le 10/01/2033 *	529	0,05	940 OCP SA, 144A, 3,750 %, échéance le 23/06/2031	757	0,06
240 Danone SA, 144A, 2,947 %, échéance le 02/11/2026	223	0,02	480 OCP SA, 144A, 5,125 %, échéance le 23/06/2051	348	0,03
940 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 3,750 %, échéance le 17/09/2024	897	0,08		1 403	0,12
	12 453	1,08	Pays-Bas — 0,45 % (28 février 2022 : 0,36 %)		
Inde — 0,10 % (28 février 2022 : 0,10 %)					
330 Reliance Industries Ltd, 144A, 2,875 %, échéance le 12/01/2032	268	0,02	200 ABN AMRO Bank NV, 144A, 4,750 %, échéance le 28/07/2025	195	0,02
1 270 Reliance Industries Ltd, 144A, 3,625 %, échéance le 12/01/2052	891	0,08	1 840 Cooperatieve Rabobank UA, 4,375 %, échéance le 04/08/2025	1 783	0,15
	1 159	0,10	250 Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 1,339 %, échéance le 24/06/2026 *	226	0,02
Irlande — 0,38 % (28 février 2022 : 0,24 %)					
850 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,150 %, échéance le 15/02/2024	829	0,07	600 Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 3,649 %, échéance le 06/04/2028 *	560	0,05
1 990 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 2,450 %, échéance le 29/10/2026	1 755	0,15	600 Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 3,758 %, échéance le 06/04/2033 *	522	0,05
			160 Shell International Finance BV, 4,550 %, échéance le 12/08/2043	146	0,01
			770 Shell International Finance BV, 4,375 %, échéance le 11/05/2045	682	0,06
			270 Shell International Finance BV, 4,000 %, échéance le 10/05/2046	225	0,02
			1 170 Shell International Finance BV, 3,250 %, échéance le 06/04/2050	861	0,07
				5 200	0,45

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
Afrique du Sud — 0,10 % (28 février 2022 : 0,08 %)					
670 Anglo American Capital Plc, 144A, 3,625 %, échéance le 11/09/2024	648	0,06	110 AbbVie Inc, 4,250 %, échéance le 21/11/2049	92	0,01
200 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, échéance le 10/04/2027	194	0,02	30 ADT Security Corp/The, 144A, 4,125 %, échéance le 01/08/2029	26	—
290 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,000 %, échéance le 11/09/2027	272	0,02	90 Aetna Inc, 2,800 %, échéance le 15/06/2023	89	0,01
	1 114	0,10	450 Air Lease Corp, 3,375 %, échéance le 01/07/2025	425	0,04
Espagne — 0,19 % (28 février 2022 : 0,15 %)					
1 200 Banco Santander SA, 2,746 %, échéance le 28/05/2025	1 125	0,10	600 Air Lease Corp, 5,300 %, échéance le 01/02/2028	583	0,05
200 Banco Santander SA, 4,175 %, échéance le 24/03/2028 *	187	0,02	160 Alphabet Inc, 0,450 %, échéance le 15/08/2025	145	0,01
500 Telefonica Emisiones SA, 4,103 %, échéance le 08/03/2027	474	0,04	370 Alphabet Inc, 1,100 %, échéance le 15/08/2030	292	0,03
210 Telefonica Emisiones SA, 5,213 %, échéance le 08/03/2047	177	0,01	370 Alphabet Inc, 1,900 %, échéance le 15/08/2040	247	0,02
260 Telefonica Emisiones SA, 4,895 %, échéance le 06/03/2048	207	0,02	230 Alphabet Inc, 2,050 %, échéance le 15/08/2050	139	0,01
	2 170	0,19	210 Amazon.com Inc, 3,300 %, échéance le 13/04/2027	198	0,02
Suisse — 1,28 % (28 février 2022 : 0,47 %)					
1 570 Credit Suisse AG/New York NY, 7,950 %, échéance le 01/09/2025	1 586	0,14	970 Amazon.com Inc, 1,200 %, échéance le 03/06/2027	838	0,07
710 Credit Suisse AG/New York NY, 2,950 %, échéance le 09/04/2025	645	0,06	660 Amazon.com Inc, 3,150 %, échéance le 22/08/2027	617	0,05
1 530 Credit Suisse AG/New York NY, 5,000 %, échéance le 07/09/2027	1 403	0,12	430 Amazon.com Inc, 3,450 %, échéance le 13/04/2029	400	0,04
1 640 Credit Suisse AG/New York NY, 7,500 %, échéance le 15/02/2028	1 657	0,14	510 Amazon.com Inc, 1,500 %, échéance le 03/06/2030	409	0,04
700 Credit Suisse Group AG, 144A, 2,593 %, échéance le 11/09/2025 *	635	0,05	260 Amazon.com Inc, 2,100 %, échéance le 12/05/2031	214	0,02
610 Credit Suisse Group AG, 144A, 2,193 %, échéance le 05/06/2026 *	526	0,05	1 750 Amazon.com Inc, 3,600 %, échéance le 13/04/2032	1 603	0,14
670 Credit Suisse Group AG, 144A, 4,194 %, échéance le 01/04/2031 *	532	0,05	2 240 Amazon.com Inc, 3,875 %, échéance le 22/08/2037	1 981	0,17
720 Credit Suisse Group AG, 144A, 3,091 %, échéance le 14/05/2032 *	507	0,04	340 Amazon.com Inc, 4,950 %, échéance le 05/12/2044	334	0,03
420 Credit Suisse Group AG, 144A, 9,016 %, échéance le 15/11/2033 *	442	0,04	320 Amazon.com Inc, 4,050 %, échéance le 22/08/2047	277	0,02
2 840 Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, perpétuelle* t.c.	2 577	0,22	1 230 Amazon.com Inc, 2,500 %, échéance le 03/06/2050	791	0,07
200 UBS AG/Londres, 144A, 4,500 %, échéance le 26/06/2048	178	0,02	140 Amazon.com Inc, 4,250 %, échéance le 22/08/2057	121	0,01
270 UBS Group AG, 144A, 4,488 %, échéance le 12/05/2026 *	263	0,02	640 American Express Co, 3,375 %, échéance le 03/05/2024	626	0,05
820 UBS Group SA, 144A, 4,253 %, échéance le 23/03/2028	774	0,07	1 000 American Express Co, 4,050 %, échéance le 03/05/2029	948	0,08
680 UBS Group AG, 144A, 4,751 %, échéance le 12/05/2028 *	655	0,06	246 American International Group Inc, 2,500 %, échéance le 30/06/2025	232	0,02
300 UBS Group AG, 144A, 2,746 %, échéance le 11/02/2033 *	236	0,02	220 American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, échéance le 15/01/2032	180	0,02
2 090 UBS Group SA, 144A, 7,000 %, perpétuelle *	2 085	0,18	34 Amgen Inc, 4,663 %, échéance le 15/06/2051	29	—
	14 701	1,28	270 Apache Corp, 7,750 %, échéance le 15/12/2029	280	0,02
Émirats arabes unis — 0,08 % (28 février 2022 : 0,07 %)					
200 DP World Ltd/Émirats Arabes Unis, 144A, 5,625 %, échéance le 25/09/2048	194	0,02	17 Apache Corp, 6,000 %, échéance le 15/01/2037	16	—
760 DP World Ltd/Émirats Arabes Unis, 5,625 %, échéance le 25/09/2048	736	0,06	1 160 Apache Corp, 5,100 %, échéance le 01/09/2040	956	0,08
	930	0,08	60 Apache Corp, 5,250 %, échéance le 01/02/2042	49	—
Royaume-Uni — 1,05 % (28 février 2022 : 0,73 %)					
410 Barclays Plc, 4,972 %, échéance le 16/05/2029 *	391	0,03	510 Apache Corp, 4,750 %, échéance le 15/04/2043	391	0,03
2 610 Barclays Plc, 5,088 %, échéance le 20/06/2030 *	2 420	0,21	180 Apache Corp, 4,250 %, échéance le 15/01/2044	130	0,01
430 HSBC Holdings Plc, 4,250 %, échéance le 18/08/2025	415	0,04	290 Apache Corp, 5,350 %, échéance le 01/07/2049	230	0,02
330 HSBC Holdings Plc, 4,300 %, échéance le 08/03/2026	319	0,03	720 Apple Inc, 2,450 %, échéance le 04/08/2026	667	0,06
600 HSBC Holdings Plc, 4,041 %, échéance le 13/03/2028 *	561	0,05	250 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 4,000 %, échéance le 01/09/2029	201	0,02
400 HSBC Holdings Plc, 4,583 %, échéance le 19/06/2029 *	376	0,03	400 AT&T Inc, 3,800 %, échéance le 15/02/2027	380	0,03
950 HSBC Holdings Plc, 4,762 %, échéance le 29/03/2033 *	854	0,07	1 300 AT&T Inc, 2,300 %, échéance le 01/06/2027	1 159	0,10
340 HSBC Holdings Plc, 6,500 %, échéance le 02/05/2036	352	0,03	510 AT&T Inc, 1,650 %, échéance le 01/02/2028	434	0,04
820 Lloyds Banking Group Plc, 4,650 %, échéance le 24/03/2026	791	0,07	150 AT&T Inc, 2,250 %, échéance le 01/02/2032	117	0,01
780 Lloyds Banking Group Plc, 4,375 %, échéance le 22/03/2028	738	0,06	390 AT&T Inc, 2,550 %, échéance le 01/12/2033	299	0,03
2 560 NatWest Group Plc, 2,359 %, échéance le 22/05/2024 *	2 538	0,22	170 AT&T Inc, 5,350 %, échéance le 01/09/2040	163	0,01
630 NatWest Group Plc, 4,269 %, échéance le 22/03/2025 *	619	0,05	190 AT&T Inc, 5,550 %, échéance le 15/08/2041	185	0,02
230 NatWest Group Plc, 4,892 %, échéance le 18/05/2029 *	220	0,02	161 AT&T Inc, 4,350 %, échéance le 15/06/2045	131	0,01
250 NatWest Group Plc, 5,076 %, échéance le 27/01/2030 *	240	0,02	1 218 AT&T Inc, 4,500 %, échéance le 09/03/2048	1 003	0,09
420 Standard Chartered Plc, 144A, 5,700 %, échéance le 26/03/2044	396	0,04	919 AT&T Inc, 3,500 %, échéance le 15/09/2053	632	0,06
340 Virgin Media Secured Finance plc, 144A, 5,500 %, échéance le 15/05/2029	308	0,03	689 AT&T Inc, 3,550 %, échéance le 15/09/2055	467	0,04
630 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, échéance le 15/07/2031	522	0,05	70 AT&T Inc, 3,800 %, échéance le 01/12/2057	49	—
	12 060	1,05	465 AT&T Inc, 3,650 %, échéance le 15/09/2059	315	0,03
États-Unis — 27,97 % (28 février 2022 : 26,22 %)					
470 3M Co, 2,375 %, échéance le 26/08/2029	395	0,03	530 Ball Corp, 3,125 %, échéance le 15/09/2031	425	0,04
130 3M Co, 3,050 %, échéance le 15/04/2030	114	0,01	680 Bank of America Corp, 3,550 %, échéance le 05/03/2024 *	680	0,06
920 3M Co, 3,700 %, échéance le 15/04/2050	714	0,06	520 Bank of America Corp, 4,200 %, échéance le 26/08/2024	510	0,04
230 Abbott Laboratories, 4,750 %, échéance le 30/11/2036	229	0,02	470 Bank of America Corp, 4,000 %, échéance le 22/01/2025	458	0,04
420 Abbott Laboratories, 4,900 %, échéance le 30/11/2046	413	0,04	130 Bank of America Corp, 4,450 %, échéance le 03/03/2026	126	0,01
140 AbbVie Inc, 3,750 %, échéance le 14/11/2023	138	0,01	830 Bank of America Corp, 3,500 %, échéance le 19/04/2026	791	0,07
2 150 AbbVie Inc, 2,600 %, échéance le 21/11/2024	2 051	0,18	1 510 Bank of America Corp, 1,319 %, échéance le 19/06/2026 *	1 370	0,12
590 AbbVie Inc, 3,800 %, échéance le 15/03/2025	573	0,05	970 Bank of America Corp, 4,250 %, échéance le 22/10/2026	932	0,08
250 AbbVie Inc, 3,600 %, échéance le 14/05/2025	241	0,02	1 600 Bank of America Corp, 4,376 %, échéance le 27/04/2028 *	1 530	0,13
520 AbbVie Inc, 2,950 %, échéance le 21/11/2026	480	0,04	940 Bank of America Corp, 3,593 %, échéance le 21/07/2028 *	867	0,08
4 280 AbbVie Inc, 3,200 %, échéance le 21/11/2029	3 787	0,33	1 770 Bank of America Corp, 3,419 %, échéance le 20/12/2028 *	1 612	0,14
7 AbbVie Inc, 4,750 %, échéance le 15/03/2045	6	—	3 040 Bank of America Corp, 3,970 %, échéance le 05/03/2029 *	2 824	0,25
90 AbbVie Inc, 4,875 %, échéance le 14/11/2048	83	0,01	1 800 Bank of America Corp, 3,974 %, échéance le 07/02/2030 *	1 648	0,14
			1 500 Bank of America Corp, 2,884 %, échéance le 22/10/2030 *	1 269	0,11
			3 090 Bank of America Corp, 2,572 %, échéance le 20/10/2032 *	2 462	0,21
			1 870 Bank of America Corp, 2,972 %, échéance le 04/02/2033 *	1 531	0,13
			560 Bank of America Corp, 4,330 %, échéance le 15/03/2050 *	472	0,04
			2 260 Bank of America Corp, 4,083 %, échéance le 20/03/2051 *	1 818	0,16
			380 Bank of New York Mellon Corp/The, 1,600 %, échéance le 24/04/2025	352	0,03
			30 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, échéance le 01/11/2025	26	—
			435 Becton Dickinson and Co, 3,363 %, échéance le 06/06/2024	424	0,04
			26 Becton Dickinson and Co, 3,734 %, échéance le 15/12/2024	25	—
			487 Becton Dickinson and Co, 4,685 %, échéance le 15/12/2044	433	0,04
			600 Becton Dickinson and Co, 4,669 %, échéance le 06/06/2047	528	0,05
			1 330 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, échéance le 15/01/2049	1 185	0,10
			3 560 Boston Properties LP, 3,400 %, échéance le 21/06/2029	3 060	0,27
			330 BP Capital Markets America Inc, 3,410 %, échéance le 11/02/2026	315	0,03
			1 150 BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, échéance le 04/05/2026	1 087	0,09
			440 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, échéance le 06/04/2030	403	0,04
			900 BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, échéance le 24/02/2050	611	0,05
			43 Brighthouse Financial Inc, 4,700 %, échéance le 22/06/2047	34	—

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
États-Unis — (suite)					
532 Bristol-Myers Squibb Co, 3,200 %, échéance le 15/06/2026	504	0,04	1 456 Citigroup Inc, 8,125 %, échéance le 15/07/2039	1 847	0,16
705 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, arrivant à échéance le 26/07/2029	647	0,06	255 Citigroup Inc, 5,300 %, échéance le 06/05/2044	240	0,02
2 120 Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, échéance le 15/11/2035	1 564	0,14	100 Citigroup Inc, série 0, 8,870 %, perpétuelle *	101	0,01
110 Builders FirstSource Inc, 144A, 4,250 %, échéance le 01/02/2032	92	0,01	390 Citigroup Inc, série P, 5,950 %, perpétuelle *	382	0,03
630 Cameron LNG LLC, 144A, 2,902 %, échéance le 15/07/2031	547	0,05	90 Citigroup Inc, série M, 6,300 %, perpétuelle *	88	0,01
850 Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, échéance le 15/01/2035	709	0,06	720 Coca-Cola Co/The, 3,375 %, échéance le 05/03/2027	688	0,06
30 Carrier Global Corp, 2,700 %, échéance le 15/02/2031	25	–	670 Coca-Cola Co/The, 1,450 %, échéance le 01/06/2027	589	0,05
50 Carrier Global Corp, 3,577 %, échéance le 05/04/2050	36	–	20 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, échéance le 01/06/2040	15	–
70 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, échéance le 15/08/2030	58	0,01	280 Coca-Cola Co/The, 2,600 %, échéance le 01/06/2050	188	0,02
370 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, échéance le 01/02/2032	300	0,03	130 Comcast Corp, 3,950 %, échéance le 15/10/2025	126	0,01
1 870 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, échéance le 01/05/2032	1 482	0,13	640 Comcast Corp, 3,150 %, échéance le 01/03/2026	605	0,05
360 Centene Corp, 4,250 %, échéance le 15/12/2027	333	0,03	280 Comcast Corp, 3,300 %, échéance le 01/04/2027	263	0,02
520 Centene Corp, 4,625 %, échéance le 15/12/2029	476	0,04	2 140 Comcast Corp, 4,150 %, échéance le 15/10/2028	2 047	0,18
290 Centene Corp, 3,375 %, échéance le 15/02/2030	245	0,02	390 Comcast Corp, 3,400 %, échéance le 01/04/2030	352	0,03
50 Centene Corp, 3,000 %, échéance le 15/10/2030	41	–	840 Comcast Corp, 4,250 %, échéance le 15/10/2030	798	0,07
60 Centene Corp, 2,625 %, échéance le 01/08/2031	47	–	60 Comcast Corp, 4,250 %, échéance le 15/01/2033	56	0,01
1 760 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, échéance le 23/07/2025	1 723	0,15	60 Comcast Corp, 5,650 %, échéance le 15/06/2035	62	0,01
1 550 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, échéance le 15/03/2028	1 426	0,12	13 Comcast Corp, 6,500 %, échéance le 15/11/2035	14	–
1 200 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, échéance le 30/03/2029	1 121	0,10	1 540 Comcast Corp, 3,900 %, échéance le 01/03/2038	1 322	0,12
500 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,400 %, échéance le 01/04/2033	428	0,04	400 Comcast Corp, 3,250 %, échéance le 01/11/2039	312	0,03
500 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, échéance le 01/04/2038	419	0,04	300 Comcast Corp, 3,750 %, échéance le 01/04/2040	246	0,02
270 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, échéance le 01/03/2042	174	0,02	80 Comcast Corp, 3,400 %, échéance le 15/07/2046	59	0,01
260 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, échéance le 23/10/2045	236	0,02	120 Comcast Corp, 4,000 %, échéance le 15/08/2047	98	0,01
70 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, échéance le 01/05/2047	56	0,01	224 Comcast Corp, 3,969 %, échéance le 01/11/2047	181	0,02
1 000 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, échéance le 01/04/2048	836	0,07	110 Comcast Corp, 4,000 %, échéance le 01/03/2048	89	0,01
240 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, échéance le 01/07/2049	185	0,02	293 Comcast Corp, 3,999 %, échéance le 01/11/2049	236	0,02
210 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, échéance le 01/03/2050	154	0,01	200 Comcast Corp, 3,450 %, échéance le 01/02/2050	147	0,01
440 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,500 %, échéance le 01/04/2063	342	0,03	400 Comcast Corp, 2,800 %, échéance le 15/01/2051	256	0,02
400 Cheniere Energy Inc, 4,625 %, échéance le 15/10/2028	371	0,03	619 Comcast Corp, 2,887 %, échéance le 01/11/2051	401	0,04
130 Cheniere Energy Partners LP, 4,000 %, échéance le 01/03/2031	112	0,01	66 Comcast Corp, 4,049 %, échéance le 01/11/2052	53	–
690 Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, échéance le 31/01/2032	554	0,05	477 Comcast Corp, 2,937 %, échéance le 01/11/2056	300	0,03
340 Chevron Corp, 2,954 %, échéance le 16/05/2026	320	0,03	100 Comcast Corp, 4,950 %, échéance le 15/10/2058	93	0,01
240 Chevron Corp, 1,995 %, échéance le 11/05/2027	215	0,02	74 Comcast Corp, 2,987 %, échéance le 01/11/2063	45	–
80 Chevron Corp, 3,078 %, échéance le 11/05/2050	58	0,01	20 CommonSpirit Health, 4,350 %, échéance le 01/11/2042	17	–
950 Chevron USA Inc, 3,850 %, échéance le 15/01/2028	914	0,08	300 CommScope Inc, 144A, 6,000 %, échéance le 01/03/2056	289	0,03
140 Chubb INA Holdings Inc, 3,350 %, échéance le 03/05/2026	133	0,01	130 CommScope Inc, 144A, 4,750 %, échéance le 01/09/2029	106	0,01
232 Cigna Group/The, 3,750 %, échéance le 15/07/2023	230	0,02	85 ConocoPhillips Co, 6,950 %, échéance le 15/04/2029	93	0,01
290 Cigna Group/The, 4,125 %, échéance le 15/11/2025	282	0,02	240 Consolidated Edison Co of New York Inc, série 20A, 3,350 %, échéance le 01/04/2030	215	0,02
3 510 Cigna Group/The, 4,375 %, échéance le 15/10/2028	3 372	0,29	190 Consolidated Edison Co of New York Inc, série 20B, 3,950 %, échéance le 01/04/2050	150	0,01
110 Cigna Group/The, 4,900 %, échéance le 15/12/2048	99	0,01	330 Constellation Brands Inc, 3,600 %, échéance le 05/09/2024	323	0,03
90 Cigna Group/The, 3,400 %, échéance le 15/03/2050	63	0,01	640 Constellation Brands Inc, 4,750 %, échéance le 15/11/2024	635	0,06
270 Cintas Corp No 2, 3,700 %, échéance le 01/04/2027	258	0,02	450 Constellation Brands Inc, 4,350 %, échéance le 05/09/2027	435	0,04
300 Cintas Corp No 2, 4,000 %, échéance le 01/05/2032	279	0,02	300 Continental Resources Inc/OK, 4,500 %, échéance le 15/04/2023	300	0,03
250 Citigroup Inc, 3,500 %, échéance le 15/05/2023	249	0,02	130 Continental Resources Inc/OK, 3,800 %, échéance le 01/06/2024	127	0,01
680 Citigroup Inc, 1,678 %, échéance le 15/05/2024 *	674	0,06	290 Continental Resources Inc/OK, 144A, 2,268 %, échéance le 15/11/2026	253	0,02
330 Citigroup Inc, 3,300 %, échéance le 27/04/2025	316	0,03	1 160 Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, échéance le 15/01/2028	1 075	0,09
440 Citigroup Inc, 4,400 %, échéance le 10/06/2025	431	0,04	390 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, échéance le 15/01/2031	369	0,03
220 Citigroup Inc, 5,500 %, échéance le 13/09/2025	221	0,02	100 Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, échéance le 01/06/2044	75	0,01
490 Citigroup Inc, 3,106 %, échéance le 08/04/2026 *	466	0,04	1 020 Costco Wholesale Corp, 1,375 %, échéance le 20/06/2027	892	0,08
110 Citigroup Inc, 4,300 %, échéance le 20/11/2026	106	0,01	340 Costco Wholesale Corp, 1,600 %, échéance le 20/04/2030	278	0,02
2 130 Citigroup Inc, 4,450 %, échéance le 29/09/2027	2 036	0,18	1 790 Coterra Energy Inc, 3,900 %, échéance le 15/05/2027	1 679	0,15
450 Citigroup Inc, 4,658 %, échéance le 24/05/2028 *	435	0,04	560 Coterra Energy Inc, 4,375 %, échéance le 15/03/2029	518	0,05
60 Citigroup Inc, 4,125 %, échéance le 25/07/2028	56	0,01	300 CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, échéance le 01/12/2030	217	0,02
1 360 Citigroup Inc, 3,520 %, échéance le 27/10/2028 *	1 246	0,11	200 CSC Holdings LLC, 144A, 3,375 %, échéance le 15/02/2031	137	0,01
1 750 Citigroup Inc, 4,075 %, échéance le 23/04/2029 *	1 630	0,14	510 CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, échéance le 15/11/2031	363	0,03
2 300 Citigroup Inc, 3,980 %, échéance le 20/03/2030 *	2 099	0,18	130 CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp, 144A, 3,875 %, échéance le 30/06/2028	111	0,01
1 590 Citigroup Inc, 4,412 %, échéance le 31/03/2031 *	1 479	0,13	761 CVS Health Corp, 3,875 %, échéance le 20/07/2025	738	0,06
1 680 Citigroup Inc, 2,520 %, échéance le 03/11/2032 *	1 327	0,12	220 CVS Health Corp, 3,625 %, échéance le 01/04/2027	207	0,02
1 150 Citigroup Inc, 3,785 %, échéance le 17/03/2033 *	1 001	0,09	268 CVS Health Corp, 4,300 %, échéance le 25/03/2028	256	0,02
540 Citigroup Inc, 4,910 %, échéance le 24/05/2033 *	512	0,04	530 CVS Health Corp, 3,750 %, échéance le 01/04/2030	479	0,04
			160 CVS Health Corp, 1,875 %, échéance le 28/02/2031	124	0,01
			410 CVS Health Corp, 2,125 %, échéance le 15/09/2031	322	0,03
			400 CVS Health Corp, 4,780 %, échéance le 25/03/2038	364	0,03
			220 CVS Health Corp, 4,125 %, échéance le 01/04/2040	181	0,02
			440 CVS Health Corp, 5,125 %, échéance le 20/07/2045	398	0,03
			3 800 CVS Health Corp, 5,050 %, échéance le 25/03/2048	3 413	0,30
			70 CVS Health Corp, 4,250 %, échéance le 01/04/2050	56	0,01
			13 CVS Pass-Through Trust, 144A, 5,298 %, échéance le 11/01/2027	12	–
			16 CVS Pass-Through Trust, 6,036 %, échéance le 10/12/2028	16	–
			29 CVS Pass-Through Trust, 6,943 %, échéance le 10/01/2030	30	–
			150 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, échéance le 03/11/2036	153	0,01
			140 Deere & Co, 3,100 %, échéance le 15/04/2030	125	0,01
			740 Deere & Co, 3,750 %, échéance le 15/04/2050	632	0,06
			190 Delta Air Lines Inc, 3,800 %, échéance le 19/04/2023	189	0,02
			410 Delta Air Lines Inc, 2,900 %, échéance le 28/10/2024	390	0,03
			3 130 Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, échéance le 01/05/2025	3 196	0,28
			810 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, échéance le 15/01/2026	834	0,07
			330 Devon Energy Corp, 8,250 %, échéance 01/08/2023	332	0,03
			530 Devon Energy Corp, 5,850 %, échéance 15/12/2025	534	0,05
			260 Devon Energy Corp, 4,500 %, échéance 15/01/2030	242	0,02
			40 Devon Energy Corp, 5,600 %, échéance 15/07/2041	37	–

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
États-Unis — (suite)					
520 Devon Energy Corp, 4,750 %, échéance 15/05/2042	433	0,04	1 390 Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, échéance le 12/02/2026 *	1 262	0,11
1 950 Devon Energy Corp, 5,000 %, échéance 15/06/2045	1 654	0,14	1 970 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, échéance le 16/11/2026	1 851	0,16
50 Diamondback Energy Inc, 3,250 %, échéance le 01/12/2026	46	–	270 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,615 %, échéance le 15/03/2028 *	251	0,02
660 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, échéance le 01/12/2029	583	0,05	4 750 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,814 %, échéance le 23/04/2029 *	4 363	0,38
480 Diamondback Energy Inc, 4,400 %, échéance le 24/03/2051	373	0,03	2 650 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223 %, échéance le 01/05/2029 *	2 483	0,22
450 DISH DBS Corp, 5,875 %, échéance le 15/11/2024	422	0,04	3 730 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,650 %, échéance le 21/10/2032 *	2 976	0,26
410 DISH DBS Corp, 7,750 %, échéance le 01/07/2026	319	0,03	670 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, échéance le 01/02/2041	718	0,06
230 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, échéance le 01/12/2026	193	0,02	160 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,210 %, échéance le 22/04/2042 *	116	0,01
40 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, échéance le 01/12/2028	32	–	380 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,908 %, échéance le 21/07/2042 *	262	0,02
170 DISH DBS Corp, 5,125 %, échéance le 01/06/2029	101	0,01	560 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, échéance le 22/05/2045	520	0,05
130 Duke Energy Carolinas LLC, 5,300 %, échéance le 15/02/2040	127	0,01	540 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750 %, échéance le 21/10/2045	484	0,04
640 Duke Energy Ohio Inc, 3,650 %, échéance le 01/02/2029	592	0,05	580 GSK Consumer Healthcare Capital US LLC, 3,375 %, échéance le 24/03/2027	540	0,05
420 Eaton Corp, 4,150 %, échéance le 02/11/2042	358	0,03	410 GSK Consumer Healthcare Capital US LLC, 3,375 %, échéance le 24/03/2029	365	0,03
36 El Paso Natural Gas Co LLC, 8,375 %, échéance le 15/06/2032	41	–	620 GSK Consumer Healthcare Capital US LLC, 3,625 %, échéance le 24/03/2032	542	0,05
200 Elevance Health Inc, 3,350 %, échéance le 01/12/2024	194	0,02	100 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, échéance le 15/12/2028	86	0,01
730 Elevance Health Inc, 3,650 %, échéance le 01/12/2027	685	0,06	11 Halliburton Co, 3,800 %, échéance le 15/11/2025	11	–
840 Elevance Health Inc, 4,100 %, échéance le 15/05/2032	772	0,07	60 Halliburton Co, 4,850 %, échéance le 15/11/2035	56	0,01
360 Elevance Health Inc, 4,550 %, échéance le 15/05/2052	312	0,03	320 Halliburton Co, 5,000 %, échéance le 15/11/2045	283	0,02
1 080 Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, échéance le 16/10/2028	1 022	0,09	50 Hanesbrands Inc, 144A, 4,625 %, échéance le 15/05/2024	50	–
510 Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, échéance le 31/01/2030	437	0,04	200 Hanesbrands Inc, 144A, 4,875 %, échéance le 15/05/2026	185	0,02
2 150 Enterprise Products Operating LLC, 4,200 %, échéance le 31/01/2050	1 729	0,15	70 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, échéance le 20/01/2026	65	0,01
420 Enterprise Products Operating LLC, 3,700 %, échéance le 31/01/2051	310	0,03	100 HCA Inc, 5,000 %, échéance le 15/04/2024	99	0,01
90 Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, échéance le 31/01/2060	66	0,01	270 HCA Inc, 5,375 %, échéance le 01/02/2025	268	0,02
220 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, échéance le 15/02/2078 *	184	0,02	10 HCA Inc, 5,250 %, échéance le 15/04/2025	10	–
240 EOG Resources Inc, 4,150 %, échéance le 15/01/2026	234	0,02	170 HCA Inc, 5,250 %, échéance le 15/06/2026	167	0,01
190 EOG Resources Inc, 4,375 %, échéance le 15/04/2030	183	0,02	30 HCA Inc, 5,375 %, échéance le 01/09/2026	30	–
690 EOG Resources Inc, 3,900 %, échéance le 01/04/2035	610	0,05	90 HCA Inc, 5,625 %, échéance le 01/09/2028	89	0,01
180 EOG Resources Inc, 4,950 %, échéance le 15/04/2050	173	0,02	660 HCA Inc, 5,875 %, échéance le 01/02/2029	660	0,06
50 EQT Corp, 6,125 %, échéance le 01/02/2025	50	–	1 040 HCA Inc, 3,500 %, échéance le 01/09/2030	895	0,08
20 EQT Corp, 144A, 3,125 %, échéance le 15/05/2026	18	–	400 HCA Inc, 5,500 %, échéance le 15/06/2047	360	0,03
1 450 EQT Corp, 3,900 %, échéance le 01/10/2027	1 327	0,12	180 Hershey Co/The, 0,900 %, échéance le 01/06/2025	164	0,01
200 EQT Corp, 5,000 %, échéance le 15/01/2029	187	0,02	200 Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,750 %, échéance le 01/05/2028	194	0,02
420 EQT Corp, 144A, 3,625 %, échéance le 15/05/2031	353	0,03	380 Home Depot Inc/The, 2,500 %, échéance le 15/04/2027	348	0,03
60 Exxon Mobil Corp, 1,571 %, échéance le 15/04/2023	60	0,01	70 Home Depot Inc/The, 3,900 %, échéance le 06/12/2028	67	0,01
180 Exxon Mobil Corp, 3,043 %, échéance le 01/03/2026	171	0,02	440 Home Depot Inc/The, 2,700 %, échéance le 15/04/2030	381	0,03
650 Exxon Mobil Corp, 3,482 %, échéance le 19/03/2030	603	0,05	490 Home Depot Inc/The, 3,300 %, échéance le 15/04/2040	391	0,03
1 130 Exxon Mobil Corp, 4,114 %, échéance le 01/03/2046	966	0,08	90 Home Depot Inc/The, 3,900 %, échéance le 15/06/2047	75	0,01
80 Exxon Mobil Corp, 4,327 %, échéance le 19/03/2050	71	0,01	1 370 Home Depot Inc/The, 3,350 %, échéance le 15/04/2050	1 018	0,09
270 FirstEnergy Corp, série A, 1,600 %, échéance le 15/01/2026	241	0,02	430 Humana Inc, 3,950 %, échéance le 15/03/2027	411	0,04
3 460 FirstEnergy Corp, série B, 4,150 %, échéance le 15/07/2027	3 231	0,28	1 700 Humana Inc, 3,125 %, échéance le 15/08/2029	1 484	0,13
1 000 FirstEnergy Corp, série C, 5,100 %, échéance le 15/07/2047	893	0,08	190 Humana Inc, 2,150 %, échéance le 03/02/2032	147	0,01
770 Ford Motor Co, 3,250 %, échéance le 12/02/2032	585	0,05	70 Humana Inc, 4,625 %, échéance le 01/12/2042	61	0,01
570 Ford Motor Co, 6,100 %, échéance le 19/08/2032	531	0,05	200 Humana Inc, 4,800 %, échéance le 15/03/2047	18	–
150 Ford Motor Co, 4,750 %, échéance le 15/01/2043	110	0,01	50 ILFC E-Capital Trust II, 144A, 6,538 %, échéance le 21/12/2065 *	36	–
400 Ford Motor Credit Co LLC, 5,125 %, échéance le 16/06/2025	387	0,03	410 Intel Corp, 1,600 %, échéance le 12/08/2028	345	0,03
1 390 Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, échéance le 28/05/2027	1 297	0,11	430 Intel Corp, 5,125 %, échéance le 10/02/2030	425	0,04
600 Ford Motor Credit Co LLC, 4,125 %, échéance le 17/08/2027	535	0,05	130 Intel Corp, 3,734 %, échéance le 08/12/2047	96	0,01
610 Ford Motor Credit Co LLC, 7,350 %, échéance le 04/11/2027	620	0,05	380 Intel Corp, 4,750 %, échéance le 25/03/2050	330	0,03
260 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, échéance le 16/02/2028	217	0,02	200 Intel Corp, 3,050 %, échéance le 12/08/2051	128	0,01
200 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, échéance le 10/02/2029	163	0,01	1 660 Intercontinental Exchange Inc, 4,600 %, échéance le 15/03/2033	1 585	0,14
810 Ford Motor Credit Co LLC, 5,113 %, échéance le 03/05/2029	741	0,06	210 Intercontinental Exchange Inc, 4,950 %, échéance le 15/06/2052	199	0,02
890 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, échéance le 13/11/2030	743	0,06	1 940 International Business Machines Corp, 3,000 %, échéance le 15/05/2024	1 887	0,16
500 Ford Motor Credit Co LLC, 3,625 %, échéance le 17/06/2031	397	0,03	1 040 Johnson & Johnson, 3,625 %, échéance le 03/03/2037	919	0,08
10 Freeport-McMoRan Inc, 3,875 %, échéance le 15/03/2023	10	–	1 420 JPMorgan Chase & Co, 1,514 %, échéance le 01/06/2024 *	1 406	0,12
30 Freeport-McMoRan Inc, 4,550 %, échéance le 14/11/2024	29	–	250 JPMorgan Chase & Co, 3,875 %, échéance le 10/09/2024	244	0,02
260 Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, échéance le 01/08/2030	240	0,02	1 400 JPMorgan Chase & Co, 4,023 %, échéance le 05/12/2024 *	1 382	0,12
240 Freeport-McMoRan Inc, 5,400 %, échéance le 14/11/2034	226	0,02	1 160 JPMorgan Chase & Co, 2,083 %, échéance le 22/04/2026 *	1 078	0,09
1 170 Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, échéance le 15/03/2043	1 058	0,09	1 000 JPMorgan Chase & Co, 3,509 %, échéance le 23/01/2029 *	915	0,08
440 General Motors Co, 6,125 %, échéance le 01/10/2025	445	0,04	770 JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, échéance le 23/07/2029 *	722	0,06
210 General Motors Co, 5,600 %, échéance le 15/10/2032	200	0,02	780 JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, échéance le 05/12/2029 *	739	0,06
50 General Motors Co, 6,600 %, échéance le 01/04/2036	50	–	640 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, échéance le 22/04/2031 *	530	0,05
50 General Motors Co, 5,150 %, échéance le 01/04/2038	43	–	2 050 JPMorgan Chase & Co, 2,545 %, échéance le 08/11/2032 *	1 640	0,14
230 General Motors Co, 6,250 %, échéance le 02/10/2043	217	0,02	1 730 JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, échéance le 01/06/2045	1 593	0,14
330 General Motors Co, 5,950 %, échéance le 01/04/2049	297	0,03	300 JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, échéance le 22/04/2051 *	205	0,02
10 General Motors Financial Co Inc, 4,250 %, échéance le 15/05/2023	10	–	380 Kinder Morgan Energy Partners LP, 3,500 %, échéance le 01/09/2023	377	0,03
50 General Motors Financial Co Inc, 4,350 %, échéance le 17/01/2027	48	–	110 Kinder Morgan Energy Partners LP, 4,250 %, échéance le 01/09/2024	108	0,01
200 Gilead Sciences Inc, 3,500 %, échéance le 01/02/2025	194	0,02	300 Kinder Morgan Inc, 4,300 %, échéance le 01/06/2025	293	0,03
250 Gilead Sciences Inc, 4,750 %, échéance le 01/03/2046	226	0,02			
10 GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,250 %, échéance le 01/06/2025	10	–			
80 GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,375 %, échéance le 15/04/2026	78	0,01			
3 Goldman Sachs Capital II, 5,730 %, perpétuelle *	2	–			
800 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,850 %, échéance le 08/07/2024	783	0,07			
760 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, échéance le 01/04/2025	732	0,06			
720 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250 %, échéance le 21/10/2025	698	0,06			

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
États-Unis — (suite)					
520 Kinder Morgan Inc, 4,300 %, échéance le 01/03/2028	496	0,04	1 160 Oracle Corp, 1,650 %, échéance le 25/03/2026	1 037	0,09
270 Kinder Morgan Inc, 5,300 %, échéance le 01/12/2034	254	0,02	90 Oracle Corp, 2,950 %, échéance le 01/04/2030	77	0,01
580 Kinder Morgan Inc, 5,550 %, échéance le 01/06/2045	525	0,05	430 Oracle Corp, 4,650 %, échéance le 06/05/2030	408	0,04
60 Kinder Morgan Inc, 5,200 %, échéance le 01/03/2048	52	—	1 690 Oracle Corp, 2,875 %, échéance le 25/03/2031	1 402	0,12
30 KKR Group Finance Co II LLC, 144A, 5,500 %, échéance le 01/02/2043	28	—	300 Otis Worldwide Corp, 2,056 %, échéance le 05/04/2025	280	0,02
130 Kraft Heinz Foods Co, 3,000 %, échéance le 01/06/2026	121	0,01	310 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, échéance le 01/08/2027	264	0,02
150 Kraft Heinz Foods Co, 4,250 %, échéance le 01/03/2031	141	0,01	390 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, échéance le 01/02/2031	304	0,03
20 Kraft Heinz Foods Co, 6,750 %, échéance le 15/03/2032	22	—	80 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, échéance le 01/08/2040	54	—
80 Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, échéance le 15/07/2035	77	0,01	190 Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, échéance le 01/08/2050	120	0,01
50 Kraft Heinz Foods Co, 6,875 %, échéance le 26/01/2039	55	—	90 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, échéance le 15/02/2028	82	0,01
10 Kraft Heinz Foods Co, 144A, 7,125 %, échéance le 01/08/2039	11	—	560 PayPal Holdings Inc, 1,650 %, échéance le 01/06/2025	519	0,05
10 Kraft Heinz Foods Co, 4,625 %, échéance le 01/10/2039	9	—	70 PepsiCo Inc, 2,625 %, échéance le 19/03/2027	65	0,01
170 Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, échéance le 04/06/2042	155	0,01	580 PepsiCo Inc, 1,625 %, échéance le 01/05/2030	472	0,04
520 Kraft Heinz Foods Co, 5,200 %, échéance le 15/07/2045	480	0,04	220 PepsiCo Inc, 2,875 %, échéance le 15/10/2049	159	0,01
210 Kraft Heinz Foods Co, 4,375 %, échéance le 01/06/2046	172	0,02	620 Pfizer Inc, 2,625 %, échéance le 01/04/2030	541	0,05
370 Kraft Heinz Foods Co, 4,875 %, échéance le 01/10/2049	327	0,03	580 Pfizer Inc, 1,700 %, échéance le 28/05/2030	475	0,04
300 Kraft Heinz Foods Co, 5,500 %, échéance le 01/06/2050	288	0,03	170 Pioneer Natural Resources Co, 1,125 %, échéance le 15/01/2026	151	0,01
2 770 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, échéance le 08/08/2024	2 667	0,23	270 Pioneer Natural Resources Co, 1,900 %, échéance le 15/08/2030	211	0,02
1 320 Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, échéance le 25/06/2025	1 224	0,11	1 000 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, échéance le 15/01/2031	789	0,07
160 Lehman Brothers Escrow, série DMTN, coupon zéro, t=0	—	—	250 PNC Bank NA, 3,875 %, échéance le 10/04/2025	242	0,02
79 Lehman Swap Receipt, coupon zéro, perpétuelle t=0	—	—	240 Principal Life Global Funding II, 144A, 1,250 %, échéance le 23/06/2025	218	0,02
120 Lennar Corp, 4,500 %, échéance le 30/04/2024	118	0,01	120 Procter & Gamble Co/The, 2,800 %, échéance le 25/03/2027	112	0,01
50 Lennar Corp, 4,750 %, échéance le 30/05/2025	49	—	340 Procter & Gamble Co/The, 3,000 %, échéance le 25/03/2030	309	0,03
460 Lennar Corp, 4,750 %, échéance le 29/11/2027	441	0,04	4 100 Prologis LP, 1,250 %, échéance le 15/10/2030	3 148	0,27
280 Lowe's Cos Inc, 4,500 %, échéance le 15/04/2030	267	0,02	200 Range Resources Corp, 4,875 %, échéance le 15/05/2025	195	0,02
540 Mars Inc, 144A, 3,200 %, échéance le 01/04/2030	487	0,04	370 Republic Services Inc, 2,500 %, échéance le 15/08/2024	355	0,03
110 Mastercard Inc, 3,850 %, échéance le 26/03/2050	93	0,01	140 Salesforce Inc, 3,700 %, échéance le 11/04/2028	133	0,01
100 McDonald's Corp, 1,450 %, échéance le 01/09/2025	91	0,01	80 Santander Holdings USA Inc, 4,500 %, échéance le 17/07/2025	78	0,01
460 McDonald's Corp, 3,700 %, échéance le 30/01/2026	444	0,04	322 Schlumberger Holdings Corp, 3,900 %, échéance le 17/05/2028	303	0,03
510 McDonald's Corp, 3,500 %, échéance le 01/03/2027	482	0,04	430 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, échéance le 01/03/2032	479	0,04
360 McDonald's Corp, 3,500 %, échéance le 01/07/2027	340	0,03	150 Southwestern Electric Power Co, 6,200 %, échéance le 15/03/2040	154	0,01
260 McDonald's Corp, 3,800 %, échéance le 01/04/2028	247	0,02	20 Southwestern Energy Co, 5,375 %, échéance le 01/02/2029	19	—
130 McDonald's Corp, 3,600 %, échéance le 01/07/2030	119	0,01	160 Southwestern Energy Co, 5,375 %, échéance le 15/03/2030	146	0,01
80 McDonald's Corp, 3,625 %, échéance le 01/09/2049	60	0,01	250 Southwestern Energy Co, 4,750 %, échéance le 01/02/2032	215	0,02
720 McDonald's Corp, 4,200 %, échéance le 01/04/2050	599	0,05	552 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, échéance le 20/09/2025	555	0,05
60 MDC Holdings Inc, 6,000 %, échéance le 15/01/2043	51	—	20 Sprint Capital Corp, 6,875 %, échéance le 15/11/2028	21	—
450 Merck & Co Inc, 1,450 %, échéance le 24/06/2030	361	0,03	655 Sprint Capital Corp, 8,750 %, échéance le 15/03/2032	780	0,07
790 Merck & Co Inc, 2,750 %, échéance le 10/12/2051	529	0,05	10 Sprint LLC, 7,875 %, échéance le 15/09/2023	10	—
300 MetLife Inc, 6,400 %, échéance le 15/12/2036	301	0,03	220 Sprint LLC, 7,625 %, échéance le 15/02/2025	226	0,02
590 Micron Technology Inc, 5,875 %, échéance le 09/02/2033	572	0,05	420 Targa Resources Corp, 5,200 %, échéance le 01/07/2027	413	0,04
10 Microsoft Corp, 3,450 %, échéance le 08/08/2036	9	—	240 Targa Resources Corp, 4,200 %, échéance le 01/02/2033	209	0,02
650 Microsoft Corp, 2,525 %, échéance le 01/06/2050	434	0,04	150 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,000 %, échéance le 15/01/2028	143	0,01
10 Microsoft Corp, 2,921 %, échéance le 17/03/2052	7	—	290 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500 %, échéance le 01/03/2030	275	0,02
207 Microsoft Corp, 3,041 %, échéance le 17/03/2062	145	0,01	490 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, échéance le 01/02/2031	446	0,04
657 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, échéance le 20/06/2027	658	0,06	200 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, échéance le 15/01/2032	170	0,01
960 Mondelez International Inc, 1,500 %, échéance le 04/05/2025	885	0,08	16 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, échéance le 16/12/2039	18	—
2 060 Morgan Stanley, série I, 0,864 %, échéance le 21/10/2025 *	1 898	0,17	300 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 4,900 %, échéance le 15/09/2044	277	0,02
5 050 Morgan Stanley, 2,188 %, échéance le 28/04/2026 *	513	0,04	30 Tenet Healthcare Corp, 4,375 %, échéance le 15/01/2030	26	—
1 360 Morgan Stanley, 3,772 %, échéance le 24/01/2029 *	1 256	0,11	160 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, échéance le 01/03/2030	135	0,01
50 Morgan Stanley, 4,431 %, échéance le 23/01/2030 *	47	—	380 Texas Instruments Inc, 1,750 %, échéance le 04/05/2030	311	0,03
960 Morgan Stanley, 2,699 %, échéance le 22/01/2031 *	802	0,07	980 The Vanguard Group Inc, 3,050 %, échéance 22/08/2050 t=0	642	0,06
2 090 Morgan Stanley, 3,622 %, échéance le 01/04/2031 *	1 852	0,16	85 Time Warner Cable LLC, 8,375 %, échéance le 15/07/2033	96	0,01
460 Morgan Stanley, 2,511 %, échéance le 20/10/2032 *	364	0,03	182 Time Warner Cable LLC, 6,550 %, échéance le 01/05/2037	175	0,02
680 Morgan Stanley, 2,484 %, échéance le 16/09/2036 *	508	0,04	420 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, échéance le 01/07/2038	421	0,04
380 MPLX LP, 4,875 %, échéance le 01/12/2024	375	0,03	560 Time Warner Cable LLC, 5,875 %, échéance le 15/11/2040	495	0,04
230 MPLX LP, 4,000 %, échéance le 15/03/2028	215	0,02	50 TJX Cos Inc/The, 2,250 %, échéance le 15/09/2026	46	—
1 290 MPLX LP, 4,800 %, échéance le 15/02/2029	1 240	0,11	2 060 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, échéance le 15/04/2025	1 974	0,17
410 MPLX LP, 4,500 %, échéance le 15/04/2038	350	0,03	160 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, échéance le 15/02/2026	146	0,01
20 MPLX LP, 5,200 %, échéance le 01/03/2047	17	—	120 T-Mobile USA Inc, 3,750 %, échéance le 15/04/2027	113	0,01
960 MPLX LP, 4,700 %, échéance le 15/04/2048	773	0,07	520 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, échéance le 15/02/2029	443	0,04
320 MPLX LP, 5,500 %, échéance le 15/02/2049	288	0,03	2 850 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, échéance le 15/04/2030	2 586	0,23
160 Newell Brands Inc, 4,450 %, échéance le 01/04/2026	151	0,01	450 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, échéance le 15/02/2031	367	0,03
580 NIKE Inc, 2,750 %, échéance le 27/03/2027	538	0,05	380 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, échéance le 15/02/2031	316	0,03
290 NIKE Inc, 3,250 %, échéance le 27/03/2040	233	0,02	270 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, échéance le 15/04/2031	234	0,02
790 NIKE Inc, 3,375 %, échéance le 27/03/2050	616	0,05	70 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, échéance le 15/11/2031	55	—
320 NVIDIA Corp, 2,850 %, échéance le 01/04/2030	282	0,02	1 170 T-Mobile USA Inc, 2,700 %, échéance le 15/03/2035	949	0,08
1 090 NVIDIA Corp, 3,500 %, échéance le 01/04/2040	897	0,08	220 T-Mobile USA Inc, 3,000 %, échéance le 15/02/2041	153	0,01
690 NVIDIA Corp, 3,500 %, échéance le 01/04/2050	536	0,05	10 T-Mobile USA Inc, 3,300 %, échéance le 15/02/2051	7	—
620 NVIDIA Corp, 3,700 %, échéance le 01/04/2060	474	0,04	150 Toll Brothers Finance Corp, 4,375 %, échéance le 15/04/2023	150	0,01
14 Occidental Petroleum Corp, 6,950 %, échéance le 01/07/2024	14	—	1 350 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, échéance le 01/02/2026	1 432	0,12
130 Occidental Petroleum Corp, 5,550 %, échéance le 15/03/2026	129	0,01	340 Union Pacific Corp, 3,750 %, échéance le 15/07/2025	330	0,03
410 Occidental Petroleum Corp, 3,400 %, échéance le 15/04/2026	381	0,03	820 Union Pacific Corp, 2,891 %, échéance le 06/04/2036	647	0,06
610 Occidental Petroleum Corp, 3,200 %, échéance le 15/08/2026	548	0,05	1 260 Union Pacific Corp, 3,839 %, échéance le 20/03/2060	963	0,08
260 Occidental Petroleum Corp, 3,000 %, échéance le 15/02/2027	236	0,02			
600 Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, échéance le 15/08/2029	533	0,05			
260 Occidental Petroleum Corp, 7,875 %, échéance le 15/09/2031	283	0,02			
730 Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, échéance le 15/09/2036	735	0,06			
200 Occidental Petroleum Corp, 6,200 %, échéance le 15/03/2040	195	0,02			
240 Occidental Petroleum Corp, 4,625 %, échéance le 15/06/2045	191	0,02			
520 Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, échéance le 15/03/2046	530	0,05			
100 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, échéance le 15/04/2046	77	0,01			
520 Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, échéance le 15/02/2047	391	0,03			
260 Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, échéance le 15/03/2048	199	0,02			
1 000 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, échéance le 15/08/2049	775	0,07			

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
États-Unis — (suite)					
470 Union Pacific Corp, 3,750 %, échéance le 05/02/2070	343	0,03	1 900 Western Midstream Operating LP, 4,300 %, échéance le 01/02/2030	1 685	0,15
440 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, échéance le 15/04/2026	415	0,04	40 Western Midstream Operating LP, 5,300 %, échéance le 01/03/2048	33	—
690 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, échéance le 15/04/2029	612	0,05	310 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, échéance le 15/08/2048	260	0,02
70 United Rentals North America Inc, 3,875 %, échéance le 15/11/2027	65	0,01	310 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, échéance le 01/02/2050	253	0,02
160 United Rentals North America Inc, 4,875 %, échéance le 15/02/2028	153	0,01	350 Williams Cos Inc/The, série A, 7,500 %, échéance le 15/01/2031	386	0,03
210 United Rentals North America Inc, 5,250 %, échéance le 15/02/2030	198	0,02	760 Williams Cos Inc/The, 7,750 %, échéance le 15/06/2031	835	0,07
1 370 United Rentals North America Inc, 3,875 %, échéance le 15/02/2031	1 174	0,10	1 038 Williams Cos Inc/The, 8,750 %, échéance le 15/03/2032	1 235	0,11
420 United Rentals North America Inc, 3,750 %, échéance le 15/02/2032	353	0,03	250 Workday Inc, 3,500 %, échéance le 01/04/2027	234	0,02
210 UnitedHealth Group Inc, 3,500 %, échéance le 15/06/2023	209	0,02	420 Workday Inc, 3,700 %, échéance le 01/04/2029	384	0,03
410 UnitedHealth Group Inc, 3,750 %, échéance le 15/07/2025	398	0,03	770 Workday Inc, 3,800 %, échéance le 01/04/2032	678	0,06
210 UnitedHealth Group Inc, 1,250 %, échéance le 15/01/2026	190	0,02	110 Wyeth LLC, 5,950 %, échéance le 01/04/2037	118	0,01
660 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, échéance le 15/12/2028	624	0,05	46 XPO Inc, 144A, 6,250 %, échéance le 01/05/2025	46	—
590 UnitedHealth Group Inc, 4,000 %, échéance le 15/05/2029	560	0,05		321 314	27,97
200 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, échéance le 15/05/2030	164	0,01	Zambie — 0,06 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
110 UnitedHealth Group Inc, 2,300 %, échéance le 15/05/2031	91	0,01	680 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, échéance le 15/10/2027	639	0,06
400 UnitedHealth Group Inc, 4,200 %, échéance le 15/05/2032	377	0,03	Total des obligations et bons d'entreprises (coût 474 000\$)		
160 UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, échéance le 15/06/2048	139	0,01		419 663	36,53
130 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, échéance le 15/12/2048	116	0,01	Obligations et bons d'État — 23,40 % (28 février 2022 : 30,21 %)		
1 540 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, échéance le 15/08/2049	1 209	0,11	Argentine — 0,18 % (28 février 2022 : 0,15 %)		
300 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, échéance le 15/08/2059	234	0,02	212 Obligation internationale de l'État argentin, 1,000 %, échéance le 09/07/2029	66	0,01
80 UnitedHealth Group Inc, 3,125 %, échéance le 15/05/2060	54	—	2 566 Obligation internationale de l'État argentin, 0,500 %, échéance le 09/07/2030	837	0,07
1 410 US Bancorp, 1,450 %, échéance le 12/05/2025	1 302	0,11	1 062 Obligation internationale de l'État argentin, 1,500 %, échéance le 09/07/2035	305	0,03
410 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, échéance le 01/11/2033	335	0,03	1 850 Obligation internationale de l'État argentin, 3,500 %, échéance le 09/07/2041	586	0,05
260 Verizon Communications Inc, 2,625 %, échéance le 15/08/2026	239	0,02	757 Obligations du gouvernement Provincia de Buenos Aires, 144A, 5,250 %, échéance le 01/09/2037	290	0,02
190 Verizon Communications Inc, 3,000 %, échéance le 22/03/2027	176	0,02		2 084	0,18
580 Verizon Communications Inc, 2,100 %, échéance le 22/03/2028	501	0,04	Brsil — 1,02 % (28 février 2022 : 0,95 %)		
1 062 Verizon Communications Inc, 4,329 %, échéance le 21/09/2028	1 018	0,09	BRL 20 000 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTNf, 10,000 %, échéance le 01/01/2027	3 498	0,30
190 Verizon Communications Inc, 3,875 %, échéance le 08/02/2029	177	0,02	BRL 17 099 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTNf, 10,000 %, échéance le 01/01/2033	2 688	0,23
500 Verizon Communications Inc, 3,150 %, échéance le 22/03/2030	438	0,04	350 Obligation internationale de l'État brésilien, 4,625 %, échéance le 13/01/2028	334	0,03
630 Verizon Communications Inc, 1,750 %, échéance le 20/01/2031	487	0,04	6 000 Obligation internationale de l'État brésilien, 5,000 %, échéance le 27/01/2045	4 605	0,40
1 110 Verizon Communications Inc, 2,550 %, échéance le 21/03/2031	908	0,08	880 Obligation internationale de l'État brésilien, 4,750 %, échéance le 14/01/2050	633	0,06
2 587 Verizon Communications Inc, 2,355 %, échéance le 15/03/2032	2 035	0,18		11 758	1,02
1 570 Verizon Communications Inc, 4,500 %, échéance le 10/08/2033	1 461	0,13	Colombie — 0,17 % (28 février 2022 : 0,16 %)		
580 Verizon Communications Inc, 5,250 %, échéance le 16/03/2037	567	0,05	890 Obligation internationale de l'État colombien, 3,250 %, échéance le 22/04/2032	633	0,06
1 480 Verizon Communications Inc, 2,650 %, échéance le 20/11/2040	1 004	0,09	900 Obligation internationale de l'État colombien, 4,125 %, échéance le 22/02/2042	554	0,05
180 Verizon Communications Inc, 3,400 %, échéance le 22/03/2041	136	0,01	990 Obligation internationale de l'État colombien, 5,625 %, échéance le 26/02/2044	718	0,06
510 Verizon Communications Inc, 3,850 %, échéance le 01/11/2042	403	0,04		1 905	0,17
430 Verizon Communications Inc, 4,125 %, échéance le 15/08/2046	350	0,03	Indonésie — 0,93 % (28 février 2022 : 1,44 %)		
550 Verizon Communications Inc, 4,862 %, échéance le 21/08/2046	497	0,04	610 Obligation internationale de l'État indonésien, 3,700 %, échéance le 30/10/2049	482	0,04
50 Verizon Communications Inc, 5,500 %, échéance le 16/03/2047	49	—	IDR 159 624 000 Bon du Trésor indonésien, série FR91, 6,375 %, échéance le 15/04/2039	10 217	0,89
320 Verizon Communications Inc, 4,000 %, échéance le 22/03/2050	253	0,02		10 699	0,93
1 320 Verizon Communications Inc, 2,875 %, échéance le 20/11/2050	832	0,07	Israël — 0,08 % (28 février 2022 : 0,07 %)		
690 Verizon Communications Inc, 3,550 %, échéance le 22/03/2051	499	0,04	650 Obligation internationale de l'État israélien, 2,750 %, échéance le 03/07/2030	575	0,05
200 Vertiv Group Corp, 144A, 4,125 %, échéance le 15/11/2028	174	0,02	390 État d'Israël, 3,375 %, échéance le 15/01/2050	289	0,03
830 Visa Inc, 3,150 %, échéance le 14/12/2025	793	0,07		864	0,08
890 Visa Inc, 4,300 %, échéance le 14/12/2045	805	0,07	Kenya — 0,15 % (28 février 2022 : 0,12 %)		
300 Walmart Inc, 1,500 %, échéance le 22/09/2028	255	0,02	2 270 Obligation internationale de l'État kényan, 144A, 6,300 %, échéance le 23/01/2034	1 727	0,15
150 Walmart Inc, 1,800 %, échéance le 22/09/2031	121	0,01	Mexique — 3,56 % (28 février 2022 : 2,02 %)		
170 Walt Disney Co/The, 6,650 %, échéance le 15/11/2037	193	0,02	MXN 6 990 Mexican Bonos, série M 20, 10,000 %, échéance le 05/12/2024	375	0,03
300 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 3,755 %, échéance le 15/03/2027	275	0,02	MXN 97 380 Mexican Bonos, série M 20, 8,500 %, échéance le 31/05/2029	5 092	0,44
370 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 4,054 %, échéance le 15/03/2029	331	0,03	MXN 194 400 Mexican Bonos, série M, 7,750 %, échéance le 23/11/2034	9 487	0,83
1 780 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 4,279 %, échéance le 15/03/2032	1 538	0,13	MXN 232 457 Mexican Bonos, série M, 7,750 %, échéance le 13/11/2042	10 900	0,95
130 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,050 %, échéance le 15/03/2042	105	0,01	MXN 256 970 Mexican Bonos, série M, 8,000 %, échéance le 07/11/2047	12 319	1,07
1 580 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,141 %, échéance le 15/03/2052	1 240	0,11	3 210 Obligation internationale de l'État mexicain, 4,600 %, échéance le 10/02/2048	2 573	0,22
240 Wells Fargo & Co, 3,750 %, échéance le 24/01/2024	236	0,02	190 Obligation internationale de l'État mexicain, 5,750 %, échéance le 12/10/2110	168	0,02
1 500 Wells Fargo & Co, 1,654 %, échéance le 02/06/2024 *	1 485	0,13		40 914	3,56
1 150 Wells Fargo & Co, 2,188 %, échéance le 30/04/2026 *	1 070	0,09			
870 Wells Fargo & Co, 3,000 %, échéance le 23/10/2026	804	0,07			
3 940 Wells Fargo & Co, 4,300 %, échéance le 22/07/2027	3 815	0,33			
560 Wells Fargo & Co, 3,584 %, échéance le 22/05/2028 *	519	0,05			
750 Wells Fargo & Co, 2,393 %, échéance le 02/06/2028 *	664	0,06			
370 Wells Fargo & Co, 4,150 %, échéance le 24/01/2029	347	0,03			
1 330 Wells Fargo & Co, 2,879 %, échéance le 30/10/2030 *	1 134	0,10			
620 Wells Fargo & Co, 4,478 %, échéance le 04/04/2031 *	584	0,05			
330 Wells Fargo & Co, 3,350 %, échéance le 03/02/2033 *	279	0,02			
580 Wells Fargo & Co, 4,900 %, échéance le 17/11/2045	514	0,04			
720 Wells Fargo & Co, 4,400 %, échéance le 14/06/2046	591	0,05			
1 890 Wells Fargo & Co, 4,750 %, échéance le 07/12/2046	1 624	0,14			
6 180 Wells Fargo & Co, 5,013 %, échéance le 04/04/2051 *	5 699	0,50			
130 Wells Fargo & Co, série U, 5,875 %, perpétuelle *	129	0,01			
460 Western Midstream Operating LP, 3,350 %, échéance le 01/02/2025	436	0,04			
110 Western Midstream Operating LP, 4,500 %, échéance le 01/03/2028	102	0,01			

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'État — (suite)				7 250	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,375 %, échéance le 15/05/2051	5 325	0,46
Nigeria — 0,02 % (28 février 2022 : 0,02 %)				7 650	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,000 %, échéance le 15/08/2051	5 145	0,45
300	Obligation internationale de l'État nigérian, 144A, 6,500 %, échéance le 28/11/2027	249	0,02	4 679		3 044	0,27
Panama — 0,10 % (28 février 2022 : 0,10 %)				477		340	0,03
670	Obligation internationale de l'État panaméen, 2,252 %, échéance le 29/09/2032	500	0,04	6 560		5 373	0,47
950	Obligation internationale de l'État panaméen, 4,500 %, échéance le 01/04/2056	698	0,06	2 300		1 934	0,17
		1 198	0,10	2 640		2 688	0,24
Paraguay — 0,04 % (28 février 2022 : 0,03 %)						194 897	16,97
470	Obligation internationale de l'État paraguayen, 144A, 3,849 %, échéance le 28/06/2033	399	0,04	Total des obligations et bons d'État (Coût 341 668\$)			
Pérou — 0,10 % (28 février 2022 : 0,19 %)				464 1011778 BC ULC, 6,320 %, échéance le 14/11/2026 *			
730	Obligation internationale de l'État péruvien, 2,783 %, échéance le 23/01/2031	603	0,05	557	Air Canada, 8,369 %, échéance le 27/07/2028 *	557	0,05
580	Obligation internationale de l'État péruvien, 5,625 %, échéance le 13/11/2050	570	0,05	1 059	Ali Group SRL, 6,676 %, échéance le 13/10/2028 *	1 056	0,09
		1 173	0,10	549	Alterra Mountain Co, 8,070 %, échéance le 30/07/2028 *	548	0,05
Russie — 0,08 % (28 février 2022 : 0,66 %)				447	AmWINS Group, Inc., 6,820 %, échéance le 17/02/2028 *	440	0,10
RUB 16 270	Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 16/09/2026 ty	11	–	1 094	API Group Inc, 7,070 %, échéance le 01/10/2026 *	1 094	0,04
RUB 89 250	Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 10/04/2030 ty	59	0,01	1 627	Asplundh Tree Expert LLC, 6,320 %, échéance le 09/04/2027 *	1 624	0,14
RUB 203 271	Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 19/01/2028 ty	135	0,01	1 077	Asurion, LLC, 8,978 %, échéance le 19/08/2028 *	1 017	0,09
RUB 436 124	Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 23/05/2029 ty	291	0,03	992	Asurion LLC, 7,820 %, échéance le 18/12/2026 *	946	0,08
RUB 232 730	Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 10/04/2030 ty	155	0,01	127	Asurion, LLC, 8,680 %, échéance le 17/08/2028 *	119	0,01
RUB 22 030	Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 10/04/2030 ty	15	–	750	Brown Group Holding LLC, 7,047 %, échéance le 07/06/2028 *	745	0,06
RUB 382 680	Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 16/03/2039 ty	255	0,02	220	Citigroup Inc, 7,817 %, échéance le 25/01/2030*	220	0,02
		921	0,08	156	Castlelake Aviation Ltd, 7,519 %, échéance le 22/10/2026 *	155	0,01
États-Unis — 16,97 % (28 février 2022 : 23,47 %)				1 496	Charter Communications Operating LLC, 6,320 %, échéance le 30/04/2025 *	1 496	0,13
11 450	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, échéance le 03/08/2023	11 440	1,00	427	Charter Communications Operating LLC, 6,320 %, échéance le 01/02/2027 *	424	0,04
1 160	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, échéance le 26/05/2023	1 147	0,10	1 101	Citadel Securities, 7,176 %, échéance le 27/02/2028 *	1 093	0,10
1 440	Federal National Mortgage Association, 6,625 %, échéance le 15/11/2030	1 670	0,15	676	Clarios Global LP, 7,820 %, échéance le 30/04/2026 *	675	0,06
3 600	Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 03/02/2023	3 600	0,31	1 830	DCert Buyer, Inc., 8,696 %, échéance le 16/10/2026 *	1 806	0,16
370	Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 28/03/2023	369	0,03	1 316	Deerfield Dakota Holding LLC, 8,311 %, échéance le 05/03/2027 *	1 266	0,11
11 650	Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 28/03/2023	11 611	1,01	622	Edelman Financial Center LLC/The, 8,070 %, échéance le 05/04/2028 *	607	0,05
6 300	Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 18/05/2023	6 236	0,54	282	Energizer Holdings, Inc., 6,928 %, échéance le 16/12/2027 *	281	0,02
7 540	United States Treasury Bill, zero coupon, échéance le 25/05/2023	7 458	0,65	380	Eycare Partners LLC, 8,480 %, échéance le 20/02/2027 *	320	0,03
3 650	Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 06/01/2023	3 606	0,31	134	FinCo I LLC, 7,070 %, échéance le 27/06/2025 *	134	0,01
6 810	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125 %, arrivant à échéance le 15/01/2033 β	6 549	0,57	233	First Eagle Holdings Inc, 7,230 %, échéance le 17/02/2027 *	229	0,02
12 300	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,500 %, échéance le 30/11/2024	12 212	1,06	1 312	Focus Financial Partners LLC, 7,811 %, échéance le 30/06/2028 *	1 306	0,11
6 310	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,250 %, échéance le 31/12/2024	6 240	0,54	1 845	Gainwell Acquisition Corp, 8,730 %, échéance le 01/10/2027 *	1 782	0,16
15 350	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, arrivant à échéance le 31/01/2025	15 152	1,32	350	Garda World Security Corp, 8,850 %, échéance le 30/10/2026 *	351	0,03
8 420	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, arrivant à échéance le 31/01/2028	8 165	0,71	1 906	Genesee & Wyoming Inc, 6,730 %, échéance le 30/12/2026 *	1 904	0,17
4 108	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,125 %, échéance le 15/11/2032	4 174	0,36	104	GFL Environmental Inc., 7,661 %, échéance le 31/05/2027 *	105	0,01
3 460	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/05/2041	2 630	0,23	1 768	Grifols Worldwide Operations USA Inc, 6,570 %, échéance le 15/11/2027 *	1 724	0,15
3 000	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,750 %, échéance le 15/08/2041	2 080	0,18	345	GVC Holdings Gibraltar Ltd, 7,230 %, échéance le 16/03/2027 *	345	0,03
3 750	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,250 %, échéance le 15/05/2042	3 316	0,29	1 105	Harbour Freight Tools USA Inc, 7,320 %, échéance le 19/10/2027 *	1 073	0,09
2 570	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,000 %, échéance le 15/11/2042	2 534	0,22	872	ICON Luxembourg Sarl, 7,000 %, échéance le 01/07/2028 *	872	0,08
2 870	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,875 %, échéance le 15/02/2043	2 785	0,24	567	iHeartCommunications Inc, 7,570 %, échéance le 01/05/2026 *	550	0,05
1 630	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/02/2048	1 360	0,12	217	Indigo Merger Sub, Inc., 7,000 %, échéance le 01/07/2028 *	217	0,02
1 510	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,375 %, échéance le 15/11/2048	1 352	0,12	847	Jane Street Group, LLC, 7,320 %, échéance le 21/01/2027 *	844	0,07
10 900	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,000 %, échéance le 15/02/2050	7 379	0,64	1 280	Mozart Borrower LP, 7,820 %, échéance le 30/09/2028 *	1 236	0,11
18 780	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,250 %, échéance le 15/05/2050	10 424	0,91	753	Nexstar Broadcasting Inc, 7,070 %, échéance le 19/09/2026 *	752	0,07
32 650	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,375 %, échéance le 15/08/2050	18 728	1,63	264	PCI Gaming Authority, 7,070 %, échéance le 31/05/2026 *	264	0,02
9 000	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,625 %, échéance le 15/11/2050	5 517	0,48	622	Phoenix Guarantor Inc, 7,820 %, échéance le 05/03/2026 *	612	0,05
20 380	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 15/02/2051	13 314	1,16	1 318	Prime Security Installations Ltd, 7,517 %, échéance le 23/09/2026 *	1 317	0,11
				465	Project Sky Merger Sub, Inc., 8,320 %, échéance le 10/08/2028 *	446	0,04
				615	Quikrete Holdings, Inc., 7,570 %, échéance le 11/06/2028 *	614	0,05
				933	Rackspace Technology Global, Inc, 7,595 %, échéance le 09/02/2028 *	591	0,05
				385	RegionalCare Hospital Partners Holding, 8,575 %, échéance le 16/11/2025 *	369	0,03
				1 420	Setanta Aircraft Leasing DAC, 6,730 %, échéance le 05/11/2028 *	1 411	0,12
				1 406	SkyMiles IP Ltd, 8,558 %, échéance le 16/09/2027 *	1 458	0,13
				1 860	Sotera Health, 7,575 %, échéance le 13/12/2026 *	1 793	0,16
				1 284	Station Casinos LLC, 6,820 %, échéance le 08/02/2027 *	1 279	0,11
				683	Terrier Media Buyer, Inc., 8,230 %, échéance le 17/12/2026 *	644	0,06
				59	TransDigm Inc, 0,000 %, échéance le 13/08/2028*	59	0,01
				49	Triton Water Holdings, Inc, 8,230 %, échéance le 16/03/2028 *	46	–
				1 319	UFC Holding LLC, 7,570 %, échéance le 29/04/2026 *	1 316	0,11
				1 091	United Airlines Inc, 8,568 %, échéance le 14/04/2028 *	1 092	0,09
				1 110	Verscend Holding Corp., 8,570 %, échéance le 27/08/2025 *	1 111	0,10
				2 102	Virgin Media Bristol LLC, 7,088 %, échéance le 04/01/2028 *	2 066	0,18
				Total des billets d'emprunt (coût 47 816\$)			
				Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat (Coût 1 352 815\$)			
						1 183 129	103,00

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Contrats (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Contrats (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Options achetées — 0,05 % (28 février 2022 : 0,03 %)					
– Futures SOFR 3 mois à 1 an Mid-Curve décembre 2023 Put 96,00, échéance le 15/12/2023 - Morgan Stanley	484	0,04	Contrats à terme standardisés — (0,32 %) (28 février 2022 : (0,60 %))		
– U.S. 5 Year April 2023 Call 107.25, échéance le 24/03/2023 - Morgan Stanley	72	0,01	Moins-valeur latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
Total des options achetées (coût 520\$)	556	0,05	Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
Swaps sur risque de crédit — 0,19 % (28 février 2022 : 0,33 %)			Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
Plus-valeur latente sur les contrats (voir ci-dessous)	2 240	0,19	Excédent du passif par rapport aux autres éléments de l'actif		
Swaps d'indices — 0,53 % (28 février 2022 : 0,37 %)			Total des actifs nets		
Plus-valeur latente sur les contrats (voir ci-dessous)	6 036	0,53	1 186 290 103,27		
Contrats de change à terme — 0,05 % (28 février 2022 : 0,23 %)			– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.		
Plus-valeur latente sur les contrats (voir ci-dessous)	540	0,05	144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 140 494 000\$, soit 12,27 % de l'actif net.		
Contrats à terme standardisés — 0,22 % (28 février 2022 : 0,40 %)			* Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.		
Plus-valeur latente sur les contrats (voir ci-dessous)	2 474	0,22	† Illiquide à compter de l'exercice clos le 28 février 2023.		
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat			∞ Le titre est évalué de bonne foi à sa juste valeur par et à la seule discrétion de la société de gestion ou du gestionnaire concerné du compartiment.		
1 194 975 104,04			ε Le titre est en défaut à la date de clôture ou depuis la clôture de l'exercice le 28 février 2023 (capital et/ou intérêts).		
			± Titres achetés sur la base d'une détermination future.		
			β Le taux d'intérêt de ce type de titre est lié à l'indice des prix à la consommation (IPC)/Indice des prix de détail (Retail Price Index - RPI). Le taux du coupon est celui au 28 février 2023.		
			γ Le titre ne génère plus de revenus pendant et/ou après l'exercice clos le 28 février 2023 en raison de l'incertitude des paiements d'intérêts.		
			ABRÉVIATIONS :		
			Perpétuelle – Obligation sans date d'échéance. Les obligations perpétuelles ne sont pas rachetables, mais paient des intérêts réguliers.		
			REMIC – Société relais de placements immobiliers hypothécaires (Real Estate Mortgage Investment Conduit).		
			TBA – À communiquer.		
			BRL – Réal brésilien		
			IDR – Rupiah indonésienne		
			MXN – Peso mexicain		
			RUB – Rouble russe		
			Analyse de l'actif total		
			Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé		
			Autres valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé		
			Instruments financiers dérivés		
			Autres actifs		
			Actif total		
			89,97 3,71 0,94 5,38 100,00		

Tableau des swaps sur risque de crédit

Contrepartie	Entité de référence – protection achat/vente	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 5,000 % - achat	20 déc 2027	7 385	\$ (116)
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % - vente	20 déc 2027	215 163	2 240
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % - vente	20 déc.2032	3 640	(42)
Plus-valeur latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : 4 882\$)				\$ 2 240
Moins-valeur latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				(158)
Plus-valeur nette des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : 4 882\$)				\$ 2 082

Tableau des swaps sur taux d'intérêt

Contrepartie	Taux	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Morgan Stanley	Paie flottant MXN TIIE Banxico, reçoit fixe 7,450 %	18 juil. 2029	142 060	\$ (628)
Morgan Stanley	Paie flottant MXN TIIE Banxico, reçoit fixe 7,440 %	20 juil. 2029	147 960	(659)
Plus-valeur latente des swaps de taux d'intérêt (28 février 2022 (en milliers) : 647\$)				\$ –
Moins-valeur latente des swaps de taux d'intérêt (28 février 2022 (en milliers) : (2 957 \$))				(1 287)
Moins-valeur nette des swaps de taux d'intérêt (28 février 2022 (en milliers) : (2 310 \$))				\$ (1 287)

Tableau des swaps d'indices

Contrepartie	Entité de référence	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Morgan Stanley	Paie fixe 1,650 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15 août 2047	834	\$ 236
Morgan Stanley	Paie fixe 2,000 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	18 mars 2032	8 200	1 041
Morgan Stanley	Paie fixe 2,500 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	21 avril 2052	86	12
Morgan Stanley	Paie fixe 2,600 %, reçoit flottant USD SOFR OIS Compound	15 fév 2048	6 547	838

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des swaps d'indices – (suite)

Contrepartie	Entité de référence – protection achat/vente	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Morgan Stanley	Paie fixe 2,850 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15 fév 2029	13 519	719
Morgan Stanley	Paie fixe 3,050 %, reçoit flottant USD SOFR OIS Compound	15 fév 2048	44 069	2 363
Morgan Stanley	Paie fixe 3,270 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	30 avril 2029	26 701	827
Morgan Stanley	Paie fixe 3,850 %, reçoit flottant USD SOFR OIS Compound	30 juin 2029	66 567	(92)
Morgan Stanley	Paie flottant USD SOFR OIS Compound, reçoit fixe 3,500 %	30 sep 2024	13 390	(330)
Plus-value latente des swaps d'indices (28 février 2022 (en milliers) : 5 476\$)				\$ 6 036
Moins-value latente des swaps d'indices (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				(422)
Moins-value nette des swaps d'indices (28 février 2022 (en milliers) : 5 476\$)				\$ 5 614

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)		
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	173	Vente	AUD	252	\$ 4
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	1 017	Vente	EUR	949	10
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	20	Vente	EUR	19	—
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	1	Vente	GBP	1	—
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD	8 827	Vente	USD	6 139	(195)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	31 766	Vente	USD	34 145	(514)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	29	Vente	USD	35	—
18 avril 2023	BNP Paribas	Achat	USD	3 200	Vente	EUR	2 959	61
18 avril 2023	BNP Paribas	Achat	EUR	5 993	Vente	USD	6 428	(70)
18 avril 2023	Citi	Achat	USD	757	Vente	MXN	14 000	(1)
18 avril 2023	Goldman Sachs	Achat	ZAR	29 450	Vente	USD	1 719	(123)
18 avril 2023	Goldman Sachs	Achat	JPY	756 179	Vente	USD	5 782	(189)
18 avril 2023	JP Morgan	Achat	USD	8 486	Vente	CAD	11 405	123
18 avril 2023	JP Morgan	Achat	USD	22 716	Vente	CNH	155 638	247
18 avril 2023	JP Morgan	Achat	USD	2 514	Vente	IDR	39 288 122	(59)
18 avril 2023	JP Morgan	Achat	INR	156 175	Vente	USD	1 875	8
18 avril 2023	JP Morgan	Achat	CAD	42 000	Vente	USD	31 448	(652)
18 avril 2023	JP Morgan	Achat	CNH	32 803	Vente	USD	4 881	(145)
18 avril 2023	Morgan Stanley	Achat	USD	2 929	Vente	AUD	4 256	60
18 avril 2023	Morgan Stanley	Achat	NOK	66 018	Vente	EUR	6 215	(220)
18 avril 2023	Morgan Stanley	Achat	USD	1 899	Vente	GBP	1 555	27
18 avril 2023	Morgan Stanley	Achat	USD	199	Vente	MXN	3 855	(10)
18 avril 2023	Morgan Stanley	Achat	AUD	17 287	Vente	USD	12 053	(400)
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 3 409\$)							\$	540
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (7 304) \$)								(2 578)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (3 895) \$)							\$	(2 038)

Tableau des contrats à terme standardisés

	Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
Indice SOFR 3 mois décembre 2023	Morgan Stanley	(549)	\$ (130 044)	\$ 1 089
Indice SOFR 3 mois décembre 2024	Morgan Stanley	(566)	(136 095)	387
Indice SOFR 3 mois décembre 2025	Morgan Stanley	120	28 980	64
Indice SOFR 3 mois juin 2023	Morgan Stanley	5	1 183	(24)
Indice SOFR 3 mois septembre 2023	Morgan Stanley	73	17 263	(121)
90 Day Euro\$, mars 2023	Morgan Stanley	129	30 614	(46)
Australia 10 Year Bond, mars 2023	Morgan Stanley	148	11 718	(473)
Devise euro, mars 2023	Morgan Stanley	3	397	(5)
Euro-Bobl, mars 2023	Morgan Stanley	50	6 091	(228)
Euro-Bund mars 2023	Morgan Stanley	48	6 748	(216)
Obligation Euro-Buxl 30 ans, mars 2023	Morgan Stanley	(25)	(3 551)	748
Euro- OAT mars 2023	Morgan Stanley	91	12 291	(825)
Obligation japonaise 10 ans (OSE), mars 2023	Morgan Stanley	(17)	(18 310)	186
Long Gilt juin 2023	Morgan Stanley	60	7 214	(96)
U.S. 10 Year Note (CBT), juin 2023	Morgan Stanley	346	38 633	(23)
U.S. 10 Year Ultra Note, juin 2023	Morgan Stanley	(572)	(67 031)	(84)
U.S. 2 Year Note (CBT), juin 2023	Morgan Stanley	18	3 667	(8)
U.S. 5 Year Note (CBT), juin 2023	Morgan Stanley	1 858	198 908	(454)
U.S. Long Bond (CBT), juin 2023	Morgan Stanley	507	63 486	(235)
U.S. Ultra Bond (CBT) juin 2023	Morgan Stanley	575	77 661	(787)
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 5 952\$)				\$ 2 474
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (8 964) \$)				(3 625)
Moins-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (3 012) \$)				\$ (1 151)

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) €	% de la valeur liquidative		Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) €	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — 43,18 % (28 février 2022 : 38,96 %)								
Australie — 0,70 % (28 février 2022 : 0,67 %)								
	970	Glencore Finance Europe Ltd, 1,750 %, échéance le 17/03/2025	923	0,70				
Belgique — 0,16 % (28 février 2022 : 1,32 %)								
	140	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2,125 %, échéance le 02/12/2027	130	0,10				
USD	90	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, échéance le 01/06/2040	75	0,06				
USD	8	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, échéance le 15/04/2048	7	—				
			212	0,16				
Brésil — 0,52 % (28 février 2022 : 0,00 %)								
USD	930	Suzano Austria GmbH, série DM3N, 3,125 %, échéance le 15/01/2032	694	0,52				
Canada — 1,89 % (28 février 2022 : 0,04 %)								
USD	60	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500 %, échéance le 15/02/2029	48	0,03				
	1 240	Banque de Montréal, 2,750 %, échéance le 15/06/2027	1 176	0,89				
USD	10	MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, échéance le 01/02/2029	9	0,01				
GBP	540	Banque Royale du Canada, 3,625 %, échéance le 14/06/2027	580	0,44				
GBP	610	Royal Bank of Canada, 5,000 %, échéance le 24/01/2028	688	0,52				
			2 501	1,89				
Chine — 0,01 % (28 février 2022 : 0,01 %)								
USD	10	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2,700 %, échéance le 01/05/2025	9	0,01				
Danemark — 0,29 % (28 février 2022 : 0,26 %)								
	390	Danske Bank A/S, 0,750 %, échéance le 02/06/2023	388	0,29				
France — 3,70 % (28 février 2022 : 1,82 %)								
	310	Altice France SA/France, 3,375 %, échéance le 15/01/2028	240	0,18				
	1 400	BNP Paribas SA, 0,500 %, échéance le 30/05/2028 *	1 191	0,90				
	700	Credit Agricole SA, 1,875 %, échéance le 22/04/2027 *	647	0,49				
GBP	200	Credit Agricole SA, 4,875 %, arrivant à échéance le 23/10/2029	223	0,17				
	400	Credit Agricole SA, 4,000 %, arrivant à échéance le 18/01/2033	394	0,30				
	600	Dassault Systèmes SE, 0,125 %, échéance le 16/09/2026	532	0,40				
	200	IPD 3 BV, 5,500 %, échéance le 01/12/2025	196	0,14				
	660	Orange SA, 5,000 %, perpétuelle *	661	0,50				
	200	RTE Réseau de Transport d'Electricité SADIR, 2,125 %, échéance le 27/09/2038	158	0,12				
	700	Thales SA, 0,750 %, échéance le 23/01/2025	660	0,50				
			4 902	3,70				
Allemagne : 2,06 % (28 février 2022 : 3,55 %)								
	800	Allianz SE, 2,625 %, perpétuelle *	569	0,43				
	100	Allianz SE, 4,750 %, perpétuelle *	99	0,08				
	200	Bayer AG, 2,375 %, échéance le 12/11/2079 *	185	0,14				
	400	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG à Muenchen, 3,250 %, échéance le 26/05/2049 *	362	0,27				
	1 020	NRW Bank, 0,375 %, échéance le 16/05/2029	856	0,65				
	690	Volkswagen Financial Services AG, 0,875 %, échéance le 31/01/2028	582	0,44				
	100	Vonovia SE, 1,000 %, échéance le 16/06/2023	69	0,05				
			2 722	2,06				
Israël — 0,28 % (28 février 2022 : 0,23 %)								
USD	10	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, échéance le 21/07/2023	9	0,01				
USD	440	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, échéance le 01/10/2026	364	0,27				
			373	0,28				
Italie — 1,91 % (28 février 2022 : 1,78 %)								
	1 100	FCA Bank SpA/Irlande, 0,500 %, échéance le 13/09/2024	1 038	0,78				
	950	Intesa Sanpaolo SpA, 1,000 %, échéance le 04/07/2024	914	0,69				
	620	UniCredit SpA, 2,000 %, échéance le 23/09/2029 *	578	0,44				
			2 530	1,91				
Japon — 0,21 % (28 février 2022 : 0,43 %)								
	300	Asahi Group Holdings Ltd, 1,151 %, échéance le 19/09/2025	280	0,21				
Luxembourg — 1,71 % (28 février 2022 : 1,49 %)								
	555	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,750 %, échéance le 12/03/2029	413	0,31				
	1 400	Logicor Financing Sarl, 1,625 %, échéance le 15/07/2027	1 172	0,88				
	260	Prologis International Funding II SA, 2,375 %, échéance le 14/11/2030	220	0,17				
	500	SELP Finance Sarl, 1,500 %, échéance le 20/11/2025	457	0,35				
			2 262	1,71				
Macao — 0,23 % (28 février 2022 : 0,20 %)								
USD	400	Sands China Ltd, 3,350 %, échéance le 08/03/2029	309	0,23				
Pays-Bas — 1,45 % (28 février 2022 : 1,92 %)								
	100	ABN AMRO Bank NV, 4,500 %, échéance le 24/11/2034	99	0,07				
	250	CTP NV, 0,625 %, échéance le 27/11/2023	244	0,18				
	320	Enxsis Holding NV, 0,750 %, échéance le 02/07/2031	253	0,19				
	940	Euronext NV, 1,000 %, échéance le 18/04/2025	878	0,66				
	300	ING Groep NV, 3,000 %, échéance le 11/04/2028 *	300	0,23				
USD	40	Shell International Finance BV, 2,750 %, échéance le 06/04/2030	33	0,03				
USD	170	Shell International Finance BV, 3,250 %, échéance le 06/04/2050	118	0,09				
			1 925	1,45				
Norvège — 0,76 % (28 février 2022 : 0,92 %)								
	1 030	DNB Bank ASA, 0,050 %, échéance le 14/11/2023	1 006	0,76				
Singapour — 0,24 % (28 février 2022 : 0,33 %)								
	500	Temasek Financial I Ltd, 1,250 %, échéance le 20/11/2049	312	0,24				
Afrique du Sud — 0,22 % (28 février 2022 : 0,21 %)								
	310	Anglo American Capital Plc, 1,625 %, échéance le 18/09/2025	294	0,22				
Espagne — 1,43 % (28 février 2022 : 0,50 %)								
	1 400	Banco Santander SA, 2,500 %, échéance le 18/03/2025	1 353	1,02				
	600	Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, échéance le 18/09/2027	542	0,41				
			1 895	1,43				
Supranational — 3,10 % (28 février 2022 : 2,89 %)								
	1 240	African Development Bank, 0,500 %, échéance le 21/03/2029	1 052	0,80				
	3 480	Mécanisme européen de stabilité, série EUR, 0,750 %, échéance le 05/09/2028	3 049	2,30				
			4 101	3,10				
Suède — 0,84 % (28 février 2022 : 0,62 %)								
USD	200	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 6,875 %, perpétuelle *	185	0,14				
	760	Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, échéance le 02/03/2028 *	760	0,58				
	160	Verisure Holding AB, 7,288 %, échéance le 15/04/2025 *	161	0,12				
			1 106	0,84				
Suisse — 1,32 % (28 février 2022 : 1,55 %)								
	700	Credit Suisse Group AG, 3,250 %, échéance le 02/04/2026 *	640	0,48				
	220	Credit Suisse Group AG, 1,000 %, échéance le 24/06/2027 *	177	0,13				
	160	Holcim Finance Luxembourg SA, 3,000 %, perpétuelle *	156	0,12				
	320	UBS AG/Londres, 0,500 %, échéance le 31/03/2031	245	0,19				
	550	UBS Group AG, 1,500 %, échéance le 30/11/2024	533	0,40				
			1 751	1,32				
Émirats arabes unis — 0,21 % (28 février 2022 : 0,46 %)								
USD	200	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd, 2,625 %, échéance le 31/03/2036	150	0,11				
	180	MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000 %, échéance le 10/03/2034	134	0,10				
			284	0,21				
Royaume-Uni — 5,38 % (28 février 2022 : 5,32 %)								
	1 070	Annington Funding Plc, 1,650 %, échéance le 12/07/2024	1 018	0,77				
	100	Aviva Plc, 3,375 %, échéance le 04/12/2045 *	94	0,07				
	1 050	Barclays Plc, 3,375 %, échéance le 02/04/2025 *	1 041	0,79				
	1 300	HSBC Holdings Plc, 3,019 %, échéance le 15/06/2027 *	1 240	0,94				
	1 110	Lloyds Banking Group Plc, 2,843 %, échéance le 21/06/2024 *	1 117	0,84				
	1 190	NatWest Group Plc, 2,500 %, échéance le 22/03/2023	1 190	0,90				
GBP	140	Pinewood Finance Co Ltd, 3,250 %, échéance le 30/09/2025	148	0,11				
	420	Rentokil Initial Plc, 0,950 %, échéance le 22/11/2024	399	0,30				
	100	Segro Capital Sarl, 1,875 %, échéance le 23/03/2030	84	0,06				
	580	Standard Chartered Plc, 3,125 %, échéance le 19/11/2024	571	0,43				
GBP	140	Virgin Media Secured Finance Plc, 5,250 %, échéance le 15/05/2029	138	0,10				
	100	Wellcome Trust Ltd/The, 1,125 %, échéance le 21/01/2027	91	0,07				
			7 131	5,38				
États-Unis — 14,56 % (28 février 2022 : 12,44 %)								
USD	50	3M Co, 3,700 %, échéance le 15/04/2050	37	0,03				
	430	AbbVie Inc, 1,250 %, échéance le 01/06/2024	416	0,31				
USD	10	AbbVie Inc, 4,875 %, échéance le 14/11/2048	9	0,01				
USD	420	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp / Atlas Luxco 4 Sarl, 144A, 4,625 %, échéance le 01/06/2028	326	0,25				
USD	40	Amazon.com Inc, 4,250 %, échéance le 22/08/2057	33	0,02				
USD	20	American International Group Inc, 2,500 %, échéance le 30/06/2025	18	0,01				
USD	30	American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, échéance le 15/01/2032	23	0,02				
	220	AT&T Inc, 3,550 %, échéance le 17/12/2032	208	0,16				
USD	100	AT&T Inc, 3,500 %, échéance le 15/09/2053	65	0,05				
USD	40	Ball Corp, 3,125 %, échéance le 15/09/2031	30	0,02				
	1 390	Bank of America Corp, 1,379 %, échéance le 07/02/2025 *	1 355	1,02				
	420	Berkshire Hathaway Inc, 1,125 %, échéance le 16/03/2027	377	0,28				
	290	Boeing Co/The, 5,150 %, échéance le 01/05/2030	266	0,20				
USD	410	Boeing Co/The, 5,805 %, échéance le 01/05/2050	369	0,28				
USD	60	BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, échéance le 06/04/2030	52	0,04				
USD	13	Bristol-Myers Squibb Co, 2,900 %, échéance le 26/07/2024	12	0,01				
USD	70	Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, échéance le 15/11/2035	49	0,04				
USD	70	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, échéance le 01/05/2032	52	0,04				
USD	200	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, échéance le 01/06/2033	147	0,11				
USD	180	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, échéance le 15/01/2034	128	0,10				
USD	20	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, échéance le 23/07/2025	19	0,01				
USD	100	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,250 %, échéance le 01/04/2053	74	0,06				
USD	180	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,500 %, échéance le 01/04/2063	132	0,10				

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) €	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) €	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)						
États-Unis — (suite)						
USD	30	Cheniere Energy Inc, 4,625 %, échéance le 15/10/2028	26	0,02		
USD	50	Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, échéance le 31/01/2032	38	0,03		
USD	120	Cigna Group/The, 4,900 %, échéance le 15/12/2048	102	0,08		
1	440	Citigroup Inc, 1,750 %, échéance le 28/01/2025	1 386	1,05		
USD	10	Coca-Cola Co/The, 2,500 %, échéance le 01/06/2040	7	0,01		
USD	10	Coca-Cola Co/The, 2,600 %, échéance le 01/06/2050	6	—		
USD	50	Coca-Cola Co/The, 2,500 %, échéance le 15/03/2051	31	0,02		
USD	100	Comcast Corp, 4,000 %, échéance le 01/03/2048	76	0,06		
USD	80	Costco Wholesale Corp, 1,600 %, échéance le 20/04/2030	62	0,05		
USD	290	CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, échéance le 01/12/2030	198	0,15		
USD	140	CVS Health Corp, 3,750 %, échéance le 01/04/2030	120	0,09		
USD	280	CVS Health Corp, 5,050 %, échéance le 25/03/2048	238	0,18		
USD	90	Delta Air Lines Inc, 3,800 %, échéance le 19/04/2023	85	0,06		
USD	170	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, échéance le 01/05/2025	164	0,12		
USD	92	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, échéance le 20/10/2025	85	0,06		
USD	90	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, échéance le 20/10/2028	81	0,06		
USD	70	Devon Energy Corp, 8,250 %, échéance le 01/08/2023	67	0,05		
430	DH Europe Finance II Sarl, 1,800 %, échéance le 18/09/2049	275	0,21			
USD	30	Diamondback Energy Inc, 3,500 %, échéance le 01/12/2029	25	0,02		
USD	130	Energy Transfer LP, 5,950 %, échéance le 01/10/2043	115	0,09		
USD	60	Exxon Mobil Corp, 3,452 %, échéance le 15/04/2051	43	0,03		
USD	180	Ford Motor Co, 3,250 %, échéance le 12/02/2032	129	0,10		
USD	200	Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, échéance le 13/11/2030	158	0,12		
USD	20	Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, échéance le 01/08/2030	18	0,01		
USD	350	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, échéance le 15/03/2043	299	0,23		
1	080	General Electric Co, 0,875 %, échéance le 17/05/2025	1 011	0,76		
USD	10	General Motors Co, 6,600 %, échéance le 01/04/2036	9	0,01		
520	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000 %, échéance le 27/07/2023	518	0,39			
540	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,125 %, échéance le 30/09/2024	527	0,40			
USD	50	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, échéance le 01/04/2025	46	0,03		
1	320	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000 %, échéance le 01/11/2028	1 179	0,89		
USD	260	GSK Consumer Healthcare Capital US LLC, 3,625 %, échéance le 24/03/2032	215	0,16		
USD	80	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, échéance le 15/12/2028	65	0,05		
USD	70	Home Depot Inc/The, 2,700 %, échéance le 15/04/2030	57	0,04		
USD	20	Home Depot Inc/The, 3,300 %, échéance le 15/04/2040	15	0,01		
USD	210	Home Depot Inc/The, 3,350 %, échéance le 15/04/2050	147	0,11		
USD	20	Humana Inc, 2,150 %, échéance le 03/02/2032	15	0,01		
1	370	JPMorgan Chase & Co, 0,625 %, échéance le 25/01/2024	1 336	1,01		
USD	60	JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, échéance le 22/04/2031 *	47	0,04		
USD	110	JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, échéance le 22/04/2051 *	71	0,05		
600	McDonald's Corp, 1,875 %, échéance le 26/05/2027	555	0,42			
USD	20	McDonald's Corp, 3,625 %, échéance le 01/09/2049	14	0,01		
USD	70	McDonald's Corp, 4,200 %, échéance le 01/04/2050	55	0,04		
230	Morgan Stanley, 3,622 %, échéance le 01/04/2031 *	193	0,15			
100	Morgan Stanley, 5,148 %, échéance le 25/01/2034 *	103	0,08			
320	Netflix Inc, 3,875 %, échéance le 15/11/2029	305	0,23			
180	Netflix Inc, 3,625 %, échéance le 15/06/2030	168	0,13			
USD	40	Northrop Grumman Corp, 5,250 %, échéance le 01/05/2050	37	0,03		
USD	90	NVIDIA Corp, 3,500 %, échéance le 01/04/2050	66	0,05		
USD	50	PayPal Holdings Inc, 1,650 %, échéance le 01/06/2025	44	0,03		
450	Prologis Euro Finance LLC, 1,875 %, échéance le 05/01/2029	395	0,30			
700	Prologis Euro Finance LLC, 1,500 %, échéance le 08/02/2034	525	0,40			
USD	40	Raytheon Technologies Corp, 2,250 %, échéance le 01/07/2030	31	0,02		
USD	180	Southwestern Energy Co, 4,750 %, échéance le 01/02/2032	146	0,11		
USD	42	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, échéance le 20/09/2025	40	0,03		
USD	40	State Street Corp, 3,152 %, échéance le 30/03/2031 *	33	0,02		
USD	130	Targa Resources Corp, 4,950 %, échéance le 15/04/2052	98	0,07		
USD	10	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, échéance le 15/01/2032	8	0,01		
USD	60	Texas Instruments Inc, 1,750 %, échéance le 04/05/2030	47	0,04		
USD	10	T-Mobile USA Inc, 2,250 %, échéance le 15/02/2026	9	0,01		
USD	40	T-Mobile USA Inc, 2,625 %, échéance le 15/02/2029	32	0,02		
USD	110	T-Mobile USA Inc, 3,875 %, échéance le 15/04/2030	94	0,07		
USD	30	T-Mobile USA Inc, 2,875 %, échéance le 15/02/2031	24	0,02		
USD	40	T-Mobile USA Inc, 3,500 %, échéance le 15/04/2031	33	0,02		
USD	130	T-Mobile USA Inc, 2,700 %, échéance le 15/03/2035	100	0,08		
USD	10	United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, échéance le 15/04/2026	9	0,01		
USD	290	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, échéance le 15/04/2029	243	0,18		
USD	110	United Rentals North America Inc, 3,875 %, échéance le 15/02/2031	89	0,07		
USD	20	UnitedHealth Group Inc, 3,750 %, échéance le 15/07/2025	18	0,01		
760	Verizon Communications Inc, 1,850 %, échéance le 18/05/2040	521	0,39			
USD	60	Verizon Communications Inc, 3,400 %, échéance le 22/03/2041	43	0,03		
USD	50	Visa Inc, 2,050 %, échéance le 15/04/2030	40	0,03		
USD	60	Visa Inc, 2,700 %, échéance le 15/04/2040	43	0,03		
USD	170	Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,141 %, échéance le 15/03/2052	126	0,10		
USD	320	Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,391 %, échéance le 15/03/2063	236	0,18		
1 050	Wells Fargo & Co, 2,250 %, échéance le 05/02/2023	1 049	0,79			
450	Wells Fargo & Co, 1,625 %, échéance le 06/02/2025	427	0,32			
		19 288	14,56			
Total des obligations et bons d'entreprises (coût 62 466€)					57 198	43,18
Obligations et bons d'État — 51,32 % (28 février 2022 : 58,64 %)						
Autriche — 2,40 % (28 février 2022 : 0,00 %)						
	3 860	Obligation de l'État kényan, 144A, 0,900 %, échéance le 20/02/2032	3 176	2,40		
Belgique — 2,12 % (28 février 2022 : 2,81 %)						
	2 720	Obligation de l'État belge, série 71, 3,750 % échéance le 22/06/2045	2 803	2,12		
France — 11,80 % (28 février 2022 : 12,75 %)						
	800	Obligation de l'État français, OAT, 1,000 %, échéance le 25/05/2027	737	0,56		
	880	Obligation de l'État français, OAT, 0,750 %, échéance le 25/05/2028	785	0,59		
	6 260	Obligation de l'État français, OAT, 0,000 %, échéance le 25/11/2030	4 979	3,76		
	1 890	Obligation de l'État français, OAT, 0,000 %, échéance le 25/05/2032	1 429	1,08		
	5 275	Obligation de l'État français, OAT, 3,250 %, échéance le 25/05/2045	5 140	3,88		
	880	Obligation de l'État français, OAT, 144A, 1,500 %, échéance le 25/05/2050	588	0,44		
	590	Obligation de l'État français, OAT, 4,000 %, échéance le 25/04/2060	661	0,50		
	1 600	UNEDIC ASSEO, 1,250 %, échéance le 25/05/2033	1 312	0,99		
			15 631	11,80		
Allemagne — 11,53 % (28 février 2022 : 15,99 %)						
	860	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/08/2030	710	0,54		
	11 690	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/02/2031	9 539	7,20		
	5 420	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, échéance le 15/08/2032	5 019	3,79		
			15 268	11,53		
Irlande — 1,03 % (28 février 2022 : 0,00 %)						
	1 770	Obligation de l'État polonais, 0,350 %, échéance le 18/10/2032	1 369	1,03		
Italie — 6,17 % (28 février 2022 : 8,01 %)						
	1 300	Italie Buoni Poliennali Del Tesoro, série CPI, 144A, 0,400 %, échéance le 15/05/2030 β	1 376	1,04		
	1 670	Italie Buoni Poliennali Del Tesoro, série 10Y, 2,500 %, échéance le 01/12/2032	1 430	1,08		
	6 585	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, série 31Y 144A, 3,250 %, échéance le 01/09/2046	5 366	4,05		
			8 172	6,17		
Mexique — 1,91 % (28 février 2022 : 1,59 %)						
	1 530	Obligation internationale de l'État mexicain, 2,875 %, échéance le 08/04/2039	1 105	0,83		
USD	1 880	Obligation internationale de l'État mexicain, 4,600 %, échéance le 23/01/2046	1 431	1,08		
			2 536	1,91		
Pays-Bas — 4,24 % (28 février 2022 : 0,00 %)						
	6 930	Obligation de l'État espagnol, 144A, 0,000 %, échéance le 15/07/2030	5 624	4,24		
Pologne — 1,27 % (28 février 2022 : 0,00 %)						
PLN	11 670	Obligation de l'État polonais, série 0432, 1,750 %, échéance le 25/04/2032	1 687	1,27		
Afrique du Sud — 1,59 % (28 février 2022 : 1,44 %)						
USD	2 500	Obligation internationale de l'État sud-africain, 4,300 %, échéance le 10/12/2028	2 103	1,59		
Corée du Sud — 0,84 % (28 février 2022 : 0,77 %)						
	1 150	Export-Import Bank of Korea, 0,375 %, échéance le 26/03/2024	1 110	0,84		
Espagne — 5,75 % (28 février 2022 : 7,08 %)						
	1 600	Obligation de l'État espagnol, 144A, 1,300 %, échéance le 31/10/2026	1 493	1,13		
	1 800	Obligation de l'État espagnol, 144A, 1,400 %, échéance le 30/04/2028	1 636	1,23		
	1 330	Obligation de l'État espagnol, 144A, 2,900 %, échéance le 31/10/2046	1 126	0,85		
	4 200	Obligation de l'État espagnol, série 30Y, 144A, 2,700 %, échéance le 31/10/2048	3 367	2,54		
			7 622	5,75		
Émirats arabes unis — 0,32 % (28 février 2022 : 0,47 %)						
USD	540	Obligation internationale de l'État d'Abu Dhabi, 3,875 %, échéance le 16/04/2050	421	0,32		
Royaume-Uni — 0,35 % (28 février 2022 : 0,01 %)						
GBP	10	Fonds d'État du Royaume-Uni, 2,500 %, échéance le 22/07/2065	8	0,01		
GBP	330	United Kingdom Inflation-Linked Gilt, Series 3MO, 0,125 %, échéance 22/03/2068 β	456	0,34		
			464	0,35		
Total des obligations et bons d'État (Coût 82 647€)					67 986	51,32

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) €	% de la valeur liquidative	Contrats (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Organismes de placement collectif — 0,50 % (28 février 2022 : 0,54 %)					
USD 692 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribution)	654	0,50	Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
				124 983	94,36
Total des organismes de placement collectif (Coût 648€)	654	0,50	Autres éléments de l'actif hors passif		
				7 484	5,64
Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat (Coût 145 761€)	125 838	95,00	Total des actifs nets		
				132 467€	100,00
– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 €, inférieurs à 1 000 €, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.					
144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 25 729 000€, soit 19,42 % de l'actif net.					
* Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.					
β Le taux d'intérêt de ce type de titre est lié à l'indice des prix à la consommation (IPC)/indice des prix de détail (Retail Price Index - RPI). Le taux du coupon est celui au 28 février 2023.					
ABRÉVIATIONS :					
Perpétuelle – Obligation sans date d'échéance. Les obligations perpétuelles ne sont pas rachetables, mais paient des intérêts réguliers.					
GBP – Livre britannique					
PLN – Zloty polonais					
USD – Dollar américain					
Analyse de l'actif total					
					% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé					93,32
Organismes de placement collectif					0,49
Instruments financiers dérivés					0,41
Autres actifs					5,78
Actif total					100,00

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)	Devise de vente (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
16 mars 2023	Citi	Achat SEK 15 480	Vente EUR 1 360	€ 37
16 mars 2023	Citi	Achat EUR 49	Vente JPY 6 900	1
16 mars 2023	Goldman Sachs	Achat EUR 69	Vente CAD 100	–
16 mars 2023	Goldman Sachs	Achat USD 525	Vente EUR 486	9
16 mars 2023	Goldman Sachs	Achat EUR 439	Vente GBP 394	(8)
16 mars 2023	Goldman Sachs	Achat EUR 3 662	Vente USD 3 964	(69)
16 mars 2023	JP Morgan	Achat EUR 225	Vente AUD 352	2
16 mars 2023	JP Morgan	Achat EUR 359	Vente CAD 522	(1)
16 mars 2023	JP Morgan	Achat GBP 403	Vente EUR 453	4
16 mars 2023	JP Morgan	Achat NOK 18 585	Vente EUR 1 681	10
16 mars 2023	JP Morgan	Achat USD 165	Vente EUR 152	3
16 mars 2023	JP Morgan	Achat EUR 2 775	Vente GBP 2 493	(51)
16 mars 2023	JP Morgan	Achat EUR 328	Vente JPY 46 350	4
16 mars 2023	JP Morgan	Achat EUR 1 627	Vente PLN 7 780	(11)
16 mars 2023	JP Morgan	Achat EUR 7 819	Vente USD 8 466	(149)
16 mars 2023	UBS	Achat USD 181	Vente EUR 168	2
16 mars 2023	UBS	Achat EUR 2 698	Vente USD 2 919	(49)
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 59€)				€ 72
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (569) €)				(338)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (510) €)				€ (266)

Tableau des contrats à terme standardisés

	Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
Indice SOFR 3 mois décembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	42	€ 9 548	€ (3)
Euribor 3 mois, décembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	80	19 323	(151)
Euro-Bobl, mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	92	10 597	(444)
Euro-Bund mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	117	15 550	(424)
Obligation Euro-Buxl 30 ans, mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	(13)	(1 746)	338
Obligation japonaise 10 ans (OSE), mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	(11)	(11 202)	120
Long Gilt juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	21	2 387	(12)
U.S. 10 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(8)	(844)	1

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats à terme standardisés – (suite)

	Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
U.S. 10 Year Ultra Note, juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(56)	(6 205)	(8)
U.S. 2 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	8	1 541	(4)
U.S. 5 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	49	4 960	(19)
U.S. Ultra Bond (CBT) juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(15)	(1 915)	17
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 567€)				€ 476
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (590) €)				(1 065)
Moins-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (23) €)				€ (589)

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des actifs — 0,24 % (28 février 2022 : 0,80 %)					
590 Home Equity Asset Trust 2005-6, série 2005 6, catégorie M5, 5,562 %, échéance le 25/12/2035 *	549	0,24			
Total des titres adossés à des actifs (coût 5765)	549	0,24			
Titres adossés à des hypothèques — 1,81 % (28 février 2022 : 3,08 %)					
580 BANK 2018-BNK15, série 2018 BN15, catégorie B, 4,657 %, échéance le 15/11/2061 *	533	0,23			
730 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, série 2021 DNA3, catégorie B1, 144A, 7,984 %, échéance le 25/10/2033 *	710	0,31			
947 Hilton USA Trust 2016-HHV, série 2016 HHV, catégorie D, 144A, 4,194 %, échéance le 05/11/2038 *	857	0,38			
5 300 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, série 2018 PHMZ, catégorie M, 144A, 13,096 %, échéance le 15/06/2035 *†	—	—			
14 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-LDP12, série 2007 LDP12, catégorie AJ, 6,673 %, échéance le 15/02/2051 *	12	—			
387 PMT Credit Risk Transfer Trust 2021-1R, série 2021 1R, catégorie A, 144A, 7,417 %, échéance le 27/02/2024 *	381	0,17			
666 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-1, série 2017 1, catégorie M1, 144A, 4,000 %, échéance le 25/01/2056 *	657	0,29			
1 518 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR17 Trust, série 2005 AR17, catégorie A1C3, 5,577 %, échéance le 25/12/2045 *	970	0,43			
Total des titres adossés à des hypothèques (coût 9 9545)	4 120	1,81			
Obligations et bons d'entreprises — 55,37 % (28 février 2022 : 54,33 %)					
Argentine — 0,20 % (28 février 2022 : 0,38 %)					
500 YPF SA, 8,500 %, échéance le 28/07/2025	449	0,20			
Belgique — 0,18 % (28 février 2022 : 0,57 %)					
180 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, échéance le 01/02/2046	165	0,07			
110 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, échéance le 01/06/2040	97	0,04			
40 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,439 %, échéance le 06/10/2048	35	0,02			
EUR 195 Ideal Standard International SA, 6,375 %, échéance le 30/07/2026	116	0,05			
	413	0,18			
Brésil — 1,95 % (28 février 2022 : 3,34 %)					
1 400 B3 SA – Brasil Bolsa Balcão, 144A, 4,125 %, échéance le 20/09/2031	1 162	0,51			
1 310 Braskem America Finance Co, 7,125 %, échéance le 22/07/2041	1 236	0,54			
1 040 Suzano Austria GmbH, 5,000 %, échéance le 15/01/2030	958	0,42			
1 060 Vale Overseas Ltd, 6,250 %, échéance le 10/08/2026	1 082	0,48			
	4 438	1,95			
Canada — 0,99 % (28 février 2022 : 1,42 %)					
1 200 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,875 %, échéance le 15/01/2028	1 069	0,47			
380 MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, échéance le 01/02/2029	355	0,15			
260 Open Text Corp, 144A, 3,875 %, échéance le 15/02/2028	224	0,10			
740 Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, échéance le 15/02/2030	610	0,27			
	2 258	0,99			
Chili — 0,14 % (28 février 2022 : 0,12 %)					
410 Antofagasta Plc, 2,375 %, échéance le 14/10/2030	325	0,14			
Chine — 0,53 % (28 février 2022 : 0,25 %)					
1 980 Prosus NV, 3,832 %, échéance le 08/02/2051	1 202	0,53			
Colombie — 0,24 % (28 février 2022 : 0,61 %)					
550 Ecopetrol SA, 8,875 %, échéance le 13/01/2033	540	0,24			
Finlande — 0,28 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
EUR 650 Nordea Bank Abp, 3,500 %, *	646	0,28			
France — 2,03 % (28 février 2022 : 1,07 %)					
EUR 1 000 BNP Paribas SA, 2,500 %, échéance le 31/03/2032 *	941	0,42			
1 690 BNP Paribas SA, 7,375 %, perpétuelle *	1 682	0,74			
EUR 560 Burger King France SAS, 7,232 %, échéance le 01/11/2026 *	592	0,26			
EUR 570 Goldstory SASU, 5,375 %, arrivant à échéance le 01/03/2026	567	0,25			
EUR 570 IPD 3 BV, 5,500 %, échéance le 01/12/2025	590	0,26			
EUR 220 Kapla Holding SAS, 7,982 %, échéance le 15/07/2027 *	235	0,10			
	4 607	2,03			
Allemagne — 2,93 % (28 février 2022 : 1,60 %)					
2 600 Allianz SE, 3,200 %, perpétuelle *	1 962	0,86			
EUR 680 APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625 %, échéance le 15/01/2027	621	0,27			
EUR 400 Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 4,375 %, échéance le 15/01/2028	376	0,17			
GBP 900 Deutsche Bank AG, 4,000 %, échéance le 24/06/2026 *	1 031	0,45			
EUR 800 Renk AG/Francfort-sur-le-Main, 5,750 %, échéance le 15/07/2025	838	0,37			
EUR 558 TK Elevator Holdco GmbH, 6,625 %, échéance le 15/07/2028	507	0,22			
EUR 540 TUI Cruises GmbH, 6,500 %, échéance le 15/05/2026	512	0,23			
EUR 900 ZF Finance GmbH, 2,000 %, échéance le 06/05/2027	822	0,36			
	6 669	2,93			
Gibraltar — 0,30 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
EUR 750 888 Acquisition Ltd, 7,558 %, échéance le 15/07/2027	682	0,30			
Guatemala — 1,05 % (28 février 2022 : 0,47 %)					
1 400 Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 144A, 5,250 %, échéance le 27/04/2029 *	1 290	0,57			
1 233 Millicom International Cellular SA, 5,125 %, échéance le 15/01/2028	1 087	0,48			
	2 377	1,05			
Inde — 0,18 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
420 ICICI Bank Ltd/Dubai, 4,000 %, échéance le 18/03/2026	400	0,18			
Indonésie — 0,17 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
460 Pertamina Persero PT, 3,100 %, échéance le 27/08/2030	396	0,17			
Irlande — 0,69 % (28 février 2022 : 0,91 %)					
590 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, échéance le 30/01/2032	473	0,21			
1 100 Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,500 %, échéance le 15/02/2024	1 087	0,48			
	1 560	0,69			
Israël — 0,99 % (28 février 2022 : 0,76 %)					
1 170 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, échéance le 21/07/2023	1 158	0,51			
1 250 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, échéance le 01/10/2026	1 093	0,48			
	2 251	0,99			
Italie — 1,51 % (28 février 2022 : 0,66 %)					
EUR 620 Castor SpA, 6,000 %, échéance le 15/02/2029	607	0,27			
EUR 500 International Design Group SPA, 6,904 %, échéance le 15/05/2026 *	523	0,23			
EUR 1 210 Intesa Sanpaolo SpA, 6,375 %, perpétuelle *	1 143	0,50			
EUR 270 Marcolin SpA, 6,125 %, échéance le 15/11/2026	248	0,11			
EUR 1 010 Telecom Italia SpA/Milano, 2,375 %, arrivant à échéance le 12/10/2027	906	0,40			
	3 427	1,51			
Kazakhstan — 1,01 % (28 février 2022 : 0,86 %)					
460 KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, échéance le 24/04/2030	416	0,18			
660 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 3,500 %, échéance le 14/04/2033	495	0,22			
1 520 KazTransGas JSC, 4,375 %, échéance le 26/09/2027	1 374	0,61			
	2 285	1,01			
Luxembourg — 0,47 % (28 février 2022 : 0,42 %)					
GBP 1 040 Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, échéance le 01/04/2028	1 077	0,47			
Macao — 0,19 % (28 février 2022 : 0,15 %)					
530 Sands China Ltd, 3,350 %, échéance le 08/03/2029	434	0,19			
Mexique — 1,97 % (28 février 2022 : 1,56 %)					
1 250 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Caiman, 7,500 %, perpétuelle *	1 173	0,52			
1 360 BBVA Bancomer SA/Texas, 5,125 %, échéance le 18/01/2033 *	1 225	0,54			
1 220 Orbia Advance Corp SAB de CV, 5,875 %, échéance le 17/09/2044	1 075	0,47			
1 070 Southern Copper Corp, 5,250 %, échéance le 08/11/2042	1 001	0,44			
	4 474	1,97			
Pays-Bas — 1,90 % (28 février 2022 : 1,51 %)					
250 Cooperatieve Rabobank UA, 3,649 %, échéance le 06/04/2028 *	233	0,10			
EUR 200 Cooperatieve Rabobank UA, 4,875 %, perpétuelle *	185	0,08			
EUR 800 Cooperatieve Rabobank UA, 3,250 %, perpétuelle *	720	0,32			
GBP 1 100 ING Groep NV, 5,000 %, échéance le 30/08/2026 *	1 306	0,57			
1 510 Trivium Packaging Finance BV, 5,500 %, échéance le 15/08/2026	1 428	0,63			
550 VZ Secured Financing BV, 144A, 5,000 %, échéance le 15/01/2032	453	0,20			
	4 325	1,90			
Pérou — 0,63 % (28 février 2022 : 1,74 %)					
610 Petroleos del Peru SA, 5,625 %, échéance le 19/06/2047	406	0,18			
1 110 Transportadora de Gas del Peru SA, 4,250 %, échéance le 30/04/2028	1 036	0,45			
	1 442	0,63			
Slovénie — 0,37 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
EUR 1 020 United Group BV, 5,250 %, arrivant à échéance le 02/01/2030	831	0,37			
Afrique du Sud — 0,09 % (28 février 2022 : 0,54 %)					
200 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, échéance le 10/04/2027	194	0,09			
Espagne — 0,49 % (28 février 2022 : 1,05 %)					
EUR 600 Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, échéance le 18/09/2027	573	0,25			
EUR 300 Telefonica Europe BV, 2,376 %, perpétuelle *	246	0,11			
EUR 300 Telefonica Europe BV, 3,875 %, perpétuelle *	294	0,13			
	1 113	0,49			
Suède — 0,77 % (28 février 2022 : 0,36 %)					
EUR 680 Heimstaden Bostad AB, 3,625 %, perpétuelle *	459	0,20			

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)							
Suède - (suite)							
EUR	1 080	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 6,374 %, perpétuelle *	511	0,22			
EUR	750	Verisure Holding AB, 7.125 %, échéance le 01/02/2028	785	0,35			
			1 755	0,77			
Suisse — 2,00 % (28 février 2022 : 1,62 %)							
	1 030	Credit Suisse Group AG, 6,373 %, échéance le 15/07/2026 *	969	0,43			
	600	Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, perpétuelle *†‡	545	0,24			
	440	Credit Suisse Group AG, 9,750 %, perpétuelle *†‡	399	0,17			
	720	Credit Suisse Group AG, 7,500 %, perpétuelle *†‡	631	0,28			
	2 010	UBS Group SA, 7,000 %, perpétuelle *	2 005	0,88			
			4 549	2,00			
Émirats arabes unis — 0,40 % (28 février 2022 : 0,69 %)							
	940	DP World Ltd/Emirats Arabes Unis, 5,625 %, échéance le 25/09/2048	910	0,40			
Royaume-Uni — 7,21 % (28 février 2022 : 4,62 %)							
GBP	620	Barclays Plc, 7,125 %, perpétuelle *	719	0,32			
GBP	570	Bellis Acquisition Co Plc, 4,500 %, échéance le 16/02/2026	590	0,26			
GBP	210	Galaxy Bidco Ltd, 6,500 %, échéance le 31/07/2026	232	0,10			
GBP	1 160	Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, échéance le 07/04/2026	1 284	0,56			
GBP	1 459	Greene King Finance Plc, série B2, 5,792 %, échéance le 15/03/2036 *	1 356	0,60			
	400	HSBC Holdings Plc, 4,762 %, échéance le 29/03/2033 *	360	0,16			
	1 240	HSBC Holdings Plc, 6,375 %, perpétuelle *	1 214	0,53			
EUR	110	INEOS Quattro Finance 1 Plc, 3,750 %, échéance le 15/07/2026	101	0,04			
EUR	1 600	Lloyds Banking Group Plc, 4,947 %, perpétuelle *	1 626	0,72			
GBP	1 275	Marston's Issuer Plc, série B1, 6,482 %, échéance le 16/07/2035 *	1 205	0,53			
GBP	660	NatWest Group Plc, 3,619 %, échéance le 29/03/2029 *	713	0,31			
GBP	170	NatWest Markets Plc, 6,375 %, échéance le 08/11/2027	212	0,09			
GBP	540	Pinewood Finance Co Ltd, 3,250 %, échéance le 30/09/2025	602	0,27			
GBP	550	Premier Foods Finance Plc, 3,500 %, échéance le 15/10/2026	598	0,26			
GBP	1 150	Saga Plc, 5,500 %, échéance le 15/07/2026	1 120	0,49			
GBP	458	Tesco Property Finance 5 Plc, 5,661 %, échéance le 13/10/2041	530	0,23			
GBP	1 038	Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, échéance le 13/07/2044	1 171	0,52			
EUR	300	Victoria Plc, 3,625 %, échéance le 24/08/2026	261	0,11			
GBP	810	Vmed O2 UK Financing I Plc, 4,500 %, échéance le 15/07/2031	767	0,34			
GBP	680	Wheel Bidco Ltd, 6,750 %, échéance le 15/07/2026	694	0,31			
GBP	1 000	Whitbread Group Plc, 2,375 %, échéance le 31/05/2027	1 036	0,46			
			16 391	7,21			
États-Unis — 23,51 % (28 février 2022 : 25,96 %)							
	500	AbbVie Inc, 4,850 %, échéance le 15/06/2044	455	0,20			
	220	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, échéance le 20/04/2026	214	0,09			
	1 320	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, échéance le 20/04/2029	1 257	0,55			
	660	American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, échéance le 01/10/2029	533	0,23			
	890	American Express Co, 3,550 %, perpétuelle *	758	0,33			
	1 790	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, échéance le 15/08/2027	1 473	0,65			
	570	Bank of America Corp, 5,015 %, échéance le 22/07/2033 *	549	0,24			
	1 150	Bank of America Corp, 3,311 %, échéance le 22/04/2042 *	856	0,38			
	140	Bank of America Corp, 4,083 %, échéance le 20/03/2051 *	113	0,05			
	350	Bausch Health Americas Inc, 144A, 9,250 %, échéance le 01/04/2026	262	0,12			
	494	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, échéance le 15/12/2025	497	0,22			
	650	Carnival Corp, 144A, 10,500 %, échéance le 01/06/2030	630	0,28			
	1 400	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,125 %, échéance le 01/05/2027	1 297	0,57			
	1 180	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, échéance le 01/06/2033	919	0,40			
	1 020	Centene Corp, 4,625 %, échéance le 15/12/2029	934	0,41			
	400	Charles Schwab Corp/The, série H, 4,000 %, perpétuelle *	339	0,15			
	1 380	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, échéance le 01/06/2041	904	0,40			
	250	Cigna Group/The, 4,800 %, échéance le 15/08/2038	231	0,10			
	1 030	Citigroup Inc, 8,125 %, échéance le 15/07/2039	1 307	0,57			
	572	Comcast Corp, 2,937 %, échéance le 01/11/2056	359	0,16			
	420	Comcast Corp, 4,950 %, échéance le 15/10/2058	390	0,17			
	1 798	Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, échéance le 01/06/2044	1 347	0,59			
	750	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, échéance le 01/02/2029	637	0,28			
	680	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, échéance le 03/11/2036	692	0,30			
	930	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, échéance le 01/05/2025	950	0,42			
	430	Delta Air Lines Inc, 7,375 %, échéance le 15/01/2026	443	0,20			
	400	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, échéance le 20/10/2028	380	0,17			
	624	Devon Energy Corp, 5,250 %, échéance 15/10/2027	617	0,27			
	246	Devon Energy Corp, 5,875 %, échéance 15/06/2028	248	0,11			
	1 200	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, échéance le 15/08/2027	1 074	0,47			
	420	DISH DBS Corp, 5,875 %, échéance le 15/11/2024	394	0,17			
	1 500	DISH DBS Corp, 7,750 %, échéance le 01/07/2026	1 166	0,51			
	670	DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, échéance le 01/12/2028	536	0,24			
	830	Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, échéance le 15/06/2025	805	0,35			
	740	Enterprise Products Operating LLC, 4,800 %, échéance le 01/02/2049	649	0,29			
	1 050	EQT Corp, 3,900 %, échéance le 01/10/2027	961	0,42			
	380	EQT Corp, 5,000 %, échéance le 15/01/2029	356	0,16			
	120	Exxon Mobil Corp, 4,327 %, échéance le 19/03/2050	107	0,05			
	780	Ford Motor Credit Co LLC, 2,748 %, échéance le 14/06/2024	894	0,39			
	390	Ford Motor Credit Co LLC, 3,815 %, échéance le 02/11/2027	343	0,15			
	1 515	Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, échéance le 10/02/2029	1 235	0,54			
	1 430	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, échéance le 15/03/2043	1 293	0,57			
	235	Goldman Sachs Capital II, 5,730 %, perpétuelle *	190	0,08			
	590	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,625 %, échéance le 29/10/2029 *	639	0,28			
	1 400	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, échéance le 15/12/2028	1 205	0,53			
	200	JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, échéance le 22/04/2031 *	165	0,07			
	30	JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, échéance le 22/04/2051 *	20	0,01			
	330	JPMorgan Chase & Co, 3,328 %, échéance le 22/04/2052 *	234	0,10			
	1 750	JPMorgan Chase & Co, série U, 6,125 %, perpétuelle *	1 755	0,77			
	270	Kraft Heinz Foods Co, 5,200 %, échéance le 15/07/2045	249	0,11			
	440	Legacy LifePoint Health LLC, 144A, 4,375 %, échéance le 15/02/2027	372	0,16			
	1 083	Match Group Holdings II LLC, 144A, 5,000 %, échéance le 15/12/2027	1 009	0,44			
	170	McDonald's Corp, 4,200 %, échéance le 01/04/2050	142	0,06			
	1 430	Morgan Stanley, 3,622 %, échéance le 01/04/2031 *	1 267	0,56			
	40	Morgan Stanley, 5,597 %, échéance le 24/03/2051 *	41	0,02			
	340	Navient Corp, 5,875 %, échéance le 25/10/2024	331	0,15			
	640	Netflix Inc, 144A, 4,875 %, échéance le 15/06/2030	615	0,27			
	690	Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, échéance le 15/08/2029	613	0,27			
	490	Radiology Partners Inc, 144A, 9,250 %, échéance le 01/02/2028	294	0,13			
	1 850	Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, échéance le 15/02/2030	1 658	0,73			
	205	Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, échéance le 01/03/2032	228	0,10			
	500	Southwestern Energy Co, 8,375 %, échéance le 15/09/2028	524	0,23			
	1 210	Southwestern Energy Co, 4,750 %, échéance le 01/02/2032	1 041	0,46			
	700	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, échéance le 20/09/2025	703	0,31			
	1 620	Sprint Capital Corp, 8,750 %, échéance le 15/03/2032	1 930	0,85			
	640	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500 %, échéance le 01/03/2030	607	0,27			
	450	T-Mobile USA Inc, 3,875 %, échéance le 15/04/2030	408	0,18			
	1 130	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, échéance le 15/04/2029	1 003	0,44			
	790	United Rentals North America Inc, 5,500 %, échéance le 15/05/2027	775	0,34			
	1 000	United Rentals North America Inc, 3,875 %, échéance le 15/02/2031	857	0,38			
	530	Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, échéance le 15/02/2029	455	0,20			
	1 000	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, échéance le 15/02/2028	882	0,39			
	160	Warnermedia Holdings Inc, 144A, 4,279 %, échéance le 15/03/2032	138	0,06			
	230	Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,050 %, échéance le 15/03/2042	186	0,08			
	270	Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,141 %, échéance le 15/03/2052	212	0,09			
	510	Wells Fargo & Co, 3,473 %, échéance le 26/04/2028 *	563	0,25			
	730	Wells Fargo & Co, 5,013 %, échéance le 04/04/2051 *	673	0,30			
	880	Wells Fargo & Co, série U, 5,875 %, perpétuelle *	875	0,39			
	210	Western Midstream Operating LP, 3,950 %, échéance le 01/06/2025	200	0,09			
	480	Western Midstream Operating LP, 5,500 %, échéance le 15/08/2048	403	0,18			
	720	Western Midstream Operating LP, 5,500 %, échéance le 01/02/2050	589	0,26			
			53 455	23,51			
Total des obligations et bons d'entreprises (coût 141 987\$)					125 875	55,37	
Obligations et bons d'État — 26,03 % (28 février 2022 : 21,55 %)							
Argentine — 0,55 % (28 février 2022 : 0,46 %)							
	3 264	Obligations du gouvernement Provincia de Buenos Aires, 144A, 5,250 %, échéance le 01/09/2037	1 251	0,55			
Bésil — 0,90 % (28 février 2022 : 2,59 %)							
BRL	11 694	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTNf, 10,000 %, échéance le 01/01/2027	2 045	0,90			
Colombie — 0,43 % (28 février 2022 : 0,40 %)							
	1 350	Obligation internationale de l'État colombien, 5,625 %, échéance le 26/02/2044	980	0,43			
Côte d'Ivoire — 0,34 % (28 février 2022 : 0,30 %)							
EUR	880	Obligation internationale de l'État ivoirien, 5,250 %, échéance le 22/03/2030	781	0,34			
République dominicaine — 0,50 % (28 février 2022 : 0,20 %)							
	1 360	Obligation internationale de la République dominicaine, 144A, 4,875 %, échéance le 23/09/2032	1 142	0,50			

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'État — (suite)			
Égypte — 0,85 % (28 février 2022 : 0,74 %)			
	1 360		
	Obligation internationale de l'État égyptien, 3,875 %, échéance le 16/02/2026		
EUR	1 180	1 095	0,48
	Obligation internationale de l'État égyptien, 6,375 %, échéance le 11/04/2031		
		837	0,37
		1 932	0,85
Gabon — 0,56 % (28 février 2022 : 0,47 %)			
	1 550		
	Obligation internationale de l'État gabonais, 144A, 7,000 %, échéance le 24/11/2031		
		1 266	0,56
Allemagne — 0,15 % (28 février 2022 : 0,00 %)			
EUR	360		
	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, échéance le 15/02/2029		
		331	0,15
Indonésie — 2,96 % (28 février 2022 : 2,96 %)			
IDR	45 226 000		
	Bon du Trésor indonésien, série FR59, 7,000 %, échéance le 15/05/2027		
		3 016	1,33
IDR	52 396 000		
	Bon du Trésor indonésien, série FR78, 8,250 %, échéance le 15/05/2029		
		3 711	1,63
		6 727	2,96
Jordanie — 0,17 % (28 février 2022 : 0,00 %)			
	430		
	Obligation internationale de l'État jordanien, 5,850 %, échéance le 07/07/2030		
		389	0,17
Mexique — 3,33 % (28 février 2022 : 2,84 %)			
MXN	161 267		
	Mexican Bonos, série M, 7,750 %, échéance le 13/11/2042		
		7 562	3,33
Nigeria — 0,42 % (28 février 2022 : 0,14 %)			
	1 400		
	Obligation internationale de l'État nigérian, 7,625 %, échéance le 28/11/2047		
		942	0,42
Oman — 0,17 % (28 février 2022 : 0,00 %)			
	390		
	Obligation internationale de l'État ghanéen, 6,000 %, échéance le 08/01/2029		
		392	0,17
Panama — 0,22 % (28 février 2022 : 0,22 %)			
	680		
	Obligation internationale de l'État panaméen, 4,500 %, échéance le 01/04/2056		
		499	0,22
Pologne — 1,46 % (28 février 2022 : 0,00 %)			
PLN	21 700		
	Obligation de l'État polonais, série 0432, 1,750 %, échéance le 25/04/2032		
		3 319	1,46
Roumanie — 0,29 % (28 février 2022 : 0,27 %)			
EUR	940		
	Obligation internationale de l'État kazakh, 2,000 %, échéance le 14/04/2033		
		666	0,29
Russie — 0,18 % (28 février 2022 : 1,14 %)			
RUB	288 495		
	Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 19/01/2028 ty		
		192	0,08
RUB	329 535		
	Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 10/04/2030 ty		
		220	0,10
		412	0,18
Afrique du Sud — 1,46 % (28 février 2022 : 1,67 %)			
ZAR	72 778		
	Obligation de l'État sud-africain, série R214, 6,500 %, échéance le 28/02/2041		
		2 497	1,10
	1 130		
	Obligation internationale de l'État sud-africain, 5,750 %, échéance le 30/09/2049		
		827	0,36
		3 324	1,46
États-Unis — 11,09 % (28 février 2022 : 3,45 %)			
	6 240		
	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,000 %, échéance le 30/04/2024		
		6 021	2,65
	30		
	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,625 %, échéance le 15/08/2030		
		24	0,01
	5 680		
	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,375 %, échéance le 15/11/2031		
		4 625	2,03
	3 320		
	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,125 %, échéance le 15/11/2032		
		3 373	1,48
	120		
	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,750 %, échéance le 15/08/2041		
		83	0,04
	140		
	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,000 %, échéance le 15/11/2041		
		101	0,04
	600		
	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,375 %, échéance le 15/08/2042		
		540	0,24
	830		
	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,000 %, échéance le 15/11/2042		
		818	0,36
	1 650		
	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/05/2045		
		1 378	0,61
	15		
	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/11/2045		
		12	0,01
	500		
	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/08/2046		
		361	0,16
	360		
	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/02/2047		
		300	0,13
	7 240		
	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,125 %, échéance le 15/05/2048		
		6 184	2,72
	820		
	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/02/2049		
		687	0,30

Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
	430		
	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2049		
		352	0,15
	40		
	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,250 %, échéance le 15/05/2050		
		22	0,01
	200		
	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,375 %, échéance le 15/08/2050		
		115	0,05
	270		
	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/08/2052		
		227	0,10
		25 223	11,09
Total des obligations et bons d'État (Coût 80 445\$)		59 183	26,03
Billets d'emprunt — 3,84 % (28 février 2022 : 4,09 %)			
	582		
	Alterra Mountain Co, 8,070 %, échéance le 30/07/2028 *		
		582	0,26
	873		
	API Group Inc, 7,070 %, échéance le 01/10/2026 *		
		874	0,38
	675		
	Asurion, LLC, 8,978 %, échéance le 19/08/2028 *		
		638	0,28
	811		
	Clarios Global LP, 7,820 %, échéance le 30/04/2026 *		
		810	0,36
	629		
	Focus Financial Partners LLC, 7,811 %, échéance le 30/06/2028 *		
		626	0,27
	463		
	Grifols Worldwide Operations USA Inc, 6,570 %, échéance le 15/11/2027 *		
		452	0,20
	1 166		
	Hilton Worldwide Finance LLC, 6,380 %, échéance le 21/06/2026 *		
		1 166	0,51
	138		
	Nexstar Broadcasting Inc, 7,070 %, échéance le 19/09/2026 *		
		137	0,06
	270		
	Nord Anglia Education, 0,000 %, échéance 25/01/2028 *		
		270	0,12
	587		
	Prime Security Installations Ltd, 7,517 %, échéance le 23/09/2026 *		
		587	0,26
	929		
	Sedgwick Claims Management Services Inc, 7,820 %, échéance le 31/12/2025 *		
		928	0,41
	600		
	Sotera Health, 7,575 %, échéance le 13/12/2026 *		
		578	0,25
	893		
	Terrier Media Buyer, Inc., 8,230 %, échéance le 17/12/2026 *		
		841	0,37
	246		
	UFC Holding LLC, 7,570 %, échéance le 29/04/2026 *		
		245	0,11
Total des billets d'emprunt (coût 8 881\$)		8 734	3,84
Organismes de placement collectif — 1,77 % (28 février 2022 : 9,56 %)			
EUR	10		
	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro Accumulating		
		1 117	0,49
	22		
	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – LM Class US\$ Accumulating		
		2 899	1,28
Total des organismes de placement collectif (Coût 3 638\$)		4 016	1,77
Actions ordinaires — 0,18 % (28 février 2022 : 0,15 %)			
États-Unis — 0,18 % (28 février 2022 : 0,15 %)			
	44		
	Berry Corp		
		414	0,18
Total des actions ordinaires (coût 491\$)		414	0,18
Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat (Coût 245 972\$)			
		202 891	89,24
Contrats de change à terme — 0,34 % (28 février 2022 : 1,52 %)			
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)			
		775	0,34
Contrats à terme standardisés — 0,03 % (28 février 2022 : 0,03 %)			
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)			
		74	0,03
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		203 740	89,61
Contrats de change à terme — (1,76 %) (28 février 2022 : (0,75 %))			
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)			
		(4 011)	(1,76)
Contrats à terme standardisés — (0,01 %) (28 février 2022 : (0,42 %))			
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)			
		(29)	(0,01)
Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		(4 040)	(1,77)
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		199 700	87,84
Autres éléments de l'actif hors passif		27 655	12,16
Total des actifs nets		227 355\$	100,00

–	Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.
144A	Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 33 298 000\$, soit 14,65 % de l'actif net.
*	Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.
ε	Le titre est en défaut à la date de clôture ou depuis la clôture de l'exercice le 28 février 2023 (capital et/ou intérêts).
†	Illiquide à compter de l'exercice clos le 28 février 2023.
γ	Le titre ne génère plus de revenus pendant et/ou après l'exercice clos le 28 février 2023 en raison de l'incertitude des paiements d'intérêts.

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

ABRÉVIATIONS :

Perpétuelle	– Obligation sans date d'échéance. Les obligations perpétuelles ne sont pas rachetables, mais paient des intérêts réguliers.
REMIC	– Société relais de placements immobiliers hypothécaires (Real Estate Mortgage Investment Conduit).
BRL	– Réal brésilien
EUR	– Euro
GBP	– Livre britannique
IDR	– Rupiah indonésienne
MXN	– Peso mexicain
PLN	– Zloty polonais
RUB	– Rouble russe
ZAR	– Rand sud-africain

	% de l'actif total
Analyse de l'actif total	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	81,72
Autres valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	3,75
Organismes de placement collectif	1,73
Instruments financiers dérivés	0,36
Autres actifs	12,44
Actif total	100,00

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)			Devise de vente (en milliers)			Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
09 mars 2023	Citi	Achat	USD	2 714	Vente	IDR	42 183 819	\$ (51)
09 mars 2023	Citi	Achat	USD	3 589	Vente	INR	293 376	43
09 mars 2023	Citi	Achat	IDR	42 183 820	Vente	USD	2 740	26
09 mars 2023	Citi	Achat	INR	66 504	Vente	USD	800	4
09 mars 2023	Citi	Achat	INR	92 144	Vente	USD	1 133	(19)
09 mars 2023	Morgan Stanley	Achat	USD	3 306	Vente	TWD	99 169	48
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	1 783	Vente	AUD	2 586	42
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	1 390	Vente	CHF	1 282	26
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	185	Vente	EUR	171	2
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	102	Vente	GBP	84	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	59	Vente	PLN	265	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	24	Vente	SGD	33	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	1	Vente	SGD	1	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	1 571	Vente	USD	1 899	(8)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD	1 324	Vente	USD	999	(17)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD	91 256	Vente	USD	63 460	2 019
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CHF	52 599	Vente	USD	57 329	1 385
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	7 160	Vente	USD	7 696	(117)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	PLN	12 075	Vente	USD	2 726	(14)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	ZAR	6 522	Vente	USD	366	(12)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	8	Vente	ZAR	147	–
16 mars 2023	BNP Paribas	Achat	USD	3 205	Vente	PLN	14 200	30
16 mars 2023	BNP Paribas	Achat	JPY	666 617	Vente	USD	5 141	(190)
16 mars 2023	Citi	Achat	USD	7 731	Vente	GBP	6 381	44
16 mars 2023	Goldman Sachs	Achat	USD	4 380	Vente	EUR	4 061	65
16 mars 2023	Goldman Sachs	Achat	USD	2 250	Vente	GBP	1 857	14
16 mars 2023	Goldman Sachs	Achat	USD	1 848	Vente	MXN	35 905	(85)
16 mars 2023	HSBC	Achat	USD	573	Vente	EUR	540	(1)
16 mars 2023	HSBC	Achat	USD	25 616	Vente	EUR	23 751	380
16 mars 2023	JP Morgan	Achat	USD	2 024	Vente	GBP	1 671	11
16 mars 2023	JP Morgan	Achat	ZAR	5 000	Vente	USD	282	(11)
16 mars 2023	JP Morgan	Achat	AUD	3 230	Vente	USD	2 245	(65)
16 mars 2023	Morgan Stanley	Achat	CAD	1 230	Vente	USD	917	(14)
16 mars 2023	UBS	Achat	USD	7 454	Vente	GBP	6 157	37
16 mars 2023	UBS	Achat	GBP	644	Vente	USD	773	3
13 juin 2023	Citi	Achat	USD	1 407	Vente	IDR	21 548 873	(3)
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 4 595\$)								\$ 775
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (2 265) \$)								(4 011)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 2 330\$)								\$ (3 236)

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats à terme standardisés

	Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
Euro-Bobl, mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	(5)	\$ (609)	\$ 24
Obligation Euro-Buxl 30 ans, mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	(1)	(142)	28
U.S. 10 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(39)	(4 355)	8
U.S. 2 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	12	2 445	(6)
U.S. 5 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(133)	(14 238)	(23)
U.S. Long Bond (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(23)	(2 880)	14
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 104\$)				\$ 74
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (1 281) \$)				(29)
Plus-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (1 177) \$)				\$ 45

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des actifs — 6,50 % (28 février 2022 : 4,73 %)					
500 522 Funding CLO 2018-3A Ltd, série 2018 3A, catégorie DR, 144A, 7,908 %, échéance le 20/10/2031 *	477	0,38	1 000 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, échéance le 09/05/2029	886	0,71
250 AB BSL CLO 2 Ltd, série 2021 2A, catégorie D, 144A, 8,142 %, échéance le 15/04/2034 *	240	0,19		1 582	1,26
310 AGL CLO 6 Ltd, série 2020 6A, catégorie ER, 144A, 11,308 %, échéance le 20/07/2034 *	287	0,23	Italie — 0,70 % (28 février 2022 : 0,43 %)		
400 Ammc Clo 20 Ltd, série 2017 20A, catégorie E, 144A, 10,602 %, échéance le 17/04/2029 *	385	0,31	380 Telecom Italia Capital SA, 6,000 %, échéance le 30/09/2034	318	0,25
300 Apex Credit CLO 2022-1 Ltd, série 2022 1A, catégorie D, 144A, 9,053 %, échéance le 22/04/2033 *	286	0,23	660 UniCredit SpA, 144A, 5,459 %, échéance le 30/06/2035 *	561	0,45
440 Ballyrock CLO 2018-1 Ltd, série 2018 1A, catégorie C, 144A, 7,958 %, échéance le 20/04/2031 *	419	0,33		879	0,70
420 Canyon CLO 2020-1 Ltd, série 2020 1A, catégorie ER, 144A, 11,142 %, échéance le 15/07/2034 *	375	0,30	Luxembourg — 1,51 % (28 février 2022 : 0,81 %)		
250 CIFC Funding 2017-1 Ltd, série 2017 1A, catégorie D, 144A, 8,315 %, échéance le 23/04/2029 *	245	0,20	500 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, échéance le 15/08/2029	409	0,32
300 GoldenTree Loan Opportunities IX Ltd, série 2014 9A, catégorie DR2, 144A, 7,802 %, échéance le 29/10/2029 *	290	0,23	710 Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, échéance le 15/05/2027	587	0,47
250 Greenwood Park CLO Ltd, série 2018 1A, catégorie E, 144A, 9,742 %, échéance le 15/04/2031 *	210	0,17	1 100 ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, échéance le 30/06/2027	901	0,72
510 Grippen Park CLO Ltd, série 2017 1A, catégorie E, 144A, 10,508 %, échéance le 20/01/2030 *	450	0,36		1 897	1,51
250 Harriman Park CLO Ltd, série 2020 1A, catégorie ER, 144A, 11,208 %, échéance le 20/04/2034 *	221	0,18	Macao — 1,80 % (28 février 2022 : 0,97 %)		
443 Magnetite XII Ltd, série 2015 12A, catégorie ER, 144A, 10,472 %, échéance le 15/10/2031 *	404	0,32	200 Sands China Ltd, 4,300 %, échéance le 01/08/2026	185	0,15
500 Marble Point CLO XIV Ltd, série 2018 2A, catégorie D, 144A, 8,338 %, échéance le 20/01/2032 *	434	0,35	200 Sands China Ltd, 5,900 %, échéance le 08/08/2028	189	0,15
280 Mountain View CLO IX Ltd, série 2015 9A, catégorie CR, 144A, 7,912 %, échéance le 15/07/2031 *	241	0,19	450 Sands China Ltd, 3,750 %, échéance le 08/08/2031	356	0,28
500 Nassau 2021-I Ltd, série 2021 1A, catégorie D, 144A, 8,542 %, échéance le 26/08/2034 *	433	0,35	200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, échéance le 15/01/2026	183	0,15
250 Neuberger Berman CLO XVIII Ltd, série 2014 18A, catégorie DR2, 144A, 10,735 %, échéance le 21/10/2030 *	221	0,18	1 120 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, échéance le 26/08/2028	960	0,77
500 Neuberger Berman Loan Advisers CLO 34 Ltd, série 2019 34A, catégorie ER, 144A, 11,139 %, échéance le 20/01/2035 *	464	0,37	460 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125 %, échéance le 15/12/2029	378	0,30
300 Ocean Trails CLO V, série 2014 5A, catégorie DRR, 144A, 8,265 %, échéance le 13/10/2031 *	256	0,20		2 251	1,80
200 Ocean Trails CLO XIV Ltd, série 2023 14A, catégorie D, 144A, 0,000 %, échéance le 20/01/2032 *	199	0,16	Pays-Bas — 0,30 % (28 février 2022 : 0,16 %)		
580 Saranac CLO III Ltd, série 2014 3A, catégorie DR, 144A, 8,003 %, échéance le 22/06/2030 *	518	0,41	420 UPC Holding BV, 144A, 5,500 %, échéance le 15/01/2028	372	0,30
280 Trinitas CLO X Ltd, série 2019 10A, catégorie DR, 144A, 8,232 %, échéance le 15/01/2035 *	254	0,20	Pologne — 0,36 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
320 Venture XVII CLO Ltd, série 2014 17A, catégorie DRR, 144A, 7,612 %, échéance le 15/04/2027 *	299	0,24	570 Canpack SA / Canpack US LLC, 144A, 3,875 %, échéance le 15/11/2029	454	0,36
100 Venture XVII CLO Ltd, série 2014 17A, catégorie ERR, 144A, 10,532 %, échéance le 15/04/2027 *	85	0,07	Porto Rico — 0,03 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
500 Vibrant CLO XI Ltd, série 2019 11A, catégorie CR, 144A, 8,308 %, échéance le 20/07/2032 *	444	0,35	40 Liberty Latin America Ltd, 2,000 %, échéance le 15/07/2024	37	0,03
Total des titres adossés à des actifs (coût 8 8035)	8 137	6,50	Suisse — 2,04 % (28 février 2022 : 0,77 %)		
Obligations et bons d'entreprises — 84,70 % (28 février 2022 : 86,26 %)					
Bermudes — 0,65 % (28 février 2022 : 0,31 %)					
881 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, échéance le 15/10/2025	811	0,65	200 Credit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, perpétuelle **†	148	0,12
Canada — 2,47 % (28 février 2022 : 1,82 %)					
230 ATS Corp, 144A, 4,125 %, échéance le 15/12/2028	201	0,16	1 520 Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, perpétuelle **†	1 379	1,10
620 Bombardier Inc, 144A, 7,875 %, échéance le 15/04/2027	617	0,49	920 Credit Suisse Group AG, 144A, 6,375 %, perpétuelle **†	682	0,55
420 Bombardier Inc, 144A, 7,500 %, échéance le 01/02/2029	412	0,33	390 VistaJet Malta Finance Plc / XO Management Holding Inc, 144A, 6,375 %, échéance le 01/02/2030	342	0,27
200 Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,375 %, échéance le 15/01/2028	181	0,15		2 551	2,04
440 Empire Communities Corp, 144A, 7,000 %, échéance le 15/12/2025	393	0,31	Royaume-Uni — 2,54 % (28 février 2022 : 1,44 %)		
800 Hubday Minerals Inc, 144A, 6,125 %, échéance le 01/04/2029	707	0,57	1 280 Barclays Plc, 8,000 %, perpétuelle *	1 270	1,01
50 MEG Energy Corp, 144A, 7,125 %, échéance le 01/02/2027	51	0,04	800 HSBC Holdings Plc, 4,600 %, perpétuelle *	647	0,52
520 Open Text Corp, 144A, 6,900 %, échéance le 01/12/2027	526	0,42	250 Virgin Media Secured Finance plc, 144A, 5,500 %, échéance le 15/05/2029	227	0,18
	3 088	2,47	770 Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC, 144A, 5,000 %, échéance le 15/07/2028	669	0,53
Îles Caïman — 0,91 % (28 février 2022 : 1,03 %)					
1 259 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, échéance le 15/09/2024	1 139	0,91	450 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, échéance le 15/07/2031	373	0,30
France — 0,28 % (28 février 2022 : 1,24 %)					
450 Altice France SA/France, 144A, 5,125 %, échéance le 15/10/2029	349	0,28		3 186	2,54
Hong Kong — 0,45 % (28 février 2022 : 0,15 %)					
200 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 4,875 %, échéance le 06/06/2025	187	0,15	États-Unis — 67,88 % (28 février 2022 : 74,05 %)		
450 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, échéance le 04/12/2029	374	0,30	340 Academy Ltd, 144A, 6,000 %, échéance le 15/11/2027	322	0,26
	561	0,45	742 Accelerate360 Holdings LLC, 144A, 8,000 %, échéance le 01/03/2028	784	0,63
Inde — 0,25 % (28 février 2022 : 0,29 %)					
340 CA Magnum Holdings, 144A, 5,375 %, échéance le 31/10/2026	314	0,25	240 Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144A, 5,000 %, échéance le 01/05/2028	192	0,15
Israël — 1,26 % (28 février 2022 : 0,96 %)					
770 Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, échéance le 01/02/2036	696	0,55	550 AdaptHealth LLC, 144A, 4,625 %, échéance le 01/08/2029	462	0,37
			120 AdaptHealth LLC, 144A, 5,125 %, échéance le 01/03/2030	104	0,08
			217 Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, échéance le 01/03/2028	200	0,16
			290 Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 6,375 %, échéance le 15/06/2030	277	0,22
			500 Akumin Inc, 144A, 7,000 %, échéance le 01/11/2025	398	0,32
			1 830 Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144A, 10,500 %, échéance le 15/02/2028	791	0,63
			370 Alta Equipment Group Inc, 144A, 5,625 %, échéance le 15/04/2026	346	0,28
			290 AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 10,000 %, échéance le 15/06/2026	150	0,12
			620 AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 7,500 %, échéance le 15/02/2029	372	0,30
			480 American Airlines Inc, 144A, 11,750 %, échéance le 15/07/2025	527	0,42
			310 American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, échéance le 15/02/2028	303	0,24
			340 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, échéance le 20/04/2029	324	0,26
			230 American Axle & Manufacturing Inc, 6,500 %, échéance le 01/04/2027	213	0,17
			580 American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, échéance le 01/10/2029	469	0,37
			467 American News Co LLC, 144A, 8,500 %, échéance le 01/09/2026	534	0,43
			90 Anagram International Inc / Anagram Holdings LLC, 144A, 10,000 %, échéance le 15/08/2026	72	0,06
			930 Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 144A, 4,625 %, échéance le 15/06/2029	718	0,57
			200 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 4,000 %, échéance le 01/09/2029	160	0,13

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
États-Unis — (suite)					
510 AthenaHealth Group Inc, 144A, 6,500 %, échéance le 15/02/2030	404	0,32	490 Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc, 144A, 4,625 %, échéance le 15/01/2029	424	0,34
180 Bath & Body Works Inc, 144A, 9,375 %, échéance le 01/07/2025	191	0,15	510 FirstCash Inc, 144A, 4,625 %, échéance le 01/09/2028	444	0,35
900 Bath & Body Works Inc, 7,500 %, échéance le 15/06/2029	904	0,72	250 FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, échéance le 01/01/2030	221	0,18
180 Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, échéance le 01/10/2030	171	0,14	770 Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 7,875 %, échéance le 15/11/2025	696	0,56
480 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, échéance le 01/02/2027	332	0,26	890 Foot Locker Inc, 144A, 4,000 %, échéance le 01/10/2029	733	0,59
690 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, échéance le 15/02/2029	304	0,24	440 Ford Motor Co, 3,250 %, échéance le 12/02/2032	334	0,27
400 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,250 %, échéance le 30/01/2030	173	0,14	930 Ford Motor Co, 6,100 %, échéance le 19/08/2032	867	0,69
800 Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, échéance le 15/02/2026	755	0,60	900 Ford Motor Credit Co LLC, 5,113 %, échéance le 03/05/2029	823	0,66
150 Blackstone Mortgage Trust Inc, 5,500 %, échéance le 15/03/2027	134	0,11	340 Ford Motor Credit Co LLC, 7,350 %, échéance le 06/03/2030	345	0,28
700 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,625 %, échéance le 15/07/2026	683	0,55	1 230 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, échéance le 13/11/2030	1 027	0,82
370 Boyne USA Inc, 144A, 4,750 %, échéance le 15/05/2029	328	0,26	270 Foundation Building Materials Inc, 144A, 6,000 %, échéance le 01/03/2029	214	0,17
430 Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, échéance le 01/02/2026	400	0,32	670 Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, échéance le 15/03/2043	606	0,48
600 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,250 %, échéance le 15/04/2028	524	0,42	800 Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, échéance le 15/02/2028	769	0,61
620 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, échéance le 15/04/2030	536	0,43	410 Gannett Holdings LLC, 144A, 6,000 %, échéance le 01/11/2026	345	0,28
280 Caesars Entertainment Inc, 144A, 8,125 %, échéance le 01/07/2027	283	0,23	370 Gen Digital Inc, 144A, 7,125 %, échéance le 30/09/2030	361	0,29
640 Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000 %, échéance le 15/02/2030	646	0,52	400 Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp, 8,875 %, échéance le 15/04/2030	402	0,32
400 Cano Health LLC, 144A, 6,250 %, échéance le 01/10/2028	262	0,21	1 080 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, échéance le 15/12/2028	930	0,74
100 Carnival Corp, 144A, 7,625 %, échéance le 01/03/2026	90	0,07	360 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, échéance le 20/01/2026	335	0,27
570 Carnival Corp, 144A, 10,500 %, échéance le 01/06/2030	552	0,44	207 HCA Inc, 7,500 %, échéance le 15/11/2029	225	0,18
220 Carnival Holdings Bermuda Ltd, 144A, 10,375 %, 01/05/2028	236	0,19	510 Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 6,250 %, échéance le 15/04/2032	463	0,37
800 Carriage Purchaser Inc, 144A, 7,875 %, échéance le 15/10/2029	599	0,48	500 Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 6,750 %, échéance le 15/01/2027	477	0,38
820 Carriage services Inc, 144A, 4,250 %, échéance le 15/05/2029	660	0,53	150 iHeartCommunications Inc, 144A, 5,250 %, échéance le 15/08/2027	131	0,10
370 Carrols Restaurant Group Inc, 144A, 5,875 %, échéance le 01/07/2029	282	0,23	230 iHeartCommunications Inc, 144A, 4,750 %, échéance le 15/01/2028	194	0,15
740 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, échéance le 01/02/2032	600	0,48	1 200 IIP Operating Partnership LP, 5,500 %, échéance le 25/05/2026	1 040	0,83
1 180 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, échéance le 01/05/2032	935	0,75	200 Installed Building Products Inc, 144A, 5,750 %, échéance le 01/02/2028	186	0,15
200 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, échéance le 01/06/2033	156	0,12	300 Iron Mountain Information Management Services Inc, 144A, 5,000 %, échéance le 15/07/2032	248	0,20
370 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, échéance le 15/01/2034	277	0,22	310 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 4,500 %, échéance le 15/11/2029	272	0,22
470 Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250 %, échéance le 15/06/2029	460	0,37	180 Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,250 %, échéance le 01/02/2027	153	0,12
970 Chord Energy Corp, 144A, 6,375 %, échéance le 01/06/2026	936	0,75	390 Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,750 %, échéance le 15/06/2029	318	0,25
200 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,875 %, échéance le 15/04/2029	140	0,11	200 Legacy LifePoint Health LLC, 144A, 6,750 %, échéance le 15/04/2025	191	0,15
140 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,125 %, échéance le 01/04/2030	96	0,08	740 Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc, 144A, 5,000 %, échéance le 01/02/2026	674	0,54
860 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 5,250 %, échéance le 15/05/2030	689	0,55	510 LSF11 A5 HoldCo LLC, 144A, 6,625 %, échéance le 15/10/2029	433	0,35
470 Clarivate Science Holdings Corp, 144A, 4,875 %, échéance le 01/07/2029	406	0,32	130 Madison IAQ LLC, 144A, 4,125 %, échéance le 30/06/2028	111	0,09
240 Clean Harbors Inc, 144A, 6,375 %, échéance le 01/02/2031	239	0,19	570 Madison IAQ LLC, 144A, 5,875 %, échéance le 30/06/2029	455	0,36
410 Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144A, 7,500 %, échéance le 01/06/2029	332	0,27	270 Match Group Holdings II LLC, 144A, 4,625 %, échéance le 01/06/2028	240	0,19
480 CNX Midstream Partners LP, 144A, 4,750 %, échéance le 15/04/2030	394	0,31	680 Match Group Holdings II LLC, 144A, 3,625 %, échéance le 01/10/2031	533	0,43
360 Coinbase Global Inc, 144A, 3,625 %, échéance le 01/10/2031	217	0,17	600 Medline Borrower LP, 144A, 5,250 %, échéance le 01/10/2029	493	0,39
110 CommScope Inc, 144A, 8,250 %, échéance le 01/03/2027	94	0,07	440 Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250 %, échéance le 01/05/2028	367	0,29
970 CommScope Inc, 144A, 4,750 %, échéance le 01/09/2029	792	0,63	740 Michaels Cos Inc/The, 144A, 7,875 %, échéance le 01/05/2029	558	0,45
380 Compass Group Diversified Holdings LLC, 144A, 5,250 %, échéance le 15/04/2029	332	0,26	280 Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 6,500 %, échéance le 01/05/2028	242	0,19
420 Crescent Energy Finance LLC, 144A, 9,250 %, échéance le 15/02/2028	410	0,33	420 Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 5,625 %, échéance le 15/01/2030	331	0,26
810 CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, échéance le 01/02/2029	687	0,55	621 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, échéance le 20/06/2027	622	0,50
320 CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, échéance le 15/01/2030	184	0,15	570 MIWD Holdco II LLC / MIWD Finance Corp, 144A, 5,500 %, échéance le 01/02/2030	463	0,37
250 CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, échéance le 01/12/2030	181	0,14	430 Affinity Gaming, 144A, 13,250 %, échéance le 15/12/2027	459	0,37
300 CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, échéance le 15/11/2031	213	0,17	340 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,500 %, échéance le 15/03/2031	233	0,19
430 CSC Holdings LLC, 144A, 5,000 %, échéance le 15/11/2031	229	0,18	980 Nabors Industries Ltd, 144A, 7,250 %, échéance le 15/01/2026	934	0,75
620 Darling Ingredients Inc, 144A, 6,000 %, échéance le 15/06/2030	600	0,48	880 NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, échéance le 15/02/2027	817	0,65
260 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, échéance le 15/01/2026	268	0,21	200 NCL Corp Ltd, 144A, 8,375 %, échéance le 01/02/2028	203	0,16
700 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, échéance le 15/08/2027	627	0,50	20 NCL Corp Ltd, 144A, 7,750 %, échéance le 15/02/2029	17	0,01
1 130 DISH DBS Corp, 7,750 %, échéance le 01/07/2026	878	0,70	140 NextEra Energy Partners LP, 144A, 2,500 %, échéance le 15/06/2026	128	0,10
1 050 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, échéance le 01/12/2028	841	0,67	490 NMG Holding Co Inc / Neiman Marcus Group LLC, 144A, 7,125 %, échéance le 01/04/2026	473	0,38
1 010 DISH DBS Corp, 5,125 %, échéance le 01/06/2029	598	0,48	410 NMI Holdings Inc, 144A, 7,375 %, échéance le 01/06/2025	408	0,33
680 Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, échéance le 15/06/2025	660	0,53	800 Northern Oil and Gas Inc, 144A, 8,125 %, échéance le 01/03/2028	773	0,62
500 Diversified Healthcare Trust, 4,750 %, échéance le 15/02/2028	326	0,26	760 Northwest Acquisitions ULC / Dominion Finco Inc, 144A, 7,125 %, échéance le 01/11/2022	—	—
440 Dornoch Debt Merger Sub Inc, 144A, 6,625 %, échéance le 15/10/2029	333	0,27	540 Occidental Petroleum Corp, 8,875 %, échéance le 15/07/2030	614	0,49
350 DraftKings Holdings Inc, coupon zéro, échéance le 15/03/2028	246	0,20	220 Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, échéance le 15/09/2036	221	0,18
320 Earthstone Energy Holdings LLC, 144A, 8,000 %, échéance le 15/04/2027	307	0,25	30 Pactiv LLC, 8,375 %, échéance le 15/04/2027	30	0,02
160 Edgewell Personal Care Co, 144A, 4,125 %, échéance le 01/04/2029	137	0,11	1 040 Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500 %, échéance le 01/04/2027	784	0,63
400 Elastic NV, 144A, 4,125 %, échéance le 15/07/2029	329	0,26			

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
États-Unis — (suite)					
220 Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer, 144A, 5,875 %, échéance le 01/10/2028	196	0,16	800 WW International Inc, 144A, 4,500 %, échéance le 15/04/2029	409	0,33
600 Park-Ohio Industries Inc, 6,625 %, échéance le 15/04/2027	458	0,37	440 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, échéance le 15/02/2031	439	0,35
600 Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp, 144A, 4,000 %, échéance le 15/06/2029	478	0,38	690 XPO CNW Inc, 6,700 %, échéance le 01/05/2034	631	0,50
200 Permian Resources Operating LLC, 144A, 5,875 %, échéance le 01/07/2029	180	0,14	160 XPO Escrow Sub LLC, 144A, 7,500 %, échéance le 15/11/2027	162	0,13
250 PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp, 144A, 7,750 %, échéance le 15/02/2029	244	0,19	440 ZipRecruiter Inc, 144A, 5,000 %, échéance le 15/01/2030	370	0,30
230 PGT Innovation Inc, 144A, 4,375 %, échéance le 01/10/2029	193	0,15	430 ZoomInfo Technologies LLC/ZoomInfo Finance Corp, 144A, 3,875 %, échéance le 01/02/2029	358	0,29
370 PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500 %, échéance le 01/10/2028	338	0,27		85 019	67,88
660 Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 6,250 %, échéance le 15/01/2028	613	0,49	Zambie — 1,27 % (28 février 2022 : 1,08 %)		
430 Rackspace Technology Global Inc, 144A, 3,500 %, échéance le 15/02/2028	262	0,21	290 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, échéance le 01/04/2025	282	0,23
40 Radiology Partners Inc, 144A, 9,250 %, échéance le 01/02/2028	24	0,02	1 390 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, échéance le 15/10/2027	1 305	1,04
590 Range Resources Corp, 8,250 %, échéance le 15/01/2029	606	0,48		1 587	1,27
290 Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, échéance le 15/02/2030	260	0,21	Total des obligations et bons d'entreprises (coût 120 932 \$)		
400 Resideo Funding Inc, 144A, 4,000 %, échéance le 01/09/2029	330	0,26		106 077	84,70
600 ROCC Holdings LLC, 144A, 9,250 %, échéance le 15/08/2026	634	0,51	Obligations et bons d'État — 0,22 % (28 février 2022 : 0,26 %)		
280 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 3,875 %, échéance le 01/03/2031	218	0,17	Argentine — 0,22 % (28 février 2022 : 0,26 %)		
1 060 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 4,000 %, échéance le 15/10/2023	785	0,63	55 Obligation internationale de l'État argentin, 1,000 %, échéance le 09/07/2029	17	0,01
630 Roller Bearing Co of America Inc, 144A, 4,375 %, échéance le 15/10/2029	545	0,44	480 Obligation internationale de l'État argentin, 0,500 %, échéance le 09/07/2030	157	0,13
380 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, échéance le 31/08/2026	350	0,28	94 Obligation internationale de l'État argentin, 1,500 %, échéance le 09/07/2035	27	0,02
310 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 11,625 %, échéance le 15/08/2027	330	0,26	190 Obligations du gouvernement Provincia de Buenos Aires, 144A, 5,250 %, échéance le 01/09/2037	73	0,06
590 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 7,250 %, échéance le 15/01/2030	592	0,47		274	0,22
370 Ryan Specialty Group LLC, 144A, 4,375 %, échéance le 01/02/2030	317	0,25	Total des obligations et bons d'État (coût 389 \$)		
530 Sabre GLBL Inc, 144A, 11,250 %, échéance le 15/12/2027	530	0,42		274	0,22
2 Service Corp International/US, 7,500 %, échéance le 01/04/2027	2	—	Billets d'emprunt — 5,28 % (28 février 2022 : 5,58 %)		
460 Service Properties Trust, 5,500 %, échéance le 15/12/2027	415	0,33	179 19th Holdings Golf, LLC, 7,667 %, échéance le 07/02/2029 *	171	0,14
390 Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed, 144A, 4,625 %, échéance le 01/03/2029	318	0,25	322 Adtalem Global Education Inc, 8,547 %, échéance le 12/02/2028 *	322	0,26
360 Sizzling Platter LLC / Sizzling Platter Finance Corp, 144A, 8,500 %, échéance le 28/11/2025	329	0,26	429 Asurion LLC, 8,680 %, échéance le 17/08/2028 *	403	0,32
340 Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 6,000 %, échéance le 01/11/2028	302	0,24	570 DCert Buyer, Inc., 11,696 %, échéance le 16/02/2029 *	533	0,43
1 050 Southwestern Energy Co, 4,750 %, échéance le 01/02/2032	903	0,72	190 Deerfield Dakota Holding LLC, 11,320 %, échéance le 14/04/2028 *	178	0,14
360 Speedway Motorsports LLC / Speedway Funding II Inc, 144A, 4,875 %, échéance le 01/11/2027	333	0,27	341 Equinox Holdings Inc, 13,730 %, échéance le 08/03/2024 *	292	0,23
250 Spirit Airlines Inc, 1,000 %, échéance le 15/05/2026	205	0,16	390 Eyecare Partners LLC, 8,480 %, échéance le 05/02/2027 *	328	0,26
170 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, échéance le 20/09/2025	171	0,14	496 Focus Financial Partners LLC, 7,811 %, échéance le 30/06/2028 *	494	0,39
560 Sprint Capital Corp, 8,750 %, échéance le 15/03/2032	667	0,53	232 Global Tel'Link Corp, 9,076 %, échéance le 29/11/2025 *	208	0,17
740 StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, échéance le 15/05/2029	536	0,43	353 Great Outdoors Group LLC, 8,320 %, échéance le 05/03/2028 *	348	0,28
240 StoneX Group Inc, 144A, 8,625 %, échéance le 15/06/2025	242	0,19	395 Magenta Buyer LLC, 9,580 %, échéance le 03/05/2028 *	338	0,27
220 Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP / Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp, 144A, 5,875 %, échéance le 15/05/2025	208	0,17	303 Mister Car Wash, 7,661 %, échéance le 14/05/2026 *	303	0,24
510 Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp, 144A, 8,500 %, échéance le 15/10/2026	485	0,39	160 Neptune Bidco U.S. Inc, 0,000 %, échéance le 11/04/2029 *	148	0,12
1 120 Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, échéance le 01/09/2026	977	0,78	463 Phoenix Guarantor Inc, 7,820 %, échéance le 05/03/2026 *	455	0,36
200 Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144A, 6,000 %, échéance le 31/12/2030	173	0,14	296 Redstone Holdco 2 LP, 9,568 %, échéance le 27/04/2028 *	244	0,19
480 Titan International Inc, 7,000 %, échéance le 30/04/2028	455	0,36	698 Rent-A-Center Inc/TX, 8,125 %, échéance le 17/02/2028 *	684	0,55
390 TopBuild Corp, 144A, 3,625 %, échéance le 15/03/2029	325	0,26	412 Spencer Spirit IH LLC, 10,517 %, échéance le 14/06/2026 *	408	0,33
100 TransDigm Inc, 5,500 %, échéance le 15/11/2027	92	0,07	140 TruGreen LP, 13,325 %, échéance le 30/10/2028 *	101	0,08
580 TransDigm Inc, 144A, 6,750 %, échéance le 15/08/2028	578	0,46	393 US Renal Care Inc, 9,625 %, échéance le 26/06/2026 *	264	0,21
290 TransDigm Inc, 4,625 %, échéance le 15/01/2029	249	0,20	394 Verscend Holding Corp., 8,570 %, échéance le 27/08/2025 *	394	0,31
520 Transocean Inc, 144A, 8,750 %, échéance le 15/02/2030	530	0,42	Total des billets d'emprunt (coût 7 098 \$)		
520 Triton Water Holdings Inc, 144A, 6,250 %, échéance le 01/04/2029	415	0,33		6 616	5,28
460 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, échéance le 15/04/2029	408	0,33	Organismes de placement collectif — 1,33 % (28 février 2022 : 0,35 %)		
1 450 United Rentals North America Inc, 5,250 %, échéance le 15/01/2030	1 368	1,09	1 661 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	1 661	1,33
250 Upbound Group Inc, 144A, 6,375 %, échéance le 15/02/2029	215	0,17	Total des organismes de placement collectif (coût 1 661\$)		
370 Urban One Inc, 144A, 7,375 %, échéance le 01/02/2028	331	0,26		1 661	1,33
1 310 US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, échéance le 15/07/2027	420	0,34	Actions privilégiées — 0,51 % (28 février 2022 : 0,93 %)		
420 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 6,250 %, échéance le 15/01/2030	415	0,33	États-Unis — 0,51 % (28 février 2022 : 0,93 %)		
1 000 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, échéance le 01/11/2033	816	0,65	18 MPLX LP, série A ∞	642	0,51
750 Vericast Corp, 144A, 11,000 %, échéance le 15/09/2026	807	0,64	Total des actions privilégiées (coût 580\$)		
610 Vertiv Group Corp, 144A, 4,125 %, échéance le 15/11/2028	531	0,42		642	0,51
590 Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, échéance le 15/05/2025	628	0,50	Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (coût 139 463 \$)		
120 Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, échéance le 15/09/2027	103	0,08		123 407	98,54
450 Viking Cruises Ltd, 144A, 7,000 %, échéance le 15/02/2029	387	0,31	Swaps sur risque de crédit — 0,08 % (28 février 2022 : 0,05 %)		
390 VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, échéance le 15/02/2028	344	0,27	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	102	0,08
920 Western Midstream Operating LP, 5,450 %, échéance le 01/04/2044	778	0,62	Contrats de change à terme — 0,00 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
			Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	1	—
			Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
				123 510	98,62
			Swaps sur risque de crédit — (0,09 %) (28 février 2022 : (0,01 %))		
			Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(116)	(0,09)
			Contrats de change à terme — (0,03 %) (28 février 2022 : (0,02 %))		
			Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(35)	(0,03)
			Contrats à terme standardisés — (0,02 %) (28 février 2022 : (0,03 %))		
			Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(31)	(0,02)
			Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
				(182)	(0,14)
			Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
				123 328	98,48
			Autres éléments de l'actif hors passif		
				1 912	1,52
			Total des actifs nets		
				125 240 \$	100,00

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

- Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.
- 144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 90 476 000 \$, soit 72,27 % de l'actif net.
- * Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.
- † Liquidité à compter de l'exercice clos le 28 février 2023.
- ∞ Le titre est évalué de bonne foi à sa juste valeur par et à la seule discrétion de la société de gestion ou du gestionnaire concerné du compartiment.
- ⊗ Le titre est en défaut à la date de clôture ou à compter de la clôture de l'exercice clos le 28 février 2023 (capital et/ou intérêts).

ABRÉVIATIONS :

- Perpétuelle – Obligation sans date d'échéance. Les obligations perpétuelles ne sont pas rachetables, mais paient des intérêts réguliers.

Analyse de l'actif total	% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	90,50
Autres valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	5,20
Organismes de placement collectif	1,31
Instruments financiers dérivés	0,08
Autres actifs	2,91
Actif total	100,00

Tableau des swaps sur risque de crédit

Contrepartie	Entité de référence – protection achat/vente	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Goldman Sachs	Beazer Homes USA, Inc, 5,000 % – achat	20 déc. 2027	580	\$ 11
Goldman Sachs	Ford Motor Co, 5,000 % – vente	20 déc. 2026	900	70
Goldman Sachs	KB Home, 5,000 % - achat	20 déc. 2027	812	(69)
Goldman Sachs	Nova Chemicals Corp, 5,000 % – achat	20 juin 2027	429	(21)
Goldman Sachs	Occidental Petroleum Corporation, 1,000 % – vente	20 juin 2026	920	(1)
Goldman Sachs	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5,000 % – achat	20 juin 2027	580	(25)
Goldman Sachs	Xerox Holdings Corp, 1,000 % – achat	20 juin 2027	231	21
Plus-value latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : 112 \$)				\$ 102
Moins-value latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : (19) \$)				(116)
Plus-value nette des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : 93 \$)				\$ (14)

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)	Devise de vente (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat USD 49	Vente EUR 46	\$ 1
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat USD 2	Vente GBP 1	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat USD 12	Vente SGD 17	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat SGD 528	Vente USD 398	(7)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat GBP 35	Vente USD 42	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat EUR 1 711	Vente USD 1 840	(28)
18 avr. 2023	JP Morgan	Achat USD 6	Vente CAD 8	–
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				\$ 1
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (41) \$)				(35)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (41) \$)				\$ (34)

Tableau des contrats à terme standardisés

Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
U.S. 5 Year Note (CBT), juin 2023	Goldman Sachs 76	\$ 8 136	\$ (31)
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 47 \$)			\$ –
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (72) \$)			(31)
Moins-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (25) \$)			\$ (31)

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des actifs — 0,40 % (28 février 2022 : 0,30 %)					
250 Magnetite XII Ltd, série 2015 12A, catégorie ER, 144A, 10,472 %, échéance le 15/10/2031 *	228	0,40			
Total des titres adossés à des actifs (coût 247 \$)	228	0,40			
Obligations et bons d'entreprises — 73,14 % (28 février 2022 : 66,19 %)					
Brésil — 1,86 % (28 février 2022 : 4,15 %)					
450 B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, échéance le 20/09/2031	373	0,65			
900 MercadoLibre Inc, 3,125 %, échéance le 14/01/2031	695	1,21			
	1 068	1,86			
Canada — 0,50 % (28 février 2022 : 0,91 %)					
340 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500 %, échéance le 15/02/2029	289	0,50			
Îles Caïman — 1,78 % (28 février 2022 : 1,04 %)					
1 131 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, échéance le 15/09/2024	1 024	1,78			
Chine — 0,28 % (28 février 2022 : 0,45 %)					
400 China Aoyuan Group Ltd, 0,000 %, échéance le 23/01/2024 €	40	0,07			
400 China Aoyuan Group Ltd, 6,350 %, échéance le 08/02/2024 €	41	0,07			
600 Yuzhou Group, 0,000 %, échéance le 25/10/2023 €	80	0,14			
	161	0,28			
Colombie — 0,44 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
260 Ecopetrol SA, 8,875 %, échéance le 13/01/2033	255	0,44			
France — 0,93 % (28 février 2022 : 0,97 %)					
520 Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, échéance le 15/10/2029	407	0,71			
EUR 120 Burger King France SAS, 7,232 %, échéance le 01/11/2026 *	127	0,22			
	534	0,93			
Allemagne — 2,00 % (28 février 2022 : 1,46 %)					
EUR 650 APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625 %, échéance le 15/01/2027	594	1,03			
EUR 360 APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625 %, échéance le 15/01/2027	329	0,57			
EUR 240 TUI Cruises GmbH, 6,500 %, échéance le 15/05/2026	227	0,40			
	1 150	2,00			
Gibraltar — 0,67 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
EUR 220 888 Acquisition Ltd, 7,558 %, échéance le 15/07/2027	200	0,35			
EUR 200 888 Acquisition Ltd, 7,558 %, échéance le 15/07/2027	182	0,32			
	382	0,67			
Guatemala — 1,14 % (28 février 2022 : 0,48 %)					
490 Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 144A, 5,250 %, échéance le 27/04/2029 *	452	0,79			
250 Millicom International Cellular SA, 4,500 %, échéance le 27/04/2031	202	0,35			
	654	1,14			
Hong Kong — 0,67 % (28 février 2022 : 0,28 %)					
260 Melco Resorts Finance Ltd, 5,375 %, échéance le 04/12/2029	216	0,38			
200 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, échéance le 04/12/2029	166	0,29			
	382	0,67			
Israël — 3,90 % (28 février 2022 : 3,16 %)					
2 560 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, échéance le 01/10/2026	2 240	3,90			
Italie — 1,71 % (28 février 2022 : 0,24 %)					
920 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, échéance le 01/06/2032 *	694	1,21			
70 Telecom Italia Capital SA, 7,200 %, échéance le 18/07/2036	62	0,11			
230 Telecom Italia SpA/Milano, 144A, 5,303 %, échéance le 30/05/2024	224	0,39			
	980	1,71			
Luxembourg — 3,83 % (28 février 2022 : 1,90 %)					
200 Altice Financing SA, 144A, 5,000 %, échéance le 15/01/2028	166	0,29			
700 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, échéance le 15/08/2029	573	1,00			
200 Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, échéance le 15/05/2027	166	0,29			
720 Altice France Holding SA, 144A, 6,000 %, échéance le 15/02/2028	502	0,87			
390 ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, échéance le 30/06/2027	319	0,55			
GBP 220 Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, échéance le 01/04/2028	228	0,40			
260 FAGE International SA / FAGE USA Dairy Industry Inc, 144A, 5,625 %, échéance le 15/08/2026	245	0,43			
	2 199	3,83			
Macao — 1,90 % (28 février 2022 : 2,44 %)					
280 MGM Chine Holdings Ltd, 144A, 4,750 %, échéance le 01/02/2027	247	0,43			
610 Sands China Ltd, 3,750 %, échéance le 08/08/2031	482	0,84			
440 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125 %, échéance le 15/12/2029	361	0,63			
	1 090	1,90			
Mexique — 1,56 % (28 février 2022 : 2,81 %)					
200 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Caïman, 144A, 7,625 %, perpétuelle *	189	0,33			
360 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Caïman, 144A, 6,625 %, perpétuelle *	310	0,54			
440 BBVA Bancomer SA/Texas, 144A, 5,125 %, échéance le 18/01/2033 *	396	0,69			
	895	1,56			
Pays-Bas — 1,12 % (28 février 2022 : 1,16 %)					
780 VZ Secured Financing BV, 144A, 5,000 %, échéance le 15/01/2032	642	1,12			
Pérou — 1,00 % (28 février 2022 : 0,88 %)					
750 Petroleos del Peru SA, 144A, 4,750 %, échéance le 19/06/2032	575	1,00			
Pologne — 0,42 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
300 Canpack SA / Canpack US LLC, 144A, 3,875 %, échéance le 15/11/2029	239	0,42			
Slovénie — 0,28 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
EUR 200 United Group BV, 5,250 %, échéance le 01/02/2030	163	0,28			
Suède — 1,47 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
EUR 200 Heimstaden AB, 4,250 %, échéance le 09/03/2026	161	0,28			
EUR 300 Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, Règlement S, 1,125 %, échéance le 04/09/2026	249	0,43			
EUR 300 Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,624 %, perpétuelle *	142	0,25			
EUR 280 Verisure Holding AB, 7,125 %, échéance le 01/02/2028	293	0,51			
	845	1,47			
Suisse — 2,38 % (28 février 2022 : 0,37 %)					
250 Credit Suisse Group AG, 144A, 6,537 %, échéance le 12/08/2033 *	225	0,39			
850 Credit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, perpétuelle *†€	628	1,09			
280 Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, perpétuelle *†€	254	0,44			
300 Credit Suisse Group AG, 144A, 7,500 %, perpétuelle *†€	263	0,46			
	1 370	2,38			
Turquie — 1,19 % (28 février 2022 : 0,86 %)					
300 TC Ziraat Bankasi AS, 144A, 5,125 %, échéance le 29/09/2023	297	0,52			
410 Turk Telekomunikasyon AS, 144A, 6,875 %, échéance le 28/02/2025	388	0,67			
	685	1,19			
Royaume-Uni — 5,97 % (28 février 2022 : 5,63 %)					
GBP 220 Bellis Acquisition Co Plc, 4,500 %, échéance le 16/02/2026	228	0,40			
EUR 310 INEOS Quattro Finance 1 Plc, 3,750 %, échéance le 15/07/2026	283	0,49			
GBP 250 Marks & Spencer Plc, 3,750 %, échéance le 19/05/2026	273	0,47			
GBP 510 Marston's Issuer Plc, série B1, 6,482 %, échéance le 16/07/2035 *	482	0,84			
GBP 840 Saga Plc, 5,500 %, échéance le 15/07/2026	818	1,43			
EUR 100 Victoria Plc, 3,625 %, échéance le 24/08/2026	87	0,15			
400 Virgin Media Secured Finance plc, 144A, 5,500 %, échéance le 15/05/2029	363	0,63			
560 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, échéance le 15/07/2031	464	0,81			
GBP 180 Wheel Bidco Ltd, 6,750 %, échéance le 15/07/2026	184	0,32			
GBP 240 Wheel Bidco Ltd, 144A, 6,750 %, échéance le 15/07/2026	245	0,43			
	3 427	5,97			
États-Unis — 36,14 % (28 février 2022 : 34,87 %)					
200 Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144A, 5,000 %, échéance le 01/05/2028	160	0,28			
150 American Airlines Group Inc, 144A, 3,750 %, échéance le 01/03/2025	137	0,24			
150 American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, échéance le 15/02/2028	147	0,25			
110 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, échéance le 20/04/2026	107	0,19			
660 American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, échéance le 01/10/2029	533	0,93			
280 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000 %, échéance le 15/06/2027	271	0,47			
400 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, échéance le 15/08/2027	329	0,57			
390 Ball Corp, 2,875 %, échéance le 15/08/2030	312	0,54			
240 Ball Corp, 3,125 %, échéance le 15/09/2031	192	0,33			
340 Boise Cascade Co, 144A, 4,875 %, échéance le 01/07/2030	298	0,52			
210 Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000 %, échéance le 15/02/2030	212	0,37			
280 Carnival Corp, 144A, 10,500 %, échéance le 01/06/2030	271	0,47			
230 Carnival Holdings Bermuda Ltd, 144A, 10,375 %, 01/05/2028	246	0,43			
500 Carnival Plc, 1,000 %, échéance le 28/10/2029	267	0,46			
620 Carriage services Inc, 144A, 4,250 %, échéance le 15/05/2029	499	0,87			
320 Carrols Restaurant Group Inc, 144A, 5,875 %, échéance le 01/07/2029	244	0,42			
1 840 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, échéance le 15/01/2034	1 379	2,40			

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
États-Unis — (suite)					
150 Charles Schwab Corp/The, série H, 4,000 %, perpétuelle *	127	0,22			
240 Coinbase Global Inc, 144A, 3,625 %, échéance le 01/10/2031	145	0,25			
230 CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, échéance le 15/01/2030	132	0,23			
380 CSC Holdings LLC, 144A, 4,625 %, échéance le 01/12/2030	205	0,36			
870 CSC Holdings LLC, 144A, 5,000 %, échéance le 15/11/2031	464	0,81			
870 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, échéance le 15/08/2027	779	1,36			
230 DISH DBS Corp, 5,875 %, échéance le 15/11/2024	216	0,38			
270 DISH DBS Corp, 7,750 %, échéance le 01/07/2026	210	0,37			
280 DISH DBS Corp, 5,125 %, échéance le 01/06/2029	166	0,29			
300 DISH Network Corp, 2,375 %, échéance le 15/03/2024	277	0,48			
890 DISH Network Corp, 3,375 %, échéance le 15/08/2026	573	1,00			
100 Diversified Healthcare Trust, 4,375 %, échéance le 01/03/2031	69	0,12			
120 EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500 %, échéance le 01/06/2030	115	0,20			
1 780 Ford Motor Co, 3,250 %, échéance le 12/02/2032	1 351	2,35			
900 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, échéance le 16/02/2028	753	1,31			
830 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, échéance le 15/12/2028	715	1,24			
810 JB Poindexter & Co Inc, 144A, 7,125 %, échéance le 15/04/2026	782	1,36			
150 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, échéance le 08/08/2024	144	0,25			
550 Level 3 Financing Inc, 144A, 3,625 %, échéance le 15/01/2029	354	0,62			
740 Match Group Holdings II LLC, 144A, 3,625 %, échéance le 01/10/2031	580	1,01			
585 NCL Corp Ltd, 144A, 3,625 %, échéance le 15/12/2024	550	0,96			
410 NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, échéance le 15/03/2026	355	0,62			
580 NCL Finance Ltd, 144A, 6,125 %, échéance le 15/03/2028	484	0,84			
340 Rackspace Technology Global Inc, 144A, 3,500 %, échéance le 15/02/2028	207	0,36			
340 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 4,250 %, échéance le 01/07/2026	297	0,52			
930 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, échéance le 01/04/2028	811	1,41			
520 Service Properties Trust, 5,500 %, échéance le 15/12/2027	469	0,82			
200 Service Properties Trust, 4,950 %, échéance le 01/10/2029	158	0,27			
390 Sirius XM Radio Inc, 144A, 4,125 %, échéance le 01/07/2030	317	0,55			
320 Southwestern Energy Co, 4,750 %, échéance le 01/02/2032	275	0,48			
250 Spirit Airlines Inc, 1,000 %, échéance le 15/05/2026	205	0,36			
360 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, échéance le 20/09/2025	362	0,63			
80 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, échéance le 20/09/2025	80	0,14			
520 StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, échéance le 15/05/2029	377	0,66			
150 Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp, 5,875 %, échéance le 01/03/2027	143	0,25			
320 Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, échéance le 01/09/2026	279	0,49			
190 Tenet Healthcare Corp, 144A, 6,250 %, échéance le 01/02/2027	185	0,32			
450 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, échéance le 15/02/2029	383	0,67			
720 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, échéance le 15/04/2029	639	1,11			
120 Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, échéance le 15/02/2029	103	0,18			
230 VVV International Inc, 144A, 4,500 %, échéance le 15/04/2029	118	0,20			
200 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, échéance le 15/02/2031	200	0,35			
	20 758	36,14			
Total des obligations et bons d'entreprises (coût 49 751 \$)	42 007	73,14			
Obligations et bons d'État — 17,71 % (28 février 2022 : 14,64 %)					
Angola — 0,52 % (28 février 2022 : 0,31 %)					
330 Obligation internationale de l'État angolais, 144A, 8,750 %, échéance le 14/04/2032	297	0,52			
Argentine — 2,30 % (28 février 2022 : 1,65 %)					
161 Obligation internationale de l'État argentin, 1,000 %, échéance le 09/07/2029	50	0,09			
297 Obligation internationale de l'État argentin, 0,500 %, échéance le 09/07/2030	97	0,17			
944 Obligation internationale de l'État argentin, 1,500 %, échéance le 09/07/2035	271	0,47			
1 671 Obligations du gouvernement Provincia de Buenos Aires, 144A, 5,250 %, échéance le 01/09/2037	640	1,11			
340 Provincia de Cordoba, 144A, 6,990 %, échéance le 01/06/2027	263	0,46			
	1 321	2,30			
Bahamas — 0,34 % (28 février 2022 : 0,23 %)					
200 Obligation internationale de l'État des Bahamas, 144A, 5,750 %, échéance le 16/01/2024	193	0,34			
Bahreïn — 0,43 % (28 février 2022 : 0,32 %)					
310 Obligation internationale de l'État du Bahreïn, 144A, 6,000 %, échéance le 19/09/2044	248	0,43			
Costa Rica — 0,34 % (28 février 2022 : 0,24 %)					
200 Obligation internationale de l'État costaricain, 6,125 %, échéance le 19/02/2031	194	0,34			
Côte d'Ivoire — 0,62 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
410 Obligation internationale de l'État ivoirien, 144A, 6,125 %, échéance le 15/06/2033	356	0,62			
République dominicaine — 1,60 % (28 février 2022 : 0,73 %)					
380 Obligation internationale de la République dominicaine, 144A, 4,500 %, échéance le 30/01/2030	328	0,57			
400 Obligation internationale de la République dominicaine, 144A, 7,050 %, échéance le 03/02/2031	400	0,70			
210 Obligation internationale de la République dominicaine, 144A, 6,000 %, échéance le 22/02/2033	191	0,33			
	919	1,60			
Équateur — 0,58 % (28 février 2022 : 0,48 %)					
660 Obligation internationale de l'État équatorien, 144A, coupon zéro, échéance le 31/07/2030	208	0,36			
350 Obligation internationale de l'État équatorien, 144A, 2,500 %, échéance le 31/07/2035	125	0,22			
	333	0,58			
Égypte — 0,89 % (28 février 2022 : 0,71 %)					
300 Obligation internationale de l'État égyptien, 6,588 %, échéance le 21/02/2028	235	0,41			
350 Obligation internationale de l'État égyptien, 144A, 7,600 %, échéance le 01/03/2029	276	0,48			
	511	0,89			
Ghana — 0,45 % (28 février 2022 : 0,60 %)					
360 Obligation internationale de l'État ghanéen, 144A, 10,750 %, échéance le 14/10/2030	256	0,45			
Jordanie — 0,79 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
440 Obligation internationale de l'État jordanien, 144A, 7,750 %, échéance le 15/01/2028	453	0,79			
Kenya — 0,30 % (28 février 2022 : 0,23 %)					
200 Obligation internationale de l'État kényan, 144A, 7,250 %, échéance le 28/02/2028	174	0,30			
Mexique — 1,29 % (28 février 2022 : 1,92 %)					
MXN 10 720 Mexican Bonos, série M, 7,750 %, échéance le 23/11/2034	523	0,91			
MXN 4 680 Mexican Bonos, série M, 7,750 %, échéance le 13/11/2042	220	0,38			
	743	1,29			
Nigeria — 0,40 % (28 février 2022 : 0,34 %)					
300 Obligation internationale de l'État nigérian, 144A, 7,875 %, échéance le 16/02/2032	232	0,40			
Russie — 0,15 % (28 février 2022 : 0,77 %)					
RUB 69 969 Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 19/01/2028 ty	47	0,08			
RUB 61 500 Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 23/05/2029 ty	41	0,07			
	88	0,15			
Sénégal — 0,28 % (28 février 2022 : 0,24 %)					
230 Obligation internationale de l'État sénégalais, 144A, 6,750 %, échéance le 13/03/2048	162	0,28			
Afrique du Sud — 0,32 % (28 février 2022 : 0,26 %)					
250 Obligation internationale de l'État sud-africain, 5,650 %, échéance le 27/09/2047	183	0,32			
Turquie — 1,46 % (28 février 2022 : 1,70 %)					
960 Obligation internationale de l'État turc, 4,250 %, échéance le 14/04/2026	839	1,46			
Ukraine — 0,15 % (28 février 2022 : 0,19 %)					
450 Obligation internationale de l'État ukrainien, 144A, 7,750 %, échéance le 01/09/2028	87	0,15			
États-Unis — 14,05 % (28 février 2022 : 0,08 %)					
100 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 30/09/2023	99	0,17			
500 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,750 %, échéance le 31/12/2023	482	0,84			
200 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,500 %, échéance le 29/02/2024	193	0,34			
500 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 28/02/2027	455	0,79			
750 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 31/05/2029	694	1,21			
700 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,125 %, échéance le 31/08/2029	661	1,15			
	2 584	4,50			
Total des obligations et bons d'État (coût 13 807 \$)	10 173	17,71			
Billets d'emprunt — 0,31 % (28 février 2022 : 3,22 %)					
300 WW International Inc, 8,070 %, échéance le 13/04/2028 *	174	0,31			
Total des billets d'emprunt (coût 221 \$)					
	174	0,31			
Organismes de placement collectif — 0,23 % (28 février 2022 : 7,76 %)					
EUR 1 Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	133	0,23			
Total des organismes de placement collectif (coût 138 \$)					
	133	0,23			

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Bon de souscription — 0,00 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
États-Unis — 0,00 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
4 EG Acquisition Corp	1	—
Total des bons de souscription (coût 4 \$)	1	—
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (coût 64 168 \$)	52 716	91,79
Contrats de change à terme — 0,10 % (28 février 2022 : 0,24 %)		
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	60	0,10
Contrats à terme standardisés — 0,07 % (28 février 2022 : 0,06 %)		
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	38	0,07
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	52 814	91,96
Contrats de change à terme — (0,47 %) (28 février 2022 : (0,17 %))		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(271)	(0,47)
Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	(271)	(0,47)
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	52 543	91,49
Autres éléments de l'actif hors passif	4 888	8,51
Total des actifs nets	57 431 \$	100,00

— Les montants désignés par « — » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 31 064 000 \$, soit 54,09 % de l'actif net.

* Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.

ε Le titre est en défaut à la date de clôture ou à compter de la clôture de l'exercice clos le 28 février 2023 (capital et/ou intérêts).

† Liquidité à compter de l'exercice clos le 28 février 2023.

γ Le titre ne génère plus de revenus pendant et/ou après l'exercice clos le 28 février 2023 en raison de l'incertitude des paiements d'intérêts.

ABRÉVIATIONS :

Perpétuelle — Obligation sans date d'échéance. Les obligations perpétuelles ne sont pas rachetables, mais paient des intérêts réguliers.

EUR — Euro

GBP — Livre britannique

MXN — Peso mexicain

RUB — Rouble russe

	% de l'actif total
Analyse de l'actif total	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	90,17
Autres valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	0,30
Organismes de placement collectif	0,23
Instruments financiers dérivés	0,17
Autres actifs	9,13
Actif total	100,00

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)	Devise de vente (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat USD 159	Vente AUD 232	\$ 5
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat USD 61	Vente EUR 55	—
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat USD 113	Vente GBP 93	—
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat USD 27	Vente GBP 22	—
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat USD 42	Vente SGD 57	—
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat GBP 3 219	Vente USD 3 891	(17)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat EUR 2 333	Vente USD 2 507	(38)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat AUD —	Vente USD —	—
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat AUD 8 098	Vente USD 5 632	(180)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat SGD 2 377	Vente USD 1 794	(30)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat SGD 5	Vente USD 4	—
18 avr. 2023	BNP Paribas	Achat USD 111	Vente EUR 102	2
18 avr. 2023	Citi	Achat USD 751	Vente EUR 695	15
18 avr. 2023	Citi	Achat EUR 100	Vente USD 108	(2)
18 avr. 2023	Citi	Achat GBP 205	Vente USD 251	(4)
18 avr. 2023	Morgan Stanley	Achat USD 2 607	Vente GBP 2 134	38
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 193 \$)				\$ 60
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (139) \$)				(271)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 54 \$)				\$ (211)

Tableau des contrats à terme standardisés

Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
Devise euro, mars 2023	UBS	(23)	\$ (3 045)
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 51 \$)			\$ 38
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : — \$)			—
Plus-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 51 \$)			\$ 38

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — 14,21 % (28 février 2022 : 14,64 %)				IDR 108 875 000	Bon du Trésor indonésien, série FR59, 7,000 % échéance le 15/05/2027	7 262	1,66
Chine — 1,11 % (28 février 2022 : 2,45 %)				IDR 20 000 000	Bon du Trésor indonésien, série FR47, 10,000 % échéance le 15/02/2028	1 508	0,34
1 150	China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd, 3,080 %, perpétuelle *	1 076	0,25	IDR 27 500 000	Bon du Trésor indonésien, série FR64, 6,125 % échéance le 15/05/2028	1 772	0,40
2 500	Coastal Emerald Ltd, 4,300 %, perpétuelle *	2 409	0,55	IDR 100 000 000	Bon du Trésor indonésien, série FR87, 6,500 %, échéance le 15/02/2031	6 449	1,47
2 100	Country Garden Holdings Co Ltd, 3,125 %, échéance le 22/10/2025	1 358	0,31	IDR 114 000 000	Bon du Trésor indonésien, série FR54, 9,500 % échéance le 15/07/2031	8 741	2,00
		4 843	1,11	IDR 25 000 000	Bon du Trésor indonésien, série FR58, 8,250 % échéance le 15/06/2032	1 800	0,41
France — 1,32 % (28 février 2022 : 1,49 %)				IDR 100 000 000	Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia, série OB, 8,250 %, échéance le 15/08/2024	6 719	1,54
SGD 8 000	Credit Agricole SA, 3,800 %, échéance le 30/04/2031 *	5 769	1,32			44 350	10,13
Hong Kong — 0,46 % (28 février 2022 : 1,02 %)				Malaisie — 11,48 % (28 février 2022 : 10,60 %)			
3 000	Panther Ventures Ltd, 3,500 %, perpétuelle	2 025	0,46	MYR 25 000	Obligation de l'État malaisien, série 0115, 3,955 %, échéance le 15/09/2025	5 637	1,29
Inde — 0,80 % (28 février 2022 : 1,92 %)				MYR 1 200	Obligation de l'État malaisien, série 0308, 5,248 %, échéance le 15/09/2028	287	0,07
4 000	REC Ltd, 2,250 %, échéance le 01/09/2026	3 511	0,80	MYR 26 850	Obligation de l'État malaisien, série 0219, 3,885 %, échéance le 15/08/2029	6 000	1,37
Indonésie — 2,30 % (28 février 2022 : 2,25 %)				MYR 78 000	Obligation de l'État malaisien, série 0411, 4,232 %, échéance le 30/06/2031	17 741	4,05
800	Freeport Indonesia PT, 4,763 %, échéance le 14/04/2027	772	0,18	MYR 51 780	Obligation de l'État malaisien, série 0122, 3,582 %, échéance le 15/07/2032	11 226	2,56
3 000	Minejesa Capital BV, 5,625 %, échéance le 10/08/2037	2 402	0,55	MYR 22 510	Obligation de l'État malaisien, série 0413, 3,844 %, échéance le 15/04/2033	4 938	1,13
3 350	Pelabuhan Indonesia Persero PT, 5,375 %, échéance le 05/05/2045	3 093	0,71	MYR 20 360	Obligation de l'État malaisien, série 0419, 3,828 %, échéance le 05/07/2034	4 428	1,01
4 000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 4,125 %, échéance le 15/05/2027	3 785	0,86			50 257	11,48
		10 052	2,30	Philippines — 4,92 % (28 février 2022 : 9,17 %)			
Malaisie — 0,51 % (28 février 2022 : 0,00 %)				PHP 1 256 000	Obligation internationale de l'État philippin, 6,250 %, échéance le 14/01/2036	21 554	4,92
SGD 3 000	Cagamas Global Plc, 3,850 %, échéance le 11/09/2023	2 216	0,51	Singapour — 6,16 % (28 février 2022 : 1,14 %)			
Qatar — 2,05 % (28 février 2022 : 1,94 %)				SGD 2 000	Housing & Development Board, 3,995 %, échéance le 06/12/2029	1 490	0,34
IDR 140 000 000	QNB Finance Ltd, 6,900 %, échéance le 23/01/2025	8 959	2,05	SGD 5 700	Bon de l'Autorité monétaire de Singapour, série 84, coupon zéro, échéance le 03/03/2023	4 226	0,97
Singapour — 3,78 % (28 février 2022 : 1,72 %)				SGD 10 000	Bon de l'Autorité monétaire de Singapour, série 84, coupon zéro, échéance le 10/03/2023	7 409	1,69
SGD 4 500	Mercatus Co-operative Ltd, série DMTN, 2,800 %, échéance le 26/07/2024	3 280	0,75	SGD 11 500	Bon de l'Autorité monétaire de Singapour, série 87, coupon zéro, échéance le 10/04/2023	8 491	1,94
SGD 11 500	Temasek Financial I Ltd, 2,800 %, échéance le 17/08/2071	6 418	1,46	SGD 900	Bon de l'Autorité monétaire de Singapour, série 84, coupon zéro, échéance le 05/05/2023	663	0,15
7 000	United Overseas Bank Ltd, 3,875 %, perpétuelle *	6 873	1,57	SGD 8 250	National Environment Agency, 2,500 %, échéance le 15/09/2051	4 706	1,07
		16 571	3,78			26 985	6,16
Supranational — 1,46 % (28 février 2022 : 1,38 %)				Corée du Sud — 18,25 % (28 février 2022 : 13,87 %)			
IDR 20 000 000	International Bank for Reconstruction & Development, 4,300 %, échéance le 13/09/2023	1 298	0,29	IDR 50 000 000	Export-Import Bank of Korea, 144A, 6,700 %, échéance le 02/12/2024	3 268	0,75
IDR 77 000 000	International Finance Corp, 8,000 %, échéance le 09/10/2023	5 113	1,17	KRW 10 000 000	Bon du Trésor coréen, série 2409, 3,125 %, échéance le 10/09/2024	7 483	1,71
		6 411	1,46	KRW 25 000 000	Bon du Trésor coréen, série 2912, 1,375 %, échéance le 10/12/2029	16 211	3,70
Thaïlande — 0,42 % (28 février 2022 : 0,47 %)				KRW 46 300 000	Bon du Trésor coréen, série 3006, 1,375 %, échéance le 10/06/2030	29 726	6,79
3 000	Thaiol Treasury Center Co Ltd, 3,500 %, échéance le 17/10/2049	1 826	0,42	KRW 22 000 000	Bon du Trésor coréen, série 3206, 3,375 %, échéance le 10/06/2032	16 253	3,71
Total des obligations et bons d'entreprises (coût 70 110 \$)				KRW 13 000 000	Bon du Trésor coréen, série 3909, 1,125 %, échéance le 10/09/2039	6 937	1,59
		62 183	14,21			79 878	18,25
Obligations et bons d'État — 83,94 % (28 février 2022 : 79,61 %)				Thaïlande — 5,38 % (28 février 2022 : 5,13 %)			
Chine — 17,35 % (28 février 2022 : 23,15 %)				THB 801 030	Obligation de l'État thaïlandais, 3,300 %, échéance le 17/06/2038	23 532	5,38
CNY 110 000	Agricultural Development Bank of China, série 1806, 4,650 %, échéance le 11/05/2028	17 157	3,92	États-Unis — 2,23 % (28 février 2022 : 0,00 %)			
HKD 7 500	China Development Bank/Hong Kong, 4,303 %, échéance le 24/01/2024 *	956	0,22	5 400	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,125 %, échéance le 15/12/2023	5 193	1,18
CNY 33 000	Obligation de l'État chinois, 3,380 %, échéance le 21/11/2024	4 810	1,10	5 500	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/02/2048	4 587	1,05
CNY 50 000	Obligation de l'État chinois, série INBK, 2,680 %, échéance le 21/05/2030	7 116	1,63			9 780	2,23
CNY 96 500	Obligation de l'État chinois, 3,600 %, échéance le 21/11/2024	14 390	3,29	Vietnam — 0,34 % (28 février 2022 : 0,00 %)			
CNY 100 000	Obligation de l'État chinois, série INBK, 3,390 %, échéance le 16/03/2050	14 571	3,33	1 500	Obligation internationale de l'État vietnamien, 4,800 %, échéance le 19/11/2024	1 475	0,34
CNY 5 000	Export-Import Bank of China/The, 4,400 %, échéance le 14/05/2024	734	0,17	Total des obligations et bons d'État (coût 420 955 \$)			
CNY 40 000	Export-Import Bank of China/The, série 2007, 3,260 %, échéance le 24/02/2027	5 840	1,33			367 428	83,94
CNY 30 000	Export-Import Bank of China/The, série 1910, 3,860 %, échéance le 20/05/2029	4 525	1,03	Organismes de placement collectif — 0,88 % (28 février 2022 : 2,41 %)			
CNY 40 000	Export-Import Bank of China/The, série 2010, 3,230 %, échéance le 23/03/2030	5 835	1,33	3 862	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	3 862	0,88
		75 934	17,35	Total des organismes de placement collectif (coût 3 862 \$)			
Inde — 7,70 % (28 février 2022 : 8,34 %)						3 862	0,88
INR 280 000	Obligation de l'État indien, 8,150 %, échéance le 24/11/2026	3 461	0,79	Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (coût 494 927 \$)			
INR 750 000	Obligation de l'État indien, série SPB, 8,240 %, échéance le 15/02/2027	9 309	2,13			433 473	99,03
INR 400 000	Obligation de l'État indien, 7,380 %, échéance le 20/06/2027	4 822	1,10	Contrats de change à terme — 0,04 % (28 février 2022 : 0,08 %)			
INR 450 000	Obligation de l'État indien, 7,170 %, échéance le 08/01/2028	5 395	1,23	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)			
INR 700 000	Obligation de l'État indien, 7,610 %, échéance le 09/05/2030	8 547	1,96			162	0,04
INR 190 000	Obligation de l'État indien, 6,570 %, échéance le 05/12/2033	2 149	0,49	Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat			
		33 683	7,70			433 635	99,07
Indonésie — 10,13 % (28 février 2022 : 8,21 %)							
IDR 51 000 000	Bon du Trésor indonésien, série FR77, 8,125 % échéance le 15/05/2024	3 414	0,78				
IDR 96 000 000	Bon du Trésor indonésien, série FR56, 8,375 %, échéance le 15/09/2026	6 685	1,53				

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Contrats de change à terme : (0,26 %) (28 février 2022 : (0,12 %))		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(1 130)	(0,26)
Contrats à terme standardisés — (0,09 %) (28 février 2022 : (0,22 %))		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(373)	(0,09)
Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	(1 503)	(0,35)
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	432 132	98,72
Autres éléments de l'actif hors passif	5 575	1,28
Total des actifs nets	437 707 \$	100,00

– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 3 268 000 \$, soit 0,75 % de l'actif net.

* Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.

ABRÉVIATIONS :

Perpétuelle	– Obligation sans date d'échéance. Les obligations perpétuelles ne sont pas rachetables, mais paient des intérêts réguliers.
CNY	– Renminbi chinois
HKD	– Dollar de Hong Kong
IDR	– Rupiah indonésienne
INR	– Roupie indienne
KRW	– Won sud-coréen
MYR	– Ringgit malaisien
PHP	– Peso philippin
SGD	– Dollar de Singapour
THB	– Baht thaïlandais

	% de l'actif total
Analyse de l'actif total	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	97,33
Organismes de placement collectif	0,87
Instruments financiers dérivés	0,04
Autres actifs	1,76
Actif total	100,00

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)	Devise de vente (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat USD 664	Vente AUD 964	\$ 16
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat USD 10	Vente CHF 10	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat USD 120	Vente CNH 838	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat USD 102	Vente CNH 695	2
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat USD 641	Vente EUR 597	7
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat USD –	Vente SGD –	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat USD 57	Vente SGD 77	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat SGD 2 894	Vente USD 2 184	(37)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat EUR 10 747	Vente USD 11 552	(175)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat CNH 26 081	Vente USD 3 846	(90)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat CHF 279	Vente USD 304	(7)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat AUD 21 725	Vente USD 15 108	(480)
13 juin 2023	Citi	Achat USD 3 514	Vente AUD 5 000	137
13 juin 2023	Citi	Achat AUD 15 000	Vente USD 10 472	(341)
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 378 \$)				\$ 162
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (594) \$)				(1 130)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (216) \$)				\$ (968)

Tableau des contrats à terme standardisés

Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
Obligation de l'État coréen à 10 ans, mars 2023 UBS	124	\$ 10 289	\$ (373)
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : – \$)			\$ –
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (1 113) \$)			(373)
Moins-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (1 113) \$)			\$ (373)

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — 83,61 % (28 février 2022 : 86,23 %)					
Australie — 0,69 % (28 février 2022 : 1,67 %)					
EUR 720 Optus Finance Pty Ltd, 1,000 %, échéance le 20/06/2029	624	0,12			
EUR 3 000 Westpac Banking Corp, 0,625 %, échéance le 22/11/2024	2 992	0,57			
	3 616	0,69			
Canada — 2,72 % (28 février 2022 : 2,64 %)					
EUR 2 200 Bank of Nova Scotia/The, 0,500 %, échéance le 30/04/2024	2 238	0,43			
GBP 1 230 Banque Royale du Canada, 1,375 %, échéance le 09/12/2024	1 388	0,26			
GBP 3 270 Banque Royale du Canada, 5,000 %, échéance le 24/01/2028	3 902	0,74			
EUR 2 110 Toronto-Dominion Bank/The, 0,375 %, échéance le 25/04/2024	2 149	0,41			
GBP 1 980 Toronto-Dominion Bank/The, 2,875 %, échéance le 05/04/2027	2 181	0,42			
GBP 2 000 Toronto-Dominion Bank/The, 5,288 %, échéance le 11/01/2028	2 413	0,46			
	14 271	2,72			
Danemark — 2,09 % (28 février 2022 : 1,91 %)					
EUR 550 Danske Bank A/S, 0,875 %, échéance le 22/05/2023	579	0,11			
1 580 Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, échéance le 12/01/2024	1 576	0,30			
GBP 2 890 Danske Bank A/S, 4,625 %, échéance le 13/04/2027 *	3 407	0,65			
EUR 5 700 Nykredit Realkredit AS, 0,250 %, échéance le 13/01/2026	5 367	1,03			
	10 929	2,09			
France — 6,57 % (28 février 2022 : 9,16 %)					
EUR 300 Air Liquide Finance SA, 1,000 %, échéance le 02/04/2025	301	0,06			
EUR 2 300 APRR SA, 0,125 %, échéance le 18/01/2029	1 985	0,38			
EUR 800 APRR SA, 1,500 %, échéance le 25/01/2030	733	0,14			
GBP 2 600 Banque Fédérative du Crédit Mutuel SA, 1,500 %, échéance le 07/10/2026	2 765	0,53			
230 BNP Paribas SA, 4,705 %, échéance le 10/01/2025 *	228	0,04			
EUR 2 700 BNP Paribas SA, 0,375 %, échéance le 14/10/2027 *	2 480	0,47			
EUR 1 100 BNP Paribas SA, 1,375 %, échéance le 28/05/2029	969	0,18			
GBP 2 600 BNP Paribas SA, 5,750 %, échéance le 13/06/2032	3 155	0,60			
EUR 1 800 Ecopetrol SA, 4,625 %, échéance le 07/06/2032	1 980	0,38			
EUR 1 000 BPCE SA, 1,000 %, échéance le 01/04/2025	994	0,19			
GBP 2 600 BPCE SA, 1,375 %, échéance le 23/12/2026	2 719	0,52			
EUR 300 Credit Agricole SA/Londres, 1,250 %, échéance le 14/04/2026	293	0,06			
6 350 Credit Agricole SA/Londres, 1,907 %, échéance le 16/06/2026 *	5 830	1,11			
EUR 300 Credit Agricole SA/Londres, 1,750 %, échéance le 05/03/2029	275	0,05			
EUR 400 Engie SA, 1,000 %, échéance le 13/03/2026	389	0,07			
EUR 300 Engie SA, 2,375 %, échéance le 19/05/2026	305	0,06			
EUR 1 100 Engie SA, 0,500 %, échéance le 24/10/2030	897	0,17			
EUR 2 200 EssilorLuxottica SA, 0,000 %, échéance le 27/05/2023	2 311	0,44			
EUR 2 400 L'Oréal SA, 0,875 %, échéance le 29/06/2026	2 344	0,45			
EUR 600 RTE Réseau de Transport d'Electricité SADIR, 1,000 %, échéance le 19/10/2026	576	0,11			
EUR 1 100 TotalEnergies Capital International SA, 1,023 %, échéance le 04/03/2027	1 051	0,20			
GBP 1 700 Vinci SA, 2,250 %, échéance le 15/03/2027	1 861	0,36			
	34 441	6,57			
Allemagne — 5,72 % (28 février 2022 : 6,50 %)					
EUR 2 100 adidas AG, 0,000 %, échéance le 09/09/2024	2 103	0,40			
EUR 900 Allianz Finance II BV, 0,000 %, échéance le 14/01/2025	891	0,17			
EUR 700 Allianz Finance II BV, 1,500 %, échéance le 15/01/2030	655	0,12			
EUR 300 BASF SE, 0,875 %, échéance le 15/11/2027	285	0,05			
EUR 600 Clearstream Banking AG, 0,000 %, échéance le 01/12/2025	573	0,11			
EUR 500 Deutsche Boerse AG, 1,125 %, échéance le 26/03/2028	477	0,09			
EUR 1 500 HOWOGE Wohnungs-baugesellschaft mbH, 0,625 %, échéance le 01/11/2028	1 299	0,25			
GBP 6 000 Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,875 %, échéance le 18/07/2024	6 857	1,31			
EUR 300 SAP SE, 1,750 %, échéance le 15/02/2049	299	0,06			
GBP 1 200 Siemens Financieringsmaatschappij NV, 0,875 %, échéance le 05/06/2023	1 429	0,27			
EUR 4 000 Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1,000 %, échéance le 25/02/2030	3 577	0,68			
EUR 3 700 Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3,375 %, échéance le 24/08/2031	3 855	0,74			
EUR 200 Vier Gas Transport GmbH, 1,500 %, échéance le 25/09/2028	187	0,04			
EUR 360 Volkswagen GmbH, 0,750 %, échéance le 15/06/2023	378	0,07			
EUR 920 Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, échéance le 01/10/2024	937	0,18			
GBP 2 000 Volkswagen Financial Services NV, 5,500 %, échéance le 07/12/2026	2 397	0,46			
EUR 2 200 Vonovia SE, 0,375 %, échéance le 16/06/2027	1 959	0,37			
EUR 2 500 Vonovia SE, 0,750 %, échéance le 01/09/2032	1 830	0,35			
	29 988	5,72			
Japon — 1,80 % (28 février 2022 : 2,17 %)					
EUR 550 Mizuho Financial Group Inc, 1,598 %, échéance le 10/04/2028	513	0,10			
EUR 2 150 Nidec Corp, 0,046 %, échéance le 30/03/2026	2 021	0,38			
EUR 3 370 NTT Finance Corp, 0,010 %, échéance le 03/03/2025	3 307	0,63			
EUR 2 000 Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 0,632 %, échéance le 23/10/2029	1 671	0,32			
GBP 1 600 Toyota Motor Finance Netherlands BV, 4,625 %, échéance le 08/06/2026	1 917	0,37			
	9 429	1,80			
Luxembourg — 0,41 % (28 février 2022 : 0,59 %)					
EUR 2 275 Prologis International Funding II SA, 1,750 %, échéance le 15/03/2028	2 125	0,41			
Pays-Bas — 5,25 % (28 février 2022 : 4,36 %)					
EUR 3 000 ABN AMRO Bank NV, 0,875 %, échéance le 15/01/2024	3 103	0,59			
EUR 220 ABN AMRO Bank NV, 1,000 %, échéance le 16/04/2025	221	0,04			
GBP 4 300 ABN AMRO Bank NV, 5,125 %, échéance le 22/02/2028	5 090	0,97			
EUR 1 470 Prosus NV, 2,625 %, échéance le 09/09/2027	1 498	0,29			
GBP 2 500 Cooperatieve Rabobank UA, 1,250 %, échéance le 14/01/2025	2 802	0,53			
EUR 2 300 Cooperatieve Rabobank UA, 0,375 %, échéance le 01/12/2027 *	2 104	0,40			
270 Cooperatieve Rabobank UA/NY, 3,375 %, échéance le 21/05/2025	260	0,05			
EUR 2 010 Enxsis Holding NV, 0,750 %, échéance le 02/07/2031	1 684	0,32			
EUR 300 ING Groep NV, 2,125 %, échéance le 10/01/2026	303	0,06			
EUR 1 300 ING Groep NV, 0,875 %, échéance le 29/11/2030 *	1 081	0,21			
1 780 Shell International Finance BV, 3,250 %, échéance le 11/05/2025	1 715	0,33			
1 700 Shell International Finance BV, 2,750 %, échéance le 06/04/2030	1 493	0,28			
EUR 1 910 TenneT Holding BV, 1,625 %, échéance le 17/11/2026	1 891	0,36			
EUR 2 220 TenneT Holding BV, 1,375 %, échéance le 05/06/2028	2 109	0,40			
EUR 1 000 Vesteda Finance BV, 2,000 %, échéance le 10/07/2026	988	0,19			
EUR 1 500 Vesteda Finance BV, 0,750 %, échéance le 18/10/2031	1 185	0,23			
	27 527	5,25			
Norvège — 1,69 % (28 février 2022 : 0,80 %)					
EUR 940 Avinor AS, 0,750 %, échéance le 01/10/2030	791	0,15			
GBP 2 150 DNB Bank ASA, 4,000 %, échéance le 17/08/2027 *	2 465	0,47			
EUR 3 400 DNB Bank ASA, 3,125 %, échéance le 21/09/2027 *	3 497	0,67			
EUR 1 000 Equinor ASA, 0,750 %, échéance le 22/05/2026	963	0,18			
EUR 540 Equinor ASA, 1,250 %, échéance le 17/02/2027	518	0,10			
EUR 620 Banistmo AS, 2,875 %, échéance le 13/09/2029	629	0,12			
	8 863	1,69			
Singapour — 1,06 % (28 février 2022 : 0,19 %)					
EUR 5 300 Temasek Financial I Ltd, 3,250 %, échéance le 15/02/2027	5 539	1,06			
Espagne — 1,42 % (28 février 2022 : 1,27 %)					
EUR 2 000 Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 3,375 %, échéance le 20/09/2027	2 047	0,39			
GBP 500 Banco Santander SA, 2,750 %, échéance le 12/09/2023	594	0,11			
3 400 Banco Santander SA, 5,294 %, échéance le 18/08/2027	3 333	0,64			
EUR 1 700 Banco Santander SA, 0,625 %, échéance le 24/06/2029 *	1 475	0,28			
	7 449	1,42			
Supranational — 2,06 % (28 février 2022 : 2,73 %)					
GBP 1 440 European Investment Bank, 0,750 %, échéance le 14/07/2023	1 709	0,33			
GBP 6 300 Inter-American Development Bank, 0,500 %, échéance le 15/09/2026	6 635	1,27			
GBP 2 090 International Finance Facility for Immunization Co, 2,750 %, échéance le 07/06/2025	2 418	0,46			
	10 762	2,06			
Suède — 2,08 % (28 février 2022 : 2,26 %)					
EUR 2 190 Hemo Treasury Oyj, 0,000 %, échéance le 19/01/2028	1 858	0,35			
EUR 1 240 Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,050 %, échéance le 01/07/2024	1 249	0,24			
EUR 3 050 Swedbank AB, 0,250 %, échéance le 09/10/2024	3 041	0,58			
EUR 2 250 Swedbank AB, 0,300 %, échéance le 20/05/2027 *	2 084	0,40			
EUR 2 000 Vattenfall AB, 3,750 %, échéance le 18/10/2026	2 115	0,40			
EUR 550 Volvo Treasury AB, 0,125 %, échéance le 17/09/2024	549	0,11			
	10 896	2,08			
Suisse — 3,77 % (28 février 2022 : 4,87 %)					
EUR 1 480 ABB Finance BV, 3,250 %, échéance le 16/01/2027	1 544	0,29			
EUR 800 Cloverie Plc for Zurich Insurance Co Ltd, 1,500 %, échéance le 15/12/2028	746	0,14			
GBP 3 530 Credit Suisse AG/Londres, 1,125 %, échéance le 15/12/2025	3 642	0,69			
500 Credit Suisse AG/New York NY, 3,625 %, échéance le 09/09/2024	473	0,09			
GBP 1 050 Credit Suisse Group AG, 2,125 %, échéance le 12/09/2025 *	1 145	0,22			
EUR 180 Novartis Finance SA, 0,500 %, échéance le 14/08/2023	188	0,04			
EUR 6 000 Novartis Finance SA, 0,000 %, échéance le 23/09/2028	5 242	1,00			
EUR 2 400 UBS Group AG, 2,125 %, échéance le 04/03/2024	2 502	0,48			
4 430 UBS Group AG, 4,703 %, échéance le 05/08/2027 *	4 291	0,82			
	19 773	3,77			
Royaume-Uni — 9,14 % (28 février 2022 : 7,81 %)					
EUR 6 000 AstraZeneca Plc, 3,625 %, échéance le 03/03/2027	6 333	1,21			
GBP 1 700 British Land Co Plc/The, 2,375 %, échéance le 14/09/2029	1 638	0,31			
EUR 400 CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd, 1,250 %, échéance le 13/04/2025	397	0,08			
GBP 1 440 Experian Finance Plc, 0,739 %, échéance le 29/10/2025	1 562	0,30			
EUR 270 GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,250 %, échéance le 21/05/2026	265	0,05			
EUR 550 GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,000 %, échéance le 12/09/2026	534	0,10			
EUR 5 000 GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,375 %, échéance le 12/09/2029	4 609	0,88			
EUR 1 200 GSK Finance BV, 3,125 %, échéance le 28/11/2032	1 202	0,23			
520 HSBC Holdings Plc, 0,875 %, échéance le 06/09/2024	526	0,10			
1 660 HSBC Holdings Plc, 3,803 %, échéance le 11/03/2025 *	1 626	0,31			
390 HSBC Holdings Plc, 1,645 %, échéance le 18/04/2026 *	357	0,07			
1 220 HSBC Holdings Plc, 2,099 %, échéance le 04/06/2026 *	1 123	0,21			
EUR 1 630 HSBC Holdings Plc, série GEN, 0,309 %, échéance le 13/11/2026 *	1 548	0,30			
GBP 300 HSBC Holdings Plc, 3,000 %, échéance le 22/07/2028 *	323	0,06			
EUR 2 100 Linde Plc, 1,000 %, échéance le 31/03/2027 *	2 018	0,38			
EUR 1 000 Lloyds Banking Group Plc, 0,500 %, échéance le 12/11/2025 *	996	0,19			

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
Royaume-Uni — (suite)					
EUR 890 Lloyds Banking Group Plc, 3,500 %, échéance le 01/04/2026 *	927	0,18	EUR 570 Microsoft Corp, 2,700 %, échéance le 12/02/2025	548	0,10
EUR 3 000 Lloyds Banking Group Plc, 3,125 %, échéance le 24/08/2030 *	2 925	0,56	EUR 2 400 Microsoft Corp, 2,400 %, échéance le 08/08/2026	2 227	0,42
EUR 200 London Stock Exchange Group Plc, 0,875 %, échéance le 19/09/2024	203	0,04	EUR 330 Morgan Stanley, 1,375 %, échéance le 27/10/2026	320	0,06
EUR 690 London Stock Exchange Group Plc, 1,750 %, échéance le 06/12/2027	671	0,13	EUR 2 040 Morgan Stanley, 4,813 %, échéance le 25/10/2028 *	2 186	0,42
GBP 1 250 London Stock Exchange Group Plc, 1,625 %, échéance le 06/04/2030	1 219	0,23	EUR 2 790 Morgan Stanley, 0,495 %, échéance le 26/10/2029 *	2 370	0,45
EUR 1 560 Motability Operations Group Plc, 0,125 %, échéance le 20/07/2028	1 364	0,26	GBP 320 Nestle Finance International Ltd, 2,250 %, échéance le 30/11/2023	379	0,07
GBP 990 Nationwide Building Society, 6,178 %, échéance le 07/12/2027 *	1 214	0,23	EUR 680 Nestle Finance International Ltd, 1,500 %, échéance le 01/04/2030	633	0,12
EUR 4 750 NatWest Markets Plc, 1,375 %, échéance le 02/03/2027	4 503	0,86	5 410 NIKE Inc, 2,400 %, échéance le 27/03/2025	5 163	0,99
GBP 1 270 NatWest Markets Plc, 6,375 %, échéance le 08/11/2027	1 585	0,30	1 600 NVIDIA Corp, 2,850 %, échéance le 01/04/2030	1 411	0,27
EUR 1 340 Segro Capital Sarl, 1,250 %, échéance le 23/03/2026	1 292	0,25	EUR 1 510 PepsiCo Inc, 0,250 %, échéance le 06/05/2024	1 538	0,29
EUR 2 200 Segro Capital Sarl, 0,500 %, échéance le 22/09/2031	1 673	0,32	EUR 310 PepsiCo Inc, 0,750 %, échéance le 18/03/2027	293	0,06
580 Standard Chartered Plc, 1,44A, 1,214 %, échéance le 23/03/2025 *	552	0,11	EUR 3 000 PepsiCo Inc, 0,500 %, échéance le 06/05/2028	2 705	0,52
850 Unilever Capital Corp, 3,250 %, échéance le 07/03/2024	833	0,16	GBP 1 260 PepsiCo Inc, 3,200 %, échéance le 22/07/2029	1 394	0,27
EUR 480 Unilever Finance Netherlands BV, 1,250 %, échéance le 25/03/2025	485	0,09	EUR 1 250 Procter & Gamble Co/The, 0,625 %, échéance le 30/10/2024	1 261	0,24
EUR 550 Unilever Finance Netherlands BV, 1,125 %, échéance le 12/02/2027	529	0,10	EUR 350 Prologis Euro Finance LLC, 1,875 %, échéance le 05/01/2029	325	0,06
EUR 2 000 Unilever Finance Netherlands BV, 3,250 %, échéance le 23/02/2031	2 070	0,39	EUR 2 200 Prologis Euro Finance LLC, 1,000 %, échéance le 08/02/2029	1 927	0,37
EUR 810 Wellcome Trust Ltd/The, 1,125 %, échéance le 21/01/2027	780	0,15	EUR 2 600 Public Storage, 0,500 %, échéance le 09/09/2030	2 076	0,40
	47 882	9,14	EUR 3 500 Roche Finance Europe BV, 3,204 %, échéance le 27/08/2029	3 661	0,70
États-Unis — 37,14 % (28 février 2022 : 36,47 %)					
3 500 3M Co, 2,375 %, échéance le 26/08/2029	2 941	0,56	7 000 Roche Holdings Inc, 1,44A, 1,930 %, échéance le 13/12/2028	6 001	1,15
EUR 2 000 Abbott Ireland Financing DAC, 0,375 %, échéance le 19/11/2027	1 833	0,35	570 Salesforce Inc, 3,250 %, échéance le 11/04/2023	569	0,11
1 240 Adobe Inc, 1,900 %, échéance le 01/02/2025	1 171	0,22	400 Sanofi, 1,000 %, échéance le 01/04/2025	402	0,08
1 700 Adobe Inc, 2,150 %, échéance le 01/02/2027	1 546	0,29	1 040 Sanofi, 3,625 %, échéance le 19/06/2028	987	0,19
4 500 Alphabet Inc, 0,800 %, échéance le 15/08/2027	3 840	0,73	EUR 4 900 Sanofi, 1,250 %, échéance le 06/04/2029	4 574	0,87
1 980 Amazon.com Inc, 3,800 %, échéance le 05/12/2024	1 937	0,37	EUR 1 000 Schneider Electric SE, 0,000 %, échéance le 12/06/2023	1 049	0,20
2 200 Amazon.com Inc, 1,200 %, échéance le 03/06/2027	1 901	0,36	EUR 2 400 Schneider Electric SE, 3,125 %, échéance le 13/10/2029	2 480	0,47
5 220 American Express Co, 4,900 %, échéance le 13/02/2026	5 181	0,99	560 Texas Instruments Inc, 1,375 %, échéance le 12/03/2025	522	0,10
340 Apple Inc, 3,200 %, échéance le 13/05/2025	329	0,06	1 150 Texas Instruments Inc, 2,900 %, échéance le 03/11/2027	1 065	0,20
EUR 1 520 Apple Inc, 0,000 %, échéance le 15/11/2025	1 470	0,28	3 850 Texas Instruments Inc, 4,600 %, échéance le 15/02/2028	3 825	0,73
GBP 1 500 Apple Inc, 3,050 %, échéance le 31/07/2029	1 684	0,32	1 630 TJX Cos Inc/The, 1,600 %, échéance le 15/05/2031	1 285	0,25
EUR 800 Bank of America Corp, 3,648 %, échéance le 31/03/2029 *	818	0,16	1 340 Toyota Motor Credit Corp, 0,750 %, échéance le 19/11/2026	1 398	0,27
4 800 Bank of America Corp, 5,015 %, échéance le 22/07/2033 *	4 620	0,88	5 320 Union Pacific Corp, 4,750 %, échéance le 21/02/2026	5 298	1,01
EUR 3 000 Berkshire Hathaway Inc, 1,125 %, échéance le 16/03/2027	2 845	0,54	EUR 2 000 United Parcel Service Inc, 1,625 %, échéance le 15/11/2025	2 010	0,38
EUR 530 BlackRock Inc, 1,250 %, échéance le 06/05/2025	534	0,10	2 800 UnitedHealth Group Inc, 5,350 %, échéance le 15/02/2033	2 866	0,55
EUR 2 550 Blackstone Holdings Finance Co LLC, 1,000 %, échéance le 05/10/2026	2 389	0,46	4 043 Verizon Communications Inc, 4,329 %, échéance le 21/09/2028	3 876	0,74
EUR 2 000 Booking Holdings Inc, 0,100 %, échéance le 08/03/2025	1 963	0,37	540 Visa Inc, 3,150 %, échéance le 14/12/2025	516	0,10
1 276 Bristol-Myers Squibb Co, 2,900 %, échéance le 26/07/2024	1 237	0,24	4 000 Visa Inc, 1,900 %, échéance le 15/04/2027	3 591	0,69
588 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, échéance le 26/07/2029	540	0,10	251 Walmart Inc, 2,375 %, échéance le 24/09/2029	218	0,04
3 000 Caterpillar Inc, 2,600 %, échéance le 09/04/2030	2 618	0,50		194 617	37,14
7 500 Charles Schwab Corp/The, 1,950 %, échéance le 01/12/2031	5 881	1,12	Total des obligations et bons d'entreprises (coût 493 884 \$)	438 107	83,61
2 400 Chevron Corp, 1,554 %, échéance le 11/05/2025	2 229	0,43	Obligations et bons d'État — 14,70 % (28 février 2022 : 12,53 %)		
310 Chubb INA Holdings Inc, 3,350 %, échéance le 03/05/2026	295	0,06	Canada — 0,94 % (28 février 2022 : 0,36 %)		
EUR 1 300 Chubb INA Holdings Inc, 0,875 %, échéance le 15/06/2027	1 212	0,23	GBP 1 200 CPPIB Capital Inc, 0,875 %, échéance le 17/12/2024	1 348	0,26
EUR 800 Chubb INA Holdings Inc, 1,550 %, échéance le 15/03/2028	755	0,14	GBP 3 000 CPPIB Capital Inc, 4,375 %, échéance le 02/03/2026	3 591	0,68
GBP 230 Citigroup Inc, 2,750 %, échéance le 24/01/2024	271	0,05		4 939	0,94
3 420 Citigroup Inc, 3,300 %, échéance le 27/04/2025	3 275	0,62	Pays-Bas — 2,02 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
2 900 Citigroup Inc, 2,572 %, échéance le 03/06/2031 *	2 380	0,45	GBP 8 800 Nederlandse Waterschapsbank NV, 4,500 %, échéance le 18/06/2025	10 591	2,02
EUR 5 000 Coca-Cola Co/The, 0,125 %, échéance le 15/03/2029	4 272	0,82	Corée du Sud — 0,13 % (28 février 2022 : 0,16 %)		
2 600 Colgate-Palmolive Co, 4,800 %, échéance le 02/03/2026	2 602	0,50	EUR 660 Korea Development Bank/The, 0,000 %, échéance le 10/07/2024	662	0,13
EUR 1 300 Colgate-Palmolive Co, 0,500 %, échéance le 06/03/2026	1 260	0,24	Suède — 1,40 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
2 890 Comcast Corp, 3,150 %, échéance le 01/03/2026	2 734	0,52	GBP 6 100 Svensk Exportkredit AB, 4,500 %, échéance le 11/03/2026	7 311	1,40
1 800 Costco Wholesale Corp, 1,375 %, échéance le 20/06/2027	1 573	0,30	États-Unis — 10,21 % (28 février 2022 : 11,76 %)		
2 900 Deere & Co, 3,100 %, échéance le 15/04/2030	2 595	0,50	37 870 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,000 %, échéance le 15/12/2024	35 354	6,75
7 000 Ecolab Inc, 2,125 %, échéance le 01/02/2032	5 590	1,07	5 470 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,500 %, échéance le 15/02/2030	4 646	0,88
2 000 Estee Lauder Cos Inc/The, 2,375 %, échéance le 01/12/2029	1 711	0,33	16 030 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,625 %, échéance le 15/05/2030	12 682	2,42
EUR 5 860 Exxon Mobil Corp, 0,142 %, échéance le 26/06/2024	5 919	1,13	980 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 15/02/2052	830	0,16
2 200 Exxon Mobil Corp, 2,992 %, échéance le 19/03/2025	2 113	0,40		53 512	10,21
780 Exxon Mobil Corp, 3,043 %, échéance le 01/03/2026	739	0,14	Total des obligations et bons d'État (coût 81 847 \$)	77 015	14,70
1 830 Gilead Sciences Inc, 3,650 %, échéance le 01/03/2026	1 748	0,33	Organismes de placement collectif — 3,25 % (28 février 2022 : 1,49 %)		
EUR 1 750 Goldman Sachs Group Inc/The, 0,125 %, échéance le 19/08/2024	1 757	0,34	17 040 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	17 040	3,25
4 500 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,600 %, échéance le 07/02/2030	3 788	0,72	Total des organismes de placement collectif (coût 17 040 \$)	17 040	3,25
2 800 Home Depot Inc/The, 2,500 %, échéance le 15/04/2027	2 561	0,49	Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (coût 592 771 \$)	532 162	101,56
180 Home Depot Inc/The, 2,700 %, échéance le 15/04/2030	156	0,03	Swaps sur risque de crédit — 0,04 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
EUR 1 020 Illinois Tool Works Inc, 0,250 %, échéance le 05/12/2024	1 016	0,19	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	213	0,04
110 Johnson & Johnson, 3,375 %, échéance le 05/12/2023	109	0,02	Contrats de change à terme — 0,71 % (28 février 2022 : 0,94 %)		
3 090 JPMorgan Chase & Co, 4,023 %, échéance le 05/12/2024 *	3 050	0,58	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	3 707	0,71
EUR 320 JPMorgan Chase & Co, 1,500 %, échéance le 29/10/2026	313	0,06	Contrats à terme standardisés — 0,92 % (28 février 2022 : 0,49 %)		
4 400 JPMorgan Chase & Co, 1,045 %, échéance le 19/11/2026 *	3 899	0,74	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	4 839	0,92
240 Kimberly-Clark Corp, 1,050 %, échéance le 15/09/2027	204	0,04	Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	540 921	103,23
910 Kimberly-Clark Corp, 3,950 %, échéance le 01/11/2028	873	0,17	Contrats de change à terme — (0,62 %) (28 février 2022 : (1,05 %))		
1 150 Mars Inc, 2,700 %, échéance le 01/04/2025	1 093	0,21	Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(3 219)	(0,62)
1 700 Mars Inc, 1,44A, 2,700 %, échéance le 01/04/2025	1 615	0,31	Contrats à terme standardisés — (0,01 %) (28 février 2022 : (0,04 %))		
280 Mastercard Inc, 3,375 %, échéance le 01/04/2024	275	0,05	Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(61)	(0,01)
EUR 2 000 Mastercard Inc, 1,000 %, échéance le 22/02/2029	1 829	0,35	Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	(3 280)	(0,63)
EUR 2 550 Medtronic Global Holding SCA, 0,000 %, échéance le 15/10/2025	2 454	0,47			
7 140 Merck & Co Inc, 1,900 %, échéance le 10/12/2028	6 125	1,17			

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
	537 641	102,60
Excédent du passif par rapport aux autres éléments de l'actif	(13 671)	(2,60)
Total des actifs nets	523 970 \$	100,00

– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 9 744 000 \$, soit 1,87 % de l'actif net.

* Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.

ABRÉVIATIONS :

EUR – Euro
GBP – Livre britannique

Analyse de l'actif total	% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	92,83
Organismes de placement collectif	3,07
Instruments financiers dérivés	1,58
Autres actifs	2,52
Actif total	100,00

Tableau des swaps sur risque de crédit

Contrepartie	Entité de référence – protection achat/vente	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Bank of America Merrill Lynch iTraxx Europe, 1,000 % - Vente		20 déc. 2027	22 500	\$ 213
Plus-value latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				\$ 213
Moins-value latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				–
Plus-value nette des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				\$ 213

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)			Devise de vente (en milliers)			Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	107	Vente	AUD	160	\$ –
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	724	Vente	EUR	678	8
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	1 315	Vente	EUR	1 244	(4)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	2 636	Vente	GBP	2 175	15
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	3 618	Vente	GBP	3 026	(21)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	348	Vente	SEK	3 624	1
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	153	Vente	SEK	1 612	(1)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD	14 602	Vente	USD	10 155	(323)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SEK	127 695	Vente	USD	12 094	115
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SEK	9 210	Vente	USD	887	(7)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	241 586	Vente	USD	291 972	(1 298)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	1 240	Vente	USD	1 309	3
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	97 263	Vente	USD	104 508	(1 534)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	1 222	Vente	USD	1 467	3
16 mai 2023	BNP Paribas	Achat	USD	20 220	Vente	EUR	18 812	232
16 mai 2023	BNP Paribas	Achat	USD	4 817	Vente	GBP	4 000	(1)
16 mai 2023	BNP Paribas	Achat	USD	9 693	Vente	GBP	7 998	58
16 mai 2023	Citi	Achat	USD	33 913	Vente	EUR	31 477	468
16 mai 2023	Citi	Achat	USD	12 992	Vente	GBP	10 723	74
16 mai 2023	Citi	Achat	USD	720	Vente	GBP	600	(2)
16 mai 2023	Citi	Achat	EUR	1 756	Vente	USD	1 894	(28)
16 mai 2023	Goldman Sachs	Achat	USD	14 006	Vente	EUR	12 993	200
16 mai 2023	Goldman Sachs	Achat	USD	472	Vente	GBP	390	3
16 mai 2023	Goldman Sachs	Achat	USD	807	Vente	JPY	104 254	33
16 mai 2023	HSBC	Achat	USD	26 768	Vente	EUR	24 819	397
16 mai 2023	JP Morgan	Achat	USD	51 552	Vente	EUR	47 825	737
16 mai 2023	JP Morgan	Achat	USD	9 973	Vente	GBP	8 220	71
16 mai 2023	Morgan Stanley	Achat	USD	35 101	Vente	EUR	32 568	497
16 mai 2023	Royal Bank of Canada	Achat	USD	6 180	Vente	GBP	5 106	29
16 mai 2023	UBS	Achat	USD	37 021	Vente	EUR	34 331	544
16 mai 2023	UBS	Achat	USD	44 416	Vente	GBP	36 688	219
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 4 176 \$)								\$ 3 707
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (4 645) \$)								(3 219)
Plus-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (469) \$)								\$ 488

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats à terme standardisés

	Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
Euro-Bobl, mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	(634)	\$ (77 238)	\$ 2 071
Euro-Bund mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	(255)	(35 848)	2 391
Obligation japonaise 10 ans (OSE), mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	(12)	(12 925)	138
Long Gilt juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(146)	(17 554)	239
U.S. 10 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	164	18 312	(4)
U.S. 5 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	142	15 202	(57)
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 2 194 \$)				\$ 4 839
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (181) \$)				(61)
Plus-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 2 013 \$)				\$ 4 778

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques — 10,40 % (28 février 2022 : 6,46 %)					
300 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 4,000 % ±	282	0,19	75 Ginnie Mae II Pool, '858546', 2,500 %, échéance le 20/12/2050	63	0,04
500 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 4,500 % ±	482	0,33	83 Ginnie Mae II Pool, 'BT1888', 2,500 %, échéance le 20/12/2050	71	0,05
2 200 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 % ±	1 864	1,27	95 Ginnie Mae II Pool, 'BZ4350', 2,500 %, échéance le 20/03/2051	82	0,06
1 500 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 3,000 % ±	1 320	0,90	80 Ginnie Mae II Pool 'CD8312', 2,500 %, échéance le 20/05/2051	68	0,05
100 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 3,500 % ±	91	0,06	136 Ginnie Mae II Pool 'MA1995', 3,500 %, échéance le 20/06/2044	127	0,09
200 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 5,000 % ±	197	0,13	15 Ginnie Mae II Pool, 'MA3597', 3,500 %, échéance le 20/04/2046	14	0,01
400 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 5,500 % ±	399	0,27	15 Ginnie Mae II Pool, 'MA3736', 3,500 %, échéance le 20/06/2046	14	0,01
4 Fannie Mae Pool '255984', 4,500 %, échéance le 01/11/2025	4	—	19 Ginnie Mae II Pool, 'MA4068', 3,000 %, échéance le 20/11/2046	17	0,01
10 Fannie Mae Pool '975097', 5,000 %, échéance le 01/06/2038	10	0,01	14 Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, échéance le 20/06/2047	13	0,01
56 Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500 %, échéance le 01/01/2043	52	0,04	4 Ginnie Mae II Pool, 'MA4836', 3,000 %, échéance le 20/11/2047	4	—
10 Fannie Mae Pool 'AL3572', 5,000 %, échéance le 01/07/2041	10	0,01	15 Ginnie Mae II Pool, 'MA4838', 4,000 %, échéance le 20/11/2047	15	0,01
73 Fannie Mae Pool 'AL7093', 4,000 %, échéance le 01/05/2045	72	0,05	53 Ginnie Mae II Pool 'MA5019', 3,500 %, échéance le 20/02/2048	49	0,03
19 Fannie Mae Pool 'AM8700', 2,930 %, échéance le 01/06/2030	17	0,01	11 Ginnie Mae II Pool 'MA5137', 4,000 %, échéance le 20/04/2048	11	0,01
23 Fannie Mae Pool 'AS4271', 4,500 %, échéance le 01/01/2045	23	0,02	61 Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500 %, échéance le 20/05/2048	60	0,04
53 Fannie Mae Pool 'AS8951', 3,500 %, échéance le 01/03/2047	49	0,03	21 Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500 %, échéance le 20/06/2048	21	0,01
17 Fannie Mae Pool 'AS9760', 4,500 %, échéance le 01/06/2047	17	0,01	30 Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, échéance le 20/07/2048	29	0,02
307 Fannie Mae Pool 'AX0756', 3,500 %, échéance le 01/07/2044	288	0,20	10 Ginnie Mae II Pool 'MA5467', 4,500 %, échéance le 20/09/2048	10	0,01
33 Fannie Mae Pool 'BC9077', 3,500 %, échéance le 01/12/2046	31	0,02	42 Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500 %, échéance le 20/10/2048	41	0,03
100 Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000 %, échéance le 01/12/2037	92	0,06	26 Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500 %, échéance le 20/01/2049	25	0,02
104 Fannie Mae Pool 'BK7700', 4,500 %, échéance le 01/10/2048	103	0,07	76 Ginnie Mae II Pool 'MA7312', 2,500 %, échéance le 20/04/2051	66	0,05
38 Fannie Mae Pool 'BM4897', 4,500 %, échéance le 01/12/2046	36	0,02	249 Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, arrivant à échéance le 20/09/2051	223	0,15
20 Fannie Mae Pool 'BM6898', 2,149 %, échéance le 01/02/2032 *	17	0,01	600 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 2,500 % ±	519	0,35
29 Fannie Mae Pool 'BN1623', 4,500 %, échéance le 01/11/2048	28	0,02	500 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 3,000 % ±	447	0,30
35 Fannie Mae Pool 'BP1585', 3,500 %, échéance le 01/01/2050	32	0,02	300 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 4,000 % ±	284	0,19
75 Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, échéance le 01/02/2051	63	0,04	500 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 4,500 % ±	485	0,33
79 Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, échéance le 01/02/2051	66	0,05	600 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 5,000 % ±	593	0,40
86 Fannie Mae Pool 'BR4393', 2,000 %, échéance le 01/03/2051	71	0,05	200 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 5,500 % ±	201	0,14
267 Fannie Mae Pool 'BU1030', 2,000 %, échéance le 01/11/2051	220	0,15	98 Government National Mortgage Association, série 2022 3, catégorie IO, 0,640 %, échéance le 16/02/2061 *	5	—
48 Fannie Mae Pool 'CA2047', 4,500 %, échéance le 01/07/2048	47	0,03	Total des titres adossés à des hypothèques (coût 16 475 \$)	15 254	10,40
96 Fannie Mae Pool 'CA2199', 4,500 %, échéance le 01/08/2048	95	0,07	Obligations et bons d'entreprises — 28,56 % (28 février 2022 : 25,27 %)		
46 Fannie Mae Pool 'CA2482', 4,500 %, échéance le 01/10/2048	45	0,03	Belgique — 0,24 % (28 février 2022 : 0,32 %)		
288 Fannie Mae Pool 'CA6672', 2,000 %, échéance le 01/07/2050	237	0,16	260 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, échéance le 01/02/2046	239	0,16
25 Fannie Mae Pool 'FM1193', 3,500 %, échéance le 01/06/2049	23	0,02	110 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, échéance le 01/06/2040	97	0,07
136 Fannie Mae Pool 'FM1578', 3,500 %, échéance le 01/09/2034	130	0,09	15 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, échéance le 15/04/2048	13	0,01
84 Fannie Mae Pool 'FM1579', 3,500 %, échéance le 01/10/2034	80	0,06		349	0,24
154 Fannie Mae Pool 'FM1727', 5,000 %, échéance le 01/09/2049	154	0,11	Bésil — 0,66 % (28 février 2022 : 0,12 %)		
72 Fannie Mae Pool 'FM3215', 3,500 %, échéance le 01/01/2049	67	0,05	230 Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, échéance le 01/02/2029	220	0,15
318 Fannie Mae Pool 'FM3347', 3,500 %, échéance le 01/05/2047	296	0,20	940 Suzano Austria GmbH, série DM3N, 3,125 %, échéance le 15/01/2032	741	0,51
47 Fannie Mae Pool 'FM4737', 3,500 %, échéance le 01/09/2050	44	0,03		961	0,66
279 Fannie Mae Pool 'FM7786', 4,000 %, échéance le 01/01/2049	267	0,18	Canada — 1,09 % (28 février 2022 : 0,12 %)		
84 Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500 %, échéance le 01/07/2051	72	0,05	130 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,875 %, échéance le 15/01/2028	116	0,08
88 Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500 %, échéance le 01/07/2051	76	0,05	130 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500 %, échéance le 15/02/2029	110	0,08
87 Fannie Mae Pool 'FM8864', 2,500 %, échéance le 01/10/2051	75	0,05	EUR 750 Banque de Montréal, 2,750 %, échéance le 15/06/2027	752	0,51
630 Fannie Mae Pool 'FM9579', 2,000 %, échéance le 01/07/2051	515	0,35	GBP 540 Banque Royale du Canada, 3,625 %, échéance le 14/06/2027	614	0,42
185 Fannie Mae Pool 'FS0331', 3,000 %, échéance le 01/01/2052	163	0,11		1 592	1,09
95 Fannie Mae Pool 'FS0352', 2,000 %, échéance le 01/01/2052	77	0,05	Chine — 0,01 % (28 février 2022 : 0,01 %)		
92 Fannie Mae Pool 'FS0424', 2,500 %, échéance le 01/01/2052	79	0,05	20 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2,700 %, échéance le 01/05/2025	19	0,01
95 Fannie Mae Pool 'FS0520', 3,000 %, échéance le 01/02/2052	85	0,06	Danemark — 0,54 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
94 Fannie Mae Pool 'FS0523', 2,500 %, échéance le 01/02/2052	80	0,06	840 Danske Bank A/S, 144A, 4,298 %, échéance le 01/04/2028 *	792	0,54
92 Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, échéance le 01/02/2052	76	0,05	France — 0,92 % (28 février 2022 : 0,53 %)		
94 Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, échéance le 01/06/2049	87	0,06	330 Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, échéance le 15/10/2029	259	0,18
75 Fannie Mae Pool 'MA4158', 2,000 %, échéance le 01/10/2050	62	0,04	200 BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, échéance le 09/06/2026 *	185	0,12
87 Fannie Mae Pool 'MA4325', 2,000 %, échéance le 01/05/2051	71	0,05	300 BNP Paribas SA, 1,875 %, échéance le 14/12/2027	308	0,21
66 Freddie Mac Gold Pool 'C91987', 3,000 %, échéance le 01/04/2038	60	0,04	500 BNP Paribas SA, 0,500 %, échéance le 30/05/2028 *	450	0,31
22 Freddie Mac Gold Pool 'G67721', 4,500 %, échéance le 01/04/2049	21	0,02	200 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 4,750 %, échéance le 17/09/2044	141	0,10
19 Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 2,091 %, échéance le 01/03/2047 *	18	0,01		1 343	0,92
42 Freddie Mac Pool 'QA7238', 3,500 %, échéance le 01/02/2050	39	0,03	Allemagne — 1,15 % (28 février 2022 : 1,27 %)		
75 Freddie Mac Pool 'Q88604', 2,000 %, échéance le 01/02/2051	62	0,04	GBP 250 E.ON International Finance BV, 5,625 %, échéance le 06/12/2023	302	0,20
178 Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500 %, échéance le 01/08/2051	153	0,10	EUR 500 Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG/Munich, 3,250 %, échéance le 26/05/2049 *	478	0,33
83 Freddie Mac Pool 'QC6768', 3,000 %, échéance le 01/09/2051	73	0,05	EUR 890 Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, échéance le 01/10/2024	906	0,62
93 Freddie Mac Pool 'QD6079', 2,500 %, échéance le 01/02/2052	80	0,05		1 686	1,15
36 Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, échéance le 01/10/2041	29	0,02	Israël — 0,58 % (28 février 2022 : 0,46 %)		
75 Freddie Mac Pool, 'SD0573', 2,000 %, échéance le 01/04/2051	63	0,04	30 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, échéance le 01/10/2026	26	0,02
86 Freddie Mac Pool, 'SD0653', 2,500 %, échéance le 01/07/2051	73	0,05	200 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,750 %, échéance le 01/03/2028	193	0,13
183 Freddie Mac Pool, 'SD0809', 3,000 %, échéance le 01/01/2052	161	0,11	720 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, échéance le 09/05/2029	638	0,43
363 Freddie Mac Pool, 'SD1218', 4,000 %, échéance le 01/07/2049	347	0,24		857	0,58
182 Freddie Mac Pool, 'SD7548', 2,500 %, échéance le 01/11/2051	156	0,11			
258 Freddie Mac Pool 'SD8146', 2,000 %, échéance le 01/05/2051	211	0,14			
66 Freddie Mac Pool 'ZA6680', 4,000 %, échéance le 01/04/2049	63	0,04			
63 Freddie Mac Pool 'ZS3204', 5,000 %, échéance le 01/06/2041	63	0,04			
126 Freddie Mac Pool 'ZS3940', 4,500 %, échéance le 01/06/2038	125	0,09			
36 Freddie Mac Pool 'ZS4720', 4,500 %, échéance le 01/05/2047	35	0,02			
52 Ginnie Mae I Pool '783669', 3,000 %, échéance le 15/09/2042	48	0,03			
362 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, échéance le 15/06/2048	343	0,23			
19 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, échéance le 15/09/2042	17	0,01			
11 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, échéance le 15/09/2042	10	0,01			
46 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, échéance le 15/10/2042	42	0,03			
30 Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000 %, échéance le 15/10/2042	28	0,02			
26 Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000 %, échéance le 15/11/2042	24	0,02			
17 Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500 %, échéance le 20/10/2049	16	0,01			
79 Ginnie Mae II Pool '785218', 2,000 %, échéance le 20/12/2050	66	0,05			
155 Ginnie Mae II Pool '785219', 2,000 %, échéance le 20/12/2050	129	0,09			
82 Ginnie Mae II Pool '785220', 2,000 %, échéance le 20/12/2050	69	0,05			
161 Ginnie Mae II Pool '785221', 2,000 %, échéance le 20/12/2050	134	0,09			

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)							
Italie — 0,74 % (28 février 2022 : 0,60 %)							
EUR	1 100	UniCredit SpA, 1,200 %, échéance le 20/01/2026 *	1 090	0,74		271	0,18
Luxembourg — 0,42 % (28 février 2022 : 0,34 %)							
EUR	620	Logicor Financing Sarl, 1,625 %, échéance le 15/07/2027	549	0,37		117	0,08
EUR	100	Logicor Financing Sarl, 2,000 %, échéance le 17/01/2034	72	0,05			
			621	0,42		86	0,06
Macao — 0,12 % (28 février 2022 : 0,09 %)							
	200	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, échéance le 26/08/2028	171	0,12		88	0,06
Mexique — 0,08 % (28 février 2022 : 0,00 %)							
	130	Southern Copper Corp, 5,250 %, échéance le 08/11/2042	122	0,08		404	0,27
Pays-Bas — 0,97 % (28 février 2022 : 1,25 %)							
EUR	200	ING Groep NV, 3,000 %, échéance le 11/04/2028 *	212	0,14		172	0,12
EUR	900	ING Groep NV, 2,500 %, échéance le 15/02/2029 *	926	0,63		117	0,08
	80	Shell International Finance BV, 2,750 %, échéance le 06/04/2030	70	0,05		130	0,09
	200	Shell International Finance BV, 4,375 %, échéance le 11/05/2045	177	0,12		117	0,08
	60	Shell International Finance BV, 3,250 %, échéance le 06/04/2050	44	0,03		336	0,23
			1 429	0,97		248	0,17
Afrique du Sud — 0,44 % (28 février 2022 : 0,36 %)							
EUR	640	Anglo American Capital Plc, 1,625 %, échéance le 18/09/2025	642	0,44		200	0,14
Suède — 0,61 % (28 février 2022 : 0,37 %)							
	200	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 6,875 %, perpétuelle *	196	0,13		88	0,06
EUR	660	Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, échéance le 02/03/2028 *	698	0,48		75	0,05
			894	0,61		97	0,07
Suisse — 1,41 % (28 février 2022 : 1,20 %)							
EUR	290	Credit Suisse Group AG, 3,250 %, échéance le 02/04/2026 *	281	0,19		53	0,04
EUR	100	Credit Suisse Group AG, 1,000 %, échéance le 24/06/2027 *	85	0,06		233	0,16
	250	Credit Suisse Group AG, 144A, 4,194 %, échéance le 01/04/2031 *	198	0,13		41	0,03
EUR	1 470	UBS Group AG, 1,500 %, échéance le 30/11/2024	1 508	1,03		35	0,02
			2 072	1,41		170	0,12
Émirats arabes unis — 0,50 % (28 février 2022 : 0,81 %)							
	530	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd, 2,625 %, échéance le 31/03/2036	421	0,29		256	0,17
EUR	400	MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000 %, échéance le 10/03/2034	315	0,21		180	0,11
			736	0,50		135	0,09
Royaume-Uni — 2,96 % (28 février 2022 : 2,26 %)							
GBP	670	Aviva Plc, 6,125 %, échéance le 14/11/2036 *	808	0,55		350	0,24
GBP	100	Aviva Plc, 5,125 %, échéance le 04/06/2050 *	110	0,08		40	0,02
GBP	100	BUPA Finance Plc, 5,000 %, échéance le 25/04/2023	120	0,08	EUR	290	0,19
	565	HSBC Holdings Plc, 4,250 %, échéance le 18/08/2025	545	0,38		360	0,20
EUR	550	HSBC Holdings Plc, 3,019 %, échéance le 15/06/2027 *	555	0,38		130	0,09
GBP	100	HSBC Holdings Plc, 7,000 %, échéance le 07/04/2038	123	0,08		120	0,08
GBP	1 000	Lloyds Banking Plc, 7,625 %, échéance le 22/04/2025	1 264	0,86		350	0,24
GBP	260	Scottish Widows Ltd, 5,500 %, échéance le 16/06/2023	313	0,21		40	0,02
EUR	140	Segro Capital Sarl, 1,875 %, échéance le 23/03/2030	125	0,09		120	0,08
	460	Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, échéance le 15/07/2031	381	0,26		60	0,03
			4 344	2,96		70	0,03
États-Unis — 15,12 % (28 février 2022 : 14,08 %)							
	100	3M Co, 3,700 %, échéance le 15/04/2050	78	0,05		20	0,01
EUR	120	AbbVie Inc, 1,500 %, échéance le 15/11/2023	125	0,08		180	0,10
	100	AbbVie Inc, 3,800 %, échéance le 15/03/2025	97	0,07		330	0,21
	80	AbbVie Inc, 3,200 %, échéance le 21/11/2029	71	0,05		10	0,01
	120	AbbVie Inc, 4,875 %, échéance le 14/11/2048	110	0,07		100	0,01
	320	AbbVie Inc, 4,250 %, échéance le 21/11/2049	267	0,18		100	0,01
	80	Amazon.com Inc, 4,250 %, échéance le 22/08/2057	69	0,05		76	0,05
	40	American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, échéance le 15/01/2032	33	0,02		235	0,16
	150	AT&T Inc, 2,250 %, échéance le 01/02/2032	117	0,08		434	0,30
	184	AT&T Inc, 4,500 %, échéance le 09/03/2048	152	0,10		18	0,01
	120	AT&T Inc, 3,500 %, échéance le 15/09/2053	83	0,06		70	0,05
	34	AT&T Inc, 3,650 %, échéance le 15/09/2059	23	0,02		8	0,01
	580	Ball Corp, 3,125 %, échéance le 15/09/2031	465	0,32		69	0,05
	160	Bank of America Corp, 4,250 %, échéance le 22/10/2026	154	0,10		138	0,09
	945	Bank of America Corp, 2,592 %, échéance le 27/04/2031 *	781	0,53		30	0,02
	610	Bank of America Corp, 5,015 %, échéance le 22/07/2033 *	587	0,40		110	0,07
	27	Becton Dickinson and Co, 3,734 %, échéance le 15/12/2024	26	0,02		106	0,07
	220	BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, échéance le 06/04/2030	202	0,14		661	0,45
	130	Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, échéance le 15/11/2035	96	0,06		300	0,22
	140	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, échéance le 01/05/2032	111	0,07		280	0,18
	330	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, échéance le 15/01/2034	247	0,17		140	0,09
	130	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, échéance le 23/07/2025	127	0,09		260	0,15
	60	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, échéance le 15/03/2028	55	0,04		280	0,16
						23	0,01
						92	0,06
						27	0,02
						40	0,03
						9	0,01
						230	0,16
						306	0,21
						838	0,57
						54	0,04
						290	0,20

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
États-Unis — (suite)					
EUR 271	Prologis Euro Finance LLC, 1,500 %, échéance le 08/02/2034	215	0,15		
180	Southwestern Energy Co, 4,750 %, échéance le 01/02/2032	155	0,10		
10	Sprint Capital Corp, 8,750 %, échéance le 15/03/2032	12	0,01		
4	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, échéance le 16/12/2039	4	—		
90	Texas Instruments Inc, 1,750 %, échéance le 04/05/2030	74	0,05		
100	Time Warner Cable LLC, 7,300 %, échéance le 01/07/2038	100	0,07		
40	Time Warner Cable LLC, 6,750 %, échéance le 15/06/2039	39	0,03		
30	T-Mobile USA Inc, 2,250 %, échéance le 15/02/2026	27	0,02		
90	T-Mobile USA Inc, 2,625 %, échéance le 15/02/2029	77	0,05		
240	T-Mobile USA Inc, 3,875 %, échéance le 15/04/2030	218	0,15		
60	T-Mobile USA Inc, 2,875 %, échéance le 15/02/2031	50	0,03		
100	T-Mobile USA Inc, 3,500 %, échéance le 15/04/2031	87	0,06		
150	T-Mobile USA Inc, 2,700 %, échéance le 15/03/2032	122	0,08		
140	T-Mobile USA Inc, 3,000 %, échéance le 15/02/2041	98	0,07		
50	United Rentals North America Inc, 5,250 %, échéance le 15/01/2030	47	0,03		
80	United Rentals North America Inc, 4,000 %, échéance le 15/07/2030	71	0,05		
670	United Rentals North America Inc, 3,875 %, échéance le 15/02/2031	574	0,39		
70	United Rentals North America Inc, 3,750 %, échéance le 15/01/2032	59	0,04		
440	UnitedHealth Group Inc, 5,350 %, échéance le 15/02/2033	450	0,31		
380	Verizon Communications Inc, 2,355 %, échéance le 15/03/2032	299	0,20		
190	Verizon Communications Inc, 4,500 %, échéance le 10/08/2033	177	0,12		
50	Verizon Communications Inc, 5,250 %, échéance le 16/03/2037	49	0,03		
10	Verizon Communications Inc, 4,862 %, échéance le 21/08/2046	9	0,01		
10	Verizon Communications Inc, 5,500 %, échéance le 16/03/2047	10	0,01		
90	Visa Inc, 2,700 %, échéance le 15/04/2040	68	0,05		
340	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, échéance le 15/02/2028	300	0,20		
180	Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,141 %, échéance le 15/03/2052	141	0,10		
220	Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,391 %, échéance le 15/03/2062	172	0,12		
840	Wells Fargo & Co, 4,897 %, échéance le 25/07/2033 *	803	0,55		
810	Wells Fargo & Co, 5,013 %, échéance le 04/04/2051 *	747	0,51		
		22 184	15,12		
Total des obligations et bons d'entreprises (coût 48 153 \$)			41 904	28,56	
Obligations et bons d'État — 53,61 % (28 février 2022 : 56,78 %)					
Belgique — 0,56 % (28 février 2022 : 0,81 %)					
EUR 760	Obligation de l'État belge, série 71, 3,750 %, échéance le 22/06/2045	828	0,56		
Brésil — 1,50 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
BRL 1 000	Brazil Notas do Tesouro Serie B, série NTN-B, 6,000 %, échéance le 15/05/2035 β	749	0,51		
BRL 9 000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTN-F, 10,000 %, échéance le 01/01/2031	1 455	0,99		
		2 204	1,50		
Canada — 1,63 % (28 février 2022 : 1,44 %)					
CAD 1 640	Obligation de l'État canadien, 2,250 %, échéance le 01/06/2025	1 159	0,79		
CAD 1 030	Province of Ontario Canada, 3,450 %, échéance le 02/06/2045	667	0,46		
CAD 860	Province de Québec Canada, 3,500 %, échéance le 01/12/2045	562	0,38		
		2 388	1,63		
France — 2,99 % (28 février 2022 : 0,87 %)					
EUR 840	Obligation de l'État français, OAT, 4,250 %, échéance le 25/10/2023	895	0,61		
EUR 1 670	Obligation de l'État français, OAT, 0,000 %, échéance le 25/05/2032	1 336	0,91		
EUR 1 400	Obligation de l'État français, OAT, 2,000 %, échéance le 25/11/2032	1 345	0,92		
EUR 870	Obligation de l'État français, OAT, 144A, 1,500 %, échéance le 25/05/2050	615	0,42		
EUR 160	Obligation de l'État français, OAT, 4,000 %, échéance le 25/04/2060	190	0,13		
		4 381	2,99		
Allemagne — 2,84 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
EUR 2 980	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, échéance le 15/08/2028	2 769	1,89		
EUR 1 430	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, échéance le 15/08/2032	1 400	0,95		
		4 169	2,84		
Indonésie — 1,19 % (28 février 2022 : 2,60 %)					
IDR 23 602 000	Bon du Trésor indonésien, série FR79, 8,375 %, échéance le 15/04/2039	1 740	1,19		
Italie — 0,99 % (28 février 2022 : 1,48 %)					
EUR 1 680	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Série 31Y, 3,250 %, échéance le 01/09/2046	1 448	0,99		
Japon — 5,86 % (28 février 2022 : 6,43 %)					
JPY 185 550	Obligation à dix ans de l'État japonais, série 342, 0,100 %, échéance le 20/03/2026	1 366	0,93		
JPY 78 450	Obligation à dix ans de l'État japonais, série 350, 0,100 %, échéance le 20/03/2028	573	0,39		
JPY 29 700	Obligation à trente ans de l'État Japonais, série 59, 0,700 %, échéance le 20/06/2048	188	0,13		
JPY 536 600	Obligation à trente ans de l'État Japonais, série 66, 0,400 %, échéance le 20/03/2050	3 068	2,09		
JPY 339 100	Obligation indexée sur l'IPC de l'État japonais, série 21, 0,100 %, échéance le 10/03/2026 β	2 397	1,64		
JPY 143 700	Obligation indexée sur l'IPC de l'État japonais, série 23, 0,100 %, échéance le 10/03/2028 β	1 002	0,68		
		8 594	5,86		
Mexique — 4,03 % (28 février 2022 : 3,78 %)					
MXN 83 640	Mexican Bonos, série M, 7,750 %, échéance le 13/11/2042	3 922	2,67		
EUR 360	Obligation internationale de l'État mexicain, 2,875 %, échéance le 08/04/2039	275	0,19		
	830 Obligation internationale de l'État mexicain, 5,550 %, échéance le 21/01/2045	767	0,52		
	1 180 Obligation internationale de l'État mexicain, 4,600 %, échéance le 23/01/2046	950	0,65		
		5 914	4,03		
Pays-Bas — 0,51 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
EUR 970	ABN AMRO Bank NV, 0,010 %, échéance le 05/10/2032	751	0,51		
Pologne — 1,32 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
PLN 12 700	Obligation de l'État polonais, série 0432, 1,750 %, échéance le 25/04/2032	1 942	1,32		
Afrique du Sud — 1,55 % (28 février 2022 : 1,61 %)					
ZAR 66 492	Obligation de l'État sud-africain, série R214, 6,500 %, échéance le 28/02/2041	2 282	1,55		
Corée du Sud — 1,23 % (28 février 2022 : 1,01 %)					
KRW 2 533 840	Bon du Trésor coréen, série 2606, 1,875 %, échéance le 10/06/2026	1 808	1,23		
Espagne — 1,44 % (28 février 2022 : 2,07 %)					
EUR 500	Obligation de l'État espagnol, 144A, 5,150 %, échéance le 31/10/2044	623	0,43		
EUR 1 750	Obligation de l'État espagnol, série 30Y, 144A, 2,700 %, échéance le 31/10/2048	1 484	1,01		
		2 107	1,44		
Émirats arabes unis — 0,50 % (28 février 2022 : 0,71 %)					
	890 Obligation internationale du gouvernement d'Abou Dhabi, 3,875 %, échéance le 16/04/2050	735	0,05		
Royaume-Uni — 5,56 % (28 février 2022 : 2,24 %)					
GBP 4 620	Fonds d'État du Royaume-Uni, 4,250 %, échéance le 07/06/2032	5 795	3,95		
GBP 1 030	Fonds d'État du Royaume-Uni, 4,250 %, échéance le 07/12/2040	1 255	0,86		
GBP 710	Fonds d'État du Royaume-Uni, 2,500 %, échéance le 22/07/2065	609	0,41		
GBP 340	United Kingdom Inflation-Linked Gilt, Series 3MO, 0,125 %, échéance le 22/03/2068 β	497	0,34		
		8 156	5,56		
États-Unis — 19,91 % (28 février 2022 : 29,33 %)					
	3 200 Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 30/11/2023	3 085	2,10		
	16 740 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 1,125 %, échéance le 28/02/2052	15 579	10,62		
	3 000 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 0,375 %, échéance le 30/04/2052	2 734	1,86		
	42 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 0,250 %, échéance le 30/06/2052	38	0,03		
	4 570 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 0,250 %, échéance le 31/08/2052	4 105	2,80		
	580 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 15/11/2052	462	0,32		
	2 300 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2049 ≠	1 882	1,28		
	1 590 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2052	1 302	0,89		
	20 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/08/2052	17	0,01		
		29 204	19,91		
Total des obligations et bons d'État (coût 91 180 \$)				78 651	53,61
Organismes de placement collectif — 7,65 % (28 février 2022 : 10,08 %)					
	767 Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class LM	10 921	7,45		
	2 Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – LM Class US\$ Accumulating	296	0,20		
Total des organismes de placement collectif (coût 10 882 \$)				11 217	7,65
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (coût 166 690 \$)				147 026	100,22

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Contrats (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Options achetées — 0,01 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
– U.S. 10 Year, avril 2023, achat 114,00, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	5	–
2 990 Achat USD/vente MXN 19,25, échéance le 14/04/2023 – JP Morgan	14	0,01
Total des options achetées (coût 36 \$)	19	0,01
Contrats de change à terme — (0,69 %) (28 février 2022 : 0,89 %)		
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	1 011	0,69
Contrats à terme standardisés — (0,23 %) (28 février 2022 : 0,41 %)		
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	338	0,23
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	148 394	101,15
Contrats (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Options souscrites — (0,00 %) (28 février 2022 : 0,00 %)		
– U.S. 10 Year April 2023 Put 109,00, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(4)	–
Total des options souscrites (coût (4) \$)	(4)	–
Contrats de change à terme — (1,43 %) (28 février 2022 : (0,94 %))		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(2 097)	(1,43)
Contrats à terme standardisés — (0,71 %) (28 février 2022 : (0,57 %))		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(1 043)	(0,71)
Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	(3 144)	(2,14)
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	145 250	99,01
Autres éléments de l'actif hors passif	1 453	0,99
Total des actifs nets	146 703 \$	100,00

- Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.
- 144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 8 227 000 \$, soit 5,61 % de l'actif net.
- * Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.
- ± Le titre (dans sa totalité ou en partie) est nanti en tant que sûreté au titre de transactions sur produits dérivés au 28 février 2023.
- ± Titres achetés sur la base d'une détermination future.
- β Le taux d'intérêt de ce type de titre est lié à l'indice des prix à la consommation (IPC)/indice des prix de détail (Retail Price Index - RPI). Le taux du coupon est celui au 28 février 2023.

ABRÉVIATIONS :

CPI	– Indice des prix à la consommation (IPC).
Perpétuelle	– Obligation sans date d'échéance. Les obligations perpétuelles ne sont pas rachetables, mais paient des intérêts réguliers.
TBA	– À communiquer.
BRL	– Réal brésilien
CAD	– Dollar canadien
EUR	– Euro
GBP	– Livre britannique
IDR	– Rupiah indonésienne
JPY	– Yen japonais
KRW	– Won sud-coréen
MXN	– Peso mexicain
PLN	– Zloty polonais
ZAR	– Rand sud-africain

Analyse de l'actif total	% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	85,23
Organismes de placement collectif	7,04
Instruments financiers dérivés	0,86
Autres actifs	6,87
Actif total	100,00

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)	Devise de vente (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
09 mars 2023	Citi	Achat	USD 10 491	Vente CNH 73 790 \$ (133)
09 mars 2023	Citi	Achat	USD 303	Vente INR 24 760 4
09 mars 2023	Citi	Achat	CNH 73 790	Vente USD 10 636 (12)
09 mars 2023	JP Morgan	Achat	USD 1 582	Vente CNH 11 110 (18)
09 mars 2023	JP Morgan	Achat	USD 1 966	Vente KRW 2 554 455 34
09 mars 2023	JP Morgan	Achat	CNH 11 110	Vente USD 1 600 (1)
09 mars 2023	JP Morgan	Achat	KRW 2 554 455	Vente USD 1 934 (2)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 1 910	Vente CAD 2 573 25
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 538	Vente EUR 502 5
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 72	Vente EUR 68 –
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD –	Vente GBP – –
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 57	Vente NZD 91 1
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 53	Vente USD 86 –
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD 8 288	Vente USD 5 244 (120)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CAD 123 048	Vente USD 91 536 (1 345)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP 2	Vente USD 2 –
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 21 905	Vente USD 23 547 (354)
16 mai 2023	BNP Paribas	Achat	USD 1 873	Vente PLN 8 300 17
16 mai 2023	Citi	Achat	USD 5 691	Vente EUR 5 282 79
16 mai 2023	Citi	Achat	USD 3 771	Vente GBP 3 113 22
16 mai 2023	Citi	Achat	EUR 500	Vente USD 541 (10)
16 mai 2023	Citi	Achat	SEK 16 710	Vente USD 1 593 10
16 mai 2023	Goldman Sachs	Achat	USD 1 072	Vente CAD 1 438 17
16 mai 2023	Goldman Sachs	Achat	USD 216	Vente EUR 200 2
16 mai 2023	Goldman Sachs	Achat	USD 4 129	Vente JPY 542 138 102
16 mai 2023	Goldman Sachs	Achat	USD 237	Vente MXN 4 606 (11)
16 mai 2023	Goldman Sachs	Achat	NOK 16 400	Vente USD 1 583 2
16 mai 2023	Goldman Sachs	Achat	JPY 65 000	Vente USD 483 –
16 mai 2023	HSBC	Achat	USD 12 119	Vente EUR 11 236 180
16 mai 2023	JP Morgan	Achat	USD 121	Vente AUD 174 4
16 mai 2023	JP Morgan	Achat	USD 2 305	Vente CNH 15 560 55

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des Contrats de change à terme – (suite)

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
16 mai 2023	JP Morgan	Achat	USD 1 575	Vente	EUR 1 461	23
16 mai 2023	JP Morgan	Achat	USD 9 685	Vente	GBP 7 998	50
16 mai 2023	JP Morgan	Achat	USD 180	Vente	GBP 150	(1)
16 mai 2023	JP Morgan	Achat	USD 1 486	Vente	JPY 192 190	58
16 mai 2023	JP Morgan	Achat	JPY 165 000	Vente	USD 1 245	(20)
16 mai 2023	JP Morgan	Achat	GBP 300	Vente	USD 364	(3)
16 mai 2023	Morgan Stanley	Achat	USD 118	Vente	CAD 158	2
16 mai 2023	Morgan Stanley	Achat	USD 2 522	Vente	EUR 2 340	36
16 mai 2023	Morgan Stanley	Achat	USD 1 484	Vente	GBP 1 226	7
16 mai 2023	Morgan Stanley	Achat	USD 3 140	Vente	JPY 406 780	119
16 mai 2023	Morgan Stanley	Achat	AUD 2 280	Vente	USD 1 585	(46)
16 mai 2023	Morgan Stanley	Achat	JPY 22 000	Vente	USD 170	(7)
16 mai 2023	UBS	Achat	USD 9 616	Vente	EUR 8 917	141
16 mai 2023	UBS	Achat	USD 324	Vente	JPY 42 000	12
13 juin 2023	Citi	Achat	USD 10 683	Vente	CNH 73 790	(12)
13 juin 2023	Citi	Achat	CNH 8 830	Vente	USD 1 276	4
13 juin 2023	JP Morgan	Achat	USD 1 609	Vente	CNH 11 110	(1)
13 juin 2023	JP Morgan	Achat	USD 1 942	Vente	KRW 2 554 455	(1)
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 1 797 \$)						\$ 1 011
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (1 907) \$)						(2 097)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (110) \$)						\$ (1 086)

Tableau des contrats à terme standardisés

	Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
Indice SOFR 3 mois décembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	88	\$ 21 160	\$ (61)
Obligation australienne 10 ans, mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	23	1 821	(22)
Euribor 3 mois, décembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	84	21 460	(165)
Euro-Bobl, mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	81	9 868	(414)
Euro-Bund mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	82	11 527	(311)
Obligation Euro-Buxl 30 ans, mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	(7)	(994)	194
Obligation japonaise 10 ans (OSE), mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	(14)	15 079	144
U.S. 10 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	32	3 573	(1)
U.S. 10 Year Ultra Note, juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(84)	(9 844)	(13)
U.S. 5 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	124	13 275	(50)
U.S. Long Bond (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	1	125	–
U.S. Ultra Bond (CBT) juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	5	675	(6)
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 837 \$)				\$ 338
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (1 170) \$)				(1 043)
Moins-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (333) \$)				\$ (705)

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Western Asset Global Credit Fund^

Portefeuille d’investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — 80,76 % (28 février 2022 : 90,58 %)		
Australie — 1,56 % (28 février 2022 : 0,95 %)		
EUR 240 AusNet Services Holdings Pty Ltd, 1,625 %, échéance le 11/03/2081 *	214	0,46
190 Glencore Finance Canada Ltd, 6,000 %, échéance le 15/11/2041	187	0,41
EUR 260 Glencore Finance Europe Ltd, 1,875 %, échéance le 13/09/2023	273	0,59
60 Westpac Banking Corp, 2,668 %, échéance le 15/11/2035 *	46	0,10
	720	1,56
Belgique — 0,39 % (28 février 2022 : 1,28 %)		
8 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, échéance le 15/04/2048	7	0,02
EUR 200 UCB SA, 1,000 %, échéance le 30/03/2028	171	0,37
	178	0,39
Brésil — 1,03 % (28 février 2022 : 0,69 %)		
300 Suzano Austria GmbH, 7,000 %, échéance le 16/03/2047	300	0,65
160 Vale Canada Ltd, 7,200 %, échéance le 15/09/2032	176	0,38
	476	1,03
Chine — 0,11 % (28 février 2022 : 0,08 %)		
60 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 3,400 %, échéance le 01/05/2030	52	0,11
Colombie — 0,25 % (28 février 2022 : 0,19 %)		
170 Ecopetrol SA, 5,875 %, échéance le 28/05/2045	112	0,25
Danemark — 2,07 % (28 février 2022 : 1,34 %)		
EUR 140 Coloplast Finance BV, 2,250 %, échéance le 19/05/2027	139	0,30
270 Danske Bank A/S, 5,375 %, échéance le 12/01/2024	269	0,59
EUR 200 Danske Bank A/S, 2,500 %, échéance le 21/06/2029 *	204	0,44
EUR 350 Danske Bank A/S, 1,375 %, échéance le 12/02/2030 *	341	0,74
	953	2,07
Finlande — 0,67 % (28 février 2022 : 0,56 %)		
EUR 130 Fortum Oyj, 1,625 %, échéance le 27/02/2026	127	0,28
EUR 200 Neste Oyj, 0,750 %, échéance le 25/03/2028	181	0,39
	308	0,67
France — 7,01 % (28 février 2022 : 6,45 %)		
EUR 210 AXA SA, 3,250 %, échéance le 28/05/2049 *	200	0,43
200 BNP Paribas SA, 4,705 %, échéance le 10/01/2025 *	198	0,43
GBP 400 BNP Paribas SA, 1,875 %, échéance le 14/12/2027	410	0,89
210 BNP Paribas SA, 144A, 3,052 %, échéance le 13/01/2031 *	178	0,39
GBP 200 BNP Paribas SA, 2,000 %, échéance le 24/05/2031 *	209	0,45
200 BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, perpétuelle *	204	0,44
EUR 300 Eiffage SA, 1,625 %, échéance le 14/01/2027	279	0,61
EUR 200 Électricité de France SA, 1,000 %, échéance le 29/11/2033	150	0,33
EUR 200 Engie SA, 0,500 %, échéance le 24/10/2030	163	0,35
EUR 100 Engie SA, 4,250 %, échéance le 11/01/2043	102	0,22
EUR 310 GELF Bond Issuer I SA, 1,125 %, échéance le 18/07/2029	257	0,56
EUR 190 Orange SA, 5,000 %, perpétuelle *	201	0,44
EUR 200 Suez SACA, 1,875 %, échéance le 24/05/2027	194	0,42
EUR 200 Terega SA, 0,875 %, échéance le 17/09/2030	163	0,36
EUR 200 Terega SASU, 0,625 %, échéance le 27/02/2028	177	0,38
200 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 4,750 %, échéance le 17/09/2044	142	0,31
	3 227	7,01
Allemagne — 7,27 % (28 février 2022 : 8,02 %)		
EUR 200 Allianz SE, 2,625 %, perpétuelle *	150	0,33
400 Allianz SE, 3,200 %, perpétuelle *	302	0,65
EUR 200 alstria office REIT-AG, 1,500 %, échéance le 23/06/2026	171	0,37
EUR 200 Amprion GmbH, 3,971 %, échéance le 22/09/2032	211	0,46
140 Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750 %, échéance le 15/06/2030	166	0,36
EUR 100 EnBW International Finance BV, 4,049 %, échéance le 22/11/2029	106	0,23
EUR 200 Grand City Properties SA, 1,500 %, perpétuelle *	108	0,23
EUR 200 Hannover Rueck SE, 1,125 %, échéance le 09/10/2039 *	165	0,36
EUR 200 Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG/Munich, 3,250 %, échéance le 26/05/2049 *	191	0,41
EUR 100 Sirius Real Estate Ltd, 1,125 %, échéance le 22/06/2026	85	0,18
EUR 100 Sirius Real Estate Ltd, 1,750 %, échéance le 24/11/2028	78	0,17
EUR 200 Vier Gas Transport GmbH, 4,000 %, échéance le 26/09/2027	212	0,46
EUR 200 Vier Gas Transport GmbH, 4,625 %, échéance le 26/09/2032	218	0,47
EUR 270 Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, échéance le 01/10/2024	275	0,60
GBP 300 Volkswagen Financial Services NV, 4,250 %, échéance le 09/10/2025	350	0,76
EUR 200 Vonovia SE, 0,375 %, échéance le 16/06/2027	178	0,39
EUR 200 Vonovia SE, 0,750 %, échéance le 01/09/2032	146	0,32
EUR 100 Vonovia SE, 1,625 %, échéance le 01/09/2051	53	0,12
EUR 200 ZF Finance GmbH, 2,000 %, échéance le 06/05/2027	183	0,40
	3 348	7,27
Hong Kong — 0,42 % (28 février 2022 : 0,27 %)		
200 AIA Group Ltd, 144A, 3,200 %, échéance le 11/03/2025	192	0,42

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Irlande — 0,64 % (28 février 2022 : 0,47 %)		
150 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, échéance le 30/01/2032	120	0,26
240 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,850 %, échéance le 29/10/2041	176	0,38
	296	0,64
Italie — 3,22 % (28 février 2022 : 3,43 %)		
400 Enel Finance International NV, 144A, 7,750 %, échéance le 14/10/2052	452	0,98
EUR 180 FCA Bank SpA/Irlande, 0,500 %, échéance le 13/09/2024	180	0,39
200 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, échéance le 01/06/2032 *	151	0,33
EUR 200 Intesa Sanpaolo SpA, 6,375 %, perpétuelle *	189	0,41
EUR 200 Terna – Rete Elettrica Nazionale, 2,375 %, perpétuelle *	177	0,38
EUR 340 UniCredit SpA, 2,000 %, échéance le 23/09/2029 *	335	0,73
	1 484	3,22
Luxembourg — 2,48 % (28 février 2022 : 2,79 %)		
110 ArcelorMittal SA, 6,550 %, échéance le 29/11/2027	113	0,25
10 ArcelorMittal SA, 6,750 %, échéance le 01/03/2041	10	0,02
GBP 200 Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 2,625 %, échéance le 20/10/2028	187	0,41
EUR 270 Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,625 %, échéance le 20/04/2030	201	0,44
EUR 250 Logicor Financing Sarl, 3,250 %, échéance le 13/11/2028	230	0,50
EUR 125 Prologis International Funding II SA, 1,750 %, échéance le 15/03/2028	117	0,25
EUR 140 SELP Finance Sarl, 1,500 %, échéance le 20/11/2025	135	0,29
EUR 160 SELP Finance Sarl, 1,500 %, échéance le 20/12/2026	149	0,32
	1 142	2,48
Macao — 0,41 % (28 février 2022 : 0,47 %)		
200 Sands China Ltd, 5,900 %, échéance le 08/08/2028	189	0,41
Mexique — 0,42 % (28 février 2022 : 0,61 %)		
200 Orbia Advance Corp SAB de CV, 144A, 6,750 %, échéance le 19/09/2042	195	0,42
Pays-Bas — 2,39 % (28 février 2022 : 3,03 %)		
EUR 170 CTP NV, 2,125 %, échéance le 01/10/2025	165	0,36
EUR 100 Enxsis Holding NV, 0,750 %, échéance le 02/07/2031	84	0,18
EUR 140 Euronext NV, 1,000 %, échéance le 18/04/2025	138	0,30
EUR 200 ING Groep NV, 3,000 %, échéance le 11/04/2028 *	211	0,46
EUR 200 ING Groep NV, 2,500 %, échéance le 15/02/2029 *	206	0,45
EUR 200 Koninklijke Ahold Delhaize NV, 1,750 %, échéance le 02/04/2027	196	0,42
EUR 110 Koninklijke Philips NV, 2,000 %, échéance le 30/03/2030	101	0,22
	1 101	2,39
Portugal — 0,40 % (28 février 2022 : 0,40 %)		
EUR 200 EDP – Energias de Portugal SA, 1,875 %, échéance le 02/08/2081 *	183	0,40
Singapour — 0,40 % (28 février 2022 : 0,29 %)		
EUR 200 Cromwell Ereit Lux Finco Sarl, 2,125 %, échéance le 19/11/2025	185	0,40
Espagne — 3,53 % (28 février 2022 : 2,27 %)		
EUR 100 Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 1,375 %, échéance le 26/01/2032	86	0,19
GBP 400 Banco Santander SA, 1,750 %, échéance le 17/02/2027	414	0,90
200 Banco Santander SA, 5,294 %, échéance le 18/08/2027	196	0,43
EUR 200 Banco Santander SA, 5,250 %, perpétuelle *	208	0,45
GBP 200 CaixaBank SA, 6,875 %, échéance le 25/10/2033 *	237	0,51
EUR 100 Cellnex Finance Co SA, 2,000 %, échéance le 15/02/2033	79	0,17
EUR 200 Cellnex Telecom SA, 1,875 %, échéance le 26/06/2029	174	0,38
140 Telefonica Emisiones SA, 7,045 %, échéance le 20/06/2036	148	0,32
EUR 100 Telefonica Europe BV, 2,376 %, perpétuelle *	82	0,18
	1 624	3,53
Suède — 1,88 % (28 février 2022 : 1,96 %)		
EUR 140 H&M Finance BV, 0,250 %, échéance le 25/08/2029	114	0,25
EUR 100 Heimstaden AB, 4,250 %, échéance le 09/03/2026	81	0,17
EUR 130 Heimstaden Bostad AB, 3,625 %, perpétuelle *	88	0,19
EUR 350 Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,624 %, perpétuelle *	166	0,36
200 Skandinaviska Enskilda Banken AB, 6,875 %, perpétuelle *	196	0,43
EUR 210 Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, échéance le 02/03/2028 *	222	0,48
	867	1,88
Suisse — 2,96 % (28 février 2022 : 3,06 %)		
GBP 200 Credit Suisse Group AG, 2,250 %, échéance le 09/06/2028 *	190	0,41
200 Credit Suisse Group AG, 7,250 %, perpétuelle *†c	148	0,32
250 Credit Suisse Group AG, 9,750 %, perpétuelle *†c	227	0,49
230 Credit Suisse Group AG, 6,375 %, perpétuelle *†c	170	0,37
EUR 200 Julius Baer Group Ltd, 6,625 %, perpétuelle *	211	0,46
200 UBS Group AG, 4,253 %, échéance le 23/03/2028	189	0,41
230 UBS Group SA, 7,000 %, perpétuelle *	229	0,50
	1 364	2,96

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'État — 13,07 % (28 février 2022 : 4,40 %)			Organismes de placement collectif — 1,21 % (28 février 2022 : 0,93 %)		
Allemagne — 6,86 % (28 février 2022 : 0,69 %)			559 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)		
EUR 560 Bundesobligation, série 182, 0,000 %, échéance le 10/10/2025	549	1,19	559 1,21		
EUR 270 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, échéance le 15/02/2025	272	0,59	Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat 559 1,21		
EUR 80 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, échéance le 15/02/2026	79	0,17	Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (coût 51 996 \$) 43 765 95,04		
EUR 200 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/08/2026	192	0,42	Contrats de change à terme — 0,74 % (28 février 2022 : 1,07 %)		
EUR 420 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, échéance le 15/02/2027	402	0,87	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous) 343 0,74		
EUR 230 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, échéance le 15/08/2027	221	0,48	Contrats à terme standardisés — 0,44 % (28 février 2022 : 0,57 %)		
EUR 270 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, échéance le 15/02/2028	257	0,56	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous) 202 0,44		
EUR 70 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, échéance le 15/08/2028	65	0,14	Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat 44 310 96,22		
EUR 240 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, échéance le 15/02/2029	221	0,48	Swaps sur risque de crédit — (0,17 %) (28 février 2022 : (0,37 %))		
EUR 420 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/08/2029	376	0,82	Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous) (76) (0,17)		
EUR 160 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/08/2031	136	0,30	Contrats de change à terme — (0,19 %) (28 février 2022 : (0,15 %))		
EUR 60 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, série 2007, 4,250 %, échéance le 04/07/2039	76	0,17	Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous) (90) (0,19)		
EUR 110 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, série 08, 4,750 %, échéance le 04/07/2040	149	0,32	Contrats à terme standardisés — (0,08 %) (28 février 2022 : (0,06 %))		
EUR 200 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,250 %, échéance le 15/08/2048	161	0,35	Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous) (34) (0,08)		
	3 156	6,86	Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (200) (0,44)		
Indonésie — 0,63 % (28 février 2022 : 0,47 %)			Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat 44 110 95,78		
EUR 350 Obligation internationale de l'État indonésien, 1,400 %, échéance le 30/10/2031	291	0,63	Autres éléments de l'actif hors passif 1 940 4,22		
Mexique — 1,10 % (28 février 2022 : 0,97 %)			Total des actifs nets 46 050 \$ 100,00		
620 Obligation internationale de l'État mexicain, 3,500 %, échéance le 12/02/2034	507	1,10	– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.		
Panama — 0,33 % (28 février 2022 : 0,23 %)			144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 2 634 000 \$, soit 5,71 % de l'actif net.		
200 Obligation internationale de l'État panaméen, 2,252 %, échéance le 29/09/2032	149	0,33	* Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.		
Royaume-Uni — 0,54 % (28 février 2022 : 0,00 %)			† Liquidité à compter de l'exercice clos le 28 février 2023.		
GBP 100 Fonds d'État du Royaume-Uni, 0,125 %, échéance le 30/01/2026	109	0,23	⋄ Le titre est en défaut à la date de clôture ou à compter de la clôture de l'exercice clos le 28 février 2023 (capital et/ou intérêts).		
GBP 140 Fonds d'État du Royaume-Uni, 0,125 %, échéance le 31/01/2028	141	0,31	ABRÉVIATIONS :		
	250	0,54	Perpétuelle – Obligation sans date d'échéance. Les obligations perpétuelles ne sont pas rachetables, mais paient des intérêts réguliers.		
États-Unis — 3,61 % (28 février 2022 : 1,32 %)			EUR – Euro		
350 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,000 %, échéance le 15/11/2026	322	0,70	GBP – Livre britannique		
200 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,500 %, échéance le 31/01/2028	194	0,42	Analyse de l'actif total		
390 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,250 %, échéance le 30/04/2028	338	0,73	Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé 92,67		
10 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,125 %, échéance le 15/11/2032	10	0,02	Organismes de placement collectif 1,20		
120 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,000 %, échéance le 15/11/2042	118	0,26	Instruments financiers dérivés 1,17		
410 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2052	336	0,73	Autres actifs 4,96		
180 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/08/2052	151	0,33	Actif total 100,00		
190 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,000 %, échéance le 15/11/2052	194	0,42			
	1 663	3,61			
Total des obligations et bons d'État (coût 6,627 \$)			6 016 13,07		

Tableau des swaps sur risque de crédit

Contrepartie	Entité de référence – protection achat/vente	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % - achat	20 déc. 2027	4 200	\$ (44)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000 % – achat	20 déc. 2027	3 440	\$ (32)
Plus-value latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				\$ –
Moins-value latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : (283) \$)				(76)
Plus-value nette des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : (283) \$)				\$ (76)

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 105	Vente	EUR 98	\$ 1
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD –	Vente	GBP –	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 4 283	Vente	USD 4 603	(69)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP 16	Vente	USD 19	–
16 mai 2023	BNP Paribas	Achat	USD 460	Vente	EUR 427	7
16 mai 2023	Citi	Achat	USD 965	Vente	EUR 896	13
16 mai 2023	Citi	Achat	USD 260	Vente	GBP 215	1
16 mai 2023	Citi	Achat	EUR 50	Vente	USD 54	(1)
16 mai 2023	Goldman Sachs	Achat	USD 7 742	Vente	EUR 7 182	111
16 mai 2023	Goldman Sachs	Achat	USD 1 096	Vente	GBP 906	6
16 mai 2023	Goldman Sachs	Achat	EUR 820	Vente	USD 870	1
16 mai 2023	Goldman Sachs	Achat	JPY 41 322	Vente	USD 320	(13)
16 mai 2023	Goldman Sachs	Achat	EUR 390	Vente	USD 421	(7)
16 mai 2023	HSBC	Achat	USD 65	Vente	EUR 60	1
16 mai 2023	JP Morgan	Achat	USD 5 541	Vente	EUR 5 139	81
16 mai 2023	JP Morgan	Achat	USD 3 870	Vente	GBP 3 196	21
16 mai 2023	Morgan Stanley	Achat	USD 1 839	Vente	EUR 1 706	26
16 mai 2023	Royal Bank of Canada	Achat	USD 796	Vente	EUR 738	12
16 mai 2023	UBS	Achat	USD 3 628	Vente	EUR 3 364	53
16 mai 2023	UBS	Achat	USD 1 762	Vente	GBP 1 455	9
16 mai 2023	UBS	Achat	GBP 100	Vente	USD 120	–
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 827 \$)						\$ 343
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (116) \$)						(90)
Plus-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 711 \$)						\$ 253

Tableau des contrats à terme standardisés

	Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
Mini-obligation à 10 ans de l'État japonais, mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	(15)	\$ (1 616)	\$ 14
Euro-Bobl, mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	(22)	(2 680)	101
Euro-Bund mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	(6)	(844)	43
Obligation japonaise 10 ans (OSE), mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	(2)	(2 154)	23
Long Gilt juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(9)	(1 082)	15
U.S. 10 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	37	4 131	(1)
U.S. 5 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	34	3 640	(13)
U.S. Long Bond (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(10)	(1 252)	6
U.S. Ultra Bond (CBT) juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	20	2 701	(20)
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 437 \$)				\$ 202
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (44) \$)				(34)
Plus-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 393 \$)				\$ 168

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des actifs — 4,57 % (28 février 2022 : 4,54 %)					
11 500 Apidos CLO XXXVI, série 2021 36A, catégorie D, 144A, 7,708 %, échéance le 20/07/2034 *	10 753	0,50	INR 250 000 Power Grid Corp of India Ltd, série C, 8,200 %, échéance le 23/01/2025	3 046	0,14
9 070 Apidos CLO XXXVIII, série 2021 38A, catégorie D, 144A, 7,765 %, échéance le 21/01/2034 *	8 470	0,40	INR 500 000 REC Ltd, série 133, 8,300 %, échéance le 10/04/2025	6 100	0,28
13 950 Bain Capital Credit CLO 2021-4 Ltd, série 2021 4A, catégorie D, 144A, 7,908 %, échéance le 20/10/2034 *	13 257	0,62		21 431	1,00
6 590 Bavarian Sky UK 5 Plc, série 2014 1A, catégorie CR2, 144A, 8,438 %, échéance le 20/10/2034 *	5 753	0,27	Irlande — 0,02 % (28 février 2022 : 0,10 %)		
6 115 Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd 2016-1, série 2016 1A, catégorie AA, 144A, 2,487 %, échéance le 16/12/2041	5 635	0,26	490 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, échéance le 30/01/2032	392	0,02
6 000 Canyon Capital CLO 2017-1 Ltd, série 2017 1A, catégorie DR, 144A, 7,792 %, échéance le 15/07/2030 *	5 658	0,27	Israël — 4,11 % (28 février 2022 : 2,75 %)		
3 115 CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-I, série 2006 I, catégorie 2A, 4,728 %, échéance le 15/01/2037 *	2 891	0,14	8 027 Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, échéance le 01/02/2036	7 256	0,34
7 189 DB Master Finance LLC, série 2021 1A, catégorie A23, 144A, 2,791 %, échéance le 20/11/2051	5 795	0,27	5 693 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, échéance le 21/07/2023	5 634	0,26
8 000 Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, série 2018 4, catégorie A, 4,060 %, échéance le 15/11/2030	7 605	0,36	18 213 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125 %, échéance le 31/01/2025	18 460	0,87
2 223 Loanpal Solar Loan Ltd, série 2020 3GS, catégorie B, 144A, 3,450 %, échéance le 20/12/2047	1 706	0,08	10 605 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, échéance le 01/10/2026	9 278	0,43
5 375 Nassau 2021-I Ltd, série 2021 IA, catégorie D, 144A, 8,542 %, échéance le 26/08/2034 *	4 652	0,22	310 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, échéance le 09/05/2027	279	0,01
5 110 Ocean Trails Clo X, série 2020 10A, catégorie DR, 144A, 8,512 %, échéance le 15/10/2034 *	4 930	0,23	2 110 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,750 %, échéance le 01/03/2028	2 030	0,10
2 350 Ocean Trails CLO XIV Ltd, série 2023 14A, catégorie D, 144A, 0,000 %, échéance le 20/01/2035 *	2 335	0,11	2 810 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, échéance le 09/05/2029	2 490	0,12
6 832 Stonepeak 2021-1 ABS, série 2021 1A, catégorie A, 144A, 2,675 %, échéance le 28/02/2033	6 060	0,28	64 981 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,100 %, échéance le 01/10/2046	42 334	1,98
7 200 Venture XXVI CLO Ltd, série 2017 26A, catégorie D, 144A, 9,058 %, échéance le 20/01/2029 *	6 706	0,31		87 761	4,11
6 000 Vibrant Clo VII Ltd, série 2017 7A, catégorie C, 144A, 8,408 %, échéance le 15/09/2030 *	5 279	0,25	Italie — 0,13 % (28 février 2022 : 0,09 %)		
Total des titres adossés à des actifs (coût 106 406\$)	97 485	4,57	2 950 Enel Finance International NV, 144A, 6,000 %, échéance le 07/10/2039	2 816	0,13
Titres adossés à des hypothèques — 0,91 % (28 février 2022 : 2,26 %)					
10 400 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, série 2021 R03, catégorie 1M2, 144A, 6,134 %, échéance le 25/12/2041 *	9 969	0,47	Macao — 1,08 % (28 février 2022 : 0,31 %)		
138 CSMC Series 2015-12R, série 2015 12R, catégorie 2A1, 144A, 3,615 %, échéance le 30/11/2037 *	138	0,01	10 380 Sands China Ltd, 5,625 %, échéance le 08/08/2025	10 071	0,47
35 Fannie Mae Pool 'CA0907', 3,500 %, échéance le 01/12/2047	33	—	3 462 Sands China Ltd, 2,800 %, échéance le 03/08/2027	2 950	0,14
28 Flagstar Mortgage Trust 2018-2, série 2018 2, catégorie A4, 144A, 3,500 %, échéance le 25/04/2048 *	27	—	1 540 Sands China Ltd, 3,350 %, échéance le 03/08/2029	1 260	0,06
7 870 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, série 2021 DNA6, catégorie M2, 144A, 5,984 %, échéance le 25/10/2041 *	7 568	0,35	3 570 Wynn Macau Ltd, 144A, 4,875 %, échéance le 01/10/2024	3 415	0,16
1 311 MortgageIT Trust 2005-3, série 2005 3, catégorie A1, 5,217 %, échéance le 25/08/2035 *	1 227	0,06	5 750 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, échéance le 15/01/2026	5 267	0,25
461 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, série 2021 NQ2R, catégorie A3, 144A, 1,353 %, échéance le 25/10/2058 *	414	0,02		22 963	1,08
Total des titres adossés à des hypothèques (coût 20 190\$)	19 376	0,91	Malaisie — 0,39 % (28 février 2022 : 0,39 %)		
Obligations et bons d'entreprises — 40,30 % (28 février 2022 : 43,01 %)					
Belgique — 0,01 % (28 février 2022 : 0,11 %)					
120 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, échéance le 23/01/2049	121	0,01	11 920 Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, échéance le 19/08/2050	8 294	0,39
Bermudes — 0,61 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
14 150 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, échéance le 15/10/2025	13 031	0,61	Mexique — 0,43 % (28 février 2022 : 0,57 %)		
Brésil : 0,38 % (28 février 2022 : 1,26 %)					
2 780 Petrobras Global Finance BV, 5,999 %, échéance le 27/01/2028	2 721	0,13	6 910 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Caiman, 144A, 7,625 %, perpétuelle *	6 535	0,30
6 380 Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, échéance le 05/06/2115	5 329	0,25	4 350 Petroleos Mexicanos, 6,375 %, échéance le 23/01/2045	2 747	0,13
	8 050	0,38		9 282	0,43
Canada — 0,20 % (28 février 2022 : 0,13 %)					
4 430 Yamana Gold Inc, 4,625 %, échéance le 15/12/2027	4 174	0,20	Supranational — 0,37 % (28 février 2022 : 0,21 %)		
Colombie — 0,47 % (28 février 2022 : 0,43 %)					
6 630 Ecopetrol SA, 5,375 %, échéance le 26/06/2026	6 289	0,30	IDR 127 100 000 European Bank for Reconstruction & Development, 5,000 %, échéance le 06/10/2026	7 953	0,37
3 770 Ecopetrol SA, 8,875 %, échéance le 13/01/2033	3 698	0,17	Suède — 0,18 % (28 février 2022 : 0,32 %)		
	9 987	0,47	4 400 Svenska Handelsbanken AB, 4,750 %, perpétuelle *	3 777	0,18
France — 0,78 % (28 février 2022 : 1,52 %)					
4 590 Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, échéance le 15/01/2028	3 785	0,18	Suisse — 2,18 % (28 février 2022 : 1,62 %)		
200 Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, échéance le 15/10/2029	157	0,01	5 780 Crédit Suisse Group AG, 144A, 9,016 %, échéance le 14/05/2033 *	6 075	0,28
400 BNP Paribas SA, 144A, 7,000 %, perpétuelle *	387	0,02	770 Crédit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, perpétuelle *†€	569	0,03
6 420 Crédit Agricole SA, 144A, 8,125 %, perpétuelle *	6 510	0,30	8 230 Crédit Suisse Group AG, 144A, 7,500 %, perpétuelle *†€	7 528	0,35
GBP 4 830 Crédit Agricole SA, 7,500 %, perpétuelle *	5 770	0,27	17 430 Crédit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, perpétuelle *†€	15 816	0,74
	16 609	0,78	1 350 Crédit Suisse Group AG, 144A, 7,500 %, perpétuelle *†€	1 183	0,06
Inde — 1,00 % (28 février 2022 : 0,60 %)					
INR 500 000 NTPC Ltd, série 53, 9,170 %, échéance le 22/09/2024	6 175	0,29	13 220 Crédit Suisse Group AG, 144A, 5,250 %, perpétuelle *†€	9 140	0,43
INR 500 000 Power Finance Corp Ltd, série 130C, 8,390 %, échéance le 19/04/2025	6 110	0,29	200 Crédit Suisse Group AG, 144A, 6,375 %, perpétuelle *†€	148	0,01
			6 160 UBS Group SA, 6,875 %, perpétuelle *	6 077	0,28
				46 536	2,18
			Émirats arabes unis — 0,37 % (28 février 2022 : 0,57 %)		
			9 560 MDGH GMTN RSC Ltd, 3,950 %, échéance le 21/05/2050	7 899	0,37
			Royaume-Uni — 0,65 % (28 février 2022 : 0,91 %)		
			9 260 Barclays Plc, 7,750 %, perpétuelle *	9 214	0,43
			2 290 BAT Capital Corp, 4,540 %, échéance le 15/08/2047	1 646	0,08
			2 040 Lloyds Banking Group Plc, 7,500 %, perpétuelle *	2 019	0,09
			270 Reynolds American Inc, 6,150 %, échéance le 15/09/2043	248	0,01
			700 Virgin Media Secured Finance plc, 144A, 5,500 %, échéance le 15/05/2029	635	0,03
			210 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, échéance le 15/07/2031	174	0,01
				13 936	0,65
			États-Unis — 26,93 % (28 février 2022 : 28,67 %)		
			520 Altria Group Inc, 2,450 %, échéance le 04/02/2032	393	0,02
			2 720 Altria Group Inc, 5,950 %, échéance le 14/02/2049	2 437	0,11
			3 265 Altria Group Inc, 6,200 %, échéance le 14/02/2059	3 047	0,14
			557 Amazon.com Inc, 4,250 %, échéance le 22/08/2057	483	0,02
			1 830 Amazon.com Inc, 2,700 %, échéance le 03/06/2060	1 126	0,05
			18 070 Amazon.com Inc, 4,100 %, échéance le 13/04/2062	14 967	0,70
			510 Apache Corp, 7,750 %, échéance le 15/12/2029	528	0,03
			560 Apache Corp, 6,000 %, échéance le 15/01/2037	518	0,02
			18 226 Apache Corp, 5,100 %, échéance le 01/09/2040	15 016	0,70
			4 550 Apache Corp, 5,250 %, échéance le 01/02/2042	3 694	0,17

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
États-Unis — (suite)					
140 Apache Corp, 7,375 %, échéance le 15/08/2047	136	0,01	730 Energy Transfer LP, 6,250 %, échéance le 15/04/2049	696	0,03
1 970 Apache Corp, 5,350 %, échéance le 01/07/2049	1 564	0,07	12 260 Energy Transfer LP, série F, 6,750 %, perpétuelle *	11 356	0,53
1 933 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, échéance le 15/08/2027	1 590	0,07	15 650 Energy Transfer LP, série G, 7,125 %, perpétuelle *	13 952	0,65
4 500 BAC Capital Trust XIV, série G, 5,169 %, perpétuelle *	3 673	0,17	13 680 Energy Transfer LP, série H, 6,500 %, perpétuelle *	12 643	0,59
210 Bank of America Corp, série X, 6,250 %, perpétuelle *	211	0,01	12 990 Energy Transfer LP, série B, 6,625 %, perpétuelle *	10 648	0,50
27 730 Bank of America Corp, série FF, 5,875 %, perpétuelle *	25 933	1,22	2 568 Enterprise Products Operating LLC, 6,125 %, échéance le 15/10/2039	2 687	0,13
10 595 Bank of America Corp, série AA, 6,100 %, perpétuelle *	10 516	0,49	1 Enterprise Products Operating LLC, 6,450 %, échéance le 01/09/2040	1	—
1 300 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, échéance le 01/11/2025	1 132	0,05	1 670 Enterprise Products Operating LLC, 5,100 %, échéance le 15/02/2045	1 531	0,07
2 978 Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, échéance le 15/02/2026	2 810	0,13	200 EQT Corp, 6,125 %, échéance le 01/02/2025	200	0,01
2 510 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, échéance le 15/12/2025	2 525	0,12	1 780 EQT Corp, 144A, 3,125 %, échéance le 15/05/2026	1 630	0,08
2 050 Boeing Co/The, 3,250 %, échéance le 01/02/2035	1 580	0,07	730 EQT Corp, 7,000 %, échéance le 01/02/2030	754	0,04
780 Boeing Co/The, 3,550 %, échéance le 01/03/2038	589	0,03	1 510 EQT Corp, 144A, 3,625 %, échéance le 15/05/2031	1 269	0,06
1 900 Boeing Co/The, 5,805 %, échéance le 01/05/2050	1 810	0,09	90 FirstEnergy Corp, série C, 5,100 %, échéance le 15/07/2047	80	—
992 Boeing Co/The, 5,930 %, échéance le 01/05/2060	928	0,04	360 Ford Motor Co, 3,250 %, échéance le 12/02/2032	273	0,01
130 Builders FirstSource Inc, 144A, 4,250 %, échéance le 01/02/2032	109	0,01	5 500 Ford Motor Co, 6,100 %, échéance le 19/08/2032	5 127	0,24
4 540 California Institute of Technology, 3,650 %, échéance le 01/09/2119	3 122	0,15	200 Ford Motor Credit Co LLC, 3,375 %, échéance le 13/11/2025	184	0,01
430 Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, échéance le 15/01/2035	359	0,02	840 Ford Motor Credit Co LLC, 4,389 %, échéance le 08/01/2026	791	0,04
8 200 Carnival Corp, 144A, 5,750 %, échéance le 01/03/2027	6 755	0,32	200 Ford Motor Credit Co LLC, 4,542 %, échéance le 01/08/2026	186	0,01
7 320 Carnival Corp, 144A, 10,500 %, échéance le 01/06/2030	7 096	0,33	200 Ford Motor Credit Co LLC, 2,700 %, échéance le 10/08/2026	174	0,01
320 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, échéance le 01/02/2032	259	0,01	4 120 Ford Motor Credit Co LLC, 4,271 %, échéance le 09/01/2027	3 736	0,18
2 100 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, échéance le 01/04/2038	1 759	0,08	4 670 Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, échéance le 28/05/2027	4 356	0,20
910 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, échéance le 01/03/2042	588	0,03	200 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, échéance le 10/02/2029	163	0,01
1 540 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, échéance le 01/03/2050	1 127	0,05	760 Ford Motor Credit Co LLC, 5,113 %, échéance le 03/05/2029	695	0,03
1 780 Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 5,125 %, échéance le 30/06/2027	1 757	0,08	1 120 Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, échéance le 01/08/2030	1 035	0,05
700 Cheniere Energy Inc, 4,625 %, échéance le 15/10/2028	650	0,03	675 Goldman Sachs Capital II, 5,730 %, perpétuelle *	547	0,03
1 300 Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, échéance le 31/01/2032	1 043	0,05	7 570 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,750 %, échéance le 01/10/2037	8 069	0,38
6 095 Citigroup Inc, 8,125 %, échéance le 15/07/2039	7 732	0,36	1 420 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, échéance le 22/05/2045	1 318	0,06
25 265 Citigroup Inc, série P, 5,950 %, perpétuelle *	24 721	1,16	300 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, échéance le 15/12/2028	258	0,01
2 179 CommonSpirit Health, 4,350 %, échéance le 01/11/2042	1 841	0,09	5 990 Hackensack Meridian Health Inc, 4,211 %, échéance le 01/07/2048	5 118	0,24
1 960 CommonSpirit Health, 3,817 %, échéance le 01/10/2049	1 483	0,07	150 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, échéance le 01/02/2026	140	0,01
330 CommScope Inc, 144A, 4,750 %, échéance le 01/09/2029	269	0,01	610 HCA Inc, 5,375 %, échéance le 01/02/2025	605	0,03
2 500 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, échéance le 15/01/2031	2 369	0,11	2 370 HCA Inc, 7,690 %, échéance le 15/06/2025	2 464	0,12
3 290 Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, échéance le 01/06/2044	2 466	0,12	380 HCA Inc, 5,625 %, échéance le 01/09/2028	376	0,02
5 110 CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, échéance le 01/02/2029	4 337	0,20	1 610 HCA Inc, 3,500 %, échéance le 01/09/2030	1 386	0,07
6 150 CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, échéance le 15/01/2030	3 529	0,17	4 401 HCA Inc, 7,500 %, échéance le 15/11/2095	4 784	0,22
3 390 CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, échéance le 01/12/2030	2 453	0,12	6 290 ILFC E-Capital Trust I, 144A, 6,288 %, échéance le 21/12/2065 *	4 324	0,20
3 640 CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, échéance le 15/11/2031	2 588	0,12	1 089 Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,500 %, échéance le 01/09/2039	1 107	0,05
690 CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp, 144A, 3,875 %, échéance le 30/06/2028	587	0,03	400 Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,550 %, échéance le 15/09/2040	402	0,02
2 405 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, échéance le 03/11/2036	2 447	0,11	170 Kraft Heinz Foods Co, 6,750 %, échéance le 15/03/2032	184	0,01
2 110 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,750 %, échéance le 15/09/2037	2 217	0,10	480 Kraft Heinz Foods Co, 6,875 %, échéance le 26/01/2039	524	0,02
2 940 Delta Air Lines Inc, 3,800 %, échéance le 19/04/2023	2 930	0,14	120 Kraft Heinz Foods Co, 144A, 7,125 %, échéance le 01/08/2039	133	0,01
3 916 Delta Air Lines Inc, 2,900 %, échéance le 28/10/2024	3 730	0,18	120 Kraft Heinz Foods Co, 4,625 %, échéance le 01/10/2039	106	0,01
5 060 Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, échéance le 01/05/2025	5 167	0,24	60 Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, échéance le 04/06/2042	55	—
2 640 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, échéance le 15/01/2026	2 719	0,13	1 180 Kraft Heinz Foods Co, 4,375 %, échéance le 01/06/2046	964	0,05
2 768 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, échéance le 20/10/2025	2 690	0,13	6 840 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, échéance le 08/08/2024	6 586	0,31
324 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 4,500 %, échéance le 20/10/2025	315	0,02	610 Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, échéance le 25/06/2025	566	0,03
354 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 4,750 %, échéance le 20/10/2028	337	0,02	1 670 Las Vegas Sands Corp, 3,500 %, échéance le 18/08/2026	1 529	0,07
3 370 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, échéance le 20/10/2028	3 204	0,15	2 826 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, échéance le 20/06/2027	2 829	0,13
5 940 Devon Energy Corp, 8,250 %, échéance 01/08/2023	5 983	0,28	1 490 MPLX LP, 5,500 %, échéance le 15/02/2049	1 341	0,06
1 986 Devon Energy Corp, 5,850 %, échéance 15/12/2025	2 000	0,09	2 490 Northern Oil and Gas Inc, 144A, 8,125 %, échéance le 01/03/2028	2 405	0,11
1 736 Devon Energy Corp, 5,250 %, échéance 15/10/2027	1 717	0,08	1 874 Occidental Petroleum Corp, 6,950 %, échéance le 01/07/2024	1 895	0,09
1 670 Devon Energy Corp, 5,875 %, échéance 15/06/2028	1 681	0,08	1 940 Occidental Petroleum Corp, 5,550 %, échéance le 15/03/2026	1 932	0,09
1 436 Devon Energy Corp, 4,500 %, échéance 15/01/2030	1 337	0,06	6 760 Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, échéance le 01/09/2030	6 956	0,33
1 690 Devon Energy Corp, 7,875 %, échéance 30/09/2031	1 912	0,09	20 070 Occidental Petroleum Corp, 6,125 %, échéance le 01/01/2031	20 240	0,95
1 440 Devon Energy Corp, 7,950 %, échéance 15/04/2032	1 640	0,08	33 383 Occidental Petroleum Corp, coupon zéro, échéance le 10/10/2036	16 894	0,79
2 555 Devon Energy Corp, 5,000 %, échéance 15/06/2045	2 168	0,10	5 325 Occidental Petroleum Corp, 6,200 %, échéance le 15/03/2040	5 194	0,24
3 720 Dignity Health, 5,267 %, échéance le 01/11/2064	3 475	0,16	11 725 Occidental Petroleum Corp, 4,500 %, échéance le 15/07/2044	9 191	0,43
170 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, échéance le 01/12/2026	143	0,01	17 150 Occidental Petroleum Corp, 4,625 %, échéance le 15/06/2045	13 624	0,64
90 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, échéance le 01/12/2028	72	—	3 360 Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, échéance le 15/03/2046	3 424	0,16
1 220 DISH DBS Corp, 5,125 %, échéance le 01/06/2029	722	0,03	3 000 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, échéance le 15/04/2046	2 305	0,11
1 530 Energy Transfer LP, 6,850 %, échéance le 15/02/2040	1 513	0,07	2 360 Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, échéance le 15/02/2047	1 773	0,08
1 540 Energy Transfer LP, 6,500 %, échéance le 01/02/2042	1 538	0,07	14 270 Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, échéance le 15/03/2048	10 946	0,51
2 135 Energy Transfer LP, 6,100 %, échéance le 15/02/2042	1 987	0,09	890 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, échéance le 01/08/2040	603	0,03
412 Energy Transfer LP, 5,400 %, échéance le 01/10/2047	355	0,02	2 280 Plains All American Pipeline LP, série B, 8,974 %, perpétuelle *	2 120	0,10
410 Energy Transfer LP, 6,000 %, échéance le 15/06/2048	378	0,02	2 180 Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 6,700 %, échéance le 15/05/2036	2 174	0,10
			4 800 Range Resources Corp, 8,250 %, échéance le 15/01/2029	4 931	0,23
			6 910 Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 6,875 %, échéance le 15/04/2040	5 667	0,27
			1 820 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, échéance le 31/08/2026	1 674	0,08
			5 650 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,375 %, échéance le 15/07/2027	4 972	0,23
			670 Southwestern Energy Co, 4,750 %, échéance le 01/02/2032	576	0,03
			2 262 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, échéance le 20/09/2025	2 273	0,11

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
États-Unis — (suite)					
2 890 Sprint Capital Corp, 8,750 %, échéance le 15/03/2032	3 443	0,16	12 540 Obligation internationale de l'État ivoirien, 144A, 6,125 %, échéance le 15/06/2033	10 887	0,51
210 Sprint Corp, 7,875 %, échéance le 15/09/2023	212	0,01		21 594	1,01
2 530 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500 %, échéance le 01/03/2030	2 400	0,11	République dominicaine — 0,35 % (28 février 2022 : 0,20 %)		
360 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, échéance le 01/02/2031	327	0,02	9 920 Obligation internationale de la République dominicaine, 144A, 5,875 %, échéance le 30/01/2060	7 485	0,35
280 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, échéance le 15/01/2032	238	0,01	Égypte — 0,24 % (28 février 2022 : 0,34 %)		
11 910 The Vanguard Group Inc, 3,050 %, échéance 22/08/2050 t=	7 808	0,37	EGP 22 000 Obligation de l'État égyptien, série 7YR, 18,400 %, échéance le 30/05/2024	689	0,03
1 300 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, échéance le 01/07/2038	1 304	0,06	5 020 Obligation internationale de l'État égyptien, 5,250 %, échéance le 06/10/2025	4 353	0,21
120 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, échéance le 15/02/2026	109	0,01		5 042	0,24
2 100 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, échéance le 15/02/2029	1 788	0,08	Inde — 5,07 % (28 février 2022 : 3,57 %)		
90 T-Mobile USA Inc, 3,375 %, échéance le 15/04/2029	80	—	INR 500 000 Obligation de l'État indien, 7,160 %, échéance le 20/05/2023	6 049	0,28
200 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, échéance le 15/04/2031	173	0,01	INR 1 200 000 Obligation de l'État indien, 8,830 %, échéance le 25/11/2023	14 649	0,69
5 160 Toll Road Investors Partnership II LP, 144A, coupon zéro, échéance le 15/02/2024	4 810	0,23	INR 900 000 Obligation de l'État indien, 6,180 %, échéance le 04/11/2024	10 697	0,50
2 100 Toll Road Investors Partnership II LP, 144A, coupon zéro, échéance le 15/02/2038	686	0,03	INR 1 000 000 Obligation de l'État indien, 5,630 %, échéance le 12/04/2026	11 540	0,54
9 590 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, échéance le 15/04/2026	9 035	0,42	INR 1 480 000 Obligation de l'État indien, 8,150 %, échéance le 24/11/2026	18 295	0,86
3 730 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, échéance le 15/04/2029	3 310	0,16	INR 300 000 Obligation de l'État indien, 7,170 %, échéance le 08/01/2028	3 597	0,17
340 United Rentals North America Inc, 3,875 %, échéance le 15/02/2031	291	0,01	INR 1 300 000 Obligation de l'État indien, 7,590 %, échéance le 20/03/2029	15 848	0,74
6 730 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,141 %, échéance le 15/03/2052	5 280	0,25	INR 1 500 000 Obligation de l'État indien, 5,790 %, échéance le 11/05/2030	16 520	0,78
8 430 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,391 %, échéance le 15/03/2062	6 583	0,31	INR 1 000 000 Obligation de l'État indien, 6,190 %, échéance le 16/09/2034	10 913	0,51
3 926 Wells Fargo & Co, série U, 5,875 %, perpétuelle *	3 904	0,18		108 108	5,07
3 490 Wesleyan University, 4,781 %, échéance le 01/07/2116	2 876	0,14	Indonésie — 7,79 % (28 février 2022 : 8,89 %)		
4 630 Western Midstream Operating LP, 3,950 %, échéance le 01/06/2025	4 403	0,21	IDR 18 941 000 Bon du Trésor indonésien, série FR56, 8,375 %, échéance le 15/09/2026	1 319	0,06
765 Western Midstream Operating LP, 4,650 %, échéance le 01/07/2026	728	0,03	IDR 594 673 000 Bon du Trésor indonésien, série FR78, 8,250 %, échéance le 15/05/2029	42 114	1,98
5 100 Western Midstream Operating LP, 4,500 %, échéance le 01/03/2028	4 722	0,22	IDR 500 248 000 Bon du Trésor indonésien, série FR87, 6,500 %, échéance le 15/02/2031	32 262	1,51
5 274 Western Midstream Operating LP, 5,450 %, échéance le 01/04/2044	4 459	0,21	IDR 342 236 000 Bon du Trésor indonésien, série FR96, 7,000 %, échéance le 15/02/2033	22 671	1,06
3 370 Western Midstream Operating LP, 5,300 %, échéance le 01/03/2048	2 785	0,13	IDR 473 554 000 Bon du Trésor indonésien, série FR68, 8,375 %, échéance le 15/03/2034	34 478	1,62
6 980 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, échéance le 15/08/2048	5 855	0,27	IDR 276 928 000 Bon du Trésor indonésien, série FR72, 8,250 %, échéance le 15/05/2036	20 075	0,94
1 330 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, échéance le 01/02/2050	1 088	0,05	IDR 75 986 000 Bon du Trésor indonésien, série FR92, 7,125 %, échéance le 15/06/2042	5 013	0,24
130 Williams Cos Inc/The, 3,750 %, échéance le 15/06/2027	122	0,01	IDR 120 448 000 Bon du Trésor indonésien, série FR76, 7,375 %, échéance le 15/05/2048	8 120	0,38
5 390 Williams Cos Inc/The, série A, 7,500 %, échéance le 15/01/2031	5 946	0,28		166 052	7,79
3 400 Williams Cos Inc/The, 8,750 %, échéance le 15/03/2032	4 044	0,19	Kenya — 0,22 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
2 920 Williams Cos Inc/The, 6,300 %, échéance le 15/04/2040	3 001	0,14	5 370 Obligation internationale de l'État kényan, 7,250 %, échéance le 28/02/2028	4 687	0,22
665 Williams Cos Inc/The, 5,100 %, échéance le 15/09/2045	586	0,03	Mexique — 5,39 % (28 février 2022 : 9,05 %)		
3 070 Willis-Knighton Medical Center, série 2018, 4,813 %, échéance le 01/09/2048	2 826	0,13	MXN 1 684 964 Mexican Bonos, série M, 7,750 %, échéance le 13/11/2042	79 009	3,71
7 313 XPO CNW Inc, 6,700 %, échéance le 01/05/2034	6 693	0,31	MXN 749 190 Mexican Bonos, série M, 8,000 %, échéance le 07/11/2047	35 915	1,68
98 XPO Inc, 144A, 6,250 %, échéance le 01/05/2025	98	—		114 924	5,39
	574 246	26,93	Nigeria — 0,14 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
Zambie — 0,01 % (28 février 2022 : 0,00 %)			3 640 Obligation internationale de l'État nigérian, 6,125 %, échéance le 28/09/2028	2 899	0,14
220 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, échéance le 15/10/2027	207	0,01	Pologne — 2,62 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
Total des obligations et bons d'entreprises (coût 964 308\$)			PLN 366 080 Obligation de l'État polonais, série 0432, 1,750 %, échéance le 25/04/2032	55 983	2,62
Obligations et bons d'État — 40,57 % (28 février 2022 : 35,29 %)			Russie — 0,25 % (28 février 2022 : 4,39 %)		
Angola — 0,17 % (28 février 2022 : 0,00 %)			RUB 354 791 Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 03/02/2027 t _y	237	0,01
2 400 Obligation internationale de l'État angolais, 8,250 %, échéance le 09/05/2028	2 219	0,11	RUB 1 685 880 Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 23/05/2029 t _y	1 123	0,05
1 450 Obligation internationale de l'État angolais, 144A, 8,750 %, échéance le 14/04/2032	1 308	0,06	RUB 287 190 Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 10/04/2030 t _y	191	0,01
	3 527	0,17	RUB 4 428 300 Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 10/05/2034 t _y	2 950	0,14
Australie — 0,74 % (28 février 2022 : 1,75 %)			RUB 1 407 660 Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 16/03/2039 t _y	938	0,04
AUD 28 730 Obligation de l'État australien, série 150, 3,000 %, échéance le 21/03/2047	15 845	0,74		5 439	0,25
Brésil — 1,07 % (28 février 2022 : 2,74 %)			Afrique du Sud — 1,46 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
BRL 41 530 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTN-F, 10,000 %, échéance le 01/01/2027	7 263	0,34	ZAR 600 250 Obligation de l'État sud-africain, série R209, 6,250 %, échéance le 31/03/2036	21 717	1,02
BRL 96 647 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTN-F, 10,000 %, échéance le 01/01/2031	15 624	0,73	ZAR 271 600 Obligation de l'État sud-africain, série R214, 6,500 %, échéance le 28/02/2041	9 319	0,44
	22 887	1,07		31 036	1,46
Côte d'Ivoire — 1,01 % (28 février 2022 : 0,59 %)			États-Unis — 14,05 % (28 février 2022 : 0,08 %)		
EUR 4 010 Obligation internationale de l'État ivoirien, 4,875 %, échéance le 30/01/2032	3 258	0,15	1 820 Morongo Band of Mission Indians/The, 144A, 7,000 %, échéance le 01/10/2039	1 952	0,09
EUR 4 020 Obligation internationale de l'État ivoirien, 144A, 4,875 %, échéance le 30/01/2032	3 266	0,15	2 330 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,125 %, échéance le 30/09/2027	2 318	0,11
621 Obligation internationale de l'État ivoirien, 5,750 %, échéance le 31/12/2032	568	0,03	152 400 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,500 %, échéance le 31/01/2028	147 781	6,93
4 164 Obligation internationale de l'État ivoirien, 6,125 %, échéance le 15/06/2033	3 615	0,17	8 690 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,625 %, échéance le 31/07/2029	7 970	0,37

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'État — (suite)			20 230 Vente USD/achat INR 82,75, échéance le 04/04/2023 – JP Morgan		
États-Unis — (suite)			112 0,01		
2 220 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,125 %, échéance le 31/08/2029	2 097	0,10	Total des options achetées (coût 25 100\$)		
35 470 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,000 %, échéance le 31/10/2029	35 266	1,65	6 090 0,28		
500 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/08/2049	359	0,02	Swaps sur risque de crédit — 0,27 % (28 février 2022 : 0,27 %)		
2 570 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 15/11/2051	1 672	0,08	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
18 446 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/02/2052 =	13 159	0,62	Swaps d'indices — 6,92 % (28 février 2022 : 1,41 %)		
1 250 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2052	1 024	0,05	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
16 910 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/08/2052	14 220	0,67	Swaps de taux d'intérêt — 0,12 % (28 février 2022 : 3,64 %)		
59 810 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,000 %, échéance le 15/11/2052	60 894	2,85	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
11 370 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,625 %, échéance le 15/02/2053	10 828	0,51	Contrats de change à terme 1,01 % (28 février 2022 : 2,68 %)		
	299 540	14,05	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
Total des obligations et bons d'État (Coût 1 043 973\$)	865 048	40,57	Contrats à terme standardisés — 0,96 % (28 février 2022 : 5,11 %)		
Billets d'emprunt — 1,98 % (28 février 2022 : 1,85 %)			20 467 0,96		
4 012 1011778 BC ULC, 6,320 %, échéance le 14/11/2026 *	3 986	0,19	Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
1 428 Alterra Mountain Co, 8,070 %, échéance le 30/07/2028 *	1 427	0,07	2 119 171 99,37		
2 752 Assurion, LLC, 8,978 %, échéance le 19/08/2028 *	2 599	0,12	Contrats (en milliers)		
6 065 Charter Communications Operating LLC, 6,320 %, échéance le 30/04/2025 *	6 066	0,28	Options souscrites — (2,17 %) (28 février 2022 : (3,05 %))		
1 426 Edelman Financial Center LLC/The, 8,070 %, échéance le 05/04/2028 *	1 391	0,07	– Contrats à terme sur le taux d'intérêt à moyen terme (SOFR) à 3 mois et à 1 an décembre 2023, achat 96,75, échéance le 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
1 333 Hilton Worldwide Finance LLC, 6,380 %, échéance le 21/06/2026 *	1 333	0,06	(7) Contrats à terme sur le taux d'intérêt à moyen terme (SOFR) à 3 mois et à 1 an décembre 2023, achat 97,00, échéance le 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
5 622 Hunter Douglas Inc, 7,859 %, échéance le 09/02/2029 *	5 189	0,24	(3) Contrats à terme sur le taux d'intérêt à moyen terme (SOFR) à 3 mois et à 1 an décembre 2023, vente 95,3750, échéance le 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
1 608 Jane Street Group, LLC, 7,320 %, échéance le 21/01/2027 *	1 603	0,08	– Contrat à terme sur le dollar australien, avril 2023, achat 70,00, échéance le 04/06/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
1 322 Phoenix Guarantor Inc, 7,820 %, échéance le 05/03/2026 *	1 300	0,06	– Contrat à terme sur le dollar australien, mars, achat 70,00, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
5 714 Prime Security Installations Ltd, 7,517 %, échéance le 23/09/2026 *	5 711	0,27	– Contrat à terme sur le dollar australien, mars, achat 71,00, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
2 514 RegionalCare Hospital Partners Holding, 8,575 %, échéance le 16/11/2025 *	2 411	0,11	– Contrat à terme sur le dollar canadien, septembre 2023, vente 68,00, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
7 750 Univision Communications Inc, 7,820 %, échéance le 24/03/2026 *	7 708	0,36	– Contrat à terme sur le dollar canadien, septembre 2023, vente 70,50, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
1 550 Virgin Media Bristol LLC, 7,088 %, échéance le 04/01/2028 *	1 523	0,07	– Contrat à terme sur le dollar canadien, septembre 2023, vente 71,00, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
Total des billets d'emprunt (coût 43 130\$)	42 247	1,98	– Contrat à terme sur l'euro, avril 2023, achat 1,07, échéance le 04/06/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
Obligations municipales — 0,61 % (28 février 2022 : 0,55 %)			– Contrat à terme sur l'euro, avril 2023, achat 1,09, échéance le 04/06/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
4 240 City of Detroit MI, 4,000 %, échéance le 01/04/2044	3 061	0,14	– Contrat à terme sur l'euro, avril 2023, achat 1,10, échéance le 04/06/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
950 Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue, 3,706 %, échéance le 15/05/2120	636	0,03	(1) Contrat à terme sur l'euro, septembre 2023, achat 1,09, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
9 530 État de l'Illinois, 5,100 %, échéance le 01/06/2033	9 375	0,44	– Contrat à terme sur l'euro, mars 2023, vente 1,0750, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
Total des obligations municipales (coût 13 919\$)	13 072	0,61	– Contrat à terme sur l'euro, mars 2023, vente 1,08, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
Organismes de placement collectif — 0,87 % (28 février 2022 : 3,96 %)			– Contrat à terme sur l'euro, mars 2023, vente 1,09, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
EUR 20 Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro Accumulating	2 181	0,10	– Contrat à terme sur l'euro, mars 2023, vente 1,0950, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
16 369 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribution)	16 369	0,77	– Euro-Bund, avril 2023, achat 134,00, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
Total des organismes de placement collectif (Coût 18 642\$)	18 550	0,87	(1) Euro-Bund, avril 2023, achat 135,00, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (coût 2 210 568\$)			(1) Euro-Bund, avril 2023, achat 136,00, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
Options achetées — 0,28 % (28 février 2022 : 0,67 %)			– Euro-Bund, avril 2023, achat 136,50, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
2 Contrats à terme sur le taux d'intérêt à moyen terme (SOFR) à 3 mois et à 1 an décembre 2023, vente 96,00, échéance le 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	1 769	0,08	– Euro-Bund, avril 2023, achat 137,00, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
– Contrat à terme sur le dollar australien, mars, achat 69,50, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	–	–	(1) Euro-Bund, avril 2023, achat 137,50, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
1 Contrat à terme sur le dollar canadien, mars 2023, achat 75,00, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	3	–	(1) Euro-Bund, avril 2023, achat 138,00, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
– Contrat à terme sur le dollar canadien, mars 2023, achat 75,50, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	1	–	– Euro-Bund, octobre 2023, vente 135,00, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
– Contrat à terme sur l'euro, mars 2023, vente 1,0850, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	722	0,03	– Euro-Bund, octobre 2023, vente 136,50, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
1 Euro-Bund, avril 2023, achat 133,00, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	690	0,03	– IMM Euro\$, décembre 2023, achat 95,50, échéance le 18/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
12 IMM Euro\$, décembre 2023, achat 97,1250, échéance le 18/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	311	0,01	(4) IMM Euro\$, décembre 2023, achat 97,00, échéance le 18/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
– U.S. 10 Year, avril 2023, achat 111,50, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	457	0,02	(6) IMM Euro\$, décembre 2023, achat 97,8750, échéance le 18/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
– U.S. 10 Year, avril 2023, vente 111,50, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	194	0,01	(19) IMM Euro\$, décembre 2023, achat 98,00, échéance le 18/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch		
– U.S. 5 Year, avril 2023, achat 107,25, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	185	0,01			
– U.S. 5 Year, avril 2023, achat 107,50, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	148	0,01			
– U.S. Bond, avril 2023, achat 125,00, échéance le 21/10/2022 – Bank of America Merrill Lynch	217	0,01			
1 U.S. Bond, avril 2023, achat 126,00, échéance le 21/10/2022 – Bank of America Merrill Lynch	1 281	0,06			

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Contrats (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Contrats (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Options souscrites — (suite)					
– Contrat à terme sur le yen japonais, avril 2023, achat 76,00, échéance le 04/06/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(267)	(0,01)	(22 237) Vente USD/achat BRL 5,2918, échéance le 03/03/2023 – Morgan Stanley	(293)	(0,01)
– Contrat à terme sur le yen japonais, mars 2023, achat 77,00, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(2)	–	(22 630) Vente USD/achat BRL 5,3073, échéance le 16/05/2023 – Morgan Stanley	(731)	(0,03)
– Contrat à terme sur le yen japonais, mars 2023, achat 78,00, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(2)	–	(22 380) Vente USD/achat BRL 5,3682, échéance le 04/06/2023 – Morgan Stanley	(763)	(0,04)
– Contrat à terme sur le yen japonais, mars 2023, achat 79,00, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(2)	–	(22 654) Vente USD/achat MXN 19,25, échéance le 03/07/2023 – Morgan Stanley	(1 117)	(0,05)
– Contrat à terme sur le yen japonais, mars 2023, achat 80,00, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(1)	–	Total des options souscrites (coût (75 861) \$)	(46 352)	(2,17)
(1) Contrat à terme sur le yen japonais, mars 2023, vente 77,00, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(5 015)	(0,24)	Swaps sur risque de crédit — (0,03 %) (28 février 2022 : (0,40 %))		
– Contrat à terme sur le yen japonais, mars 2023, vente 77,50, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(1 175)	(0,06)	Moins-valeur latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(520)	(0,03)
(4) U.S. 10 Year, avril 2023, achat 112,50, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(2 408)	(0,11)	Swaps d'indices — (0,92 %) (28 février 2022 : (0,04 %))		
(6) U.S. 10 Year, avril 2023, achat 113,00, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(2 203)	(0,10)	Moins-valeur latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(19 599)	(0,92)
(2) U.S. 10 Year, avril 2023, achat 113,50, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(614)	(0,03)	Swaps de taux d'intérêt — (1,07 %) (28 février 2022 : (4,88 %))		
– U.S. 10 Year, avril 2023, achat 114,00, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(39)	–	Moins-valeur latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(22 883)	(1,07)
(1) U.S. 10 Year, avril 2023, achat 114,50, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(169)	(0,01)	Contrats de change à terme — (2,05 %) (28 février 2022 : (2,35 %))		
(3) U.S. 10 Year, avril 2023, achat 115,00, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(209)	(0,01)	Moins-valeur latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(43 616)	(2,05)
(4) U.S. 10 Year, avril 2023, achat 116,00, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(113)	(0,01)	Contrats à terme standardisés — (2,21 %) (28 février 2022 : (5,69 %))		
(1) U.S. 10 Year, avril 2023, achat 117,00, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(13)	–	Moins-valeur latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(47 194)	(2,21)
(2) U.S. 10 Year, avril 2023, vente 113,00, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(3 127)	(0,15)	Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	(180 164)	(8,45)
– U.S. 10 Year, avril 2023, vente 115,00, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(1 567)	(0,07)	Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	1 939 007	90,92
(1) U.S. 10 Year, juin 2023, achat 115,00, échéance le 26/05/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(409)	(0,02)	Autres éléments de l'actif hors passif	193 494	9,08
(1) U.S. 10 Year W1, mars 2023, achat 112,00, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(114)	(0,01)	Total des actifs nets	2 132 501\$	100,00
– U.S. 5 Year, avril 2023, achat 107,00, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(227)	(0,01)	– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.		
(3) U.S. 5 Year, avril 2023, achat 107,75, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(1 162)	(0,05)	144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 325 464 000 \$, soit 15,25 % de l'actif net.		
(1) U.S. 5 Year, avril 2023, achat 108,00, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(299)	(0,01)	* Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.		
(1) U.S. 5 Year, avril 2023, achat 108,50, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(177)	(0,01)	† Illiquide à compter de l'exercice clos le 28 février 2023.		
(1) U.S. 5 Year, avril 2023, achat 108,75, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(79)	–	∞ Le titre est évalué de bonne foi à sa juste valeur par le comité d'évaluation ou à sa discrétion.		
(2) U.S. 5 Year, avril 2023, achat 109,00, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(214)	(0,01)	ε Le titre est en défaut à la date de clôture ou suite à la clôture de l'exercice le 28 février 2023 (capital et/ou intérêts).		
(3) U.S. 5 Year, avril 2023, achat 109,50, échéance le 24/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(127)	(0,01)	≠ Le titre (dans sa totalité ou en partie) est nanti en tant que sûreté au titre de transactions sur produits dérivés au 28 février 2023.		
(1) U.S. Bond, avril 2023, achat 128,00, échéance le 21/10/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(476)	(0,02)	γ Le titre ne génère plus de revenus pendant et/ou après l'exercice clos le 28 février 2023 en raison de l'incertitude des paiements d'intérêts.		
(1) U.S. Bond, avril 2023, achat 130,00, échéance le 21/10/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(330)	(0,02)	ABRÉVIATIONS :		
(1) U.S. Bond, avril 2023, achat 132,00, échéance le 21/10/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(141)	(0,01)	Perpétuelle – Obligation sans date d'échéance. Les obligations perpétuelles ne sont pas rachetables, mais paient des intérêts réguliers.		
– U.S. Bond, avril 2023, achat 134,00, échéance le 21/10/2022 – Bank of America Merrill Lynch	(13)	–	REMIC – Société relais de placements immobiliers hypothécaires (Real Estate Mortgage Investment Conduit).		
(22 237) Achat USD/vente BRL 5,2918, échéance le 03/03/2023 – Morgan Stanley	(24)	–	AUD – Dollar australien		
(22 630) Achat USD/vente BRL 5,3073, échéance le 16/05/2023 – Morgan Stanley	(691)	(0,03)	BRL – Réal brésilien		
(22 380) Achat USD/vente BRL 5,3682, échéance le 04/06/2023 – Morgan Stanley	(318)	(0,02)	EGP – Livre égyptienne		
(22 750) Achat USD/vente KRW 236,00, échéance le 03/03/2023 – Morgan Stanley	(1 465)	(0,07)	EUR – Euro		
(22 750) Achat USD/vente KRW 244,00, échéance le 05/04/2023 – Morgan Stanley	(1 305)	(0,06)	GBP – Livre britannique		
(22 360) Vente USD/achat AUD 0,6990, échéance le 03/03/2023 – Morgan Stanley	(57)	–	IDR – Rupiah indonésienne		
(22 420) Vente USD/achat BRL 5,00, échéance le 22/03/2023 – Morgan Stanley	(48)	–	INR – Roupie indienne		
			MXN – Peso mexicain		
			PLN – Zloty polonais		
			RUB – Rouble russe		
			ZAR – Rand sud-africain		
			Analyse de l'actif total		% de l'actif total
			Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé		74,64
			Autres valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé		1,70
			Organismes de placement collectif		0,75
			Instruments financiers dérivés		8,21
			Autres actifs		14,70
			Actif total		100,00

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des swaps sur risque de crédit

Contrepartie	Entité de référence – protection achat/vente	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000 % – vente	20-déc-2027	6 091	\$ 96
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % - vente	20 déc.2027	544 283	5 666
Bank of America Merrill Lynch	Teva Pharmaceutical Industries Ltd, 1,000 % – vente	20-juin-2026	12 479	(520)
Plus-value latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : 11 462\$)				\$ 5 762
Moins-value latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : (16 749) \$)				(520)
Plus-value nette des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : (5 287) \$)				\$ 5 242

Tableau des swaps sur taux d'intérêt

Contrepartie	Taux	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Bank of America Merrill Lynch	Paie flottant USD SOFR Compound, reçoit fixe 3,550 %	01-mar-2025	2 219 704	\$ (18 619)
Bank of America Merrill Lynch	Paie flottant CDI BRL, reçoit fixe 11,993 %	04-janv.-2027	496 488	(2 387)
Bank of America Merrill Lynch	Paie flottant MXN TIE Banxico, reçoit fixe 9,260 %	25-oct-2032	1 009 497	1 018
Bank of America Merrill Lynch	Paie fixe 3,150 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15-mai-2048	44 912	1 567
BNP Paribas	Paie flottant CDI BRL, reçoit fixe 12,610 %	02-janv.-2029	679 541	(1 794)
JP Morgan	Paie flottant CDI BRL, reçoit fixe 12,893 %	02-janv.-2029	73 048	(83)
Plus-value latente des swaps de taux d'intérêt (28 février 2022 (en milliers) : 152 352 \$)				\$ 2 585
Moins-value latente des swaps de taux d'intérêt (28 février 2022 (en milliers) : (204 363) \$)				(22 883)
Moins-value nette des swaps de taux d'intérêt (28 février 2022 (en milliers) : (52 011) \$)				\$ (20 298)

Tableau des swaps d'indices

Contrepartie	Entité de référence	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Bank of America Merrill Lynch	Paie fixe 1,130 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15-août-2028	143 464	\$ 19 396
Bank of America Merrill Lynch	Paie fixe 1,220 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15-août-2028	213 642	27 954
Bank of America Merrill Lynch	Paie fixe 1,520 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15-fév-2047	26 146	7 901
Bank of America Merrill Lynch	Paie fixe 1,650 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15-août-2047	32 688	9 258
Bank of America Merrill Lynch	Paie fixe 2,000 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	18-mar-2032	35 169	4 463
Bank of America Merrill Lynch	Paie fixe 2,500 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	21-avr-2052	111 770	15 781
Bank of America Merrill Lynch	Paie fixe 2,510 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15-fév-2048	12 230	1 747
Bank of America Merrill Lynch	Paie fixe 2,600 %, reçoit flottant USD SOFR OIS Compound	15-fév-2048	227 407	29 105
Bank of America Merrill Lynch	Paie fixe 2,620 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15-fév-2048	34 210	4 265
Bank of America Merrill Lynch	Paie fixe 2,850 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15-fév-2029	61 775	3 286
Bank of America Merrill Lynch	Paie fixe 3,220 %, reçoit flottant USD SOFR OIS Compound	15-mai-2032	420 344	14 456
Bank of America Merrill Lynch	Paie fixe 3,250 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	30-sep-2029	23 847	724
Bank of America Merrill Lynch	Paie fixe 3,270 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	30-avr-2029	296 533	9 184
Bank of America Merrill Lynch	Paie fixe 3,850 %, reçoit flottant USD SOFR OIS Compound	30-juin-2029	97 359	(135)
Bank of America Merrill Lynch	Paie flottant USD SOFR Compound, reçoit fixe 1,396 %	13-oct-2025	582 851	(12 143)
Bank of America Merrill Lynch	Paie flottant USD SOFR Compound, reçoit fixe 3,400 %	21-juin-2025	826 407	(4 766)
Bank of America Merrill Lynch	Paie flottant USD SOFR Compound, reçoit fixe 4,600 %	04-juin-2024	354 373	(2 555)
Plus-value latente des swaps d'indices (28 février 2022 (en milliers) : 58 980 \$)				\$ 147 520
Moins-value latente des swaps d'indices (28 février 2022 (en milliers) : (1 721) \$)				(19 599)
Moins-value nette des swaps d'indices (28 février 2022 (en milliers) : 57 259 \$)				\$ 127 921

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)			Devise de vente (en milliers)			Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
02-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD	44 109	Vente	BRL	228 318	\$ 500
02-mar-2023	BNY Mellon	Achat	BRL	228 318	Vente	USD	44 880	(1 269)
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD	4 598	Vente	AUD	6 638	129
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD	6 225	Vente	CHF	5 758	102
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD	189	Vente	CNH	1 299	1
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD	76 495	Vente	EUR	71 462	842
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD	517	Vente	EUR	489	(2)
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD	1 288	Vente	GBP	1 076	(9)
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD	3 509	Vente	GBP	2 900	17
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD	2 678	Vente	JPY	356 964	51
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD	10	Vente	NOK	102	–
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD	1 116	Vente	NOK	11 468	10
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD	52	Vente	PLN	233	–
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD	88	Vente	SEK	920	–
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD	50	Vente	SEK	530	–
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD	2 555	Vente	SGD	3 410	25
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD	–	Vente	SGD	–	–
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	CHF	25 527	Vente	USD	27 823	(672)
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	EUR	710	Vente	USD	749	2

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des Contrats de change à terme – (suite)

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	CNH 27 699	Vente	USD 4 084	\$ (95)
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	JPY 7 513 435	Vente	USD 57 397	(2 090)
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	EUR 808 639	Vente	USD 869 211	(13 093)
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	AUD 65 186	Vente	USD 45 331	(1 441)
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	NOK 25	Vente	USD 2	–
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	NOK 74 379	Vente	USD 7 235	(65)
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	SEK 8	Vente	USD –	–
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	SEK 16 272	Vente	USD 1 541	14
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	PLN 5 199	Vente	USD 1 174	(6)
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	GBP 72 596	Vente	USD 87 732	(387)
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	AUD 4	Vente	USD 2	–
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	GBP 47	Vente	USD 55	–
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	SGD 56 688	Vente	USD 42 783	(727)
04-avr-2023	BNY Mellon	Achat	USD 450	Vente	BRL 2 355	3
04-avr-2023	BNY Mellon	Achat	BRL 203 020	Vente	USD 38 954	(443)
18-avr-2023	Bank of America Merrill Lynch	Achat	USD 47 299	Vente	TWD 1 437 902	(139)
18-avr-2023	Bank of America Merrill Lynch	Achat	KRW 27 950 786	Vente	USD 21 960	(757)
18-avr-2023	Bank of America Merrill Lynch	Achat	CNH 217 661	Vente	USD 32 390	(967)
18-avr-2023	Bank of America Merrill Lynch	Achat	USD 9 238	Vente	ZAR 168 753	89
18-avr-2023	BNP Paribas	Achat	USD 77 685	Vente	EUR 71 702	1 622
18-avr-2023	BNP Paribas	Achat	EUR 53 800	Vente	USD 58 444	(1 371)
18-avr-2023	BNP Paribas	Achat	USD 22 443	Vente	ZAR 410 453	188
18-avr-2023	Citi	Achat	USD 12 852	Vente	EUR 11 800	334
18-avr-2023	Citi	Achat	USD 9 200	Vente	JPY 1 183 000 450	
18-avr-2023	Citi	Achat	JPY 750 000	Vente	USD 5 880	(332)
18-avr-2023	Citi	Achat	EUR 27 700	Vente	USD 29 927	(542)
18-avr-2023	Citi	Achat	GBP 1 900	Vente	USD 2 302	(14)
18-avr-2023	Citi	Achat	AUD 28 500	Vente	USD 20 258	(1 047)
18-avr-2023	Goldman Sachs	Achat	USD 289 517	Vente	JPY 37 849 029	9 550
18-avr-2023	Goldman Sachs	Achat	USD 107 152	Vente	MXN 2 120 970	(7 668)
18-avr-2023	Goldman Sachs	Achat	ZAR 593 428	Vente	USD 34 646	(2 470)
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	USD 21 043	Vente	BRL 109 222	369
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	USD 213 644	Vente	CNH 1 463 389	2 380
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	USD 20 222	Vente	COP 98 621 820	129
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	USD 100 560	Vente	IDR 1 571 371 091	(2 375)
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	USD 88 349	Vente	INR 7 358 629	(362)
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	USD 22 721	Vente	KRW 27 950 786	1 517
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	SGD 45 121	Vente	USD 33 776	(271)
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	CAD 51 338	Vente	USD 38 440	(797)
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	CNH 1 089 996	Vente	USD 161 049	(3 691)
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	IDR 142 957 783	Vente	USD 9 190	174
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	INR 1 081 792	Vente	USD 13 079	(37)
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	BRL 175 606	Vente	USD 32 788	452
18-avr-2023	Morgan Stanley	Achat	USD 27 764	Vente	AUD 39 819	922
18-avr-2023	Morgan Stanley	Achat	USD 33 157	Vente	EUR 31 219	39
18-avr-2023	Morgan Stanley	Achat	USD 60 865	Vente	GBP 49 830	871
18-avr-2023	Morgan Stanley	Achat	USD 65 320	Vente	PLN 291 145	101
18-avr-2023	Morgan Stanley	Achat	PLN 49 302	Vente	USD 11 005	39
18-avr-2023	Morgan Stanley	Achat	MYR 49 444	Vente	USD 11 383	(337)
18-avr-2023	Morgan Stanley	Achat	NOK 36 790	Vente	USD 3 692	(140)
18-avr-2023	Morgan Stanley	Achat	GBP 6 674	Vente	USD 8 025	10
20-sep-2023	Goldman Sachs	Achat	USD 4 667	Vente	RUB 338 380	572
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 112 006 \$)						\$ 21 504
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (98 156) \$)						(43 616)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 13 850 \$)						\$ (22 112)

Tableau des contrats à terme standardisés

	Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
Indice SOFR 3 mois décembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(494)	\$ (117 016)	\$ 970
Indice SOFR 3 mois décembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	(2 262)	(543 898)	2 559
Indice SOFR 3 mois juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	504	119 228	(2 446)
Indice SOFR 3 mois septembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	4 122	974 801	(6 826)
90 jours Euro\$, mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	(2 098)	(497 895)	(57)
Devise dollar australien, mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	1 618	109 013	(2 436)
Devise livre sterling, mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	520	39 185	(1 054)
Devise dollar canadien, mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	167	12 255	(105)

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats à terme standardisés – (suite)

	Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
Euribor 3 mois, décembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	2 418	USD 614 476	\$ (5 930)
Devise euro, mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	504	66 730	(1 936)
Euro-Bund juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	75	10 467	(45)
Euro-Bund mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	698	98 124	(3 398)
Fed Fund 30 jours, février 2023	Bank of America Merrill Lynch	(1 147)	(456 100)	(62)
Obligation japonaise 10 ans (OSE), mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	(594)	(639 787)	3 317
Devise yen japonais, mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	3 665	337 134	(12 180)
Long Gilt juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	264	31 743	(157)
Devise peso mexicain, mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	4 030	109 737	5 766
U.S. 10 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	27 440	3 063 848	(892)
U.S. 10 Year Ultra Note, juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(16 192)	(1 897 500)	(2 376)
U.S. 2 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(13 633)	(2 777 404)	7 855
U.S. 5 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(6 378)	(682 795)	(1 106)
U.S. Long Bond (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	14 483	1 813 543	(1 793)
U.S. Ultra Bond (CBT) juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	3 516	474 880	(4 395)
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 213 705 \$)				\$ 20 467
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (237 864) \$)				(47 194)
Moins-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (24 159) \$)				\$ (26 727)

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des actifs — 14,21 % (28 février 2022 : 9,77 %)					
69 ABFC 2003-OPT1 Trust, série 2003 OPT1, catégorie A3, 5,297 %, échéance le 25/04/2033 *	64	0,02	630 National Collegiate Student Loan Trust 2005-1, série 2005 1, catégorie B, 4,997 %, échéance le 26/03/2035 *	520	0,19
1 274 ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series 2005-HE3, série 2005 HE3, catégorie M4, 5,562 %, échéance le 25/05/2035 *	1 137	0,41	77 National Collegiate Student Loan Trust 2006-1, série 2006 1, catégorie A5, 4,967 %, échéance le 25/03/2033 *	72	0,03
669 Aegis Asset Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Ctf5 Ser 2005-4, série 2005 4, catégorie M2, 5,322 %, échéance le 25/10/2035 *	621	0,23	790 National Collegiate Student Loan Trust 2006-3, série 2006 3, catégorie B, 4,977 %, échéance le 26/01/2032 *	615	0,22
950 AGL CLO 12 Ltd, série 2021 12A, catégorie D, 144A, 7,658 %, échéance le 20/07/2034 *	893	0,33	839 National Collegiate Student Loan Trust 2007-2, série 2007 2, catégorie A4, 4,907 %, échéance le 25/01/2033 *	776	0,28
400 Ammc Clo 20 Ltd, série 2017 20A, catégorie E, 144A, 10,602 %, échéance le 17/04/2029 *	385	0,14	1 302 National Collegiate V Commutation Trust, série 2007 33A6, catégorie 1O, 144A, 0,000 %, échéance le 25/03/2038 *	339	0,12
450 Anchorage Capital CLO 3-R Ltd, série 2014 3RA, catégorie E, 144A, 10,302 %, échéance le 28/01/2031 *	388	0,14	2 291 National Collegiate VI 2007-4 Class A-3L Commutation Trust, série 2007 4VI, catégorie O, 144A, 5,356 %, échéance le 29/03/2038 *†	448	0,16
480 Bain Capital Credit CLO 2022-2 Ltd, série 2022 2A, catégorie D1, 144A, 8,303 %, échéance le 22/04/2035 *	443	0,16	1 000 Ocean Trails CLO V, série 2014 5A, catégorie DRR, 144A, 8,265 %, échéance le 13/10/2031 *	854	0,31
660 Bain Capital Credit CLO 2023-1 Ltd, série 2023 1A, catégorie AN, 144A, 0,000 %, échéance le 16/04/2036 *	660	0,24	650 OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 35 Ltd, série 2018 1A, catégorie C, 144A, 7,408 %, échéance le 20/01/2031 *	588	0,21
1 380 Ballyrock CLO 19 Ltd, série 2022 19A, catégorie D, 144A, 11,749 %, échéance le 20/04/2035	1 264	0,46	940 Option One Mortgage Loan Trust 2005-3, série 2005 3, catégorie M4, 5,547 %, échéance le 25/08/2035 *	748	0,27
1 225 Ballyrock CLO 2018-1 Ltd, série 2018 1A, catégorie C, 144A, 7,958 %, échéance le 20/04/2031 *	1 168	0,43	267 Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, série 2007 FXD1, catégorie 1A1, 5,866 %, échéance le 25/01/2037	217	0,08
720 Barings CLO Ltd 2016-II, série 2016 2A, catégorie ER2, 144A, 11,308 %, échéance le 20/01/2032 *	663	0,24	546 Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, série 2007 FXD1, catégorie 2A1, 5,866 %, échéance le 25/01/2037	458	0,17
500 Black Diamond Clo 2019-2 Ltd, série 2019 2A, catégorie A1A, 144A, 6,245 %, échéance le 23/07/2032 *	492	0,18	678 RAMP Series 2006-NC3 Trust, série 2006 NC3, catégorie M1, 5,127 %, échéance le 25/03/2036 *	654	0,24
441 Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd 2016-1, série 2016 1A, catégorie AA, 144A, 2,487 %, échéance le 16/12/2041	406	0,15	80 RBSSP Resecuritization Trust 2010-4, série 2010 4, catégorie 6A2, 144A, 5,825 %, échéance le 26/02/2036	77	0,03
1 000 BlueMountain CLO XXII Ltd, série 2018 22A, catégorie A1, 144A, 5,872 %, échéance le 15/07/2031 *	991	0,36	1 320 Saranac CLO III Ltd, série 2014 3A, catégorie DR, 144A, 8,003 %, échéance le 22/06/2030 *	1 178	0,43
720 CarVal CLO VII Ltd, série 2023 1A, catégorie A1, 144A, 6,883 %, échéance le 20/01/2035 *	721	0,26	320 SMB Private Education Loan Trust 2015-C, série 2015 C, catégorie C, 144A, 4,500 %, échéance le 17/09/2046	296	0,11
255 CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-B, série 2004 B, catégorie 2A, 4,808 %, échéance le 15/02/2029 *	227	0,08	858 Structured Asset Investment Loan Trust 2004-2, série 2004 2, catégorie A4, 5,322 %, échéance le 25/03/2034 *	811	0,29
19 CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2005-D, série 2005 D, catégorie 2A, 4,778 %, échéance le 15/11/2035 *	18	0,01	1 170 Sunrun Athena Issuer 2018-1 LLC, série 2018 1, catégorie A, 144A, 5,310 %, échéance le 30/04/2049	1 111	0,40
698 Dividend Solar Loans 2018-2 LLC, série 2018 2, catégorie B, 144A, 4,250 %, échéance le 20/12/2038	642	0,23	540 Symphony CLO 37 Ltd, série 2022 37A, catégorie A1A, 144A, 6,546 %, échéance le 20/10/2034 *	541	0,20
531 Educational Funding Co LLC/The, série 2006 1A, catégorie A3, 144A, 5,168 %, échéance le 25/04/2033 *	370	0,13	500 Venture XVII CLO Ltd, série 2014 17A, catégorie ERR, 144A, 10,532 %, échéance le 15/04/2027 *	426	0,16
660 Encore Credit Receivables Trust 2005-2, série 2005 2, catégorie M4, 5,547 %, échéance le 25/11/2035 *	604	0,22	750 Voya CLO 2016-3 Ltd, série 2016 3A, catégorie A1R, 144A, 5,985 %, échéance le 18/10/2031 *	745	0,27
78 First Franklin Mortgage Loan Trust 2003-FF4, série 2003 FF4, catégorie M1, 6,366 %, échéance le 25/10/2033 *	74	0,03	1 000 Voya CLO 2017-1 Ltd, série 2017 1A, catégorie C, 144A, 8,122 %, échéance le 17/04/2030 *	923	0,34
1 131 FOCUS Brands Funding LLC, série 2017 1A, catégorie A2II, 144A, 5,093 %, échéance le 30/04/2047	1 026	0,37	200 VOYA CLO 2017-2, série 2017 2A, catégorie D, 144A, 10,812 %, échéance le 07/06/2030 *	173	0,06
540 FS Rialto 2022-FL6 Issuer LLC, série 2022 FL6, catégorie A, 144A, 7,144 %, échéance le 17/08/2037 *	541	0,20	660 WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Series 2007-HE4 Trust, série 2007 HE4, catégorie 1A, 4,787 %, échéance le 25/07/2047 *	477	0,17
1 000 Golub Capital Partners CLO 21M Ltd, série 2014 21A, catégorie CR, 144A, 7,268 %, échéance le 25/01/2031 *	961	0,35	600 Wellfleet CLO 2017-3 Ltd, série 2017 3A, catégorie C, 144A, 7,542 %, échéance le 17/01/2031 *	522	0,19
1 000 Golub Capital Partners CLO 53B Ltd, série 2021 53A, catégorie E, 144A, 11,508 %, échéance le 20/07/2034 *	908	0,33	Total des titres adossés à des actifs (coût 41 801\$)		39 064 14,21
139 GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, série 2021 4GS, catégorie A, 144A, 1,930 %, échéance le 20/07/2048	106	0,04	Titres adossés à des hypothèques — 12,42 % (28 février 2022 : 10,09 %)		
250 Greenwood Park CLO Ltd, série 2018 1A, catégorie E, 144A, 9,742 %, échéance le 15/04/2031 *	210	0,08	286 Alternative Loan Trust 2007-4CB, série 2007 4CB, catégorie 1A5, 5,750 %, échéance le 25/04/2037	241	0,09
1 000 Grippen Park CLO Ltd, série 2017 1A, catégorie D, 144A, 8,108 %, échéance le 20/01/2030 *	939	0,34	202 BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RGG10, série 2016 GG10, catégorie AJA, 144A, 5,648 %, échéance le 10/08/2045 *	52	0,02
1 372 Hardee's Funding LLC, série 2020 1A, catégorie A2, 144A, 3,981 %, échéance le 20/12/2050	1 191	0,43	577 Banc of America Funding Corp, série 2015 R3, catégorie 1A2, 144A, 1,895 %, échéance le 27/03/2036 *	469	0,17
1 400 Harriman Park CLO Ltd, série 2020 1A, catégorie ER, 144A, 11,208 %, échéance le 20/04/2034 *	1 239	0,45	780 BANK 2017-BNK7, série 2017 BNK7, catégorie A4, 3,175 %, échéance le 15/09/2060	715	0,26
145 HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, série 2021 FL1, catégorie C, 144A, 6,290 %, échéance le 16/06/2036 *	136	0,05	140 BBCCRE Trust 2015-GTP, série 2015 GTP, catégorie D, 144A, 4,563 %, échéance le 10/08/2033 *	122	0,04
170 HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, série 2021 FL1, catégorie D, 144A, 6,940 %, échéance le 16/06/2036 *	160	0,06	840 BBSG 2016-MRP Mortgage Trust, série 2016 MRP, catégorie A, 144A, 3,275 %, échéance le 05/06/2036	669	0,24
584 Home Equity Asset Trust 2006-4, série 2006 4, catégorie 2A4, 5,177 %, échéance le 25/08/2036 *	570	0,21	510 BHMS 2018-ATLS, série 2018 ATLS, catégorie C, 144A, 6,488 %, échéance le 15/07/2035 *	491	0,18
750 Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2005-C, série 2005 C, catégorie M2, 5,367 %, échéance le 25/10/2035 *	730	0,27	520 BX Trust 2021-VIEW, série 2021 VIEW, catégorie C, 144A, 6,938 %, échéance le 15/06/2036 *	491	0,18
500 LCM XXII Ltd 22A, catégorie DR, 144A, 10,308 %, échéance le 20/10/2028 *	424	0,15	784 BXMT 2020-FL2 Ltd, série 2020 FL2, catégorie A, 144A, 5,578 %, échéance le 15/02/2038 *	775	0,28
244 Long Beach Mortgage Loan Trust 2005-1, série 2005 1, catégorie M4, 5,892 %, échéance le 25/02/2035 *	236	0,09	480 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, série 2017 P8, catégorie A3, 3,203 %, échéance le 15/09/2050	441	0,16
1 000 Magnetite XII Ltd, série 2015 12A, catégorie ER, 144A, 10,472 %, échéance le 15/10/2031 *	912	0,33	11 117 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, série 2017 P8, catégorie XA, 0,871 %, échéance le 15/09/2050 *	337	0,12
1 270 Marble Point CLO XIV Ltd, série 2018 2A, catégorie D, 144A, 8,338 %, échéance le 20/01/2032 *	1 101	0,40	383 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2018-C5, série 2018 C5, catégorie A3, 3,963 %, échéance le 10/06/2051 *	355	0,13
548 Mastr Asset Backed Securities Trust 2007-HE2, série 2007 HE2, catégorie A1, 5,767 %, échéance le 25/08/2037 *	458	0,17	710 COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, série 2015 DC1, catégorie C, 4,297 %, échéance le 10/02/2048 *	624	0,23
331 Mosaic Solar Loan Trust 2018-1, série 2018 1A, catégorie CERT, 144A, 0,000 %, échéance le 22/06/2043 ∞	202	0,07	360 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, série 2019 R07, catégorie 1B1, 144A, 8,017 %, échéance le 25/10/2039 *	358	0,13
1 336 Mosaic Solar Loan Trust 2022-1, série 2022 1A, catégorie B, 144A, 3,160 %, échéance le 20/01/2053	1 109	0,40	670 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, série 2021 R01, catégorie 1M2, 144A, 6,034 %, échéance le 25/10/2041 *	655	0,24
710 National Collegiate II Commutation Trust, série 2005 AR15, catégorie AR15, 0,000 %, échéance le 01/06/2045	105	0,04	190 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, série 2021 R03, catégorie 1B1, 144A, 7,234 %, échéance le 25/12/2041 *	178	0,07
			700 Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, série 2022 R04, catégorie 1M2, 144A, 7,584 %, échéance le 25/03/2042 *	708	0,26
			940 CSALL 2016-C5 Commercial Mortgage Trust, série 2016 C5, catégorie A5, 3,757 %, échéance le 15/11/2048	895	0,33

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques — (suite)					
330			790		
			Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-4, série 2018		
1 480	282	0,10	4, catégorie M, 144A, 4,750 %, échéance le 25/03/2058	663	0,24
			472 Sequoia Mortgage Trust 2007-2, série 2007 2, catégorie 1A3,		
630	788	0,29	5,238 %, échéance le 20/06/2036 *	436	0,16
			250 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, série 2014 STAR,		
618	592	0,22	catégorie C, 144A, 7,338 %, échéance le 15/11/2027 *	26	0,01
700	503	0,18	410 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, série 2014 STAR,		
			catégorie D, 144A, 8,088 %, échéance le 15/11/2027 *	16	0,01
790	697	0,25	370 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, série 2014 STAR,		
			catégorie E, 144A, 8,988 %, échéance le 15/11/2027 *†	1	–
630	823	0,30	853 Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, série 2018 THL,		
			catégorie D, 144A, 6,872 %, échéance le 11/11/2034 *	837	0,30
950	669	0,24	834 Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, série 2018 THL,		
			catégorie E, 144A, 8,052 %, échéance le 11/11/2034 *	810	0,29
2 500	991	0,36	891 Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, série 2018 THL,		
			catégorie F, 144A, 8,824 %, échéance le 11/11/2034 *	854	0,31
100	2 409	0,88	63 Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Series		
			2007-C33, série 2007 C33, catégorie AJ, 5,871 %, échéance		
520	98	0,04	le 15/02/2051 *	56	0,02
			105 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series		
500	508	0,18	2005-AR17 Trust, série 2005 AR17, catégorie A1C3,		
			5,577 %, échéance le 25/12/2045 *	67	0,02
680	527	0,19	2 326 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series		
			2005-AR2 Trust, série 2005 AR2, catégorie B1, 5,412 %,		
570	663	0,24	échéance le 25/01/2045 *	1 865	0,68
			326 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series		
450	540	0,20	2006-AR13 Trust, série 2006 AR13, catégorie 2A, 4,293 %,		
			échéance le 25/10/2046 *	291	0,11
164	467	0,17	130 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR3		
			Trust, série 2006 AR3, catégorie A1B, 3,793 %, échéance le		
380	89	0,03	25/02/2046 *	114	0,04
			743 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C38, série		
462	381	0,14	2017 C38, catégorie A4, 3,190 %, échéance le 15/07/2050	681	0,25
			Total des titres adossés à des hypothèques (coût 38 2745)	34 158	12,42
60	200	0,07	Obligations et bons d'entreprises — 59,17 % (28 février 2022 : 52,04 %)		
			Argentine — 0,35 % (28 février 2022 : 0,55 %)		
330	53	0,02	410 Transportadora de Gas del Sur SA, 144A, 6,750 %, échéance		
			le 02/05/2025	385	0,14
1 242	932	0,34	290 YPF SA, 144A, 8,500 %, échéance le 28/07/2025	260	0,09
			420 YPF SA, 144A, 6,950 %, échéance le 21/07/2027	329	0,12
1 010	–	–		974	0,35
			Belgique — 0,37 % (28 février 2022 : 0,31 %)		
2	2	–	EUR 1 000 KBC Group NV, 4,750 %, perpétuelle *	1 027	0,37
1 300	991	0,36	Bermudes — 0,38 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
			1 130 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings		
84	73	0,03	Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, échéance le 15/10/2025	1 041	0,38
			Brésil — 1,03 % (28 février 2022 : 1,59 %)		
281	124	0,05	460 B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 144A,		
			4,125 %, échéance le 20/09/2031	382	0,14
31	8	–	550 Braskem Netherlands Finance BV, 144A, 4,500 %, échéance		
			le 10/01/2028	496	0,18
31	8	–	370 Mercadolibre Inc, 3,125 %, échéance le 14/01/2031	286	0,10
500	476	0,17	690 Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, échéance le 05/06/2115	576	0,21
			800 Suzano Austria GmbH, série DM3N, 3,125 %, échéance le		
381	335	0,12	15/01/2032	631	0,23
			450 Vale Overseas Ltd, 6,875 %, échéance le 10/11/2039	460	0,17
159	116	0,04		2 831	1,03
			Canada — 2,18 % (28 février 2022 : 1,96 %)		
880	722	0,26	780 Air Canada, 144A, 3,875 %, échéance le 15/08/2026	703	0,26
			250 Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,375 %, échéance		
361	279	0,10	le 15/01/2028	226	0,08
			CAD 420 Doman Building Materials Group Ltd, 144A, 5,250 %,		
726	659	0,24	échéance le 15/05/2026	280	0,10
			865 GFL Environmental Inc, 144A, 5,125 %, échéance le		
254	228	0,08	15/12/2026	829	0,30
			380 GFL Environmental Inc, 144A, 4,750 %, échéance le		
441	371	0,14	15/06/2029	338	0,12
			280 Hudbay Minerals Inc, 144A, 4,500 %, échéance le 01/04/2026	252	0,09
263	258	0,09	390 Hudbay Minerals Inc, 144A, 6,125 %, échéance le 01/04/2029	345	0,13
			440 MEG Energy Corp, 144A, 7,125 %, échéance le 01/02/2027	447	0,16
610	602	0,22	1 050 MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, échéance le 01/02/2029	980	0,36
			140 Open Text Corp, 144A, 3,875 %, échéance le 15/02/2028	121	0,04
1 226	1 102	0,40	270 Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, échéance le		
			15/02/2030	223	0,08
			250 Superior LP / Superior General Partner Inc, 144A,		
			4,500 %, échéance le 15/03/2029	217	0,08
			250 TransAlta Corp, 7,750 %, échéance le 15/11/2029	256	0,09
			860 TransAlta Corp, 6,500 %, échéance le 15/03/2040	784	0,29
				6 001	2,18
			Îles Caïman — 0,42 % (28 février 2022 : 0,32 %)		
			1 274 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, échéance le		
			15/09/2024	1 153	0,42
			Chili — 0,21 % (28 février 2022 : 0,25 %)		
			803 VTR Comunicaciones SpA, 144A, 5,125 %, échéance le		
			15/01/2028	568	0,21

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative			
Obligations et bons d'entreprises — (suite)								
Chine — 0,30 % (28 février 2022 : 0,32 %)								
400 Country Garden Holdings Co Ltd, 8,000 %, échéance le 27/01/2024	349	0,13	Pays-Bas — 0,48 % (28 février 2022 : 0,42 %)					
200 Prosperous Ray Ltd, 4,625 %, échéance le 12/11/2023	199	0,07						
370 Prosus SA, 144A, 3,061 %, échéance le 13/07/2031	284	0,10						
	832	0,30	EUR 1 000 Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, perpétuelle *	987	0,36			
Danemark — 0,29 % (28 février 2022 : 0,00 %)								
800 Danske Bank A/S, 144A, 6,466 %, échéance le 09/01/2026 *	805	0,29	EUR 310 Stichting AK Rabobank Certificaten, 6,500 %, perpétuelle	323	0,12			
France — 0,74 % (28 février 2022 : 0,38 %)								
200 Altice France SA/France, 144A, 8,125 %, échéance le 01/02/2027	187	0,07	Porto Rico — 0,03 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
550 BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, perpétuelle *	562	0,20						
1 270 Crédit Agricole SA, 144A, 8,125 %, perpétuelle *	1 288	0,47						
	2 037	0,74	80 Liberty Latin America Ltd, 2,000 %, échéance le 15/07/2024	74	0,03			
Allemagne — 0,78 % (28 février 2022 : 0,21 %)								
320 Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 5,500 %, échéance le 15/01/2028	283	0,10	Singapour — 0,08 % (28 février 2022 : 0,12 %)					
120 Mercer International Inc, 5,125 %, échéance le 01/12/2029	99	0,04						
EUR 100 Nidda BondCo GmbH, 5,000 %, échéance le 30/09/2025	104	0,04						
1 733 ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750 %, échéance le 29/04/2025	1 657	0,60	220 Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4,250 %, échéance le 19/06/2024	216	0,08			
	2 143	0,78	Afrique du Sud — 0,09 % (28 février 2022 : 0,25 %)					
Guatemala — 0,11 % (28 février 2022 : 0,00 %)								
363 Millicom International Cellular SA, 144A, 4,500 %, échéance le 27/04/2031	293	0,11						
Hong Kong — 0,29 % (28 février 2022 : 0,17 %)								
200 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 4,875 %, échéance le 06/06/2025	187	0,07	Suisse — 1,75 % (28 février 2022 : 0,27 %)					
730 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, échéance le 12/04/2029	606	0,22						
	793	0,29						
Irlande — 0,33 % (28 février 2022 : 0,20 %)								
630 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, échéance le 30/01/2032	505	0,19	250 Crédit Suisse AG/New York NY, 1,000 %, échéance le 05/05/2023	247	0,09			
420 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 4,250 %, échéance le 15/04/2026	390	0,14	700 Crédit Suisse Group AG, 144A, 6,537 %, échéance le 12/08/2033 *	629	0,23			
	895	0,33	500 Crédit Suisse Group AG, 144A, 9,016 %, échéance le 15/11/2033 *	525	0,19			
Israël — 0,50 % (28 février 2022 : 0,53 %)								
1 230 Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, échéance le 01/02/2036	1 112	0,40	200 Crédit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, perpétuelle *†€	148	0,05			
300 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, échéance le 09/05/2027	270	0,10	910 Crédit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, perpétuelle *†€	826	0,30			
	1 382	0,50	200 Crédit Suisse Group AG, 144A, 7,500 %, perpétuelle *†€	175	0,06			
Italie — 0,46 % (28 février 2022 : 0,30 %)								
230 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, échéance le 15/01/2026	220	0,08	1 500 UBS Group SA, 144A, 7,000 %, perpétuelle *	1 497	0,55			
530 UniCredit SpA, 144A, 7,296 %, échéance le 02/04/2034 *	500	0,18	390 Vistajet Malta Finance Plc / XO Management Holding Inc, 144A, 7,875 %, échéance le 01/05/2027	372	0,14			
640 UniCredit SpA, 144A, 5,459 %, échéance le 30/06/2035 *	544	0,20	440 Vistajet Malta Finance Plc / XO Management Holding Inc, 144A, 6,375 %, échéance le 01/02/2030	386	0,14			
	1 264	0,46		4 805	1,75			
Kazakhstan — 0,20 % (28 février 2022 : 0,52 %)								
380 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 4,750 %, échéance le 19/04/2047	349	0,13	Émirats arabes unis — 0,23 % (28 février 2022 : 0,26 %)					
230 KazTransGas JSC, 144A, 4,375 %, échéance le 26/09/2027	208	0,07						
	557	0,20						
Koweït — 0,27 % (28 février 2022 : 0,27 %)								
730 MEGlobal Canada ULC, 144A, 5,875 %, échéance le 18/05/2030	747	0,27	660 DP World Ltd/Emirats Arabes Unis, 144A, 5,625 %, échéance le 25/09/2048	639	0,23			
Luxembourg — 0,94 % (28 février 2022 : 0,61 %)								
1 650 Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, échéance le 15/05/2027	1 364	0,50	Royaume-Uni — 1,64 % (28 février 2022 : 2,09 %)					
500 ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, échéance le 30/06/2027	410	0,15						
570 Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, échéance le 01/04/2028	591	0,21						
220 FAGE International SA / FAGE USA Dairy Industry Inc, 144A, 5,625 %, échéance le 15/08/2026	207	0,08	210 Barclays Plc, 7,750 %, perpétuelle *	209	0,08			
	2 572	0,94	320 Lloyds Banking Group Plc, 4,947 %, perpétuelle *	325	0,12			
Macao — 0,82 % (28 février 2022 : 0,44 %)								
270 Sands China Ltd, 5,625 %, échéance le 08/08/2025	262	0,09	250 Lloyds Banking Group Plc, 7,500 %, perpétuelle *	247	0,09			
200 Sands China Ltd, 5,900 %, échéance le 08/08/2028	189	0,07	242 McLaren Finance Plc, 144A, 7,500 %, échéance le 01/08/2026	190	0,07			
200 Sands China Ltd, 3,350 %, échéance le 03/08/2029	164	0,06	970 NatWest Group Plc, 4,500 %, perpétuelle *	950	0,35			
200 Sands China Ltd, 3,750 %, échéance le 08/08/2031	158	0,06	690 Neptune Energy Bondco Plc, 144A, 6,625 %, échéance le 15/05/2025	672	0,24			
1 550 Wynn Macau Ltd, 144A, 4,875 %, échéance le 01/10/2024	1 483	0,54	800 Saga Plc, 5,500 %, échéance le 15/07/2026	779	0,28			
	2 256	0,82	950 Virgin Media Secured Finance plc, 144A, 5,500 %, échéance le 15/05/2029	862	0,31			
Malaisie — 0,12 % (28 février 2022 : 0,19 %)								
490 Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, échéance le 19/08/2050	341	0,12	330 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, échéance le 15/07/2031	274	0,10			
Mexique — 0,35 % (28 février 2022 : 0,41 %)								
1 020 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Caïman, 144A, 7,500 %, perpétuelle *	957	0,35		4 508	1,64			
			États-Unis — 42,60 % (28 février 2022 : 37,58 %)					
			720 Abercrombie & Fitch Management Co, 144A, 8,750 %, échéance le 15/07/2025	726	0,26			
			1 103 Accelerate360 Holdings LLC, 144A, 8,000 %, échéance le 01/03/2028	1 165	0,42			
			330 Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144A, 5,000 %, échéance le 01/05/2028	263	0,10			
			630 AdaptHealth LLC, 144A, 6,125 %, échéance le 01/08/2028	580	0,21			
			286 Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, échéance le 01/03/2028	264	0,10			
			690 Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 6,375 %, échéance le 15/06/2030	660	0,24			
			447 Akumin Escrow Inc, 144A, 7,500 %, échéance le 01/08/2028	313	0,11			
			300 Akumin Inc, 144A, 7,000 %, échéance le 01/11/2025	239	0,09			
			240 Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 6,125 %, échéance le 15/05/2028	236	0,09			
			1 310 Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144A, 10,500 %, échéance le 15/02/2028	566	0,21			
			300 Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,625 %, échéance le 15/07/2026	285	0,10			
			40 Altria Group Inc, 2,450 %, échéance le 04/02/2032	30	0,01			
			340 Altria Group Inc, 5,950 %, échéance le 14/02/2049	305	0,11			
			170 AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 7,500 %, échéance le 15/02/2029	102	0,04			
			324 American Airlines 2017-1 Class B Pass Through Trust, série B, 4,950 %, échéance le 15/02/2025	315	0,11			
			71 American Airlines 2017-2 Class B Pass Through Trust, série B, 3,700 %, échéance le 15/02/2025	66	0,02			
			190 American Airlines Inc, 144A, 11,750 %, échéance le 15/07/2025	209	0,08			
			430 American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, échéance le 15/02/2028	420	0,15			
			30 American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, échéance le 20/04/2026	29	0,01			
			720 American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, échéance le 20/04/2029	686	0,25			
			1 162 American News Co LLC, 144A, 8,500 %, échéance le 01/09/2026	1 329	0,48			
			190 Antero Resources Corp, 144A, 5,375 %, échéance le 01/03/2030	173	0,06			
			350 Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 5,375 %, échéance le 15/10/2023	348	0,13			
			130 Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 144A, 4,625 %, échéance le 15/06/2029	100	0,04			

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
États-Unis — (suite)					
210 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000 %, échéance le 15/06/2027	203	0,07	260 CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, échéance le 15/01/2030	149	0,05
480 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 4,000 %, échéance le 01/09/2029	385	0,14	240 CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, échéance le 01/12/2030	174	0,06
740 AthenaHealth Group Inc, 144A, 6,500 %, échéance le 15/02/2030	586	0,21	530 CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, échéance le 15/11/2031	377	0,14
90 Aviation Capital Group LLC, 144A, 5,500 %, échéance le 15/12/2024	89	0,03	270 CVS Health Corp, 5,050 %, échéance le 25/03/2048	243	0,09
350 Ball Corp, 2,875 %, échéance le 15/08/2030	280	0,10	1 340 Darling Ingredients Inc, 144A, 6,000 %, échéance le 15/06/2030	1 296	0,47
340 Ball Corp, 3,125 %, échéance le 15/09/2031	273	0,10	330 DCP Midstream Operating LP, 5,625 %, échéance le 15/07/2027	327	0,12
320 Bath & Body Works Inc, 5,250 %, échéance le 01/02/2028	298	0,11	470 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,750 %, échéance le 15/09/2037	494	0,18
510 Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, échéance le 01/10/2030	484	0,18	950 Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, échéance le 01/05/2025	970	0,35
170 Bausch Health Americas Inc, 144A, 9,250 %, échéance le 01/04/2026	127	0,05	290 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, échéance le 01/12/2029	256	0,09
340 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, échéance le 01/11/2025	296	0,11	1 430 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, échéance le 15/08/2027	1 280	0,47
320 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, échéance le 01/02/2027	221	0,08	800 DISH DBS Corp, 5,875 %, échéance le 15/11/2024	750	0,27
140 Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,000 %, échéance le 15/01/2028	63	0,02	530 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, échéance le 01/12/2028	424	0,15
70 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,000 %, échéance le 30/01/2028	30	0,01	800 DISH Network Corp, coupon zéro, échéance le 15/12/2025	514	0,19
1 540 Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, échéance le 15/02/2026	1 453	0,53	260 DISH Network Corp, 3,375 %, échéance le 15/08/2026	167	0,06
320 Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625 %, échéance le 01/09/2028	280	0,10	196 Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, échéance le 15/06/2025	190	0,07
1 140 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, échéance le 15/12/2025	1 147	0,42	760 DraftKings Holdings Inc, coupon zéro, échéance le 15/03/2028	534	0,19
360 Boeing Co/The, 3,250 %, échéance le 01/02/2035	278	0,10	280 El Paso Natural Gas Co LLC, 7,500 %, échéance le 15/11/2026	297	0,11
440 Boeing Co/The, 5,930 %, échéance le 01/05/2060	412	0,15	623 Endeavour Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 5,750 %, échéance le 30/01/2028	602	0,22
660 Boyne USA Inc, 144A, 4,750 %, échéance le 15/05/2029	585	0,21	220 Energy Transfer LP, 5,350 %, échéance le 15/05/2045	188	0,07
280 Builders FirstSource Inc, 144A, 4,250 %, échéance le 01/02/2032	235	0,09	260 Energy Transfer LP, 6,250 %, échéance le 15/04/2049	248	0,09
230 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, échéance le 15/04/2030	199	0,07	320 Energy Transfer LP, série G, 7,125 %, perpétuelle *	285	0,10
240 Caesars Entertainment Inc, 144A, 8,125 %, échéance le 01/07/2027	243	0,09	260 Entegris Inc, 144A, 4,375 %, échéance le 15/04/2028	230	0,08
840 Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000 %, échéance le 15/02/2030	847	0,31	330 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, échéance le 15/02/2078 *	276	0,10
590 Carnival Corp, 144A, 4,000 %, échéance le 01/08/2028	499	0,18	170 EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,000 %, échéance le 01/07/2025	164	0,06
680 Carnival Corp, 144A, 10,500 %, échéance le 01/06/2030	659	0,24	190 EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500 %, échéance le 01/07/2027	180	0,07
474 Carnival Plc, 7,875 %, échéance le 01/06/2027	470	0,17	740 EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500 %, échéance le 01/06/2030	706	0,26
160 Carriage Purchaser Inc, 144A, 7,875 %, échéance le 15/10/2029	120	0,04	650 EQT Corp, 6,125 %, échéance le 01/02/2025	652	0,24
460 Carriage services Inc, 144A, 4,250 %, échéance le 15/05/2029	370	0,13	80 EQT Corp, 7,000 %, échéance le 01/02/2030	83	0,03
110 Carrolls Restaurant Group Inc, 144A, 5,875 %, échéance le 01/07/2029	84	0,03	620 FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, échéance le 01/01/2030	549	0,20
750 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, échéance le 15/08/2030	618	0,22	250 FirstEnergy Corp, série B, 4,150 %, échéance le 15/07/2027	233	0,09
500 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, échéance le 01/02/2032	405	0,15	1 500 Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 7,875 %, échéance le 15/11/2025	1 356	0,49
870 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, échéance le 01/05/2032	689	0,25	520 Foot Locker Inc, 144A, 4,000 %, échéance le 01/10/2029	428	0,16
120 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, échéance le 01/06/2033	93	0,03	690 Ford Motor Co, 3,250 %, échéance le 12/02/2032	524	0,19
70 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, échéance le 15/01/2034	52	0,02	1 540 Ford Motor Co, 6,100 %, échéance le 19/08/2032	1 436	0,52
380 CDW LLC / CDW Finance Corp, 4,125 %, échéance le 01/05/2025	363	0,13	450 Ford Motor Credit Co LLC, 5,125 %, échéance le 16/06/2025	435	0,16
170 CDW LLC / CDW Finance Corp, 3,250 %, échéance le 15/02/2029	143	0,05	200 Ford Motor Credit Co LLC, 3,625 %, échéance le 17/06/2031	159	0,06
20 Centene Corp, 4,250 %, échéance le 15/12/2027	18	0,01	1 350 Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, échéance le 15/03/2043	1 221	0,44
1 290 Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250 %, échéance le 15/06/2029	1 263	0,46	1 370 Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, échéance le 15/02/2028	1 316	0,48
290 Chart Industries Inc, 144A, 7,500 %, échéance le 01/01/2030	295	0,11	480 Gannett Holdings LLC, 144A, 6,000 %, échéance le 01/11/2026	404	0,15
270 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, échéance le 30/03/2029	252	0,09	220 Gartner Inc, 144A, 3,625 %, échéance le 15/06/2029	190	0,07
60 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,384 %, échéance le 23/10/2035	58	0,02	1 440 Gen Digital Inc, 144A, 7,125 %, échéance le 30/09/2030	1 406	0,51
210 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, échéance le 01/04/2038	176	0,06	430 Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp, 8,875 %, échéance le 15/04/2030	433	0,16
420 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, échéance le 01/07/2049	324	0,12	540 GEO Group Inc/The, 10,500 %, échéance le 30/06/2028	550	0,20
1 020 Chord Energy Corp, 144A, 6,375 %, échéance le 01/06/2026	985	0,36	157 GEO Group Inc/The, 144A, 9,500 %, échéance le 31/12/2028	152	0,06
1 050 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,125 %, échéance le 01/04/2030	720	0,26	950 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, échéance le 15/12/2028	818	0,30
490 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 4,750 %, échéance le 15/02/2031	379	0,14	1 590 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, échéance le 20/01/2026	1 480	0,54
610 Clarios Global LP / Clarios US Finance Co, 144A, 8,500 %, échéance le 15/05/2027	607	0,22	650 Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 6,250 %, échéance le 15/04/2032	590	0,21
410 Coinbase Global Inc, 144A, 3,625 %, échéance le 01/10/2031	248	0,09	580 Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 6,750 %, échéance le 15/01/2027	553	0,20
450 CommScope Inc, 144A, 6,000 %, échéance le 01/03/2026	434	0,16	590 iHeartCommunications Inc, 144A, 4,750 %, échéance le 15/01/2028	497	0,18
540 CommScope Inc, 144A, 7,125 %, échéance le 01/07/2028	426	0,15	1 120 IIP Operating Partnership LP, 5,500 %, échéance le 25/05/2026	971	0,35
620 CommScope Inc, 144A, 4,750 %, échéance le 01/09/2029	506	0,18	1 380 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 4,500 %, échéance le 15/11/2029	1 213	0,44
910 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, échéance le 15/01/2031	862	0,31	270 Jazz Securities DAC, 144A, 4,375 %, échéance le 15/01/2029	239	0,09
910 CoreCivic Inc, 8,250 %, échéance le 15/04/2026	922	0,34	60 Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,250 %, échéance le 01/02/2027	51	0,02
310 CrowdStrike Holdings Inc, 3,000 %, échéance le 15/02/2029	261	0,10	220 Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,750 %, échéance le 15/06/2029	179	0,07
540 CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, échéance le 01/02/2029	458	0,17	1 010 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, échéance le 08/08/2024	973	0,35
			100 Las Vegas Sands Corp, 3,500 %, échéance le 18/08/2026	92	0,03
			410 Legacy LifePoint Health LLC, 144A, 6,750 %, échéance le 15/04/2025	392	0,14
			300 Legacy LifePoint Health LLC, 144A, 4,375 %, échéance le 15/02/2027	254	0,09
			620 Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc, 144A, 5,000 %, échéance le 01/02/2026	565	0,21
			690 Liberty Interactive LLC, 8,500 %, échéance le 15/07/2029	317	0,12
			70 Liberty TripAdvisor Holdings Inc, 144A, 0,500 %, échéance le 30/06/2051	55	0,02
			490 LPL Holdings Inc, 144A, 4,000 %, échéance le 15/03/2029	432	0,16
			190 Match Group Holdings II LLC, 144A, 5,000 %, échéance le 15/12/2027	177	0,06
			290 Match Group Holdings II LLC, 144A, 4,625 %, échéance le 01/06/2028	258	0,09
			323 McClatchy Co LLC/The, 144A, 11,000 %, échéance le 15/07/2027	366	0,13
			330 Medline Borrower LP, 144A, 3,875 %, échéance le 01/04/2029	275	0,10

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
États-Unis — (suite)					
450 Medline Borrower LP, 144A, 5,250 %, échéance le 01/10/2029	370	0,13	490 Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, échéance le 01/09/2026	428	0,16
440 Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250 %, échéance le 01/05/2028	367	0,13	260 Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144A, 6,000 %, échéance le 31/12/2030	225	0,08
660 Michaels Cos Inc/The, 144A, 7,875 %, échéance le 01/05/2029	497	0,18	1 010 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, échéance le 01/02/2031	918	0,33
560 Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 6,500 %, échéance le 01/05/2028	484	0,18	190 Tenet Healthcare Corp, 144A, 5,125 %, échéance le 01/11/2027	179	0,07
300 Minerals Technologies Inc, 144A, 5,000 %, échéance le 01/07/2028	270	0,10	310 Time Warner Cable LLC, 6,750 %, échéance le 15/06/2039	298	0,11
930 Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 13,250 %, échéance le 15/12/2027	993	0,36	1 630 Titan International Inc, 7,000 %, échéance le 30/04/2028	1 546	0,56
670 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,500 %, échéance le 15/03/2031	460	0,17	260 TKC Holdings Inc, 144A, 6,875 %, échéance le 15/05/2028	213	0,08
90 MSC1 Inc, 144A, 3,875 %, échéance le 15/02/2031	78	0,03	350 TopBuild Corp, 144A, 3,625 %, échéance le 15/03/2029	292	0,11
150 Navient Corp, 5,625 %, échéance le 01/08/2033	113	0,04	260 TransDigm Inc, 144A, 8,000 %, échéance le 15/12/2025	266	0,10
620 NCL Corp Ltd, 144A, 3,625 %, échéance le 15/12/2024	583	0,21	1 000 TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, échéance le 15/03/2026	988	0,36
290 NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, échéance le 15/03/2026	251	0,09	270 TransDigm Inc, 7,500 %, échéance le 15/03/2027	267	0,10
550 NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, échéance le 15/02/2027	511	0,19	310 TransDigm Inc, 144A, 6,750 %, échéance le 15/08/2028	309	0,11
410 NCR Corp, 144A, 5,125 %, échéance le 15/04/2029	351	0,13	520 Transocean Inc, 144A, 8,750 %, échéance le 15/02/2030	530	0,19
570 NMI Holdings Inc, 144A, 7,375 %, échéance le 01/06/2025	568	0,21	570 Triumph Group Inc, 7,750 %, échéance le 15/08/2025	546	0,20
610 Northern Oil and Gas Inc, 144A, 8,125 %, échéance le 01/03/2028	589	0,21	620 Tutor Perini Corp, 144A, 6,875 %, échéance le 01/05/2025	519	0,19
2 790 Northwest Acquisitions ULC / Dominion Finco Inc, 144A, 7,125 %, échéance le 01/11/2022	—	—	58 United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, 4,875 %, échéance le 15/01/2026	56	0,02
190 Occidental Petroleum Corp, 7,200 %, échéance le 15/03/2029	199	0,07	80 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, échéance le 15/04/2026	75	0,03
220 Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, échéance le 09/01/2030	226	0,08	1 490 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, échéance le 15/04/2029	1 322	0,48
110 Occidental Petroleum Corp, 7,500 %, échéance le 05/01/2031	118	0,04	280 United Rentals North America Inc, 5,500 %, échéance le 15/05/2027	275	0,10
690 Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, échéance le 15/09/2036	694	0,25	270 United Rentals North America Inc, 144A, 6,000 %, échéance le 15/12/2029	270	0,10
120 Olin Corp, 5,000 %, échéance le 01/02/2030	109	0,04	930 United Rentals North America Inc, 5,250 %, échéance le 15/01/2030	878	0,32
840 Option Care Health Inc, 144A, 4,375 %, échéance le 31/10/2029	721	0,26	420 United Rentals North America Inc, 3,875 %, échéance le 15/02/2031	360	0,13
390 Pactiv LLC, 8,375 %, échéance le 15/04/2027	393	0,14	50 United Rentals North America Inc, 3,750 %, échéance le 15/01/2032	42	0,02
1 104 Park-Ohio Industries Inc, 6,625 %, échéance le 15/04/2027	843	0,31	460 Upbound Group Inc, 144A, 6,375 %, échéance le 15/02/2029	395	0,14
390 Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp, 144A, 4,000 %, échéance le 15/06/2029	311	0,11	440 US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, échéance le 15/07/2027	141	0,05
1 580 Permian Resources Operating LLC, 144A, 5,875 %, échéance le 01/07/2029	1 419	0,52	970 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 6,250 %, échéance le 15/01/2030	958	0,35
670 Plains All American Pipeline LP, série B, 8,974 %, perpétuelle *	623	0,23	300 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, échéance le 01/11/2033	245	0,09
680 PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500 %, échéance le 01/10/2028	622	0,23	170 Vericast Corp, 144A, 11,000 %, échéance le 15/09/2026	183	0,07
880 Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 3,375 %, échéance le 31/08/2027	762	0,28	200 Vericast Corp, 144A, 12,500 %, échéance le 15/12/2027	227	0,08
250 Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 6,250 %, échéance le 15/01/2028	232	0,08	822 Vertiv Group Corp, 144A, 4,125 %, échéance le 15/11/2028	715	0,26
330 QVC Inc, 5,450 %, échéance le 15/08/2034	165	0,06	160 Viavi Solutions Inc, 144A, 3,750 %, échéance le 01/10/2029	134	0,05
420 Rackspace Technology Global Inc, 144A, 3,500 %, échéance le 15/02/2028	256	0,09	190 Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, échéance le 15/02/2029	163	0,06
550 Radiology Partners Inc, 144A, 9,250 %, échéance le 01/02/2028	330	0,12	880 Viper Energy Partners LP, 144A, 5,375 %, échéance le 01/11/2027	838	0,30
900 Range Resources Corp, 8,250 %, échéance le 15/01/2029	924	0,34	630 VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, échéance le 15/02/2028	556	0,20
360 Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, échéance le 15/02/2030	323	0,12	1 100 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 3,755 %, échéance le 15/03/2027	1 010	0,37
670 ROCC Holdings LLC, 144A, 9,250 %, échéance le 15/08/2026	708	0,26	450 Western Midstream Operating LP, 3,350 %, échéance le 01/02/2025	427	0,16
830 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 3,625 %, échéance le 01/03/2029	668	0,24	990 Western Midstream Operating LP, 5,450 %, échéance le 01/04/2044	837	0,30
50 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 3,875 %, échéance le 01/03/2031	39	0,01	1 000 Western Midstream Operating LP, 5,300 %, échéance le 01/03/2048	826	0,30
590 Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 7,500 %, échéance le 15/07/2038	533	0,19	170 Williams Cos Inc/The, 8,750 %, échéance le 15/03/2032	202	0,07
370 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 11,500 %, échéance le 01/06/2025	394	0,14	400 WW International Inc, 144A, 4,500 %, échéance le 15/04/2029	204	0,07
120 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, échéance le 31/08/2026	110	0,04	390 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, échéance le 15/02/2031	390	0,14
320 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 11,625 %, échéance le 15/08/2027	341	0,12	1 107 XPO CNW Inc, 6,700 %, échéance le 01/05/2034	1 013	0,37
220 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 7,250 %, échéance le 15/01/2030	221	0,08	600 XPO Escrow Sub LLC, 144A, 7,500 %, échéance le 15/11/2027	609	0,22
780 Sabre GLBL Inc, 144A, 11,250 %, échéance le 15/12/2027	780	0,28	710 Ziff Davis Inc, 144A, 4,625 %, échéance le 15/10/2030	600	0,22
1 170 Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 5,625 %, échéance le 01/12/2025	1 142	0,42	180 ZipRecruiter Inc, 144A, 5,000 %, échéance le 15/01/2030	151	0,06
520 Scientific Games International Inc, 144A, 8,625 %, échéance le 01/07/2025	532	0,19	370 ZoomInfo Technologies LLC/ZoomInfo Finance Corp, 144A, 3,875 %, échéance le 01/02/2029	308	0,11
200 Sealed Air Corp., 144A, 6,125 %, échéance le 01/02/2028	197	0,07		117 162	42,60
670 Service Properties Trust, 7,500 %, échéance le 15/09/2025	665	0,24	Zambie — 0,83 % (28 février 2022 : 0,79 %)		
260 Service Properties Trust, 5,500 %, échéance le 15/12/2027	235	0,09	207 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, échéance le 01/04/2025	201	0,07
530 Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc, 144A, 4,625 %, échéance le 01/11/2026	488	0,18	610 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, échéance le 01/03/2026	582	0,21
800 Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed, 144A, 4,625 %, échéance le 01/03/2029	653	0,24	1 600 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, échéance le 15/10/2027	1 503	0,55
550 Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 6,000 %, échéance le 01/11/2028	489	0,18		2 286	0,83
1 240 Southwestern Energy Co, 8,375 %, échéance le 15/09/2028	1 299	0,47	Total des obligations et bons d'entreprises (coût 178 925\$)		
880 Southwestern Energy Co, 4,750 %, échéance le 01/02/2032	757	0,28		162 728	59,17
610 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, échéance le 20/09/2025	613	0,22	Obligations et bons d'État — 5,45 % (28 février 2022 : 14,10 %)		
508 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, échéance le 20/09/2025	510	0,19	Angola — 0,07 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
500 Sprint Capital Corp, 8,750 %, échéance le 15/03/2032	596	0,22	210 Obligation internationale de l'État angolais, 144A, 8,750 %, échéance le 14/04/2032	189	0,07
810 StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, échéance le 15/05/2029	586	0,21	Argentine — 0,68 % (28 février 2022 : 0,67 %)		
830 StoneX Group Inc, 144A, 8,625 %, échéance le 15/06/2025	836	0,30	8 Obligation internationale de l'État argentin, 1,000 %, échéance le 09/07/2029	2	—
320 Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp, 144A, 8,500 %, échéance le 15/10/2026	304	0,11	47 Obligation internationale de l'État argentin, 0,500 %, échéance le 09/07/2030	16	0,01
			500 Obligations du gouvernement Ciudad Autonoma De Buenos Aires, 7,500 %, échéance le 01/06/2027	467	0,17
			2 248 Obligations du gouvernement Provincia de Buenos Aires, 144A, 5,250 %, échéance le 01/09/2037	862	0,31
			665 Provincia de Cordoba, 144A, 6,990 %, échéance le 01/06/2027	514	0,19
				1 861	0,68

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'État — (suite)			
Bahamas — 0,19 % (28 février 2022 : 0,14 %)			
550	Obligation internationale de l'État des Bahamas, 144A, 5,750 %, échéance le 16/01/2024	531	0,19
Brésil — 0,22 % (28 février 2022 : 0,75 %)			
770	Obligation internationale de l'État brésilien, 5,000 %, échéance le 27/01/2045	591	0,22
Côte d'Ivoire — 0,26 % (28 février 2022 : 0,30 %)			
EUR 180	Obligation internationale de l'État ivoirien, 144A, 4,875 %, échéance le 30/01/2032	146	0,05
660	Obligation internationale de l'État ivoirien, 6,125 %, échéance le 15/06/2033	573	0,21
		719	0,26
République dominicaine — 0,23 % (28 février 2022 : 0,26 %)			
700	Obligation internationale de la République dominicaine, 144A, 6,000 %, échéance le 22/02/2033	636	0,23
Gabon — 0,07 % (28 février 2022 : 0,11 %)			
250	Obligation internationale de l'État gabonais, 144A, 7,000 %, échéance le 24/11/2031	204	0,07
Allemagne — 0,10 % (28 février 2022 : 0,09 %)			
EUR 280	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/08/2026	269	0,10
Indonésie — 1,35 % (28 février 2022 : 2,51 %)			
750	Obligation internationale de l'État indonésien, 3,500 %, échéance le 11/01/2028	707	0,26
IDR 29 496 000	Bon du Trésor indonésien, série FR59, 7,000 %, échéance le 15/05/2027	1 967	0,71
IDR 15 502 000	Bon du Trésor indonésien, série FR87, 6,500 %, échéance le 15/02/2031	1 000	0,36
IDR 721 000	Bon du Trésor indonésien, série FR68, 8,375 %, échéance le 15/03/2034	52	0,02
		3 726	1,35
Jordanie — 0,21 % (28 février 2022 : 0,00 %)			
560	Obligation internationale de l'État jordanien, 144A, 7,750 %, échéance le 15/01/2028	576	0,21
Kazakhstan — 0,19 % (28 février 2022 : 0,24 %)			
500	Obligation internationale de l'État kazakh, 5,125 %, échéance le 21/07/2025	518	0,19
Mexique — 0,65 % (28 février 2022 : 0,87 %)			
MXN 13 970	Mexican Bonos, série M 20, 8,500 %, échéance le 31/05/2029	731	0,26
1 280	Obligation internationale de l'État mexicain, 4,750 %, échéance le 08/03/2044	1 065	0,39
		1 796	0,65
Panama — 0,25 % (28 février 2022 : 0,29 %)			
930	Obligation internationale de l'État panaméen, 4,500 %, échéance le 01/04/2056	683	0,25
Pérou — 0,21 % (28 février 2022 : 0,29 %)			
690	Obligation internationale de l'État péruvien, 2,783 %, échéance le 23/01/2031	570	0,21
Qatar — 0,20 % (28 février 2022 : 0,38 %)			
580	Obligation internationale de l'État du Qatar, 4,817 %, échéance le 14/03/2049	553	0,20
États-Unis — 0,57 % (28 février 2022 : 5,80 %)			
1 570	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,125 %, échéance le 31/10/2027	1 562	0,57
Total des obligations et bons d'État (Coût 16 849\$)			
		14 984	5,45
Billets d'emprunt — 5,09 % (28 février 2022 : 6,54 %)			
430	8Th Avenue Food & Provisions Inc, 12,320 %, échéance le 01/10/2026 *†	287	0,10
460	Acrisure LLC, 10,447 %, échéance le 15/02/2027 *	461	0,17
113	Allen Media LLC, 10,230 %, échéance le 10/02/2027 *	95	0,04
3	Allied Universal Holdco LLC, 8,411 %, échéance le 14/05/2028 *	3	—
52	API Group Inc, 7,070 %, échéance le 01/10/2026 *	52	0,02
67	Apollo Group CMR, 7,320 %, échéance le 15/05/2026 *	66	0,02
249	Ascensus Holdings Inc, 8,250 %, échéance le 02/08/2028 *	242	0,09
195	Asurion, LLC, 8,680 %, échéance le 17/08/2028 *	183	0,07
571	Asurion, LLC, 8,978 %, échéance le 19/08/2028 *	540	0,20
193	Asurion LLC, 7,820 %, échéance le 18/12/2026 *	184	0,07
249	Brown Group Holding LLC, 7,047 %, échéance le 07/06/2028 *	248	0,09
220	Caesars Entertainment Inc, 7,817 %, échéance le 25/01/2030 *	220	0,08
315	City Brewing Co LLC, 8,330 %, échéance le 31/03/2028 *	156	0,06
490	Columbus McKinnon Corp, 0,000 %, échéance le 14/05/2028 *	488	0,18
249	DCert Buyer, Inc., 8,696 %, échéance le 16/10/2026 *	246	0,09
644	Equinox Holdings Inc, 13,730 %, échéance le 08/03/2024 *	550	0,20
105	Eyecare Partners LLC, 8,480 %, échéance le 05/02/2027 *	88	0,03
535	First Brands Group LLC, 10,252 %, échéance le 24/03/2027 *	522	0,19
4	Focus Financial Partners LLC, 7,811 %, échéance le 30/06/2028 *	4	—
EUR 790	Froneri Lux FinCo SARL, 5,067 %, échéance le 30/01/2027 *	805	0,29

Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
249	Gainwell Acquisition Corp, 8,730 %, échéance le 01/10/2027 *	241	0,09
208	Garda World Security Corp, 8,850 %, échéance le 30/10/2026 *	208	0,08
77	Global Medical Response, Inc, 8,830 %, échéance le 24/09/2025 *	62	0,02
203	Great Outdoors Group LLC, 8,320 %, échéance le 05/03/2028 *	200	0,07
628	Greystone Select Financial, 9,798 %, échéance le 05/06/2028 *	612	0,22
229	Hayward Industries Inc., 7,911 %, échéance le 28/05/2028 *	224	0,08
196	Hayward Industries Inc., 7,070 %, échéance le 14/05/2028 *	191	0,07
256	Jazz Financing Lux Sarl, 8,070 %, échéance le 22/04/2028 *	256	0,09
476	One Call Corp, 10,375 %, échéance le 07/04/2027 *	397	0,14
797	PECF USS Intermediate Holding Corp, 8,820 %, échéance le 04/11/2028 *	682	0,25
413	Peraton Corporation, 8,320 %, échéance le 22/02/2028 *	410	0,15
738	Polyconcept North America Holdings Inc, 10,080 %, échéance le 12/05/2029 *	722	0,26
499	Prime Security Installations Ltd, 7,517 %, échéance le 23/09/2026 *	498	0,18
130	Project Sky Merger Sub, Inc., 10,570 %, échéance le 10/08/2029 *	117	0,04
249	Quikrete Holdings Inc, 0,000 %, échéance le 18/03/2029 *	249	0,09
316	Redstone Holdco 2 LP, 9,568 %, échéance le 27/04/2028 *	260	0,10
510	Scotera Health Holdings LLC, 0,000 %, échéance le 13/12/2028 *	500	0,18
370	Sedgwick Claims Management Services Inc, 0,000 %, échéance le 17/12/2028 *	366	0,13
550	Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 0,000 %, date d'échéance 27/02/2029 *	549	0,20
695	Tutor Perini Corp, 9,320 %, échéance le 18/08/2027 *	664	0,24
357	US Renal Care Inc, 9,625 %, échéance le 14/06/2026 *	240	0,09
245	UFC Holding LLC, 7,570 %, échéance le 29/04/2026 *	244	0,09
117	United Airlines Inc, 8,568 %, échéance le 14/04/2028 *	117	0,04
249	Vertex Aerospace Services Corp, 8,070 %, échéance 06/12/2028 *	249	0,09
260	Virgin Media Bristol LLC, 7,088 %, échéance le 04/01/2028 *	255	0,09
56	Virgin Pulse Inc, 8,570 %, échéance le 30/03/2028 *	47	0,02
Total des billets d'emprunt (coût 14 906\$)		14 000	5,09
Organismes de placement collectif — 0,18 % (28 février 2022 : 1,55 %)			
EUR 5	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro Accumulating	507	0,18
Total des organismes de placement collectif (Coût 528\$)		507	0,18
Actions privilégiées — 0,88 % (28 février 2022 : 2,23 %)			
États-Unis : 0,88 % (28 février 2022 : 2,23 %)			
67	MPLX LP, série A ∞	2 424	0,88
Total des actions privilégiées (coût 2 188\$)		2 424	0,88
Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat (Coût 293 471\$)		267 865	97,40
Contrats (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Options achetées — 0,20 % (28 février 2022 : 0,11 %)			
—	IMM Euro\$, décembre 2023, achat 99,00, échéance le 18/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	—	—
—	S&P 500 E-mini, juin 2023, vente 3 600,00, échéance le 16/06/2023 – Bank of America Merrill Lynch	28	0,01
—	S&P 500 E-mini, juin 2023, vente 3 700,00, échéance le 16/06/2023 – Bank of America Merrill Lynch	86	0,03
—	S&P 500 E-mini, mars 2023, vente 3 500,00, échéance le 17/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	2	—
—	S&P 500 E-mini, mars 2023, vente 3 600,00, échéance le 17/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	2	—
—	S&P 500 E-mini W3, mai 2023, vente 3 700,00, échéance le 19/05/2023 – Bank of America Merrill Lynch	57	0,02
—	S&P 500 E-mini W3, mai 2023, vente 3 800,00, échéance le 19/05/2023 – Bank of America Merrill Lynch	49	0,02
5 460	Achat USD/Vente JPY 133,80, échéance le 03/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	90	0,03
3 570	Vente USD/achat MXN 19,6440, échéance le 03/07/2023 – Morgan Stanley	252	0,09
Total des options achetées (coût 544\$)		566	0,20
Swaps sur risque de crédit — 0,06 % (28 février 2022 : 0,03 %)			
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		155	0,06
Swaps d'indices — 0,32 % (28 février 2022 : 0,01 %)			
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		878	0,32
Contrats de change à terme — 0,20 % (28 février 2022 : 1,44 %)			
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		536	0,20
Contrats à terme standardisés — 0,02 % (28 février 2022 : 0,21 %)			
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		53	0,02
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		270 053	98,20

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Contrats (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	ABRÉVIATIONS :		% de l'actif total
Options souscrites — (0,01 %) (28 février 2022 : (0,05 %))			Perpétuelle	– Obligation sans date d'échéance. Les obligations perpétuelles ne sont pas rachetables, mais paient des intérêts réguliers.	
– S&P 500 E-mini, juin 2023, vente 3 200,00, échéance le 16/06/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(12)	–	REMIC	– Société relais de placements immobiliers hypothécaires (Real Estate Mortgage Investment Conduit).	
– S&P 500 E-mini, mars 2023, vente 3 300,00, échéance le 17/03/2023 – Bank of America Merrill Lynch	–	–	TBA	– À communiquer.	
– S&P 500 E-mini W3, mai 2023, vente 3 300,00, échéance le 19/05/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(7)	–	CAD	– Dollar canadien	
– S&P 500 E-mini W3, mai 2023, vente 3 500,00, échéance le 19/05/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(17)	(0,01)	EUR	– Euro	
Total des options souscrites (coût (72) \$)	(36)	(0,01)	GBP	– Livre britannique	
Swaps d'indices — 0,00 % (28 février 2022 : 0,00 %)			IDR	– Rupiah indonésienne	
Moins-valeur latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(5)	–	MXN	– Peso mexicain	
Swaps de taux d'intérêt — (0,28 %) (28 février 2022 : (0,15 %))			Analyse de l'actif total		
Moins-valeur latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(756)	(0,28)	Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé		
Contrats de change à terme — (1,08 %) (28 février 2022 : (1,95 %))			Autres valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé		
Moins-valeur latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(2 965)	(1,08)	Organismes de placement collectif		
Contrats à terme standardisés — (0,32 %) (28 février 2022 : (0,60 %))			Instruments financiers dérivés		
Moins-valeur latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(890)	(0,32)	Autres actifs		
Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	(4 652)	(1,69)	Actif total		
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	265 401	96,51			
Autres éléments de l'actif hors passif	9 611	3,49			
Total des actifs nets	275 012\$	100,00			

– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 164 595 000\$, soit 59,80 % de l'actif net.

* Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.

† Illiquide à compter de l'exercice clos le 28 février 2023.

∞ Le titre est évalué de bonne foi à sa juste valeur par le comité d'évaluation ou à sa discrétion.

ε Le titre est en défaut à la date de clôture ou depuis la clôture de l'exercice le 30 juin 2022 (capital et/ou intérêts).

± Titres achetés sur la base d'une détermination future.

β Le taux d'intérêt de ce type de titre est lié à l'indice des prix à la consommation (IPC)/indice des prix de détail (Retail Price Index - RPI). Le taux du coupon est celui au 28 février 2023.

Tableau des swaps sur risque de crédit

Contrepartie	Entité de référence – protection achat/vente	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000 % – vente	20-déc-2027	5 315	\$ 83
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % – vente	20-déc-2027	6 896	72
Plus-valeur latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : 107\$)				\$ 155
Moins-valeur latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				–
Plus-valeur nette des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : 107\$)				\$ 155

Tableau des swaps sur taux d'intérêt

Contrepartie	Taux	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Bank of America Merrill Lynch	Paie flottant MXN TIIE Banxico, reçoit fixe 7,450 %	18-juil-2029	170 990	\$ (756)
Plus-valeur latente des swaps de taux d'intérêt (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				\$ –
Moins-valeur latente des swaps de taux d'intérêt (28 février 2022 (en milliers) : (532) \$)				(756)
Moins-valeur nette des swaps de taux d'intérêt (28 février 2022 (en milliers) : (532) \$)				\$ (756)

Tableau des swaps d'indices

Contrepartie	Entité de référence	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Bank of America Merrill Lynch	Paie fixe 2,510 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15-fév-2048	1 733	\$ 248
Bank of America Merrill Lynch	Paie fixe 2,620 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15-fév-2048	661	82
Bank of America Merrill Lynch	Paie fixe 2,650 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15-août-2047	2 951	355
Bank of America Merrill Lynch	Paie fixe 3,050 %, reçoit flottant USD SOFR OIS Compound	15-fév-2048	903	48
Bank of America Merrill Lynch	Paie fixe 3,250 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	30-sep-2029	4 770	145
Bank of America Merrill Lynch	Paie fixe 3,850 %, reçoit flottant USD SOFR OIS Compound	30-juin-2029	3 468	(5)
Plus-valeur latente des swaps d'indices (28 février 2022 (en milliers) : 30\$)				\$ 878
Moins-valeur latente des swaps d'indices (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				(5)
Moins-valeur nette des swaps d'indices (28 février 2022 (en milliers) : 30\$)				\$ 873

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
08-mar-2023	Morgan Stanley	Achat	USD 1 401	Vente	MXN 28 155	\$ (135)
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD 218	Vente	CAD 294	3
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD 101	Vente	CHF 92	2
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD 1 136	Vente	EUR 1 061	12
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD 8	Vente	GBP 6	–
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD 4 067	Vente	GBP 3 366	20
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	GBP 154 024	Vente	USD 186 147	(823)
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	GBP 599	Vente	USD 718	3
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	CHF 4 057	Vente	USD 4 423	(107)
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	CAD 24 755	Vente	USD 18 416	(271)
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	EUR 47 980	Vente	USD 51 574	(777)
18-avr-2023	Bank of America Merrill Lynch	Achat	USD 1 211	Vente	MXN 23 640	(68)
18-avr-2023	Bank of America Merrill Lynch	Achat	EUR 970	Vente	USD 1 042	(13)
18-avr-2023	BNP Paribas	Achat	USD 9 681	Vente	EUR 8 955	182
18-avr-2023	BNP Paribas	Achat	EUR 940	Vente	USD 1 010	(12)
18-avr-2023	Citi	Achat	EUR 600	Vente	USD 645	(9)
18-avr-2023	Citi	Achat	JPY 72 694	Vente	USD 549	(11)
18-avr-2023	Goldman Sachs	Achat	USD 1 273	Vente	JPY 165 820	46
18-avr-2023	Goldman Sachs	Achat	USD 1 816	Vente	MXN 35 030	(81)
18-avr-2023	Goldman Sachs	Achat	MXN 3 976	Vente	USD 201	14
18-avr-2023	Goldman Sachs	Achat	JPY 706 468	Vente	USD 5 351	(125)
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	USD 247	Vente	AUD 360	4
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	USD 39	Vente	BRL 200	1
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	USD 3 295	Vente	CAD 4 390	75
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	USD 2 628	Vente	CNH 18 007	28
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	USD 3 325	Vente	IDR 51 961 824	(79)
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	USD 127	Vente	JPY 16 010	8
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	USD –	Vente	NZD –	–
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	BRL 1 987	Vente	USD 371	5
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	CAD 5 763	Vente	USD 4 315	(89)
18-avr-2023	JP Morgan	Achat	IDR 13 876 120	Vente	USD 914	(5)
18-avr-2023	Morgan Stanley	Achat	USD 750	Vente	AUD 1 060	35
18-avr-2023	Morgan Stanley	Achat	USD 6 536	Vente	GBP 5 353	92
18-avr-2023	Morgan Stanley	Achat	MXN 2 489	Vente	USD 128	6
18-avr-2023	Morgan Stanley	Achat	NOK 37 429	Vente	USD 3 756	(143)
18-avr-2023	Morgan Stanley	Achat	AUD 9 181	Vente	USD 6 404	(217)
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 5 345\$)						\$ 536
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (7 240) \$)						(2 965)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (1 895) \$)						\$ (2 429)

Tableau des contrats à terme standardisés

	Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
Indice SOFR 3 mois décembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	145	USD 34 347	\$ (285)
Indice SOFR 3 mois décembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	46	11 061	(52)
Indice SOFR 3 mois juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	68	16 086	(136)
Obligation australienne 10 ans, mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	20	1 584	(63)
Obligation Euro-Buxl 30 ans, mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	(1)	(142)	28
ICE SONIA 3 mois, juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	3	860	(2)
ICE SONIA 3 mois, septembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	80	22 908	(59)
Long Gilt juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	22	2 645	(13)
U.S. 10 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	198	22 108	(4)
U.S. 10 Year Ultra Note, juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	38	4 453	2
U.S. 2 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	158	32 189	(73)
U.S. 5 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	47	5 032	(9)
U.S. Long Bond (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(20)	(2 505)	23
U.S. Ultra Bond (CBT) juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	183	24 716	(194)
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 774\$)				\$ 53
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (2 239) \$)				(890)
Moins-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (1 465) \$)				\$ (837)

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des actifs — 12,60 % (28 février 2022 : 19,51 %)					
1 190 Accredited Mortgage Loan Trust 2005-1, série 2005 1, catégorie M5, 4,990 %, échéance le 25/04/2035 *	1 196	0,21	3 362 Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2005-9XS, série 2005 9XS, catégorie M2, 5,592 %, échéance le 25/06/2035 *	3 321	0,59
23 AFC Trust Series 2000-3, série 2000 3, catégorie 1A, 144A, 5,367 %, échéance le 25/10/2030 *	22	—	1 500 Structured Asset Securities Corp Trust 2005-SC1, série 2005 SC1, catégorie 1A1, 144A, 4,887 %, échéance le 25/05/2031 *	1 096	0,20
2 390 BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust, série 1996 1, catégorie B1, 7,875 %, échéance le 10/10/2026	80	0,01	2 451 Sunnova Sol Issuer LLC, série 2020 1A, catégorie B, 144A, 5,540 %, échéance le 01/02/2055	2 121	0,38
696 Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, série 2007 B, catégorie 1A2, 7,331 %, échéance le 28/08/2047	586	0,11	Total des titres adossés à des actifs (coût 91 959\$)	70 510	12,60
1 244 Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, série 2007 B, catégorie 1A3, 7,719 %, échéance le 28/08/2047	323	0,06	Titres adossés à des hypothèques — 80,10 % (28 février 2022 : 73,99 %)		
83 Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-CL1, série 2005 CL1, catégorie A1, 3,216 %, échéance le 25/09/2034 *	80	0,01	463 Alternative Loan Trust 2005-56, série 2005 56, catégorie 4A1, 5,237 %, échéance le 25/11/2035 *	409	0,07
3 660 Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd 2016-1, série 2016 1A, catégorie B, 144A, 5,682 %, échéance le 16/12/2041	2 422	0,43	422 Alternative Loan Trust 2005-59, série 2005 59, catégorie 1A1, 5,251 %, échéance le 20/11/2035 *	383	0,07
5 526 Consec Finance Securitizations Corp, série 2000 3, catégorie A, 144A, 8,260 %, échéance le 01/12/2030 *	1 519	0,27	1 182 Alternative Loan Trust 2005-80CB, série 2005 80CB, catégorie 2A1, 6,000 %, échéance le 25/02/2036	1 112	0,20
818 Certificats adossés à des actifs nationaux, série 2007 SD1, catégorie A1, 144A, 5,517 %, échéance le 25/03/2047 *	678	0,12	2 177 Alternative Loan Trust 2006-19CB, série 2006 19CB, catégorie A14, 6,000 %, échéance le 25/08/2036	1 347	0,24
962 Credit-Based Asset Servicing and Securitization LLC, série 2007 MX1, catégorie A4, 144A, 6,231 %, échéance le 25/12/2036	954	0,17	554 Alternative Loan Trust 2006-19CB, série 2006 19CB, catégorie A15, 6,000 %, échéance le 25/08/2036	342	0,06
1 888 CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2004-9, série 2004 9, catégorie MF2, 5,572 %, échéance le 25/11/2034 *	1 745	0,31	567 Alternative Loan Trust 2006-19CB, série 2006 19CB, catégorie A16, 6,000 %, échéance le 25/08/2036	351	0,06
1 584 Dividend Solar Loans 2018-1 LLC, série 2018 1, catégorie D, 144A, 6,390 %, échéance le 20/07/2038	1 306	0,23	642 Alternative Loan Trust 2006-19CB, série 2006 19CB, catégorie A20, 9,498 %, échéance le 25/08/2036 *	591	0,11
3 318 Dividend Solar Loans 2018-2 LLC, série 2018 2, catégorie D, 144A, 5,910 %, échéance le 20/12/2038	2 809	0,50	620 Alternative Loan Trust 2006-19CB, série 2006 19CB, catégorie A24, 6,000 %, échéance le 25/08/2036	384	0,07
4 869 Fieldstone Mortgage Investment Trust Series 2005-2, série 2005 2, catégorie M3, 5,397 %, échéance le 25/12/2035 *	4 111	0,74	789 Alternative Loan Trust 2006-19CB, série 2006 19CB, catégorie A3, 6,000 %, échéance le 25/08/2036 *	489	0,09
4 First Franklin Mortgage Loan Trust 2002-FF1, série 2002 FF1, catégorie 1A2, 5,691 %, échéance le 25/04/2032 *	3	—	84 Alternative Loan Trust 2006-19CB, série 2006 19CB, catégorie A7, 6,000 %, échéance le 25/08/2036	52	0,01
6 687 Fremont Home Loan Trust 2006-B, série 2006 B, catégorie 1A, 4,917 %, échéance le 25/08/2036 *	2 846	0,51	376 Alternative Loan Trust 2006-19CB, série 2006 19CB, catégorie A8, 6,000 %, échéance le 25/08/2036	233	0,04
2 335 GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, série 2021 4GS, catégorie C, 144A, 3,500 %, échéance le 20/07/2048	1 662	0,30	4 768 Alternative Loan Trust 2006-28CB, série 2006 28CB, catégorie A12, 1,283 %, échéance le 25/10/2036 *†	577	0,10
2 868 GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2022-1, série 2022 1GS, catégorie C, 144A, 3,500 %, échéance le 20/01/2049	1 961	0,35	952 Alternative Loan Trust 2007-23CB, série 2007 23CB, catégorie A8, 9,932 %, échéance le 25/09/2037 *	830	0,15
2 970 HERO Funding Trust 2016-1, série 2016 1A, catégorie R, 144A, 0,000 %, échéance le 20/09/2041	411	0,07	6 455 Alternative Loan Trust 2007-5CB, série 2007 5CB, catégorie 1A20, 0,843 %, échéance le 25/04/2037 *†	682	0,12
500 HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, série 2021 FL1, catégorie E, 144A, 7,540 %, échéance le 16/06/2036 *	468	0,08	2 990 BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, série 2016 GG10, catégorie AJA, 144A, 5,648 %, échéance le 10/08/2045 *	764	0,14
2 650 Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2005-B, série 2005 B, catégorie M6, 5,682 %, échéance le 25/08/2035 *	2 468	0,44	1 046 Banc of America Funding 2015-R4 Trust, série 2015 R4, catégorie 4A2, 144A, 4,500 %, échéance le 27/01/2030 *	1 034	0,18
2 375 Home Partners of America 2021-2 Trust, série 2021 2, catégorie F, 144A, 3,799 %, échéance le 17/12/2026	2 060	0,37	3 970 Banc of America Funding 2015-R4 Trust, série 2015 R4, catégorie 4A3, 144A, 7,589 %, échéance le 27/01/2030 *	1 353	0,24
1 441 Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, série 2021 1GS, catégorie C, 144A, 3,500 %, échéance le 20/01/2048	921	0,17	6 000 BBCCRE Trust 2015-GTP, série 2015 GTP, catégorie F, 144A, 4,563 %, échéance le 10/08/2033 *	4 849	0,87
2 395 Loanpal Solar Loan 2021-2 Ltd, série 2021 2GS, catégorie C, 144A, 3,500 %, échéance le 20/03/2048	1 499	0,27	851 BCAP LLC 2011-RR2 Trust, série 2011 RR2, catégorie 1A4, 144A, 3,399 %, échéance le 26/07/2036 *	403	0,07
1 231 Loanpal Solar Loan Ltd, série 2020 3GS, catégorie C, 144A, 3,500 %, échéance le 20/12/2047	774	0,14	5 940 BCAP LLC 2014-RR2, série 2014 RR2, catégorie 10A2, 144A, 3,540 %, échéance le 26/07/2046 *	5 396	0,96
31 Long Beach Mortgage Loan Trust 2002-2, série 2002 2, catégorie M2, 5,521 %, échéance le 25/07/2032 *	30	0,01	885 BCAP LLC Trust 2007-AA3, série 2007 AA3, catégorie 1A2, 5,157 %, échéance le 25/04/2037 *	1 107	0,20
4 698 Magnolia Finance, 3,114 %, échéance le 09/08/2024	4 593	0,82	1 306 Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2004-AC6, série 2004 AC6, catégorie A1, 5,750 %, échéance le 25/11/2034	1 123	0,20
78 Mastr Specialized Loan Trust, série 2006 2, catégorie A, 144A, 5,137 %, échéance le 25/02/2036 *	75	0,01	1 698 Bellemeade Re 2018-1 Ltd, série 2018 1A, catégorie M2, 144A, 7,517 %, échéance le 25/04/2028 *	1 705	0,30
4 Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust Series 2003-SD1, série 2003 SD1, catégorie A1, 5,617 %, échéance le 25/03/2033 *	4	—	14 000 BHMS 2018-MZB, série 2018 MZB, catégorie MZB, 144A, 11,224 %, échéance le 15/07/2025 *	12 063	2,16
1 281 Mosaic Solar Loan Trust 2018-1, série 2018 1A, catégorie CERT, 144A, 0,000 %, échéance le 22/06/2043 ∞	783	0,14	3 500 BX Trust 2018-GW MZ, série 2018 GWMZ, catégorie MC, 144A, 10,076 %, échéance le 15/05/2037 *	3 450	0,62
3 000 National Collegiate II Commutation Trust, série 2005 AR15, catégorie AR15, 0,000 %, échéance le 01/06/2045	445	0,08	1 750 BX Trust 2018-GW, série 2018 GW, catégorie G, 144A, 7,508 %, échéance le 15/05/2035 *	1 699	0,30
10 796 National Collegiate Student Loan Trust 2005-3, série 2005 3, catégorie B, 5,117 %, échéance le 27/07/2037 *	7 813	1,40	870 BX Trust 2021-VIEW, série 2021 VIEW, catégorie E, 144A, 8,188 %, échéance le 15/06/2036 *	805	0,14
5 987 National Collegiate V Commutation Trust, série 2007 33A5, catégorie 1O, 144A, 0,000 %, échéance le 25/03/2038 *	1 694	0,30	937 Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Series 2004-4, série 2004 4A, catégorie B1, 144A, 4,014 %, échéance le 25/10/2035 *	701	0,13
6 140 National Collegiate V Commutation Trust, série 2007 33A6, catégorie 1O, 144A, 0,000 %, échéance le 25/03/2038 *	1 597	0,29	289 Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Series 2005-1, série 2005 1 A, catégorie A2, 144A, 4,817 %, échéance le 25/01/2036 *	256	0,05
4 252 NRZ Excess Spread-Collateralized Notes, série 2021 FHT1, catégorie A, 144A, 3,104 %, échéance le 25/07/2026	3 764	0,67	469 Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Series 2005-B, série 2005 BA, catégorie B1, 144A, 4,906 %, échéance le 25/06/2036 *	385	0,07
874 Ownit Mortgage Loan Trust Series 2005-3, série 2005 3, catégorie M1, 5,292 %, échéance le 25/06/2036 *	717	0,13	421 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2004-25, série 2004 25, catégorie 2A1, 5,297 %, échéance le 25/02/2035 *	356	0,06
2 536 Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-2, série 2005 2, catégorie M2, 6,217 %, échéance le 25/04/2035	1 849	0,33	393 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-11, série 2005 11, catégorie 3A3, 3,192 %, échéance le 25/04/2035 *	288	0,05
2 485 Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-5, série 2005 5, catégorie MV2, 3,080 %, échéance le 25/11/2035 *	2 208	0,39	549 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-11, série 2005 11, catégorie 6A1, 5,217 %, échéance le 25/03/2035 *	379	0,07
120 SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM 2017-F LLC, série 2017 F, catégorie R1, 144A, 0,000 %, échéance le 25/01/2041	1 710	0,31	214 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-25, série 2005 25, catégorie A15, 6,576 %, échéance le 25/11/2035 *	130	0,02
— Southern Pacific Secured Assets Corp, série 1998 1, catégorie A7, 6,510 %, échéance le 25/12/2027 *	—	—	838 Citicorp Mortgage Securities Trust Series 2007-3, série 2007 3, catégorie 1A4, 6,000 %, échéance le 25/04/2037	767	0,14
734 Stonepeak 2021-1 ABS, série 2021 1A, catégorie A, 144A, 2,675 %, échéance le 28/02/2033	651	0,12	9 200 Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-AR6, série 2006 AR6, catégorie 2A4, 5,057 %, échéance le 25/09/2036 *	3 033	0,54
3 713 Stonepeak 2021-1 ABS, série 2021 1A, catégorie B, 144A, 3,821 %, échéance le 28/02/2033	3 135	0,56	774 Citigroup Mortgage Loan Trust 2008-3, série 2008 3, catégorie A3, 144A, 6,100 %, échéance le 25/04/2037	347	0,06
			3 529 Citigroup Mortgage Loan Trust 2014-J2, série 2014 J2, catégorie B5, 144A, 3,799 %, échéance le 25/11/2044 *	2 125	0,38

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques — (suite)			8 088	Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, série 2020 DNA2, catégorie B2, 144A, 9,417 %, échéance le 25/02/2050 *	7 373 1,32
3 250	COLT 2021-RPL1 Trust, série 2021 RPL1, catégorie B1, 144A, 4,768 %, échéance le 25/09/2061 *	2 697 0,48	530	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, série 2021 DNA5, catégorie B2, 144A, 9,984 %, échéance le 25/01/2034 *	449 0,08
1 908	Comm 2014-UBS2 Mortgage Trust, série 2014 UBS2, catégorie E, 144A, 4,981 %, échéance le 10/03/2047 *	1 611 0,29	5 020	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, série 2021 DNA6, catégorie B2, 144A, 11,984 %, échéance le 25/10/2041 *	4 639 0,83
5 409	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, série 2019 R05, catégorie B1, 144A, 8,717 %, échéance le 25/07/2039 *	5 553 0,99	4 620	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA1, série 2019 DNA1, catégorie B2, 144A, 15,367 %, échéance le 25/01/2049 *	5 376 0,96
8 330	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, série 2019 R07, catégorie B1, 144A, 8,017 %, échéance le 25/10/2039 *	8 280 1,48	2 250	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA2, série 2019 DNA2, catégorie B2, 144A, 15,117 %, échéance le 25/03/2049 *	2 551 0,46
5 760	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, série 2021 R01, catégorie B1, 144A, 7,584 %, échéance le 25/10/2041 *	5 500 0,98	4 600	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, série 2019 DNA3, catégorie B1, 144A, 7,867 %, échéance le 25/07/2049 *	4 720 0,84
86	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, série 2005 C2, catégorie AMFX, 4,877 %, échéance le 15/04/2037	85 0,02	3 100	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, série 2019 DNA3, catégorie B2, 144A, 12,767 %, échéance le 25/07/2049 *	3 273 0,59
320	CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Series 2004-AR5, série 2004 AR5, catégorie CB2, 3,343 %, échéance le 25/06/2034 *	242 0,04	5 550	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA4, série 2019 DNA4, catégorie B2, 144A, 10,867 %, échéance le 25/10/2049 *	5 546 0,99
9 700	CSMC 2014-USA OA LLC, série 2014 USA, catégorie E, 144A, 4,373 %, échéance le 15/09/2037	5 665 1,01	4 000	Freddie Mac Stacr Trust 2019-FTR4, série 2019 FTR4, catégorie B2, 144A, 9,617 %, échéance le 25/1/2047 *	3 526 0,63
9 200	CSMC 2014-USA OA LLC, série 2014 USA, catégorie F, 144A, 4,373 %, échéance le 15/09/2037	4 899 0,88	4 926	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, série 2016 DNA1, catégorie B, 14,617 %, échéance le 25/07/2028 *	5 264 0,94
4 373	CSMC 2017-RPL1 Trust, série 2017 RPL1, catégorie B1, 144A, 2,954 %, échéance le 25/07/2057 *	3 246 0,58	2 508	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, série 2016 DNA2, catégorie B, 15,117 %, échéance le 25/10/2028 *	2 705 0,48
5 017	CSMC 2017-RPL1 Trust, série 2017 RPL1, catégorie B2, 144A, 2,954 %, échéance le 25/07/2057 *	3 311 0,59	2 546	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, série 2016 DNA3, catégorie B, 15,867 %, échéance le 25/12/2028 *	2 810 0,50
4 266	CSMC 2017-RPL1 Trust, série 2017 RPL1, catégorie B3, 144A, 2,954 %, échéance le 25/07/2057 *	2 507 0,45	5 487	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, série 2016 DNA4, catégorie B, 13,217 %, échéance le 25/03/2029 *	5 621 1,00
4 357	CSMC 2017-RPL1 Trust, série 2017 RPL1, catégorie B4, 144A, 2,954 %, échéance le 25/07/2057 *	855 0,15	6 919	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, série 2017 DNA2, catégorie B2, 15,867 %, échéance le 25/10/2029 *	7 182 1,28
2 223	CSMC 2017-RPL3 Trust, série 2017 RPL3, catégorie B3, 144A, 4,415 %, échéance le 01/08/2057 *	2 084 0,37	6 369	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, série 2017 HRP1, catégorie B2D, 7,617 %, échéance le 25/12/2042 *	4 420 0,79
5 998	CSMC 2017-RPL3 Trust, série 2017 RPL3, catégorie B4, 144A, 4,415 %, échéance le 01/08/2057 *	5 452 0,97	5 499	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, série 2018 SP11, catégorie B, 144A, 3,784 %, échéance le 25/02/2048 *	3 089 0,55
7 859	CSMC Mortgage-Backed Trust 2006-7, série 2006 7, catégorie 11A2, 1,883 %, échéance le 25/08/2036 *†	1 206 0,22	5 879	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, série 2018 SP12, catégorie B, 144A, 3,834 %, échéance le 25/05/2048 *	3 436 0,61
99	CSMC Resecuritization Trust 2006-1R, série 2006 1R, catégorie 1A2, 144A, 6,828 %, échéance le 27/07/2036 *	124 0,02	6 862	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, série 2018 SP13, catégorie B, 144A, 4,161 %, échéance le 25/08/2048 *	4 093 0,73
4 622	CSMC Series 2015-2R, série 2015 2R, catégorie 7A2, 144A, 3,598 %, échéance le 27/08/2036 *	3 498 0,63	27 943	FRESB 2018-SB48 Mortgage Trust, série 2018 SB48, catégorie B, 144A, 3,971 %, échéance le 25/02/2038 *	23 010 4,11
4 282	CSMC Trust 2013-IVR5, série 2013 IVR5, catégorie B5, 144A, 3,622 %, échéance le 25/10/2043 *	2 858 0,51	720	Government National Mortgage Association, Series 2010 102, catégorie IO, 0,010 %, échéance le 16/06/2052 *	– –
2 000	CSMC Trust 2017-CHOP, série 2017 CHOP, catégorie H, 144A, 11,938 %, échéance le 15/07/2032 *	1 860 0,33	3 894	Government National Mortgage Association, Series 2010 13, catégorie IO, 0,000 %, échéance le 16/11/2051 *	– –
323 437	CSMC Trust 2018-J1 Trust, série 2018 J1, catégorie AX1, 144A, 0,091 %, échéance le 25/02/2048 *	815 0,15	3 259	Government National Mortgage Association, Series 2011 127, catégorie IO, 0,079 %, échéance le 16/03/2047 *	5 –
4 319	CSMC Trust 2018-J1 Trust, série 2018 J1, catégorie B5, 144A, 3,591 %, échéance le 25/02/2048 *	3 022 0,54	12 784	Government National Mortgage Association, Series 2011 95, catégorie IO, 0,007 %, échéance le 16/04/2051 *	2 –
8 649	CSMC Trust 2018-J1 Trust, série 2018 J1, catégorie B6, 144A, 3,591 %, échéance le 25/02/2048 *	4 211 0,75	8 784	Government National Mortgage Association, Series 2012 114, catégorie IO, 0,612 %, échéance le 16/01/2053 *	135 0,02
–	CSMC Trust 2018-J1 Trust, série 2018 J1, catégorie SA, 144A, 0,000 %, échéance le 25/02/2048	– –	3 411	Government National Mortgage Association, Series 2013 163, catégorie IO, 1,018 %, échéance le 16/02/2046 *	54 0,01
4 000	CSWF 2018-TOP, série 2018 TOP, catégorie H, 144A, 8,001 %, échéance le 15/08/2035 *	3 708 0,66	5 651	Government National Mortgage Association, Series 2014 16, catégorie IO, 0,457 %, échéance le 16/06/2055 *	81 0,01
592	DSLA Mortgage Loan Trust 2004-AR4, série 2004 AR4, catégorie 2A2B, 5,431 %, échéance le 19/01/2045 *	383 0,07	7 310	Government National Mortgage Association, Series 2014 171, catégorie IO, 0,423 %, échéance le 16/11/2055 *	74 0,01
1 414	DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR3, série 2005 AR3, catégorie 2A1B, 5,071 %, échéance le 19/07/2045 *	1 301 0,23	827	Government National Mortgage Association, série 2014 47, catégorie IA, 0,147 %, échéance le 16/02/2048 *	5 –
2 358	DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR5, série 2005 AR5, catégorie 2A1B, 5,271 %, échéance le 19/09/2045 *	1 870 0,33	3 578	Government National Mortgage Association, Series 2014 50, catégorie IO, 0,629 %, échéance le 16/09/2055 *	90 0,02
484	DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1, série 2007 AR1, catégorie 2A1B, 4,771 %, échéance le 19/04/2047 *	498 0,09	711	Government National Mortgage Association, série 2016 135, catégorie SB, 1,510 %, échéance le 16/10/2046 *	94 0,02
5 326	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2016 C01, catégorie B, 16,367 %, échéance le 25/08/2028 *	6 036 1,08	691	Government National Mortgage Association, série 2016 51, catégorie NS, 1,452 %, échéance le 20/04/2046 *	65 0,01
3 659	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2016 C02, catégorie B, 16,867 %, échéance le 25/09/2028 *	4 163 0,74	3 427	Government National Mortgage Association, série 2018 125, catégorie HS, 1,652 %, échéance le 20/09/2048 *	281 0,05
2 937	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2016 C03, catégorie B, 16,367 %, échéance le 25/10/2028 *	3 311 0,59	4 390	Government National Mortgage Association, série 2022 202, catégorie Z, 3,000 %, échéance le 16/10/2063 *	2 719 0,49
4 873	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2016 C04, catégorie B, 14,867 %, échéance le 25/01/2029 *	5 310 0,95	2 575	Government National Mortgage Association, série 2023 16, catégorie Z, 3,500 %, échéance le 16/07/2063 *	1 734 0,31
7 165	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2016 C06, catégorie B, 13,867 %, échéance le 25/04/2029 *	7 622 1,36	25 982	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, série 2018 SRP5, catégorie D, 144A, 11,088 %, échéance le 15/09/2031 *	8 253 1,48
4 000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2017 C06, catégorie B1, 8,767 %, échéance le 25/02/2030 *	4 213 0,75	1 250	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC26, série 2014 GC26, catégorie D, 144A, 4,521 %, échéance le 10/11/2047 *	859 0,15
3 210	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2017 C07, catégorie B1, 8,617 %, échéance le 25/05/2030 *	3 410 0,61	4 907	GSR Mortgage Loan Trust 2006-1F, série 2006 1F, catégorie 6A1, 5,017 %, échéance le 25/02/2036 *	546 0,10
2 060	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2018 C03, catégorie B1, 8,367 %, échéance le 25/10/2030 *	2 168 0,39	80	HarborView Mortgage Loan Trust 2004-11, série 2004 11, catégorie 3A3, 5,351 %, échéance le 19/01/2035 *	71 0,01
7 750	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2018 C06, catégorie B1, 8,367 %, échéance le 25/03/2031 *	8 116 1,45	48	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-1, série 2005 1, catégorie 2A1A, 5,131 %, échéance le 19/03/2035 *	46 0,01
1 716	Fannie Mae REMICS, série 2017 85, catégorie SC, 1,583 %, échéance le 25/11/2047 *	139 0,03	127	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-10, série 2005 10, catégorie 2A1A, 5,211 %, échéance le 19/11/2035 *	98 0,02
3 590	Freddie Mac Multifamily Structured Credit Risk, série 2021 MN2, catégorie M2, 144A, 7,834 %, échéance le 25/07/2041 *	3 136 0,56			
6 605	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K038, catégorie X3, 2,489 %, échéance le 25/06/2042 *	166 0,03			
19 370	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K052, catégorie X3, 1,615 %, échéance le 25/01/2044 *	727 0,13			
6 000	Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-DNA1, série 2020 DNA1, catégorie B2, 144A, 9,867 %, échéance le 25/01/2050 *	5 622 1,01			

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques — (suite)			5 308	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, série 2019 FAME, catégorie D, 144A, 4,398 %, échéance le 15/08/2036 *	4 354 0,78
420	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-2, série 2005 2, catégorie 2A1A, 5,031 %, échéance le 19/05/2035 *	385 0,07	4 870	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, série 2019 FAME, catégorie E, 144A, 4,398 %, échéance le 15/08/2036 *	3 764 0,67
202	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-3, série 2005 3, catégorie 2A1A, 5,071 %, échéance le 19/06/2035 *	191 0,03	3 000	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2022-JERI, série 2022 JERI, catégorie G, 144A, 12,020 %, échéance le 15/01/2039 *	2 718 0,49
2 143	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-8, série 2005 8, catégorie 2A2, 4,293 %, échéance le 19/09/2035 *	1 874 0,34	3 694	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-4, série 2016 4 A, catégorie B5, 144A, 4,786 %, échéance le 25/11/2056 *	3 268 0,58
479	HarborView Mortgage Loan Trust 2006-10, série 2006 10, catégorie 2A1A, 4,771 %, échéance le 19/11/2036 *	425 0,08	3 000	New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM3, série 2021 NQM3, catégorie B2, 144A, 4,051 %, échéance le 27/11/2056 *	1 963 0,35
876	Impac CMB Trust Series 2005-1, série 2005 1, catégorie M1, 5,307 %, échéance le 25/04/2035 *	806 0,14	3 632	Nomura Resecuritization Trust 2015-4R, série 2015 4R, catégorie 4A7, 144A, 3,662 %, échéance le 26/03/2037 *	3 495 0,62
1 649	Impac CMB Trust Series 2005-3, série 2005 3, catégorie A2, 5,217 %, échéance le 25/08/2035 *	1 483 0,27	452	Opteum Mortgage Acceptance Corp Trust 2006-1, série 2006 1, catégorie M1, 5,172 %, échéance le 25/04/2036 *	328 0,06
698	Impac CMB Trust Series 2005-4, série 2005 4, catégorie 1M1, 5,047 %, échéance le 25/05/2035 *	645 0,12	3 690	PMT Credit Risk Transfer Trust 2021-1R, série 2021 1R, catégorie A, 144A, 7,417 %, échéance le 27/02/2024 *	3 639 0,65
1 112	Impac CMB Trust Series 2005-7, série 2005 7, catégorie A1, 5,137 %, échéance le 25/11/2035 *	972 0,17	3 161	PMT Credit Risk Transfer Trust, 144A, 8,217 %, échéance le 29/04/2024 *	3 102 0,55
1 268	Impac Secured Assets Trust 2006-2, série 2006 2, catégorie 2B, 6,267 %, échéance le 25/08/2036 *	1 219 0,22	3 455	PMT Credit Risk Transfer Trust, 144A, 6,867 %, échéance le 27/02/2025 *	3 368 0,60
197	Impac Secured Assets Trust 2006-2, série 2006 2, catégorie 2M3, 6,267 %, échéance le 25/08/2036 *	197 0,04	637	RALI Series 2006-QA2 Trust, série 2006 QA2, catégorie 1A1, 4,867 %, échéance le 25/02/2036 *	398 0,07
628	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR13, série 2005 AR13, catégorie 1A1, 3,324 %, échéance le 25/08/2035 *	308 0,06	8 188	RBSGC Mortgage Loan Trust 2007-A, série 2007 A, catégorie 3A1, 4,967 %, échéance le 25/01/2037 *	2 106 0,38
667	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR2, série 2005 AR2, catégorie 2A1B, 5,397 %, échéance le 25/02/2035 *	473 0,08	12 948	Redwood Funding Trust 2019-1, série 2019-1, catégorie PT, 144A, 4,468 %, échéance le 27/09/2024	12 467 2,23
1 808	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR6, série 2005 AR6, catégorie 2A2, 5,277 %, échéance le 25/04/2035 *	1 401 0,25	1 126	Reperforming Loan REMIC Trust 2006-R2, série 2006 R2, catégorie AF1, 144A, 5,037 %, échéance le 25/07/2036 *	1 020 0,18
2 395	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, série 2017 FL11, catégorie E, 144A, 8,608 %, échéance le 15/10/2032 *	2 392 0,43	3 588	Residential Asset Securitization Trust 2006-A7CB, série 2006 A7CB, catégorie 1A3, 6,250 %, échéance le 25/07/2036	2 797 0,50
2 250	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, série 2017 FL11, catégorie F, 144A, 9,908 %, échéance le 15/10/2032 *	2 218 0,40	12 974	Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, série 2017 4, catégorie B, 144A, 0,000 %, échéance le 25/06/2057 *	2 134 0,38
28 545	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, série 2018 PHMZ, catégorie M, 144A, 13,096 %, échéance le 15/06/2035 *	– –	19 879	Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, série 2017 4, catégorie BIO, 144A, 1,706 %, échéance le 25/06/2057**	2 981 0,53
4 022	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-FL7, série 2015 FL7, catégorie D, 144A, 8,338 %, échéance le 15/05/2028 *	3 724 0,67	4 409	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, série 2016 1, catégorie B, 144A, 0,000 %, échéance le 25/09/2055 *	664 0,12
1 800	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, série 2018 WPT, catégorie GFL, 144A, 8,230 %, échéance le 05/07/2033 *	1 304 0,23	8 004	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, série 2016 1, catégorie BIO, 144A, 0,923 %, échéance le 25/09/2055**	940 0,17
6 574	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, série 2020 MKST, catégorie G, 144A, 9,088 %, échéance le 15/12/2036 *	2 331 0,42	3 571	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, série 2016 1, catégorie M2, 144A, 3,750 %, échéance le 25/09/2055 *	3 172 0,57
6 867	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, série 2020 MKST, catégorie H, 144A, 11,588 %, échéance le 15/12/2036 *	1 739 0,31	51 785	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, série 2016 1, catégorie XSIO, 144A, 0,075 %, échéance le 25/09/2055**	226 0,04
322	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-NNN MZ, série 2020 NNNZ, catégorie M, 144A, 8,542 %, échéance le 16/01/2037	279 0,05	12 939	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2, série 2017 2, catégorie B, 144A, 0,000 %, échéance le 25/08/2056 *	2 085 0,37
4 000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2021-NYMZ, série 2021 NYMZ, catégorie M, 144A, 11,838 %, échéance le 15/06/2026 *	3 873 0,69	21 448	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2, série 2017 2, catégorie BIO, 144A, 1,090 %, échéance le 25/08/2056**	2 333 0,42
3 814	JP Morgan Mortgage Trust 2007-S3, série 2007 S3, catégorie 1A18, 5,117 %, échéance le 25/08/2037 *	1 367 0,24	420 987	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2, série 2017 2, catégorie XSIO, 144A, 0,075 %, échéance le 25/08/2056**	1 723 0,31
9 842	JP Morgan Mortgage Trust 2018-4, série 2018 4, catégorie AX1, 144A, 0,213 %, échéance le 25/10/2048 *	45 0,01	3 250	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3, série 2017 3, catégorie M2, 144A, 4,750 %, échéance le 25/07/2056 *	2 894 0,52
10 830	JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, série 2018 5, catégorie AX1, 144A, 0,229 %, échéance le 25/10/2048 *	67 0,01	2 728	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1, série 2018 1, catégorie M, 4,750 %, échéance le 25/05/2057 *	2 451 0,44
1 952	JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, série 2018 5, catégorie B5, 144A, 3,729 %, échéance le 25/10/2048 *	1 244 0,22	11 460	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-2, série 2018 2, catégorie BX, 3,189 %, échéance le 25/11/2057 *	3 811 0,68
2 632	JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, série 2018 5, catégorie B6, 144A, 3,729 %, échéance le 25/10/2048 *	1 442 0,26	16 071	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3, série 2018 3, catégorie BX, 144A, 1,660 %, échéance le 25/08/2057 *	5 575 1,00
5 420	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C25, série 2014 C25, catégorie D, 144A, 3,935 %, échéance le 15/11/2047 *	3 420 0,61	2 630	STACR Trust 2018-DNA3, série 2018 DNA3, catégorie B1, 144A, 8,517 %, échéance le 25/09/2048 *	2 717 0,49
12	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-15, série 2004 15, catégorie 6A1, 4,947 %, échéance le 25/12/2034 *	11 –	3 000	STACR Trust 2018-DNA3, série 2018 DNA3, catégorie B2, 144A, 12,367 %, échéance le 25/09/2048 *	3 147 0,56
1 830	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-6, série 2004 6, catégorie B1, 3,853 %, échéance le 25/07/2034 *	1 670 0,30	650	Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, série 2014 STAR, catégorie D, 144A, 8,088 %, échéance le 15/11/2027 *	26 –
1 225	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-8, série 2004 8, catégorie B1, 3,698 %, échéance le 25/09/2034 *	1 059 0,19	14 332	Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, série 2014 STAR, catégorie E, 144A, 8,988 %, échéance le 15/11/2027 *	29 0,01
720	MASTR Reperforming Loan Trust 2005-1, série 2005 1, catégorie 1A1, 144A, 6,000 %, échéance le 25/08/2034	488 0,09	323	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust, série 2004 2, catégorie 1A1, 4,154 %, échéance le 25/03/2034 *	298 0,05
853	MASTR Reperforming Loan Trust 2005-2, série 2005 2, catégorie 1A1F, 144A, 4,967 %, échéance le 25/05/2035 *	454 0,08	3 570	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR5, série 2006 AR5, catégorie 4A1, 5,057 %, échéance le 25/05/2046 *	1 218 0,22
378	ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, série 2007 5, catégorie AJ, 5,450 %, échéance le 12/08/2048 *	97 0,02	54	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR6, série 2006 AR6, catégorie 1A1, 4,977 %, échéance le 25/07/2046 *	45 0,01
187	ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, série 2007 5, catégorie AJFL, 144A, 5,450 %, échéance le 12/08/2048 *	48 0,01	3 900	Towd Point Mortgage Trust 2018-2, série 2018 2, catégorie B2, 144A, 3,480 %, échéance le 25/03/2058 *	3 090 0,55
5 000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32, série 2016 C32, catégorie D, 144A, 3,396 %, échéance le 15/12/2049 *	3 449 0,62	7 118	Towd Point Mortgage Trust 2018-4, série 2018 4, catégorie B2, 144A, 3,267 %, échéance le 25/06/2058 *	4 597 0,82
1 634	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2004-11AR, série 2004 11AR, catégorie 1B1, 5,217 %, échéance le 25/01/2035 *	1 275 0,23	4 000	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-NYCH, série 2018 NYCH, catégorie F, 144A, 8,409 %, échéance le 15/02/2032 *	3 828 0,68
3 372	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2006-8AR, série 2006 8AR, catégorie 1A3, 4,937 %, échéance le 25/06/2036 *	777 0,14	3 374	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR11 Trust, série 2005 AR11, catégorie B1, 5,532 %, échéance le 25/08/2045 *	2 799 0,50
521	Multifamily Trust 2016-1, série 2016 1, catégorie B, 144A, 2,401 %, échéance le 25/04/2046 *	521 0,09	1 038	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR9 Trust, série 2005 AR9, catégorie B1, 5,562 %, échéance le 25/07/2045 *	798 0,14
			1 343	Waterfall Commercial Mortgage Trust 2015-SBC5, série 2015 SBC5, catégorie B, 144A, 6,461 %, échéance le 14/09/2022 *	1 127 0,20

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques — (suite)		
1 252 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C22, série 2014 C22, catégorie D, 144A, 3,906 %, échéance le 15/09/2057 *	993	0,18
Total des titres adossés à des hypothèques (coût 589 494\$)	448 236	80,10
Obligations et bons d'entreprises — 0,48 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
États-Unis — 0,48 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
3 000 Two Harbors Investment Corp, 6,250 %, échéance le 15/01/2026	2 686	0,48
Total des obligations et bons d'entreprises (coût 2 608\$)	2 686	0,48
Billets d'emprunt — 3,29 % (28 février 2022 : 2,76 %)		
30 000 American Dream, — %, échéance le 29/06/2024 *†∞	2 926	0,52
1 613 Freehand Hotel, 8,330 %, échéance le 17/12/2024 *∞	1 607	0,29
2 935 Freehand Hotel, 8,330 %, échéance le 17/12/2024 *∞	2 924	0,52
5 452 Freehand Hotel, 8,330 %, échéance le 17/12/2024 *∞	5 432	0,97
5 551 Sono Retail Loan, 7,947 %, échéance le 06/06/2023 *∞	5 518	0,99
Total des billets d'emprunt (coût 45 452\$)	18 407	3,29
Organismes de placement collectif — 3,08 % (28 février 2022 : 3,43 %)		
17 212 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribution)	17 212	3,08
Total des organismes de placement collectif (Coût 17 212\$)	17 212	3,08
Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat (Coût 746 725\$)		
	557 051	99,55
Contrats de change à terme — 0,00 % (28 février 2022 : 0,02 %)		
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	8	—
Contrats à terme standardisés — 0,05 % (28 février 2022 : 0,05 %)		
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	317	0,05
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	557 376	99,60
Contrats de change à terme — (0,30 %) (28 février 2022 : (0,33 %))		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(1 683)	(0,30)
Contrats à terme standardisés — (0,01 %) (28 février 2022 : (0,20 %))		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(73)	(0,01)
Total des passifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat	(1 756)	(0,31)
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	555 620	99,29
Autres éléments de l'actif hors passif	3 928	0,71
Total des actifs nets	559 548\$	100,00

— Les montants désignés par « — » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 350 611 000\$, soit 62,65 % de l'actif net.

* Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.

† Illiquide.

∞ Le titre est évalué de bonne foi à sa juste valeur par le comité d'évaluation ou à sa discrétion.

ABRÉVIATIONS :

REMIC — Société relais de placements immobiliers hypothécaires (Real Estate Mortgage Investment Conduit).

	% de l'actif total
Analyse de l'actif total	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	92,82
Autres valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	3,28
Organismes de placement collectif	3,06
Instruments financiers dérivés	0,06
Autres actifs	0,78
Actif total	100,00

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)	Devise de vente (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	USD 596	8
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	JPY 5 655 127	(1 573)
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	GBP 71	—
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	EUR 6 283	(102)
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat	CHF 282	(8)
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 203 \$)				8
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (3 513) \$)				(1 683)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (3 310) \$)				(1 675)

Tableau des contrats à terme standardisés

	Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
U.S. 10 Year Ultra Note, juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(84)	\$ (9 844)	(12)
U.S. 2 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(415)	(84 547)	252
U.S. 5 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	62	6 638	(25)
U.S. Long Bond (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(109)	(13 649)	65
U.S. Ultra Bond (CBT) juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	34	4 592	(36)
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 502 \$)				317
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (2 083) \$)				(73)
Plus-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (1 581) \$)				244

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

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

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des actifs — 1,53 % (28 février 2022 : 1,75 %)					
1 215 DB Master Finance LLC, série 2021 1A, catégorie A23, 144A, 2,791 %, échéance le 20/11/2051	979	0,09	20 Fannie Mae Pool '865915', 4,497 %, échéance le 03/01/2036 *	20	—
2 695 Hardee's Funding LLC, série 2020 1A, catégorie A2, 144A, 3,981 %, échéance le 20/12/2050	2 339	0,21	137 Fannie Mae Pool '888218', 5,000 %, échéance le 03/01/2037	138	0,01
2 000 HGI CRE CLO 2021-FL2 Ltd, série 2021 FL2, catégorie A, 144A, 5,590 %, échéance le 17/09/2036 *	1 936	0,17	10 Fannie Mae Pool '889117', 5,000 %, échéance le 10/01/2035	10	—
2 747 Home Partners of America 2021-3 Trust, série 2021 3, catégorie A, 144A, 2,200 %, échéance le 17/01/2041	2 373	0,22	211 Fannie Mae Pool '890345', 5,000 %, échéance le 06/01/2041	213	0,02
2 320 Loanpal Solar Loan 2021-2 Ltd, série 2021 2GS, catégorie B, 144A, 2,790 %, échéance le 20/03/2048	1 723	0,15	568 Fannie Mae Pool '890604', 4,500 %, échéance le 10/01/2044	561	0,05
1 500 MF1 2021-FL6 Ltd, série 2021 FL6, catégorie A, 144A, 5,701 %, échéance le 16/07/2036 *	1 466	0,13	15 Fannie Mae Pool '902663', 6,000 %, échéance le 11/01/2036	16	—
2 570 MF1 2021-FL7 Ltd, série 2021 FL7, catégorie A, 144A, 5,671 %, échéance le 16/10/2036 *	2 525	0,23	3 Fannie Mae Pool '909856', 6,000 %, échéance le 03/01/2037	3	—
691 Navient Student Loan Trust 2016-3, série 2016 3 A, catégorie A3, 144A, 5,967 %, échéance le 25/06/2065 *	690	0,06	181 Fannie Mae Pool '934231', 5,000 %, échéance le 01/01/2039	181	0,02
615 SBA Small Business Investment Cos, série 2018 10B, catégorie 1, 3,548 %, échéance le 10/09/2028	577	0,05	71 Fannie Mae Pool '961907', 5,000 %, échéance le 03/01/2038	72	0,01
1 350 SMB Private Education Loan Trust 2015-C, série 2015 C, catégorie C, 144A, 4,500 %, échéance le 17/09/2046	1 250	0,11	482 Fannie Mae Pool '962687', 5,000 %, échéance le 04/01/2038	486	0,04
1 488 Store Master Funding I-VII XIV XIX XX, série 2021 1A, catégorie A3, 144A, 2,860 %, échéance le 20/06/2051	1 247	0,11	8 Fannie Mae Pool '973013', 4,500 %, échéance le 03/01/2038	8	—
Total des titres adossés à des actifs (coût 19 401\$)	17 105	1,53	1 Fannie Mae Pool '974763', 4,500 %, échéance le 04/01/2038	1	—
Titres adossés à des hypothèques — 98,53 % (28 février 2022 : 95,73 %)					
54 327 BANK 2017-BNK8, série 2017 BNK8, catégorie XA, 0,713 %, échéance le 15/11/2050 *	1 457	0,13	15 Fannie Mae Pool '981766', 4,500 %, échéance le 04/01/2038	15	—
2 400 BANK 2018-BNK10, série 2018 BN10, catégorie A5, 3,688 %, échéance le 15/02/2061	2 236	0,20	4 Fannie Mae Pool '995072', 5,500 %, échéance le 08/01/2038	4	—
2 210 Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, série 2018 B1, catégorie A5, 3,666 %, échéance le 15/01/2051 *	2 063	0,18	528 Fannie Mae Pool '995948', 5,000 %, échéance le 03/01/2039	532	0,05
4 050 BHMS 2018-ATLS, série 2018 ATLS, catégorie A, 144A, 5,838 %, échéance le 15/07/2035 *	3 979	0,36	61 Fannie Mae Pool 'AA8438', 4,500 %, échéance le 01/06/2039	61	0,01
2 975 BXMT 2020-FL2 Ltd, série 2020 FL2, catégorie A, 144A, 5,578 %, échéance le 15/02/2038 *	2 940	0,26	64 Fannie Mae Pool 'AB0129', 5,000 %, échéance le 01/04/2035	64	0,01
33 756 CD 2017-CD6 Mortgage Trust, série 2017 CD6, catégorie XA, 0,875 %, échéance le 13/11/2050 *	912	0,08	35 Fannie Mae Pool 'AB2725', 5,500 %, échéance le 01/04/2041	36	—
461 COLT 2021-RPL1 Trust, série 2021 RPL1, catégorie A1, 144A, 1,665 %, échéance le 25/09/2061 *	407	0,04	1 003 Fannie Mae Pool 'AB3882', 4,500 %, échéance le 01/11/2041	996	0,09
2 170 CSMC 2021-NQM8, série 2021 NQM8, catégorie A1, 144A, 1,841 %, échéance le 25/10/2066 *	1 845	0,16	394 Fannie Mae Pool 'AB5692', 4,000 %, échéance le 01/06/2042	378	0,03
1 234 Fannie Mae Interest Strip 406, catégorie 2, 4,000 %, échéance le 25/02/2041	211	0,02	46 Fannie Mae Pool 'AB7668', 3,000 %, échéance le 01/01/2043	42	—
285 Fannie Mae Interest Strip 407, catégorie 9, 5,000 %, échéance le 25/02/2041 *	47	—	134 Fannie Mae Pool 'AB8144', 5,000 %, échéance le 04/01/2037	136	0,01
642 Fannie Mae Interest Strip 407, catégorie C10, 5,000 %, échéance le 25/01/2038	112	0,01	204 Fannie Mae Pool 'AB9107', 3,500 %, échéance le 04/01/2033	195	0,02
399 Fannie Mae Interest Strip 409, catégorie C13, 3,500 %, échéance le 25/11/2041	64	0,01	30 Fannie Mae Pool 'AC2389', 5,000 %, échéance le 02/01/2037	30	—
2 199 Fannie Mae Interest Strip 417, catégorie C5, 3,500 %, échéance le 25/02/2043	334	0,03	11 Fannie Mae Pool 'AD3336', 5,500 %, échéance le 04/01/2040	11	—
5 209 Fannie Mae Interest Strip 418, catégorie C15, 3,500 %, échéance le 25/08/2043	891	0,08	12 Fannie Mae Pool 'AD3796', 5,000 %, échéance le 04/01/2040	12	—
17 851 Fannie Mae Interest Strip 427, catégorie C73, 3,000 %, échéance le 25/12/2048	2 879	0,26	3 Fannie Mae Pool 'AD4567', 5,500 %, échéance le 04/01/2040	3	—
— Fannie Mae Pool '252875', 8,000 %, échéance le 11/01/2029	—	—	5 Fannie Mae Pool 'AD4598', 5,500 %, échéance le 05/01/2040	5	—
— Fannie Mae Pool '253184', 8,000 %, échéance le 04/01/2030	—	—	10 Fannie Mae Pool 'AD4614', 5,500 %, échéance le 06/01/2040	10	—
— Fannie Mae Pool '253399', 8,500 %, échéance le 08/01/2030	—	—	6 Fannie Mae Pool 'AD8281', 5,500 %, échéance le 07/01/2040	6	—
— Fannie Mae Pool '253438', 8,500 %, échéance le 09/01/2030	—	—	45 Fannie Mae Pool 'AD8326', 5,500 %, échéance le 07/01/2040	45	—
1 Fannie Mae Pool '253598', 8,500 %, échéance le 12/01/2030	1	—	75 Fannie Mae Pool 'AD8642', 5,500 %, échéance le 08/01/2040	77	0,01
82 Fannie Mae Pool '254793', 5,000 %, échéance le 07/01/2033	83	0,01	64 Fannie Mae Pool 'AD9893', 5,500 %, échéance le 07/01/2040	65	0,01
5 310 Fannie Mae Pool '387771', 3,790 %, échéance le 08/01/2028	5 073	0,45	11 Fannie Mae Pool 'AE0758', 7,000 %, échéance le 02/01/2039	12	—
— Fannie Mae Pool '535270', 8,500 %, échéance le 04/01/2030	—	—	33 Fannie Mae Pool 'AH5036', 5,500 %, échéance le 02/01/2041	33	—
8 Fannie Mae Pool '535299', 7,500 %, échéance le 05/01/2030	8	—	15 Fannie Mae Pool 'AH9785', 5,500 %, échéance le 04/01/2041	15	—
1 Fannie Mae Pool '535332', 8,500 %, échéance le 04/01/2030	1	—	25 Fannie Mae Pool 'AI9532', 5,500 %, échéance le 09/01/2041	25	—
— Fannie Mae Pool '535351', 8,500 %, échéance le 06/01/2030	—	—	15 Fannie Mae Pool 'AIJ033', 5,500 %, échéance le 10/01/2041	15	—
— Fannie Mae Pool '535435', 8,500 %, échéance le 08/01/2030	—	—	27 Fannie Mae Pool 'AJ4713', 4,500 %, échéance le 11/01/2041	27	—
— Fannie Mae Pool '535608', 9,500 %, échéance le 04/01/2030	—	—	44 Fannie Mae Pool 'AL0521', 5,000 %, échéance le 06/01/2041	45	—
4 Fannie Mae Pool '535996', 7,500 %, échéance le 06/01/2031	4	—	89 Fannie Mae Pool 'AL1051', 4,500 %, échéance le 09/01/2041	89	0,01
— Fannie Mae Pool '537715', 8,500 %, échéance le 09/01/2030	—	—	553 Fannie Mae Pool 'AL1469', 7,000 %, échéance le 02/01/2039	589	0,05
21 Fannie Mae Pool '545189', 7,500 %, échéance le 08/01/2031	21	—	240 Fannie Mae Pool 'AL1470', 7,000 %, échéance le 04/01/2037	251	0,02
17 Fannie Mae Pool '545190', 7,500 %, échéance le 08/01/2031	17	—	3 704 Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500 %, échéance le 01/01/2043	3 453	0,31
1 Fannie Mae Pool '545612', 8,000 %, échéance le 04/01/2032	1	—	32 Fannie Mae Pool 'AL3026', 3,500 %, échéance le 12/01/2042	30	—
2 Fannie Mae Pool '545990', 7,500 %, échéance le 04/01/2031	2	—	1 316 Fannie Mae Pool 'AL4324', 6,500 %, échéance le 05/01/2040	1 390	0,12
— Fannie Mae Pool '546591', 8,500 %, échéance le 06/01/2030	—	—	128 Fannie Mae Pool 'AL4741', 4,500 %, échéance le 01/01/2044	126	0,01
2 Fannie Mae Pool '548965', 8,500 %, échéance le 07/01/2030	2	—	4 934 Fannie Mae Pool 'AL7093', 4,000 %, échéance le 05/01/2045	4 846	0,43
9 Fannie Mae Pool '555676', 7,500 %, échéance le 12/01/2032	10	—	898 Fannie Mae Pool 'AL7877', 4,000 %, échéance le 12/01/2045	862	0,08
101 Fannie Mae Pool '555743', 5,000 %, échéance le 09/01/2033	102	0,01	907 Fannie Mae Pool 'AL8991', 3,000 %, échéance le 08/01/2035	835	0,07
20 Fannie Mae Pool '735578', 5,000 %, échéance le 06/01/2035	20	—	106 Fannie Mae Pool 'AL9546', 3,500 %, échéance le 11/01/2046	99	0,01
15 Fannie Mae Pool '745248', 7,500 %, échéance le 08/01/2034	15	—	475 Fannie Mae Pool 'AM8700', 2,930 %, échéance le 06/01/2030	432	0,04
453 Fannie Mae Pool '745580', 5,000 %, échéance le 06/01/2036	457	0,04	180 Fannie Mae Pool 'AN4677', 3,200 %, échéance le 02/01/2029	167	0,02
118 Fannie Mae Pool '745802', 6,000 %, échéance le 07/01/2036	123	0,01	287 Fannie Mae Pool 'AN4927', 3,450 %, échéance le 03/01/2029	271	0,02
10 Fannie Mae Pool '745959', 5,500 %, échéance le 11/01/2036	10	—	331 Fannie Mae Pool 'AN5386', 3,250 %, échéance le 05/01/2029	309	0,03
157 Fannie Mae Pool '836390', 5,000 %, échéance le 10/01/2035	158	0,01	109 Fannie Mae Pool 'AO4102', 4,000 %, échéance le 06/01/2042	104	0,01
473 Fannie Mae Pool '836398', 4,295 %, échéance le 01/10/2035 *	463	0,04	368 Fannie Mae Pool 'AP9766', 4,000 %, échéance le 10/01/2042	354	0,03
6 Fannie Mae Pool '836852', 4,246 %, échéance le 01/10/2035 *	6	—	1 068 Fannie Mae Pool 'AQ6295', 3,500 %, échéance le 12/01/2032	1 011	0,09
8 Fannie Mae Pool '843823', 4,345 %, échéance le 11/01/2035 *	8	—	66 Fannie Mae Pool 'AQ7130', 3,500 %, échéance le 12/01/2032	63	0,01
83 Fannie Mae Pool '843997', 4,238 %, échéance le 11/01/2035 *	81	0,01	284 Fannie Mae Pool 'AQ7270', 3,500 %, échéance le 12/01/2032	269	0,02
			296 Fannie Mae Pool 'AQ7306', 3,000 %, échéance le 01/01/2043	266	0,02
			319 Fannie Mae Pool 'AQ7864', 3,500 %, échéance le 12/01/2032	302	0,03
			57 Fannie Mae Pool 'AQ7869', 3,500 %, échéance le 11/01/2032	54	—
			136 Fannie Mae Pool 'AQ7913', 3,500 %, échéance le 12/01/2032	129	0,01
			209 Fannie Mae Pool 'AQ8677', 3,500 %, échéance le 12/01/2032	198	0,02
			87 Fannie Mae Pool 'AR1198', 3,000 %, échéance le 01/01/2043	78	0,01
			289 Fannie Mae Pool 'AR1202', 3,000 %, échéance le 01/01/2043	259	0,02
			152 Fannie Mae Pool 'AR7399', 3,000 %, échéance le 06/01/2043	137	0,01
			356 Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, échéance le 07/01/2043	322	0,03
			562 Fannie Mae Pool 'AS0462', 3,500 %, échéance le 09/01/2033	533	0,05
			196 Fannie Mae Pool 'AS0469', 4,000 %, échéance le 09/01/2033	189	0,02
			122 Fannie Mae Pool 'AS1281', 3,500 %, échéance le 12/01/2033	116	0,01
			3 445 Fannie Mae Pool 'AS4347', 4,000 %, échéance le 01/01/2045	3 337	0,30
			1 591 Fannie Mae Pool 'AS4363', 4,500 %, échéance le 02/01/2045	1 586	0,14
			435 Fannie Mae Pool 'AS6340', 3,500 %, échéance le 12/01/2045	405	0,04
			812 Fannie Mae Pool 'AS6396', 3,500 %, échéance le 12/01/2045	756	0,07
			298 Fannie Mae Pool 'AS6541', 3,500 %, échéance le 01/01/2046	278	0,02
			229 Fannie Mae Pool 'AS6562', 3,500 %, échéance le 01/01/2046	213	0,02
			252 Fannie Mae Pool 'AS9453', 4,000 %, échéance le 04/01/2047	241	0,02
			157 Fannie Mae Pool 'AS9760', 4,500 %, échéance le 06/01/2047	154	0,01
			247 Fannie Mae Pool 'AT2486', 3,500 %, échéance le 06/01/2033	233	0,02
			3 206 Fannie Mae Pool 'AT3070', 3,500 %, échéance le 04/01/2043	3 015	0,27
			73 Fannie Mae Pool 'AU4395', 4,000 %, échéance le 10/01/2033	70	—
			33 Fannie Mae Pool 'AU4397', 4,000 %, échéance le 10/01/2033	32	—
			345 Fannie Mae Pool 'AU6735', 3,000 %, échéance le 10/01/2043	313	0,03
			75 Fannie Mae Pool 'AU7248', 4,000 %, échéance le 10/01/2033	73	0,01
			84 Fannie Mae Pool 'AU9562', 4,000 %, échéance le 10/01/2033	82	0,01
			120 Fannie Mae Pool 'AU9567', 4,000 %, échéance le 10/01/2033	115	0,01

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

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

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques — (suite)					
93 Fannie Mae Pool 'AU9570', 4,000 %, échéance le 10/01/2033	89	0,01	81 Fannie Mae Pool 'BU3608', 3,000 %, échéance le 11/01/2051	72	0,01
14 Fannie Mae Pool 'AV6366', 4,500 %, échéance le 01/01/2044	14	–	90 Fannie Mae Pool 'BU5925', 3,000 %, échéance le 12/01/2051	80	0,01
23 Fannie Mae Pool 'AV7116', 4,500 %, échéance le 03/01/2044	23	–	5 846 Fannie Mae Pool 'BU8670', 4,500 %, échéance le 05/01/2052	5 639	0,50
77 Fannie Mae Pool 'AV7681', 3,500 %, échéance le 01/01/2034	74	0,01	373 Fannie Mae Pool 'BU9129', 2,000 %, échéance le 02/01/2052	305	0,03
171 Fannie Mae Pool 'AV7683', 3,500 %, échéance le 01/01/2034	164	0,01	678 Fannie Mae Pool 'BV3167', 3,500 %, échéance le 05/01/2052	625	0,06
216 Fannie Mae Pool 'AV7694', 3,500 %, échéance le 01/01/2034	204	0,02	3 973 Fannie Mae Pool 'BW5810', 5,000 %, échéance le 08/01/2052	3 917	0,35
297 Fannie Mae Pool 'AV7696', 3,500 %, échéance le 01/01/2034	284	0,03	100 Fannie Mae Pool 'BX6441', 6,500 %, échéance le 02/01/2053	103	0,01
3 314 Fannie Mae Pool 'AY1321', 3,500 %, échéance le 03/01/2035	3 169	0,28	1 100 Fannie Mae Pool 'BX7702', 6,500 %, échéance le 02/01/2053	1 129	0,10
2 354 Fannie Mae Pool 'AZ9645', 4,000 %, échéance le 09/01/2035	2 282	0,20	141 Fannie Mae Pool 'CA0907', 3,500 %, échéance le 12/01/2047	131	0,01
2 576 Fannie Mae Pool 'BF0144', 3,500 %, échéance le 10/01/2056	2 362	0,21	5 338 Fannie Mae Pool 'CA0917', 3,500 %, échéance le 12/01/2047	4 939	0,44
715 Fannie Mae Pool 'BF0145', 3,500 %, échéance le 03/01/2057	656	0,06	1 320 Fannie Mae Pool 'CA1902', 4,500 %, échéance le 06/01/2048	1 297	0,12
2 046 Fannie Mae Pool 'BF0161', 5,000 %, échéance le 10/01/2046	2 074	0,19	980 Fannie Mae Pool 'CA6000', 3,000 %, échéance le 06/01/2050	872	0,08
4 307 Fannie Mae Pool 'BF0162', 5,000 %, échéance le 11/01/2045	4 366	0,39	514 Fannie Mae Pool 'CA6053', 3,000 %, échéance le 06/01/2050	457	0,04
949 Fannie Mae Pool 'BF0191', 4,000 %, échéance le 06/01/2057	906	0,08	3 838 Fannie Mae Pool 'CA7257', 2,500 %, échéance le 10/01/2050	3 302	0,30
1 770 Fannie Mae Pool 'BF0222', 4,500 %, échéance le 09/01/2057	1 716	0,15	73 Fannie Mae Pool 'CA8955', 2,500 %, échéance le 02/01/2051	62	0,01
1 189 Fannie Mae Pool 'BF0263', 3,500 %, échéance le 05/01/2058	1 097	0,10	9 858 Fannie Mae Pool 'CB0414', 2,500 %, échéance le 05/01/2051	8 411	0,75
2 198 Fannie Mae Pool 'BF0301', 4,500 %, échéance le 08/01/2058	2 138	0,19	1 180 Fannie Mae Pool 'CB1666', 2,500 %, échéance le 09/01/2051	1 007	0,09
745 Fannie Mae Pool 'BF0338', 4,500 %, échéance le 01/01/2059	726	0,07	1 875 Fannie Mae Pool 'CB1878', 3,000 %, échéance le 10/01/2051	1 655	0,15
2 117 Fannie Mae Pool 'BF0531', 2,500 %, échéance le 05/01/2055	1 808	0,16	4 907 Fannie Mae Pool 'CB2164', 3,000 %, échéance le 11/01/2051	4 359	0,39
179 Fannie Mae Pool 'BH6684', 4,000 %, échéance le 08/01/2047	171	0,02	3 057 Fannie Mae Pool 'CB2292', 3,000 %, échéance le 11/01/2051	2 725	0,24
87 Fannie Mae Pool 'BJ0685', 4,000 %, échéance le 04/01/2048	83	0,01	2 312 Fannie Mae Pool 'CB3044', 2,500 %, échéance le 03/01/2052	1 976	0,18
1 155 Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000 %, échéance le 12/01/2037	1 055	0,09	384 Fannie Mae Pool 'CB3833', 3,000 %, échéance le 06/01/2052	339	0,03
321 Fannie Mae Pool 'BJ2763', 4,500 %, échéance le 05/01/2048	316	0,03	7 533 Fannie Mae Pool 'CB4898', 5,000 %, échéance le 10/01/2052	7 434	0,66
29 Fannie Mae Pool 'BK0751', 3,500 %, échéance le 03/01/2048	26	–	977 Fannie Mae Pool 'CB5156', 6,500 %, échéance le 11/01/2052	1 013	0,09
812 Fannie Mae Pool 'BK4770', 4,500 %, échéance le 08/01/2048	795	0,07	1 385 Fannie Mae Pool 'CB5497', 6,500 %, échéance le 01/01/2053	1 434	0,13
402 Fannie Mae Pool 'BM1660', 4,000 %, échéance le 08/01/2047	385	0,03	1 775 Fannie Mae Pool 'FM1002', 3,500 %, échéance le 01/01/2048	1 647	0,15
1 417 Fannie Mae Pool 'BM3929', 3,500 %, échéance le 07/01/2032	1 369	0,12	75 Fannie Mae Pool 'FM1159', 4,500 %, échéance le 02/01/2048	74	0,01
1 077 Fannie Mae Pool 'BM4696', 3,000 %, échéance le 03/01/2047	977	0,09	908 Fannie Mae Pool 'FM1349', 3,500 %, échéance le 03/01/2047	848	0,08
188 Fannie Mae Pool 'BM4751', 3,500 %, échéance le 03/01/2043	177	0,02	67 Fannie Mae Pool 'FM1458', 4,500 %, échéance le 04/01/2049	66	0,01
104 Fannie Mae Pool 'BM4781', 4,500 %, échéance le 10/01/2048	102	0,01	6 463 Fannie Mae Pool 'FM1625', 4,000 %, échéance le 09/01/2049	6 192	0,55
265 Fannie Mae Pool 'BM4897', 3,500 %, échéance le 12/01/2046	249	0,02	1 086 Fannie Mae Pool 'FM1637', 4,500 %, échéance le 05/01/2049	1 067	0,10
2 028 Fannie Mae Pool 'BM4951', 4,500 %, échéance le 09/01/2048	2 036	0,18	210 Fannie Mae Pool 'FM2173', 4,000 %, échéance le 09/01/2048	200	0,02
818 Fannie Mae Pool 'BM5073', 3,000 %, échéance le 04/01/2048	737	0,07	2 054 Fannie Mae Pool 'FM2256', 4,500 %, échéance le 10/01/2044	2 022	0,18
127 Fannie Mae Pool 'BM5119', 4,500 %, échéance le 12/01/2048	125	0,01	441 Fannie Mae Pool 'FM2745', 4,500 %, échéance le 03/01/2050	431	0,04
1 394 Fannie Mae Pool 'BM6898', 2,149 %, échéance le 01/02/2032 *	1 164	0,10	1 624 Fannie Mae Pool 'FM2770', 3,500 %, échéance le 04/01/2050	1 495	0,13
668 Fannie Mae Pool 'BM6912', 2,500 %, échéance le 01/01/2052	556	0,05	75 Fannie Mae Pool 'FM3083', 4,500 %, échéance le 10/01/2049	74	0,01
106 Fannie Mae Pool 'BO2878', 3,000 %, échéance le 11/01/2049	94	0,01	213 Fannie Mae Pool 'FM3141', 3,500 %, échéance le 11/01/2048	198	0,02
146 Fannie Mae Pool 'BO8932', 3,000 %, échéance le 01/01/2050	131	0,01	267 Fannie Mae Pool 'FM3158', 4,000 %, échéance le 11/01/2048	255	0,02
836 Fannie Mae Pool 'BP2319', 3,000 %, échéance le 02/01/2050	744	0,07	1 727 Fannie Mae Pool 'FM3347', 3,500 %, échéance le 05/01/2047	1 608	0,14
685 Fannie Mae Pool 'BP3484', 2,500 %, échéance le 06/01/2051	587	0,05	2 028 Fannie Mae Pool 'FM3445', 4,000 %, échéance le 09/01/2048	1 934	0,17
962 Fannie Mae Pool 'BP6171', 3,500 %, échéance le 04/01/2050	890	0,08	78 Fannie Mae Pool 'FM3542', 4,000 %, échéance le 05/01/2049	75	0,01
725 Fannie Mae Pool 'BP8713', 3,000 %, échéance le 08/01/2050	641	0,06	1 134 Fannie Mae Pool 'FM3589', 4,500 %, échéance le 02/01/2046	1 127	0,10
636 Fannie Mae Pool 'BQ1150', 2,500 %, échéance le 10/01/2050	544	0,05	199 Fannie Mae Pool 'FM3830', 3,000 %, échéance le 04/01/2050	178	0,02
985 Fannie Mae Pool 'BQ5815', 2,500 %, échéance le 11/01/2050	838	0,08	102 Fannie Mae Pool 'FM4532', 3,000 %, échéance le 09/01/2050	90	0,01
328 Fannie Mae Pool 'BQ5876', 2,500 %, échéance le 11/01/2050	282	0,03	690 Fannie Mae Pool 'FM4577', 2,500 %, échéance le 10/01/2050	591	0,05
256 Fannie Mae Pool 'BQ6652', 2,500 %, échéance le 10/01/2051	218	0,02	378 Fannie Mae Pool 'FM5018', 2,500 %, échéance le 12/01/2050	324	0,03
165 Fannie Mae Pool 'BQ9226', 2,000 %, échéance le 01/01/2051	136	0,01	2 088 Fannie Mae Pool 'FM5279', 3,500 %, échéance le 11/01/2050	1 918	0,17
78 Fannie Mae Pool 'BR0001', 2,500 %, échéance le 12/01/2050	66	0,01	5 036 Fannie Mae Pool 'FM5306', 2,000 %, échéance le 12/01/2050	4 144	0,37
758 Fannie Mae Pool 'BR1001', 2,500 %, échéance le 05/01/2051	655	0,06	5 787 Fannie Mae Pool 'FM5307', 2,000 %, échéance le 12/01/2050	4 754	0,42
84 Fannie Mae Pool 'BR1823', 2,000 %, échéance le 01/01/2051	69	0,01	1 246 Fannie Mae Pool 'FM5423', 2,500 %, échéance le 01/01/2051	1 066	0,10
84 Fannie Mae Pool 'BR2303', 3,000 %, échéance le 08/01/2051	75	0,01	153 Fannie Mae Pool 'FM5434', 4,500 %, échéance le 05/01/2046	151	0,01
158 Fannie Mae Pool 'BR2641', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	132	0,01	3 430 Fannie Mae Pool 'FM5592', 4,000 %, échéance le 12/01/2050	3 248	0,29
149 Fannie Mae Pool 'BR2643', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	123	0,01	66 Fannie Mae Pool 'FM5743', 2,500 %, échéance le 02/01/2051	57	0,01
74 Fannie Mae Pool 'BR2644', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	61	0,01	125 Fannie Mae Pool 'FM5904', 2,500 %, échéance le 02/01/2051	108	0,01
75 Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	63	0,01	297 Fannie Mae Pool 'FM5931', 2,500 %, échéance le 02/01/2051	254	0,02
236 Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	197	0,02	282 Fannie Mae Pool 'FM6117', 3,000 %, échéance le 11/01/2048	254	0,02
391 Fannie Mae Pool 'BR3286', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	324	0,03	159 Fannie Mae Pool 'FM6460', 2,500 %, échéance le 03/01/2051	137	0,01
167 Fannie Mae Pool 'BR4035', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	137	0,01	258 Fannie Mae Pool 'FM6816', 2,500 %, échéance le 04/01/2051	221	0,02
4 493 Fannie Mae Pool 'BR4393', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	3 674	0,33	2 668 Fannie Mae Pool 'FM7167', 4,500 %, échéance le 08/01/2050	2 598	0,23
381 Fannie Mae Pool 'BR4722', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	313	0,03	15 841 Fannie Mae Pool 'FM7382', 3,000 %, échéance le 05/01/2051	14 038	1,25
331 Fannie Mae Pool 'BR4753', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	275	0,02	7 129 Fannie Mae Pool 'FM7518', 2,500 %, échéance le 06/01/2051	6 095	0,54
670 Fannie Mae Pool 'BR4756', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	551	0,05	251 Fannie Mae Pool 'FM7529', 3,000 %, échéance le 05/01/2051	224	0,02
326 Fannie Mae Pool 'BR5487', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	268	0,02	2 107 Fannie Mae Pool 'FM7556', 3,500 %, échéance le 05/01/2051	1 944	0,17
168 Fannie Mae Pool 'BR5577', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	139	0,01	298 Fannie Mae Pool 'FM7675', 2,500 %, échéance le 06/01/2051	256	0,02
583 Fannie Mae Pool 'BR5587', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	483	0,04	87 Fannie Mae Pool 'FM7676', 2,500 %, échéance le 06/01/2051	75	0,01
938 Fannie Mae Pool 'BR5633', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	772	0,07	81 Fannie Mae Pool 'FM7694', 3,000 %, échéance le 06/01/2051	72	0,01
682 Fannie Mae Pool 'BR5634', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	560	0,05	250 Fannie Mae Pool 'FM7727', 2,500 %, échéance le 06/01/2051	218	0,02
875 Fannie Mae Pool 'BR5649', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	720	0,06	1 024 Fannie Mae Pool 'FM7750', 2,000 %, échéance le 05/01/2051	843	0,08
165 Fannie Mae Pool 'BR6515', 2,000 %, échéance le 04/01/2051	137	0,01	944 Fannie Mae Pool 'FM7869', 2,500 %, échéance le 01/01/2051	769	0,07
424 Fannie Mae Pool 'BR6768', 2,500 %, échéance le 06/01/2051	362	0,03	1 096 Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500 %, échéance le 07/01/2051	940	0,08
80 Fannie Mae Pool 'BR7744', 2,000 %, échéance le 04/01/2051	67	0,01	879 Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500 %, échéance le 07/01/2051	758	0,07
77 Fannie Mae Pool 'BR7745', 2,000 %, échéance le 04/01/2051	64	0,01	774 Fannie Mae Pool 'FM8025', 2,500 %, échéance le 07/01/2051	667	0,06
218 Fannie Mae Pool 'BR8276', 2,500 %, échéance le 04/01/2051	187	0,02	315 Fannie Mae Pool 'FM8166', 3,000 %, échéance le 06/01/2051	283	0,03
83 Fannie Mae Pool 'BR8478', 2,000 %, échéance le 04/01/2051	69	0,01	1 743 Fannie Mae Pool 'FM8188', 3,000 %, échéance le 03/01/2040	1 592	0,14
77 Fannie Mae Pool 'BR8518', 2,000 %, échéance le 04/01/2051	64	0,01	3 359 Fannie Mae Pool 'FM8189', 3,000 %, échéance le 08/01/2038	3 093	0,28
288 Fannie Mae Pool 'BR9104', 2,500 %, échéance le 05/01/2051	249	0,02	1 318 Fannie Mae Pool 'FM8210', 3,000 %, échéance le 04/01/2050	1 176	0,11
1 047 Fannie Mae Pool 'BT0122', 2,500 %, échéance le 06/01/2051	890	0,08	10 261 Fannie Mae Pool 'FM8415', 2,000 %, échéance le 08/01/2051	8 385	0,75
524 Fannie Mae Pool 'BT0846', 2,500 %, échéance le 07/01/2051	449	0,04	1 550 Fannie Mae Pool 'FM8576', 3,000 %, échéance le 02/01/2050	1 399	0,13
703 Fannie Mae Pool 'BT3244', 2,500 %, échéance le 07/01/2051	603	0,05	15 012 Fannie Mae Pool 'FM8685', 3,000 %, échéance le 09/01/2051	13 241	1,18
622 Fannie Mae Pool 'BT3270', 2,500 %, échéance le 08/01/2051	534	0,05	2 940 Fannie Mae Pool 'FM8786', 2,500 %, échéance le 10/01/2051	2 519	0,23
367 Fannie Mae Pool 'BT3290', 2,500 %, échéance le 08/01/2051	315	0,03	436 Fannie Mae Pool 'FM8864', 2,500 %, échéance le 10/01/2051	374	0,03
262 Fannie Mae Pool 'BT3303', 2,500 %, échéance le 08/01/2051	225	0,02	86 Fannie Mae Pool 'FM8977', 2,500 %, échéance le 09/01/2051	75	0,01
3 150 Fannie Mae Pool 'BT9482', 2,500 %, échéance le 12/01/2051	2 687	0,24	500 Fannie Mae Pool 'FM9044', 3,000 %, échéance le 10/01/2051	448	0,04
16 710 Fannie Mae Pool 'BU0971', 2,000 %, échéance le 11/01/2051	13 788	1,23	92 Fannie Mae Pool 'FM9174', 2,000 %, échéance le 10/01/2051	75	0,01
910 Fannie Mae Pool 'BU2599', 2,500 %, échéance le 01/01/2052	779	0,07	7 124 Fannie Mae Pool 'FM9195', 2,500 %, échéance le 10/01/2051	6 049	0,54
3 269 Fannie Mae Pool 'BU2838', 2,500 %, échéance le 11/01/2051	2 798	0,25	2 696 Fannie Mae Pool 'FM9264', 2,000 %, échéance le 10/01/2041	2 279	0,20
			1 861 Fannie Mae Pool 'FM9292', 3,000 %, échéance le 11/01/2051	1 662	0,15
			181 Fannie Mae Pool 'FM9335', 2,500 %, échéance le 10/01/2051	154	0,01

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

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

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques — (suite)				2 261	Fannie Mae REMICS, série 2019 45, catégorie BS, 1,433 %, échéance le 25/08/2049 *	235	0,02
2 846	Fannie Mae Pool 'FM9362', 3,000 %, échéance le 06/01/2038	2 635	0,24	4 010	Fannie Mae REMICS, série 2019 5, catégorie IO, 4,500 %, échéance le 25/03/2049	782	0,07
170	Fannie Mae Pool 'FM9412', 2,500 %, échéance le 11/01/2051	145	0,01	1 181	Fannie Mae REMICS, série 2019 57, catégorie NS, 1,383 %, échéance le 25/10/2049 *	121	0,01
16 797	Fannie Mae Pool 'FM9434', 2,000 %, échéance le 11/01/2051	13 860	1,24	1 501	Fannie Mae REMICS, série 2019 58, catégorie HS, 1,383 %, échéance le 25/10/2049 *	135	0,01
5 686	Fannie Mae Pool 'FM9456', 3,500 %, échéance le 11/01/2051	5 261	0,47	3 135	Fannie Mae REMICS, série 2019 59, catégorie SH, 1,383 %, échéance le 25/10/2049 *	320	0,03
6 703	Fannie Mae Pool 'FM9507', 3,000 %, échéance le 03/01/2037	6 206	0,55	1 263	Fannie Mae REMICS, série 2020 26, catégorie SA, 1,333 %, échéance le 25/05/2050 *	124	0,01
15 831	Fannie Mae Pool 'FM9579', 2,000 %, échéance le 07/01/2051	12 957	1,16	949	Fannie Mae REMICS, série 2020 47, catégorie GZ, 2,000 %, échéance le 25/07/2050	567	0,05
8 311	Fannie Mae Pool 'FM9733', 2,500 %, échéance le 10/01/2051	7 091	0,63	1 708	Fannie Mae REMICS, série 2020 62, catégorie BI, 2,000 %, échéance le 25/09/2050	215	0,02
339	Fannie Mae Pool 'FM9867', 2,500 %, échéance le 12/01/2051	290	0,03	2 503	Fannie Mae REMICS, série 2020 67, catégorie IH, 2,000 %, échéance le 25/09/2050	317	0,03
1 093	Fannie Mae Pool 'FS0028', 2,500 %, échéance le 09/01/2051	937	0,08	155	Fannie Mae REMICS, série 2020 74, catégorie EI, 2,500 %, échéance le 25/10/2050	26	–
238	Fannie Mae Pool 'FS0041', 3,000 %, échéance le 11/01/2050	213	0,02	13 693	Fannie Mae REMICS, série 2020 88, catégorie GI, 2,500 %, échéance le 25/12/2050	2 054	0,18
4 250	Fannie Mae Pool 'FS0331', 3,000 %, échéance le 01/01/2052	3 757	0,34	1 086	Fannie Mae REMICS, série 2020 89, catégorie DI, 2,500 %, échéance le 25/12/2050	159	0,01
3 603	Fannie Mae Pool 'FS0352', 2,000 %, échéance le 01/01/2052	2 945	0,26	9 010	Fannie Mae REMICS, série 2020 91, catégorie IO, 2,500 %, échéance le 25/12/2050	1 367	0,12
360	Fannie Mae Pool 'FS0408', 3,000 %, échéance le 01/01/2052	323	0,03	6 393	Fannie Mae REMICS, série 2020 93, catégorie LI, 2,500 %, échéance le 25/10/2051	924	0,08
2 672	Fannie Mae Pool 'FS0424', 2,500 %, échéance le 01/01/2052	2 288	0,20	25 860	Fannie Mae REMICS, série 2021 42, catégorie NI, 2,500 %, échéance le 25/11/2048	3 345	0,30
265	Fannie Mae Pool 'FS0464', 2,000 %, échéance le 01/01/2052	217	0,02	7 980	Fannie Mae REMICS, série 2021 46, catégorie BI, 2,500 %, échéance le 25/12/2048	1 030	0,09
2 382	Fannie Mae Pool 'FS0520', 3,000 %, échéance le 02/01/2052	2 121	0,19	5 359	Fannie Mae REMICS, série 2021 49, catégorie GI, 2,500 %, échéance le 25/10/2048	728	0,07
2 808	Fannie Mae Pool 'FS0523', 2,500 %, échéance le 02/01/2052	2 401	0,21	1 208	Fannie Mae REMICS, série 2021 54, catégorie KI, 2,500 %, échéance le 25/05/2049	174	0,02
463	Fannie Mae Pool 'FS0534', 2,500 %, échéance le 07/01/2051	397	0,04	9 672	Fannie Mae REMICS, série 2021 59, catégorie TI, 2,500 %, échéance le 25/09/2051	1 418	0,13
2 418	Fannie Mae Pool 'FS0551', 2,500 %, échéance le 02/01/2052	2 072	0,19	1 546	Fannie Mae REMICS, série 2021 61, catégorie KI, 2,500 %, échéance le 25/04/2049	220	0,02
1 694	Fannie Mae Pool 'FS0582', 2,500 %, échéance le 02/01/2052	1 450	0,13	5 914	Fannie Mae REMICS, série 2021 85, catégorie IN, 2,500 %, échéance le 25/02/2050	891	0,08
1 477	Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, échéance le 02/01/2052	1 217	0,11	13 612	Fannie Mae REMICS, série 2021 91, catégorie IG, 2,500 %, échéance le 25/01/2052	2 034	0,18
6 531	Fannie Mae Pool 'FS0605', 2,500 %, échéance le 02/01/2052	5 567	0,50	11 428	Fannie Mae REMICS, série 2022 29, catégorie KZ, 1,500 %, échéance le 25/06/2042	7 907	0,71
855	Fannie Mae Pool 'FS0612', 2,000 %, échéance le 02/01/2052	706	0,06	320	Fannie Mae-Aces, série 2016 M11, catégorie AL, 2,944 %, échéance le 25/07/2039	286	0,03
6 174	Fannie Mae Pool 'FS1107', 2,500 %, échéance le 12/01/2051	5 293	0,47	15 609	Fannie Mae-Aces, série 2019 M11, catégorie X1, 1,187 %, échéance le 25/06/2029 *	760	0,07
554	Fannie Mae Pool 'FS1289', 3,000 %, échéance le 03/01/2052	496	0,04	14 946	Fannie Mae-Aces, série 2019 M13, catégorie X1, 0,825 %, échéance le 25/06/2034 *	666	0,06
354	Fannie Mae Pool 'FS1403', 3,000 %, échéance le 01/01/2045	321	0,03	37 527	Fannie Mae-Aces, série 2019 M14, catégorie X1, 0,560 %, échéance le 25/06/2029 *	1 039	0,09
453	Fannie Mae Pool 'FS1539', 3,000 %, échéance le 11/01/2048	411	0,04	5 456	Fannie Mae-Aces, série 2020 M11, catégorie IO, 1,747 %, échéance le 25/01/2029 *	434	0,04
822	Fannie Mae Pool 'FS1553', 2,500 %, échéance le 11/01/2050	704	0,06	34 077	Fannie Mae-Aces, série 2020 M16, catégorie X1, 0,464 %, échéance le 25/04/2032 *	979	0,09
188	Fannie Mae Pool 'FS1624', 2,500 %, échéance le 10/01/2051	160	0,01	5 197	Fannie Mae-Aces, série 2020 M24, catégorie X1, 1,699 %, échéance le 25/01/2037 *	522	0,05
1 326	Fannie Mae Pool 'FS1628', 2,500 %, échéance le 04/01/2052	1 146	0,10	15 556	Fannie Mae-Aces, série 2020 M31, catégorie X2, 1,237 %, échéance le 25/12/2032 *	971	0,09
278	Fannie Mae Pool 'FS1924', 2,500 %, échéance le 03/01/2051	236	0,02	39	Freddie Mac Gold Pool 'A29586', 5,000 %, échéance le 01/01/2035	39	–
756	Fannie Mae Pool 'FS1938', 2,500 %, échéance le 02/01/2052	645	0,06	9	Freddie Mac Gold Pool 'A30703', 5,500 %, échéance le 12/01/2034	10	–
7 169	Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, échéance le 06/01/2049	6 640	0,59	100	Freddie Mac Gold Pool 'A35950', 5,000 %, échéance le 07/01/2035	101	0,01
8 124	Fannie Mae Pool 'FS3065', 3,000 %, échéance le 01/01/2052	7 160	0,64	13	Freddie Mac Gold Pool 'A36526', 5,000 %, échéance le 08/01/2035	13	–
5 744	Fannie Mae Pool 'FS3191', 5,500 %, échéance le 10/01/2052	5 749	0,51	42	Freddie Mac Gold Pool 'A39036', 5,000 %, échéance le 05/01/2035	42	–
1 836	Fannie Mae Pool 'FS3411', 6,000 %, échéance le 01/01/2053	1 872	0,17	7	Freddie Mac Gold Pool 'A39302', 5,500 %, échéance le 11/01/2035	7	–
10	Fannie Mae Pool 'MA0440', 5,500 %, échéance le 05/01/2040	10	–	–	Freddie Mac Gold Pool 'A84166', 6,500 %, échéance le 01/01/2039	–	–
26	Fannie Mae Pool 'MA0619', 5,500 %, échéance le 11/01/2040	27	–	1	Freddie Mac Gold Pool 'C00556', 8,000 %, échéance le 10/01/2027	1	–
5	Fannie Mae Pool 'MA0706', 4,500 %, échéance le 04/01/2031	5	–	–	Freddie Mac Gold Pool 'C01025', 8,000 %, échéance le 07/01/2030	–	–
12	Fannie Mae Pool 'MA0734', 4,500 %, échéance le 05/01/2031	11	–	–	Freddie Mac Gold Pool 'C01051', 8,000 %, échéance le 09/01/2030	–	–
16	Fannie Mae Pool 'MA0766', 5,500 %, échéance le 05/01/2041	16	–	1	Freddie Mac Gold Pool 'C46047', 8,000 %, échéance le 12/01/2030	1	–
6	Fannie Mae Pool 'MA0776', 4,500 %, échéance le 06/01/2031	6	–	3	Freddie Mac Gold Pool 'C55319', 8,000 %, échéance le 08/01/2031	3	–
155	Fannie Mae Pool 'MA0823', 5,500 %, échéance le 07/01/2041	159	0,01	–	Freddie Mac Gold Pool 'C57324', 8,000 %, échéance le 09/01/2031	–	–
65	Fannie Mae Pool 'MA0867', 5,500 %, échéance le 09/01/2041	66	0,01	2	Freddie Mac Gold Pool 'C91046', 6,500 %, échéance le 05/01/2027	2	–
141	Fannie Mae Pool 'MA0913', 4,500 %, échéance le 11/01/2031	139	0,01				
160	Fannie Mae Pool 'MA0939', 4,500 %, échéance le 12/01/2031	157	0,01				
31	Fannie Mae Pool 'MA0968', 4,500 %, échéance le 12/01/2031	31	–				
189	Fannie Mae Pool 'MA1177', 3,500 %, échéance le 09/01/2042	176	0,02				
11	Fannie Mae Pool 'MA1221', 4,500 %, échéance le 09/01/2042	10	–				
45	Fannie Mae Pool 'MA1363', 3,000 %, échéance le 02/01/2043	40	–				
1 444	Fannie Mae Pool 'MA1393', 4,000 %, échéance le 03/01/2043	1 388	0,12				
311	Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500 %, échéance le 09/01/2043	306	0,03				
244	Fannie Mae Pool 'MA1629', 4,500 %, échéance le 10/01/2043	240	0,02				
153	Fannie Mae Pool 'MA1664', 4,500 %, échéance le 11/01/2043	151	0,01				
214	Fannie Mae Pool 'MA1711', 4,500 %, échéance le 12/01/2043	211	0,02				
436	Fannie Mae Pool 'MA2672', 3,000 %, échéance le 07/01/2036	398	0,04				
422	Fannie Mae Pool 'MA2832', 3,000 %, échéance le 12/01/2036	385	0,03				
679	Fannie Mae Pool 'MA4204', 2,000 %, échéance le 12/01/2040	580	0,05				
5 634	Fannie Mae Pool 'MA4208', 2,000 %, échéance le 12/01/2050	4 615	0,41				
7 980	Fannie Mae Pool 'MA4325', 2,000 %, échéance le 05/01/2051	6 528	0,58				
439	Fannie Mae Pool 'MA4387', 2,000 %, échéance le 07/01/2041	375	0,03				
625	Fannie Mae Pool 'MA4428', 4,000 %, échéance le 08/01/2051	589	0,05				
2 903	Fannie Mae Pool 'MA4570', 2,000 %, échéance le 03/01/2042	2 453	0,22				
966	Fannie Mae REMICS, série 2010 2, catégorie AI, 5,500 %, échéance le 25/02/2040	170	0,02				
960	Fannie Mae REMICS, série 2012 124, catégorie SD, 1,533 %, échéance le 25/11/2042 *	99	0,01				
1 384	Fannie Mae REMICS, série 2012 22, catégorie SM, 1,883 %, échéance le 25/03/2042 *	143	0,01				
629	Fannie Mae REMICS, série 2012 9, catégorie PT, 11,467 %, échéance le 25/07/2036 *	761	0,07				
790	Fannie Mae REMICS, série 2013 9, catégorie BC, 6,500 %, échéance le 25/07/2042	836	0,07				
3 760	Fannie Mae REMICS, série 2013 9, catégorie CB, 5,500 %, échéance le 25/04/2042	3 820	0,34				
6 182	Fannie Mae REMICS, série 2016 48, catégorie IA, 4,500 %, échéance le 25/06/2038	897	0,08				
2 054	Fannie Mae REMICS, série 2017 74, catégorie PZ, 3,500 %, échéance le 25/10/2047	1 702	0,15				
3 734	Fannie Mae REMICS, série 2018 3, catégorie IO, 4,000 %, échéance le 25/02/2048	709	0,06				
974	Fannie Mae REMICS, série 2019 25, catégorie PI, 5,000 %, échéance le 25/05/2048	192	0,02				
4 163	Fannie Mae REMICS, série 2019 38, catégorie SH, 1,544 %, échéance le 25/07/2049 *	379	0,03				
2 087	Fannie Mae REMICS, série 2019 44, catégorie SM, 1,433 %, échéance le 25/08/2049 *	261	0,02				

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

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

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques — (suite)				3 989	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K115, catégorie X1, 1,326 %, échéance le 25/06/2030 *	300	0,03
1 080	Freddie Mac Gold Pool 'C91981', 3,000 %, échéance le 02/01/2038	988	0,09	7 963	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K116, catégorie X1, 1,425 %, échéance le 25/07/2030 *	629	0,06
–	Freddie Mac Gold Pool 'G00556', 8,000 %, échéance le 09/01/2026	–	–	989	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K121, catégorie X1, 1,024 %, échéance le 25/10/2030 *	58	0,01
1	Freddie Mac Gold Pool 'G00726', 8,000 %, échéance le 06/01/2027	1	–	76 519	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K123, catégorie X1, 0,773 %, échéance le 25/12/2030 *	3 514	0,31
–	Freddie Mac Gold Pool 'G00931', 8,000 %, échéance le 11/01/2026	–	–	2 992	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K124, catégorie X1, 0,720 %, échéance le 25/12/2030 *	131	0,01
5	Freddie Mac Gold Pool 'G02427', 5,500 %, échéance le 12/01/2036	5	–	12 497	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K132, catégorie X1, 0,508 %, échéance le 25/08/2031 *	432	0,04
27	Freddie Mac Gold Pool 'G04581', 6,500 %, échéance le 08/01/2038	28	–	58 280	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K141, catégorie X1, 0,305 %, échéance le 25/02/2032 *	1 363	0,12
1	Freddie Mac Gold Pool 'G04947', 6,500 %, échéance le 04/01/2038	1	–	61 479	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K142, catégorie X1, 0,297 %, échéance le 25/03/2032 *	1 394	0,12
4	Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500 %, échéance le 09/01/2039	4	–	85 346	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K143, catégorie X1, 0,342 %, échéance le 25/04/2035 *	2 256	0,20
103	Freddie Mac Gold Pool 'G07335', 7,000 %, échéance le 03/01/2039	110	0,01	17 895	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K148, catégorie X1, 0,250 %, échéance le 25/07/2032 *	393	0,04
231	Freddie Mac Gold Pool 'G07509', 6,500 %, échéance le 09/01/2039	241	0,02	28 481	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates KG06, catégorie X1, 0,532 %, échéance le 25/10/2031 *	1 003	0,09
944	Freddie Mac Gold Pool 'G08700', 4,500 %, échéance le 03/01/2046	931	0,08	4 179	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, série K 1515, catégorie X1, 1,511 %, échéance le 25/02/2035 *	490	0,04
170	Freddie Mac Gold Pool 'G16672', 3,000 %, échéance le 03/01/2033	161	0,01	5 632	Freddie Mac Non Gold Pool '841075', 3,269 %, échéance le 01/01/2049 *	5 324	0,48
1 293	Freddie Mac Gold Pool 'G60329', 5,500 %, échéance le 06/01/2040	1 331	0,12	2 597	Freddie Mac Non Gold Pool '841076', 3,007 %, échéance le 11/01/2048 *	2 450	0,22
3 698	Freddie Mac Gold Pool 'G60344', 4,000 %, échéance le 12/01/2045	3 585	0,32	509	Freddie Mac Non Gold Pool '841077', 2,877 %, échéance le 11/01/2047 *	488	0,04
5 098	Freddie Mac Gold Pool 'G61814', 3,500 %, échéance le 09/01/2048	4 737	0,42	900	Freddie Mac Non Gold Pool '841081', 3,096 %, échéance le 02/01/2050 *	860	0,08
9 024	Freddie Mac Gold Pool 'G67701', 3,000 %, échéance le 10/01/2046	8 171	0,73	92	Freddie Mac Pool 'QA5770', 3,000 %, échéance le 01/01/2050	83	0,01
1	Freddie Mac Gold Pool 'H00790', 5,500 %, échéance le 05/01/2037	1	–	335	Freddie Mac Pool 'QA7238', 3,500 %, échéance le 02/01/2050	309	0,03
44	Freddie Mac Gold Pool 'H02425', 5,500 %, échéance le 02/01/2038	44	–	3 153	Freddie Mac Pool 'QA7256', 3,000 %, échéance le 02/01/2050	2 805	0,25
1	Freddie Mac Gold Pool 'H09170', 5,500 %, échéance le 01/01/2038	1	–	122	Freddie Mac Pool 'QA9685', 3,000 %, échéance le 05/01/2050	110	0,01
291	Freddie Mac Gold Pool 'J39722', 3,000 %, échéance le 10/01/2033	273	0,02	201	Freddie Mac Pool 'QA9686', 3,000 %, échéance le 05/01/2050	181	0,02
176	Freddie Mac Gold Pool 'J39962', 3,000 %, échéance le 12/01/2033	165	0,01	478	Freddie Mac Pool 'QB5092', 2,500 %, échéance le 11/01/2050	412	0,04
172	Freddie Mac Gold Pool 'Q26702', 4,000 %, échéance le 06/01/2044	169	0,02	312	Freddie Mac Pool 'QB5093', 2,500 %, échéance le 11/01/2050	268	0,02
1 536	Freddie Mac Gold Pool 'U69040', 4,000 %, échéance le 05/01/2045	1 474	0,13	78	Freddie Mac Pool 'QB8602', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	65	0,01
63	Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000 %, échéance le 10/01/2042	60	0,01	149	Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	124	0,01
381	Freddie Mac Gold Pool 'U90378', 4,000 %, échéance le 11/01/2042	367	0,03	72	Freddie Mac Pool 'QB8773', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	60	0,01
312	Freddie Mac Gold Pool 'U90436', 4,000 %, échéance le 11/01/2042	301	0,03	78	Freddie Mac Pool 'QB9482', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	64	0,01
33	Freddie Mac Gold Pool 'U90598', 3,500 %, échéance le 12/01/2042	31	–	230	Freddie Mac Pool 'QB9484', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	191	0,02
80	Freddie Mac Gold Pool 'U90608', 3,500 %, échéance le 12/01/2042	75	0,01	161	Freddie Mac Pool 'QB9485', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	134	0,01
48	Freddie Mac Gold Pool 'U90768', 3,500 %, échéance le 01/01/2043	45	–	87	Freddie Mac Pool 'QB9961', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	72	0,01
64	Freddie Mac Gold Pool 'U90778', 3,500 %, échéance le 01/01/2043	60	0,01	74	Freddie Mac Pool 'QC0160', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	61	0,01
97	Freddie Mac Gold Pool 'U90794', 3,500 %, échéance le 01/01/2043	90	0,01	82	Freddie Mac Pool 'QC0161', 2,000 %, échéance le 03/01/2051	67	0,01
145	Freddie Mac Gold Pool 'U90828', 3,500 %, échéance le 02/01/2043	136	0,01	86	Freddie Mac Pool 'QC0885', 2,000 %, échéance le 04/01/2051	72	0,01
159	Freddie Mac Gold Pool 'U90879', 3,500 %, échéance le 02/01/2043	148	0,01	78	Freddie Mac Pool 'QC1164', 2,000 %, échéance le 04/01/2051	65	0,01
115	Freddie Mac Gold Pool 'U90903', 3,500 %, échéance le 02/01/2043	107	0,01	168	Freddie Mac Pool 'QC2044', 2,500 %, échéance le 05/01/2051	147	0,01
129	Freddie Mac Gold Pool 'U91027', 3,500 %, échéance le 02/01/2043	120	0,01	579	Freddie Mac Pool 'QC3242', 3,000 %, échéance le 06/01/2051	517	0,05
3 854	Freddie Mac Gold Pool 'U99124', 3,500 %, échéance le 03/01/2045	3 594	0,32	449	Freddie Mac Pool 'QC3690', 2,500 %, échéance le 07/01/2051	386	0,03
2 012	Freddie Mac Gold Pool 'U99135', 4,000 %, échéance le 02/01/2044	1 936	0,17	874	Freddie Mac Pool 'QC4446', 2,500 %, échéance le 07/01/2051	747	0,07
57 629	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K065, catégorie X1, 0,667 %, échéance le 25/04/2027 *	1 322	0,12	435	Freddie Mac Pool 'QC4689', 2,500 %, échéance le 08/01/2051	374	0,03
83 189	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K069, catégorie X1, 0,348 %, échéance le 25/09/2027 *	1 170	0,10	457	Freddie Mac Pool 'QC4690', 2,500 %, échéance le 08/01/2051	392	0,04
54 532	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K079, catégorie XAM, 0,081 %, échéance le 25/06/2028 *	340	0,03	360	Freddie Mac Pool 'QC4818', 2,500 %, échéance le 08/01/2051	308	0,03
57 720	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K081, catégorie XAM, 0,073 %, échéance le 25/08/2028 *	345	0,03	541	Freddie Mac Pool 'QC4824', 2,500 %, échéance le 08/01/2051	465	0,04
884	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K091, catégorie X1, 0,561 %, échéance le 25/03/2032 *	25	–	4 002	Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500 %, échéance le 08/01/2051	3 438	0,31
4 988	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K105, catégorie X1, 1,523 %, échéance le 25/10/2030 *	409	0,04	1 904	Freddie Mac Pool 'QC7411', 2,500 %, échéance le 09/01/2051	1 633	0,15
9 960	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K110, catégorie X1, 1,697 %, échéance le 25/04/2030 *	904	0,08	3 835	Freddie Mac Pool 'QC8573', 2,500 %, échéance le 10/01/2051	3 283	0,29
				1 009	Freddie Mac Pool 'QD1347', 2,500 %, échéance le 11/01/2051	863	0,08
				4 258	Freddie Mac Pool 'QD1596', 2,000 %, échéance le 12/01/2051	3 517	0,31
				94	Freddie Mac Pool 'QD1954', 3,000 %, échéance le 11/01/2051	83	0,01
				91	Freddie Mac Pool 'QD2260', 3,000 %, échéance le 12/01/2051	80	0,01
				7 402	Freddie Mac Pool 'QD2419', 3,000 %, échéance le 12/01/2051	6 602	0,59
				262	Freddie Mac Pool 'QD4146', 2,500 %, échéance le 01/01/2052	225	0,02
				554	Freddie Mac Pool 'QD5620', 2,000 %, échéance le 02/01/2052	454	0,04
				672	Freddie Mac Pool 'QD5628', 2,000 %, échéance le 02/01/2052	550	0,05
				94	Freddie Mac Pool 'QD5827', 2,000 %, échéance le 02/01/2052	77	0,01
				852	Freddie Mac Pool 'QD5960', 2,000 %, échéance le 02/01/2052	698	0,06
				552	Freddie Mac Pool 'QD5961', 2,000 %, échéance le 02/01/2052	452	0,04
				3 451	Freddie Mac Pool 'QD6079', 2,500 %, échéance le 02/01/2052	2 960	0,26
				284	Freddie Mac Pool 'QD6142', 2,500 %, échéance le 02/01/2052	243	0,02
				195	Freddie Mac Pool 'QD6216', 3,000 %, échéance le 02/01/2052	173	0,02
				276	Freddie Mac Pool 'QD7365', 2,000 %, échéance le 02/01/2052	227	0,02
				655	Freddie Mac Pool 'QE1492', 3,500 %, échéance le 05/01/2052	604	0,05
				197	Freddie Mac Pool 'QE5811', 4,000 %, échéance le 07/01/2052	185	0,02
				3 123	Freddie Mac Pool 'QE8530', 5,500 %, échéance le 08/01/2052	3 137	0,28
				2 981	Freddie Mac Pool 'QE8532', 5,500 %, échéance le 08/01/2052	2 992	0,27
				898	Freddie Mac Pool 'QF4924', 6,000 %, échéance le 12/01/2052	915	0,08
				200	Freddie Mac Pool 'QF6516', 6,500 %, échéance le 01/01/2053	205	0,02
				200	Freddie Mac Pool 'QF6690', 6,500 %, échéance le 01/01/2053	205	0,02
				200	Freddie Mac Pool 'QF8222', 6,500 %, échéance le 02/01/2053	206	0,02
				300	Freddie Mac Pool 'QF8298', 6,500 %, échéance le 03/01/2053	309	0,03
				1 222	Freddie Mac Pool 'RA1293', 3,000 %, échéance le 09/01/2049	1 099	0,10

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

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

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques — (suite)			349 Freddie Mac REMICS 4759, catégorie MI, 4,000 %, échéance le 15/09/2045	24	—
2 222 Freddie Mac Pool 'RA2114', 3,500 %, échéance le 02/01/2050	2 046	0,18	1 314 Freddie Mac REMICS 4808, catégorie SB, 1,612 %, échéance le 15/07/2048 *	155	0,01
7 063 Freddie Mac Pool 'RA2194', 3,000 %, échéance le 02/01/2050	6 340	0,57	189 Freddie Mac REMICS 4813, catégorie CJ, 3,000 %, échéance le 15/08/2048	164	0,01
382 Freddie Mac Pool 'RA2729', 2,500 %, échéance le 06/01/2050	328	0,03	1 624 Freddie Mac REMICS 4856, catégorie IO, 5,000 %, échéance le 15/01/2049	304	0,03
407 Freddie Mac Pool 'RA3882', 2,000 %, échéance le 11/01/2050	337	0,03	853 Freddie Mac REMICS 4870, catégorie ES, 1,412 %, échéance le 15/04/2049 *	86	0,01
5 830 Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, échéance le 11/01/2050	5 029	0,45	1 745 Freddie Mac REMICS 4882, catégorie S, 1,462 %, échéance le 15/05/2049 *	169	0,02
18 807 Freddie Mac Pool 'RA4142', 2,500 %, échéance le 12/01/2050	16 223	1,45	2 432 Freddie Mac REMICS 4921, catégorie SN, 1,433 %, échéance le 25/10/2049 *	233	0,02
1 839 Freddie Mac Pool 'RA4175', 2,500 %, échéance le 12/01/2050	1 574	0,14	1 085 Freddie Mac REMICS 4936, catégorie YZ, 2,500 %, échéance le 25/12/2049	885	0,08
69 Freddie Mac Pool 'RA4349', 2,500 %, échéance le 01/01/2051	59	0,01	1 394 Freddie Mac REMICS 4962, catégorie SP, 1,433 %, échéance le 25/03/2050 *	127	0,01
459 Freddie Mac Pool 'RA4414', 2,500 %, échéance le 01/01/2051	393	0,04	4 746 Freddie Mac REMICS 4988, catégorie AZ, 2,000 %, échéance le 25/07/2050	2 843	0,25
2 293 Freddie Mac Pool 'RA4526', 3,000 %, échéance le 02/01/2051	2 043	0,18	2 326 Freddie Mac REMICS 4995, catégorie IQ, 2,500 %, échéance le 25/07/2050	336	0,03
75 Freddie Mac Pool 'RA4532', 2,500 %, échéance le 02/01/2051	65	0,01	10 079 Freddie Mac REMICS 4995, catégorie QI, 2,500 %, échéance le 25/07/2050	1 567	0,14
576 Freddie Mac Pool 'RA4703', 2,000 %, échéance le 02/01/2051	474	0,04	5 039 Freddie Mac REMICS 5000, catégorie IB, 2,500 %, échéance le 25/07/2050	608	0,05
1 535 Freddie Mac Pool 'RA5117', 2,000 %, échéance le 05/01/2051	1 261	0,11	4 003 Freddie Mac REMICS 5000, catégorie UI, 2,500 %, échéance le 25/07/2050	643	0,06
576 Freddie Mac Pool 'RA5373', 2,000 %, échéance le 06/01/2051	145	0,01	1 688 Freddie Mac REMICS 5027, catégorie HI, 2,000 %, échéance le 25/10/2050	230	0,02
1 573 Freddie Mac Pool 'RA5576', 2,500 %, échéance le 07/01/2051	1 344	0,12	148 Freddie Mac REMICS 5040, catégorie IB, 2,500 %, échéance le 25/11/2050	22	—
1 211 Freddie Mac Pool 'RA5921', 2,500 %, échéance le 09/01/2051	1 027	0,09	2 381 Freddie Mac REMICS 5058, catégorie IL, 2,500 %, échéance le 25/01/2051	342	0,03
8 629 Freddie Mac Pool 'RB5125', 2,000 %, échéance le 09/01/2041	7 321	0,65	697 Freddie Mac REMICS 5059, catégorie IB, 2,500 %, échéance le 25/01/2051	110	0,01
2 290 Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, échéance le 10/01/2041	1 833	0,16	5 163 Freddie Mac REMICS 5070, catégorie NI, 2,000 %, échéance le 25/02/2051	684	0,06
292 Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, échéance le 11/01/2041	236	0,02	9 156 Freddie Mac REMICS 5078, catégorie EI, 1,500 %, échéance le 25/01/2051	923	0,08
11 304 Freddie Mac Pool 'SC0190', 2,500 %, échéance le 09/01/2041	9 929	0,89	21 173 Freddie Mac REMICS 5085, catégorie IK, 2,500 %, échéance le 25/03/2051	3 206	0,29
156 Freddie Mac Pool 'SD0247', 4,000 %, échéance le 07/01/2047	150	0,01	11 558 Freddie Mac REMICS 5092, catégorie IU, 2,500 %, échéance le 25/02/2051	1 409	0,13
244 Freddie Mac Pool 'SD0422', 4,500 %, échéance le 07/01/2045	236	0,02	3 695 Freddie Mac REMICS 5113, catégorie NI, 2,500 %, échéance le 25/06/2051	477	0,04
151 Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, échéance le 04/01/2051	125	0,01	11 937 Freddie Mac REMICS 5134, catégorie KI, 2,500 %, échéance le 25/07/2048	1 601	0,14
346 Freddie Mac Pool 'SD0618', 3,000 %, échéance le 02/01/2051	308	0,03	11 149 Freddie Mac REMICS 5135, catégorie DI, 2,500 %, échéance le 25/05/2048	1 378	0,12
5 062 Freddie Mac Pool 'SD0630', 4,000 %, échéance le 02/01/2050	4 851	0,43	1 468 Freddie Mac REMICS 5149, catégorie NI, 2,500 %, échéance le 25/01/2051	210	0,02
343 Freddie Mac Pool 'SD0653', 2,500 %, échéance le 07/01/2051	293	0,03	9 666 Freddie Mac REMICS 5160, catégorie IU, 2,500 %, échéance le 25/11/2050	1 291	0,12
2 611 Freddie Mac Pool 'SD0731', 2,000 %, échéance le 05/01/2051	2 139	0,19	9 941 Freddie Mac REMICS 5162, catégorie DI, 2,500 %, échéance le 25/11/2051	1 238	0,11
7 246 Freddie Mac Pool 'SD0777', 2,500 %, échéance le 11/01/2051	6 184	0,55	7 700 Freddie Mac REMICS 5169, catégorie PW, 2,000 %, échéance le 25/09/2051	5 257	0,47
3 843 Freddie Mac Pool 'SD0809', 3,000 %, échéance le 01/01/2052	3 388	0,30	7 200 Freddie Mac REMICS 5178, catégorie CY, 2,000 %, échéance le 25/01/2042	4 973	0,44
924 Freddie Mac Pool 'SD0849', 2,500 %, échéance le 01/01/2052	792	0,07	4 900 Freddie Mac REMICS 5209, catégorie EQ, 3,000 %, échéance le 25/04/2052	3 811	0,34
385 Freddie Mac Pool 'SD0952', 3,000 %, échéance le 04/01/2052	343	0,03	1 204 Freddie Mac Strips 312, catégorie S1, 1,362 %, échéance le 15/09/2043 *	115	0,01
3 106 Freddie Mac Pool 'SD0957', 3,500 %, échéance le 04/01/2052	2 832	0,25	4 000 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, série 2021 DNA2, catégorie M2, 144A, 6,784 %, échéance le 25/08/2033 *	4 011	0,36
7 032 Freddie Mac Pool 'SD1070', 3,500 %, échéance le 04/01/2052	6 485	0,58	— Ginnie Mae I Pool '410304', 7,500 %, échéance le 15/12/2025	1	—
3 083 Freddie Mac Pool 'SD1071', 3,500 %, échéance le 04/01/2052	2 834	0,25	1 Ginnie Mae I Pool '417463', 7,000 %, échéance le 15/09/2025	—	—
16 560 Freddie Mac Pool 'SD1143', 4,500 %, échéance le 09/01/2050	16 196	1,45	— Ginnie Mae I Pool '430208', 7,000 %, échéance le 15/09/2027	—	—
14 443 Freddie Mac Pool 'SD1218', 4,000 %, échéance le 07/01/2049	13 809	1,23	— Ginnie Mae I Pool '462669', 7,000 %, échéance le 15/04/2028	—	—
3 924 Freddie Mac Pool 'SD1586', 3,500 %, échéance le 08/01/2052	3 620	0,32	— Ginnie Mae I Pool '486470', 6,500 %, échéance le 15/08/2028	—	—
4 691 Freddie Mac Pool 'SD1876', 3,500 %, échéance le 11/01/2052	4 719	0,42	— Ginnie Mae I Pool '486516', 6,500 %, échéance le 15/09/2028	—	—
7 319 Freddie Mac Pool 'SD2284', 6,000 %, échéance le 12/01/2052	7 462	0,67	— Ginnie Mae I Pool '519569', 8,000 %, échéance le 15/05/2030	—	—
636 Freddie Mac Pool 'SD7509', 3,000 %, échéance le 11/01/2049	568	0,05	24 Ginnie Mae I Pool '646044', 6,500 %, échéance le 15/10/2037	25	—
221 Freddie Mac Pool 'SD7525', 2,500 %, échéance le 10/01/2050	191	0,02	1 Ginnie Mae I Pool '652203', 5,000 %, échéance le 15/03/2036	1	—
705 Freddie Mac Pool 'SD7534', 2,500 %, échéance le 02/01/2051	610	0,05	3 Ginnie Mae I Pool '658182', 6,000 %, échéance le 15/11/2036	3	—
24 053 Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, échéance le 11/01/2051	20 679	1,85	1 Ginnie Mae I Pool '675375', 5,000 %, échéance le 15/05/2038	1	—
5 865 Freddie Mac Pool 'SD8135', 2,500 %, échéance le 03/01/2051	4 994	0,45	1 Ginnie Mae I Pool '676940', 5,000 %, échéance le 15/04/2038	1	—
4 897 Freddie Mac Pool 'SD8146', 2,000 %, échéance le 05/01/2051	4 005	0,36	4 Ginnie Mae I Pool '683926', 5,000 %, échéance le 15/02/2038	4	—
1 210 Freddie Mac Pool 'ZA2343', 3,500 %, échéance le 05/01/2034	1 157	0,10	6 Ginnie Mae I Pool '684334', 5,000 %, échéance le 15/02/2038	6	—
1 630 Freddie Mac Pool 'ZA2415', 3,000 %, échéance le 06/01/2036	1 488	0,13	2 Ginnie Mae I Pool '684754', 5,000 %, échéance le 15/04/2038	2	—
267 Freddie Mac Pool 'ZA5297', 4,000 %, échéance le 03/01/2048	255	0,02	2 Ginnie Mae I Pool '684848', 5,000 %, échéance le 15/04/2038	2	—
240 Freddie Mac Pool 'Z19993', 5,000 %, échéance le 05/01/2040	242	0,02	2 Ginnie Mae I Pool '686062', 5,000 %, échéance le 15/05/2038	2	—
2 125 Freddie Mac Pool 'ZM1466', 3,500 %, échéance le 07/01/2046	1 979	0,18	52 Ginnie Mae I Pool '698086', 6,000 %, échéance le 15/04/2039	53	—
383 Freddie Mac Pool 'ZN0480', 3,500 %, échéance le 10/01/2042	357	0,03	10 Ginnie Mae I Pool '701501', 5,000 %, échéance le 15/12/2038	10	—
812 Freddie Mac Pool 'ZN0538', 3,500 %, échéance le 11/01/2042	758	0,07	277 Ginnie Mae I Pool '701947', 5,000 %, échéance le 15/06/2039	281	0,03
2 278 Freddie Mac Pool 'ZN0608', 3,500 %, échéance le 02/01/2043	2 124	0,19	119 Ginnie Mae I Pool '733600', 5,000 %, échéance le 15/04/2040	121	0,01
90 Freddie Mac Pool 'ZN0614', 3,500 %, échéance le 02/01/2043	83	0,01	262 Ginnie Mae I Pool '733627', 5,000 %, échéance le 15/05/2040	266	0,02
107 Freddie Mac Pool 'ZN0628', 3,500 %, échéance le 02/01/2043	100	0,01	1 Ginnie Mae I Pool '780732', 7,000 %, échéance le 15/03/2028	1	—
58 Freddie Mac Pool 'ZN2185', 4,500 %, échéance le 12/01/2048	57	0,01			
11 Freddie Mac Pool 'ZS0823', 5,000 %, échéance le 12/01/2034	11	—			
321 Freddie Mac Pool 'ZS1355', 6,000 %, échéance le 03/01/2037	333	0,03			
6 Freddie Mac Pool 'ZS1530', 5,500 %, échéance le 07/01/2037	6	—			
9 Freddie Mac Pool 'ZS1821', 5,500 %, échéance le 11/01/2037	9	—			
137 Freddie Mac Pool 'ZS3059', 5,500 %, échéance le 12/01/2038	141	0,01			
10 287 Freddie Mac Pool 'ZS4751', 3,500 %, échéance le 01/01/2048	9 490	0,85			
156 Freddie Mac Pool 'ZS8673', 3,000 %, échéance le 10/01/2032	147	0,01			
232 Freddie Mac Pool 'ZS9826', 3,000 %, échéance le 10/01/2046	209	0,02			
39 Freddie Mac Pool 'ZT0474', 4,500 %, échéance le 08/01/2048	39	—			
2 249 Freddie Mac Pool 'ZT1101', 3,000 %, échéance le 01/01/2043	2 039	0,18			
783 Freddie Mac Pool 'ZT1107', 3,500 %, échéance le 03/01/2043	730	0,07			
140 Freddie Mac Pool 'ZT1159', 3,500 %, échéance le 02/01/2044	130	0,01			
146 Freddie Mac Pool 'ZT1257', 3,000 %, échéance le 01/01/2046	131	0,01			
36 Freddie Mac Pool 'ZT1854', 4,500 %, échéance le 03/01/2049	35	—			
154 Freddie Mac Pool 'ZT1970', 3,500 %, échéance le 04/01/2033	148	0,01			
1 835 Freddie Mac Pool 'ZT2228', 3,500 %, échéance le 06/01/2049	1 691	0,15			
4 600 Freddie Mac REMICS 3810, catégorie WA, 5,442 %, échéance le 15/06/2040 *	4 657	0,42			
3 057 Freddie Mac REMICS 3998, catégorie DS, 1,912 %, échéance le 15/02/2042 *	337	0,03			
2 170 Freddie Mac REMICS 4134, catégorie IM, 3,500 %, échéance le 15/11/2042	355	0,03			
825 Freddie Mac REMICS 4280, catégorie AI, 3,000 %, échéance le 15/02/2028	19	—			
4 800 Freddie Mac REMICS 4377, catégorie UZ, 3,000 %, échéance le 15/08/2044	3 869	0,35			
285 Freddie Mac REMICS 4403, catégorie IG, 3,500 %, échéance le 15/07/2032	10	—			
1 220 Freddie Mac REMICS 4715, catégorie JS, 1,562 %, échéance le 15/08/2047 *	137	0,01			

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

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

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques — (suite)					
1 Ginnie Mae I Pool '781001', 7,500 %, échéance le 15/03/2029	1	—	140 Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, échéance le 20/07/2048	137	0,01
49 Ginnie Mae I Pool '781590', 5,500 %, échéance le 15/04/2033	51	—	1 891 Ginnie Mae II Pool 'MA5399', 4,500 %, échéance le 20/08/2048	1 858	0,17
336 Ginnie Mae I Pool '781994', 5,500 %, échéance le 15/11/2033	349	0,03	42 Ginnie Mae II Pool 'MA5467', 4,500 %, échéance le 20/09/2048	41	—
2 Ginnie Mae I Pool '782198', 6,000 %, échéance le 15/10/2037	2	—	6 533 Ginnie Mae II Pool 'MA5530', 5,000 %, échéance le 20/10/2048	6 554	0,59
296 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, échéance le 15/06/2048	281	0,03	65 Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500 %, échéance le 20/12/2048	63	0,01
132 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, échéance le 15/09/2042	122	0,01	207 Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500 %, échéance le 20/01/2049	201	0,02
152 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, échéance le 15/09/2042	140	0,01	215 Ginnie Mae II Pool 'MA5713', 5,500 %, échéance le 20/01/2049	218	0,02
46 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, échéance le 15/10/2042	42	—	2 523 Ginnie Mae II Pool 'MA5766', 5,500 %, échéance le 20/02/2049	2 574	0,23
240 Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000 %, échéance le 15/10/2042	222	0,02	135 Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500 %, échéance le 20/03/2049	132	0,01
210 Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000 %, échéance le 15/11/2042	194	0,02	557 Ginnie Mae II Pool 'MA5820', 5,500 %, échéance le 20/03/2049	569	0,05
1 869 Ginnie Mae I Pool 'B58462', 3,500 %, échéance le 15/06/2050	1 764	0,16	12 Ginnie Mae II Pool 'MA5877', 4,500 %, échéance le 20/04/2049	12	—
7 Ginnie Mae II Pool '4040', 6,500 %, échéance le 20/10/2037	7	—	543 Ginnie Mae II Pool 'MA5879', 5,500 %, échéance le 20/04/2049	555	0,05
10 Ginnie Mae II Pool '4170', 6,000 %, échéance le 20/06/2038	10	—	408 Ginnie Mae II Pool 'MA5934', 5,500 %, échéance le 20/05/2049	417	0,04
684 Ginnie Mae II Pool '4245', 6,000 %, échéance le 20/09/2038	722	0,06	3 740 Ginnie Mae II Pool 'MA5989', 5,500 %, échéance le 20/06/2049	3 818	0,34
109 Ginnie Mae II Pool '4602', 6,000 %, échéance le 20/12/2039	115	0,01	4 152 Ginnie Mae II Pool 'MA6157', 5,000 %, échéance le 20/09/2049	4 167	0,37
112 Ginnie Mae II Pool '4617', 4,500 %, échéance le 20/01/2040	112	0,01	213 Ginnie Mae II Pool 'MA6217', 2,500 %, échéance le 20/10/2049	186	0,02
56 Ginnie Mae II Pool '4696', 4,500 %, échéance le 20/05/2040	56	0,01	125 Ginnie Mae II Pool 'MA6412', 4,500 %, échéance le 20/01/2050	121	0,01
35 Ginnie Mae II Pool '4747', 5,000 %, échéance le 20/07/2040	36	—	87 Ginnie Mae II Pool 'MA6542', 3,500 %, échéance le 20/03/2050	81	0,01
40 Ginnie Mae II Pool '4772', 5,000 %, échéance le 20/08/2040	41	—	126 Ginnie Mae II Pool 'MA6602', 4,500 %, échéance le 20/04/2050	124	0,01
4 Ginnie Mae II Pool '4774', 6,000 %, échéance le 20/08/2040	4	—	4 966 Ginnie Mae II Pool 'MA6657', 3,500 %, échéance le 20/05/2050	4 612	0,41
84 Ginnie Mae II Pool '4802', 5,000 %, échéance le 20/09/2040	85	0,01	4 228 Ginnie Mae II Pool 'MA6658', 4,000 %, échéance le 20/05/2050	4 045	0,36
35 Ginnie Mae II Pool '4855', 5,000 %, échéance le 20/11/2040	36	—	2 059 Ginnie Mae II Pool 'MA6869', 4,500 %, échéance le 20/09/2050	2 022	0,18
13 Ginnie Mae II Pool '4923', 4,500 %, échéance le 20/01/2041	13	—	2 654 Ginnie Mae II Pool 'MA6935', 4,500 %, échéance le 20/10/2050	2 610	0,23
8 Ginnie Mae II Pool '4928', 6,000 %, échéance le 20/01/2041	8	—	111 Ginnie Mae II Pool 'MA7194', 3,000 %, échéance le 20/02/2051	100	0,01
453 Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500 %, échéance le 20/03/2041	453	0,04	16 572 Ginnie Mae II Pool 'MA7312', 2,500 %, échéance le 20/04/2051	14 420	1,29
1 004 Ginnie Mae II Pool '783050', 5,000 %, échéance le 20/07/2040	1 008	0,09	2 308 Ginnie Mae II Pool 'MA7314', 3,500 %, échéance le 20/04/2051	2 142	0,19
742 Ginnie Mae II Pool '783298', 4,500 %, échéance le 20/04/2041	741	0,07	5 043 Ginnie Mae II Pool 'MA7316', 4,500 %, échéance le 20/04/2051	4 963	0,44
69 Ginnie Mae II Pool '784106', 3,500 %, échéance le 20/01/2046	64	0,01	4 890 Ginnie Mae II Pool 'MA7420', 3,500 %, échéance le 20/06/2051	4 532	0,40
2 074 Ginnie Mae II Pool '784577', 4,000 %, échéance le 20/07/2047	1 993	0,18	4 033 Ginnie Mae II Pool 'MA7475', 4,000 %, échéance le 20/07/2051	3 851	0,34
63 Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000 %, échéance le 20/01/2050	56	0,01	9 201 Ginnie Mae II Pool 'MA7589', 2,500 %, échéance le 20/09/2051	7 979	0,71
530 Ginnie Mae II Pool '785360', 2,000 %, échéance le 20/03/2051	427	0,04	19 899 Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, échéance le 20/09/2051	17 866	1,60
9 302 Ginnie Mae II Pool '785944', 3,000 %, échéance le 20/02/2052	8 342	0,75	3 565 Ginnie Mae II Pool 'MA7649', 2,500 %, échéance le 20/10/2051	3 090	0,28
2 203 Ginnie Mae II Pool '786077', 3,000 %, échéance le 20/03/2052	1 972	0,18	3 963 Ginnie Mae II Pool 'MA7883', 3,500 %, échéance le 20/02/2052	3 655	0,33
3 086 Ginnie Mae II Pool '786082', 3,000 %, échéance le 20/11/2051	2 770	0,25	3 399 Ginnie Mae II Pool 'MA8045', 4,000 %, échéance le 20/05/2052	3 215	0,29
291 Ginnie Mae II Pool '786095', 3,000 %, échéance le 20/04/2052	253	0,02	3 011 Ginnie Mae II Pool 'MA8046', 4,500 %, échéance le 20/05/2052	2 924	0,26
1 576 Ginnie Mae II Pool '786107', 3,000 %, échéance le 20/03/2052	1 415	0,13	975 Ginnie Mae II Pool 'MA8100', 4,000 %, échéance le 20/06/2052	922	0,08
1 349 Ginnie Mae II Pool '786108', 3,500 %, échéance le 20/03/2052	1 227	0,11	16 383 Ginnie Mae II Pool 'MA8197', 2,500 %, échéance le 20/08/2052	14 195	1,27
456 Ginnie Mae II Pool '786134', 3,000 %, échéance le 20/04/2052	398	0,04	1 887 Ginnie Mae II Pool 'MA8428', 5,000 %, échéance le 20/11/2052	1 869	0,17
9 988 Ginnie Mae II Pool '786348', 4,500 %, échéance le 20/08/2052	8 742	0,78	8 200 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 5,000 % ±	8 104	0,72
5 463 Ginnie Mae II Pool '786374', 5,000 %, échéance le 20/09/2052	5 457	0,49	2 300 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 5,000 % ±	2 273	0,20
2 053 Ginnie Mae II Pool '892346', 6,727 %, échéance le 20/08/2059 *	2 091	0,19	4 000 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 5,500 % ±	4 015	0,36
222 Ginnie Mae II Pool '892614', 6,126 %, échéance le 20/08/2060 *	229	0,02	2 200 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 6,000 % ±	2 229	0,20
923 Ginnie Mae II Pool, 'AV0243', 3,500 %, échéance le 20/08/2046	862	0,08	702 Government National Mortgage Association, série 2004 81, catégorie SK, 1,610 %, échéance le 16/10/2034 *	26	—
1 109 Ginnie Mae II Pool, 'AV8311', 3,500 %, échéance le 20/08/2046	1 034	0,09	1 234 Government National Mortgage Association, série 2008 40, catégorie SC, 1,760 %, échéance le 16/05/2038 *	70	0,01
1 256 Ginnie Mae II Pool, 'AV8312', 3,500 %, échéance le 20/08/2046	1 172	0,10	1 502 Government National Mortgage Association, série 2008 79, catégorie ID, 2,202 %, échéance le 20/06/2035 *	101	0,01
454 Ginnie Mae II Pool 'AZ3074', 4,000 %, échéance le 20/02/2047	434	0,04	320 Government National Mortgage Association, série 2010 H02, catégorie FA, 5,197 %, échéance le 20/02/2060 *	318	0,03
527 Ginnie Mae II Pool 'BC5293', 3,500 %, échéance le 20/08/2047	492	0,04	726 Government National Mortgage Association, série 2010 H20, catégorie AF, 4,722 %, échéance le 20/10/2060 *	722	0,06
3 345 Ginnie Mae II Pool 'BC5429', 3,500 %, échéance le 20/10/2047	3 119	0,28	267 Government National Mortgage Association, série 2010 H22, catégorie FE, 4,742 %, échéance le 20/05/2059 *	265	0,02
255 Ginnie Mae II Pool 'BD3554', 3,500 %, échéance le 20/10/2047	238	0,02	357 Government National Mortgage Association, série 2010 H28, catégorie FE, 4,792 %, échéance le 20/12/2060 *	355	0,03
1 325 Ginnie Mae II Pool 'BD3636', 3,500 %, échéance le 20/10/2047	1 236	0,11	692 Government National Mortgage Association, série 2011 146, catégorie KS, 1,510 %, échéance le 16/11/2041 *	60	0,01
33 Ginnie Mae II Pool 'BG7951', 4,500 %, échéance le 20/06/2048	32	—	902 Government National Mortgage Association, série 2011 79, catégorie KS, 0,802 %, échéance le 20/05/2041 *	60	0,01
727 Ginnie Mae II Pool 'BH1521', 4,500 %, échéance le 20/07/2048	710	0,06	2 927 Government National Mortgage Association, série 2012 H21, catégorie FA, 4,892 %, échéance le 20/07/2062 *	2 914	0,26
898 Ginnie Mae II Pool 'BH1870', 4,500 %, échéance le 20/08/2048	881	0,08	9 913 Government National Mortgage Association, série 2013 93, catégorie SA, 1,610 %, échéance le 16/06/2043 *	1 096	0,10
670 Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500 %, échéance le 20/02/2050	617	0,06	544 Government National Mortgage Association, série 2014 118, catégorie HS, 1,602 %, échéance le 20/08/2044 *	54	0,01
134 Ginnie Mae II Pool 'BM9734', 4,000 %, échéance le 20/10/2049	129	0,01	862 Government National Mortgage Association, série 2014 2, catégorie CI, 4,500 %, échéance le 20/01/2044	167	0,02
548 Ginnie Mae II Pool 'BS1728', 4,000 %, échéance le 20/01/2050	532	0,05	2 509 Government National Mortgage Association, série 2014 60, catégorie SA, 1,510 %, échéance le 16/04/2044 *	182	0,02
446 Ginnie Mae II Pool 'BS1742', 4,000 %, échéance le 20/02/2050	432	0,04	8 150 Government National Mortgage Association, série 2015 136, catégorie IO, 0,411 %, échéance le 16/08/2055 *	131	0,01
75 Ginnie Mae II Pool 'BS8546', 2,500 %, échéance le 20/12/2050	63	0,01	3 876 Government National Mortgage Association, série 2015 177, catégorie MI, 5,000 %, échéance le 20/10/2044	770	0,07
495 Ginnie Mae II Pool 'BT1888', 2,500 %, échéance le 20/12/2050	429	0,04	26 590 Government National Mortgage Association, série 2017 111, catégorie IO, 0,526 %, échéance le 16/02/2059 *	870	0,08
1 118 Ginnie Mae II Pool 'BT9472', 4,000 %, échéance le 20/05/2050	1 074	0,10	1 947 Government National Mortgage Association, série 2017 19, catégorie SE, 1,560 %, échéance le 16/02/2047 *	172	0,02
2 408 Ginnie Mae II Pool 'BU3196', 4,000 %, échéance le 20/05/2050	2 278	0,20	3 928 Government National Mortgage Association, série 2017 26, catégorie IQ, 5,000 %, échéance le 20/02/2040	794	0,07
867 Ginnie Mae II Pool 'BW7380', 4,500 %, échéance le 20/07/2050	855	0,08	7 026 Government National Mortgage Association, série 2017 8, catégorie IO, 0,450 %, échéance le 16/08/2058 *	183	0,02
978 Ginnie Mae II Pool, 'BW7384', 4,000 %, échéance le 20/08/2052	930	0,08	1 819 Government National Mortgage Association, série 2018 125, catégorie HS, 1,652 %, échéance le 20/09/2048 *	149	0,01
1 486 Ginnie Mae II Pool 'BX2423', 3,000 %, échéance le 20/10/2050	1 336	0,12	2 927 Government National Mortgage Association, série 2018 134, catégorie SM, 1,602 %, échéance le 20/10/2048 *	232	0,02
95 Ginnie Mae II Pool 'CL5523', 3,000 %, échéance le 20/04/2052	84	0,01	678 Government National Mortgage Association, série 2018 37, catégorie QA, 2,750 %, échéance le 20/03/2048	604	0,05
162 Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500 %, échéance le 20/04/2046	151	0,01			
90 Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500 %, échéance le 20/05/2046	84	0,01			
152 Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500 %, échéance le 20/06/2046	142	0,01			
92 Ginnie Mae II Pool 'MA3803', 3,500 %, échéance le 20/07/2046	86	0,01			
5 595 Ginnie Mae II Pool 'MA4003', 3,000 %, échéance le 20/10/2046	5 085	0,45			
785 Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000 %, échéance le 20/02/2047	711	0,06			
394 Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, échéance le 20/06/2047	378	0,03			
2 388 Ginnie Mae II Pool 'MA4586', 3,500 %, échéance le 20/07/2047	2 090	0,19			
82 Ginnie Mae II Pool 'MA4587', 4,000 %, échéance le 20/07/2047	78	0,01			
117 Ginnie Mae II Pool 'MA4654', 4,500 %, échéance le 20/08/2047	116	0,01			
159 Ginnie Mae II Pool 'MA4781', 5,000 %, échéance le 20/10/2047	160	0,01			
197 Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000 %, échéance le 20/11/2047	189	0,02			
179 Ginnie Mae II Pool 'MA4901', 4,000 %, échéance le 20/12/2047	172	0,02			
15 367 Ginnie Mae II Pool 'MA4961', 3,000 %, échéance le 20/01/2048	13 948	1,25			
56 Ginnie Mae II Pool 'MA5020', 4,000 %, échéance le 20/02/2048	53	—			
89 Ginnie Mae II Pool 'MA5078', 4,000 %, échéance le 20/03/2048	85	0,01			
179 Ginnie Mae II Pool 'MA5138', 4,500 %, échéance le 20/04/2048	176	0,02			
133 Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500 %, échéance le 20/05/2048	131	0,01			
18 Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500 %, échéance le 20/06/2048	18	—			

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

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

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats à terme standardisés

		Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
U.S. 10 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(153)	\$ (17 084)	\$ 20
U.S. 10 Year Ultra Note, juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	12	1 406	1
U.S. 2 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(540)	(110 012)	328
U.S. 5 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	1 221	130 714	(498)
U.S. Long Bond (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	489	61 232	(233)
U.S. Ultra Bond (CBT) juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(4)	(540)	4
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 1 640 \$)				\$ 353
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (666) \$)				(731)
Moins-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 974 \$)				\$ (378)

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) £	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) £	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — 94,04 % (28 février 2022 : 89,45 %)			Supranational — 3,11 % (28 février 2022 : 3,00 %)		
Australie — 0,98 % (28 février 2022 : 1,61 %)			810 European Investment Bank, 1,375 %, échéance le 07/03/2025 762 1,66		
160 APA Infrastructure Ltd, 3,125 %, échéance le 18/07/2031	130	0,29	680 European Investment Bank, 3,750 %, échéance le 07/12/2027	665	1,45
380 National Australia Bank Ltd, 1,699 %, échéance le 15/09/2031 *	318	0,69		1 427	3,11
	448	0,98			
Belgique — 0,56 % (28 février 2022 : 1,02 %)			Suède — 2,10 % (28 février 2022 : 1,41 %)		
166 Anheuser-Busch InBev SA/NV, 4,000 %, échéance le 24/09/2025	163	0,36	340 Svenska Handelsbanken AB, 4,625 %, échéance le 23/08/2032 *	320	0,70
USD 110 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,800 %, échéance le 23/01/2059	95	0,20	350 Swedbank AB, 1,375 %, échéance le 08/12/2027 *	303	0,66
	258	0,56	410 Vattenfall AB, 2,500 %, échéance le 29/06/2083 *	342	0,74
				965	2,10
Canada — 1,29 % (28 février 2022 : 0,72 %)			Suisse — 2,89 % (28 février 2022 : 3,74 %)		
340 Banque Royale du Canada, 1,375 %, échéance le 12/09/2024	319	0,69	EUR 350 Credit Suisse Group AG, 2,250 %, échéance le 09/06/2028 *	276	0,60
300 Toronto-Dominion Bank/The, 2,875 %, échéance le 05/04/2027	275	0,60	130 Credit Suisse Group AG, 7,750 %, échéance le 01/03/2029 *	114	0,25
	594	1,29	380 Credit Suisse Group AG, 2,125 %, échéance le 15/11/2029 *	280	0,61
			650 UBS Group AG, 1,875 %, échéance le 03/11/2029 *	539	1,17
Danemark — 1,57 % (28 février 2022 : 1,16 %)			130 Zurich Finance Ireland Designated Activity Co, 5,125 %, échéance le 23/11/2052 *	119	0,26
220 Danske Bank A/S, 4,625 %, échéance le 13/04/2027 *	216	0,47		1 328	2,89
350 Danske Bank A/S, 2,250 %, échéance le 14/01/2028 *	304	0,66			
250 Orsted A/S, 2,500 %, échéance le 16/05/2033	200	0,44			
	720	1,57			
Finlande — 0,71 % (28 février 2022 : 1,04 %)			Royaume-Uni — 42,05 % (28 février 2022 : 42,35 %)		
400 Nordea Bank Abp, 1,625 %, échéance le 09/12/2032 *	326	0,71	160 Anglian Water Osprey Financing Plc, 2,000 %, échéance le 31/07/2028	128	0,28
France — 5,69 % (28 février 2022 : 5,91 %)			220 Anglian Water Services Financing Plc, 1,625 %, échéance le 10/08/2025	205	0,45
290 BNP Paribas SA, 3,375 %, échéance le 23/01/2026	275	0,60	210 Annington Funding Plc, 2,308 %, échéance le 06/10/2032	153	0,33
300 BNP Paribas SA, 1,875 %, échéance le 14/12/2027	256	0,56	520 Annington Funding Plc, 4,750 %, échéance le 09/08/2033	461	1,00
300 BNP Paribas SA, 2,000 %, échéance le 24/05/2031 *	260	0,57	360 Aspire Defence Finance Plc, série A, 4,674 %, échéance le 31/03/2040	344	0,75
100 BNP Paribas SA, 5,750 %, échéance le 13/06/2032	101	0,22	230 Associated British Foods Plc, 2,500 %, échéance le 16/06/2034	184	0,40
500 BPCE SA, 2,500 %, échéance le 30/11/2032 *	412	0,90	280 Assura Financing Plc, 3,000 %, échéance le 19/07/2028	248	0,54
400 Credit Agricole SA, 4,875 %, arrivant à échéance le 23/10/2029	392	0,85	270 Assura Financing Plc, 1,625 %, échéance le 30/06/2033	187	0,41
220 Credit Agricole SA, 7,500 %, perpétuelle *	219	0,48	117 Aviva Plc, 5,125 %, échéance le 04/06/2050 *	107	0,23
EUR 300 Électricité de France SA, 1,000 %, échéance le 29/11/2033	187	0,41	190 Aviva Plc, 6,875 %, échéance le 20/05/2058 *	199	0,43
100 Électricité de France SA, 5,500 %, échéance le 27/03/2037	94	0,20	360 Barclays Plc, 3,375 %, échéance le 02/04/2025 *	314	0,68
100 Électricité de France SA, 5,500 %, échéance le 17/10/2041	92	0,20	260 Barclays Plc, 1,700 %, échéance le 03/11/2026 *	235	0,51
100 Électricité de France SA, 6,000 %, échéance le 23/01/2114	93	0,20	493 Barclays Plc, 3,250 %, échéance le 12/02/2027	450	0,98
300 TotalEnergies Capital International SA, 1,405 %, échéance le 03/09/2031	230	0,50	200 BP Capital Markets Plc, 2,274 %, échéance le 03/07/2026	186	0,41
	2 611	5,69	570 British Land Co Plc/The, 2,375 %, échéance le 14/09/2029	457	0,99
			240 British Telecommunications Plc, 3,125 %, échéance le 21/11/2031	201	0,44
Allemagne — 5,43 % (28 février 2022 : 5,74 %)			130 Burberry Group Plc, 1,125 %, échéance le 21/09/2025	118	0,26
200 Deutsche Bank AG, 4,000 %, échéance le 24/06/2026 *	190	0,41	250 Cadent Finance Plc, 2,625 %, échéance le 22/09/2038	171	0,37
190 Deutsche Telekom AG, 3,125 %, échéance le 06/02/2034	160	0,35	100 Chancellor Masters & Scholars of The University of Cambridge/The, 2,350 %, échéance le 27/06/2078	58	0,13
400 E.ON International Finance BV, 6,125 %, échéance le 06/07/2039	415	0,90	300 Clarion Funding Plc, 1,250 %, échéance le 13/11/2032	212	0,46
940 Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 6,000 %, échéance le 07/12/2028	1 022	2,23	200 Clarion Funding Plc, 1,875 %, échéance le 22/01/2035	139	0,30
200 Volkswagen Financial Services NV, 2,125 %, échéance le 27/06/2024	192	0,42	150 Clarion Funding Plc, 3,125 %, échéance le 19/04/2048	102	0,22
400 Volkswagen International Finance NV, 3,375 %, échéance le 16/11/2026	371	0,81	320 Close Brothers Group Plc, 2,000 %, échéance le 11/09/2031 *	270	0,59
EUR 200 Vonovia SE, 2,375 %, échéance le 25/03/2032	144	0,31	300 Coventry Building Society, 2,000 %, échéance le 20/12/2030	232	0,51
	2 494	5,43	235 CRH Finance UK Plc, 4,125 %, échéance le 02/12/2029	220	0,48
			540 Derwent London Plc, 1,875 %, échéance le 17/11/2031	389	0,85
Italie — 1,73 % (28 février 2022 : 1,32 %)			92 Eastern Power Networks Plc, 6,250 %, échéance le 11/12/2036	102	0,22
341 Enel Finance International NV, 5,750 %, échéance le 14/09/2040	336	0,73	220 Experian Finance Plc, 0,739 %, échéance le 29/10/2025	198	0,43
210 Intesa Sanpaolo SpA, 2,625 %, échéance le 11/03/2036	143	0,31	170 Experian Finance Plc, 3,250 %, échéance le 07/04/2032	149	0,33
USD 400 UniCredit SpA, 7,296 %, échéance le 02/04/2034 *	314	0,69	220 Folio Residential Finance NO 1 Plc, 1,246 %, échéance le 31/10/2027	184	0,40
	793	1,73	278 Gatwick Funding Ltd, 6,125 %, échéance le 02/03/2026	285	0,62
			100 Gatwick Funding Ltd, 2,500 %, échéance le 15/04/2030	83	0,18
Luxembourg — 1,21 % (28 février 2022 : 0,80 %)			100 Gatwick Funding Ltd, 3,250 %, échéance le 26/02/2048	67	0,14
240 Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 2,625 %, échéance le 20/10/2028	187	0,40	190 GlaxoSmithKline Capital Plc, 6,375 %, échéance le 09/03/2039	216	0,47
190 Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 4,875 %, échéance le 29/04/2032	155	0,34	100 Grainger Plc, 3,375 %, échéance le 24/04/2028	86	0,19
260 Prologis International Funding II SA, 2,750 %, échéance le 22/02/2032	215	0,47	190 Grainger Plc, 3,000 %, échéance le 03/07/2030	150	0,33
	557	1,21	154 Greene King Finance Plc, série A2, 5,318 %, échéance le 15/09/2031	144	0,31
			110 Greene King Finance Plc, série B1, 5,512 %, échéance le 15/12/2034 *	85	0,19
Pays-Bas — 1,95 % (28 février 2022 : 1,86 %)			210 Guinness Partnership Ltd/The, 2,000 %, échéance le 22/04/2055	108	0,23
400 Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, échéance le 23/05/2029	371	0,81	127 HSBC Holdings Plc, 6,000 %, échéance le 29/03/2040	117	0,25
300 ING Groep NV, 3,000 %, échéance le 18/02/2026	282	0,61	210 HSBC Holdings Plc, 5,875 %, perpétuelle *	196	0,43
240 Koninklijke KPN NV, 5,750 %, échéance le 17/09/2029	242	0,53	50 Hutchison Whampoa Finance UK Plc, série B, 5,625 %, échéance le 24/11/2026	51	0,11
	895	1,95	210 Land Securities Capital Markets Plc, 2,399 %, échéance le 08/02/2029	183	0,40
			100 Land Securities Capital Markets Plc, 2,625 %, échéance le 22/09/2037	74	0,16
Norvège — 1,49 % (28 février 2022 : 0,00 %)			520 Leeds Building Society, 1,375 %, échéance le 06/10/2027	438	0,95
240 DNB Bank ASA, 2,625 %, échéance le 10/06/2026 *	227	0,49	190 Leeds Building Society, 3,750 %, échéance le 25/04/2029 *	168	0,37
480 DNB Bank ASA, 4,000 %, échéance le 17/08/2027 *	458	1,00	120 Legal & General Group Plc, 3,750 %, échéance le 26/11/2049 *	101	0,22
	685	1,49	190 Legal & General Group Plc, 4,500 %, échéance le 01/11/2050 *	166	0,36
			230 Liberty Living Finance Plc, 3,375 %, échéance le 28/11/2029	196	0,43
Afrique du Sud — 0,33 % (28 février 2022 : 0,37 %)			120 LiveWest Treasury Plc, 2,250 %, échéance le 10/10/2043	77	0,17
170 Anglo American Capital Plc, 3,375 %, échéance le 11/03/2029	151	0,33	510 Lloyds Banking Plc, 7,625 %, échéance le 22/04/2025	536	1,17
Espagne — 2,08 % (28 février 2022 : 1,34 %)			230 Lloyds Banking Group Plc, 6,625 %, échéance le 02/06/2033 *	229	0,50
800 Banco Santander SA, 2,250 %, échéance le 04/10/2032 *	655	1,43	340 Lloyds Banking Group Plc, 5,125 %, perpétuelle *	320	0,70
100 CaixaBank SA, 6,875 %, échéance le 25/10/2033 *	99	0,21	350 Logicor 2019-1 UK Plc, 1,875 %, échéance le 17/11/2026	308	0,67
200 Telefonica Emisiones SA, 5,445 %, échéance le 08/10/2029	200	0,44	180 London Stock Exchange Group Plc, 1,625 %, échéance le 06/04/2030	146	0,32
	954	2,08			

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) £	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) £	% de la valeur liquidative				
Obligations et bons d'entreprises — (suite)									
Royaume-Uni — (suite)									
177 Manchester Airport Group Funding Plc, 4,125 %, échéance le 04/02/2024	175	0,38	USD	210 GSK Consumer Healthcare Capital UK Plc, 3,375 %, échéance le 29/03/2038	168	0,37			
240 Manchester Airport Group Funding Plc, 4,750 %, échéance le 31/03/2034	228	0,50		310 JPMorgan Chase & Co, 4,912 %, échéance le 25/07/2033 *	247	0,54			
160 Manchester Airport Group Funding Plc, 2,875 %, échéance le 30/09/2044	105	0,23		100 McDonald's Corp, 2,950 %, échéance le 15/03/2034	83	0,18			
185 Marston's Issuer Plc, série A3, 5,177 %, échéance le 15/07/2032 *	165	0,36	EUR	180 McDonald's Corp, série gmtn, 3,750 %, échéance le 31/05/2038	152	0,33			
108 Marston's Issuer Plc, série B1, 6,482 %, échéance le 16/07/2035 *	85	0,18		92 MetLife Inc, 5,375 %, échéance le 09/12/2024	92	0,20			
88 Mitchells & Butlers Finance Plc, série B2, 6,013 %, échéance le 15/12/2028	82	0,18		230 Metropolitan Life Global Funding I, 5,000 %, échéance le 10/01/2030	230	0,50			
360 Motability Operations Group Plc, Series Emtn, 4,875 %, échéance le 17/01/2043	350	0,76	USD	120 Mondelez International Inc, 4,500 %, échéance le 03/12/2035	109	0,24			
150 National Express Group Plc, 2,375 %, échéance le 20/11/2028	126	0,28		320 Morgan Stanley, 4,210 %, échéance le 20/04/2028 *	253	0,55			
310 National Gas Transmission Plc, 1,375 %, échéance le 07/02/2031	230	0,50		250 Morgan Stanley, 5,789 %, échéance le 18/11/2033 *	252	0,55			
275 National Grid Electricity Distribution East Midlands Plc, 6,250 %, échéance le 10/12/2040	295	0,64	EUR	280 Netflix Inc, 3,875 %, échéance le 15/11/2029	235	0,51			
250 National Grid Electricity Transmission Plc, 2,000 %, échéance 17/04/2040	155	0,34		290 New York Life Global Funding, 4,350 %, échéance le 16/09/2025	286	0,62			
100 Nationwide Building Society, 3,000 %, échéance le 06/05/2026	95	0,21		290 Omnicom Capital Holdings Plc, 2,250 %, échéance le 22/11/2033	218	0,48			
150 Nationwide Building Society, 6,178 %, échéance le 07/12/2027 *	153	0,33	210 PepsiCo Inc, 3,200 %, échéance le 22/07/2029	193	0,42				
206 Nationwide Building Society, 3,250 %, échéance le 20/01/2028	190	0,41	100 PepsiCo Inc, 3,550 %, échéance le 22/07/2034	89	0,19				
230 Natwest Group Plc, 3,125 %, échéance le 28/03/2027 *	213	0,46	190 Realty Income Corp, 1,875 %, échéance le 14/01/2027	168	0,37				
150 NatWest Group Plc, 3,619 %, échéance le 29/03/2029 *	135	0,29	265 Time Warner Cable LLC, 5,750 %, échéance le 02/06/2031	254	0,55				
190 Natwest Group Plc, 2,105 %, échéance le 28/11/2031 *	161	0,35	200 Toyota Motor Credit Corp, 0,750 %, échéance le 19/11/2026	173	0,38				
190 NatWest Markets Plc, 6,375 %, échéance le 08/11/2027	197	0,43	590 Verizon Communications Inc, 1,875 %, échéance le 19/09/2030	471	1,03				
110 Northern Powergrid Northeast Plc, 3,250 %, échéance le 01/04/2052	79	0,17	110 Verizon Communications Inc, 2,500 %, échéance le 08/04/2031	91	0,20				
120 Notting Hill Genesis, 2,875 %, échéance le 31/01/2029	106	0,23	26 Walmart Inc, 5,250 %, échéance le 28/09/2035	28	0,06				
140 Onward Homes Ltd, 2,125 %, échéance le 25/03/2053	76	0,16	410 Wells Fargo & Co, 3,473 %, échéance le 26/04/2028 *	376	0,82				
240 Paragon Treasury Plc, 2,000 %, échéance le 07/05/2036	167	0,36	650 Wells Fargo & Co, 4,875 %, échéance le 29/11/2035	599	1,30				
170 Rentokil Initial Plc, 5,000 %, échéance le 27/06/2032	164	0,36		8 663	18,87				
190 Sanctuary Capital Plc, 2,375 %, échéance le 14/04/2050	112	0,24	Total des obligations et bons d'entreprises (coût 50 295£)			43 175	94,04		
440 Santander UK Group Holdings Plc, 2,920 %, échéance le 08/05/2026 *	412	0,90	Obligations et bons d'État — 1,62 % (28 février 2022 : 5,81 %)						
170 Santander UK Plc, 5,750 %, échéance le 02/03/2026	175	0,38	Royaume-Uni — 0,87 % (28 février 2022 : 4,38 %)						
198 Scottish Widows Ltd, 7,000 %, échéance le 16/06/2043	202	0,44	160 Fonds d'État du Royaume-Uni, 0,125 %, échéance le 31/01/2028	135	0,29				
350 Segro Plc, 2,875 %, échéance le 11/10/2037	264	0,58	620 Fonds d'État du Royaume-Uni, 0,625 %, échéance le 22/10/2050	267	0,58				
140 Severn Trent Utilities Finance Plc, 2,625 %, échéance le 22/02/2033	113	0,25		402	0,87				
120 Severn Trent Utilities Finance Plc, 4,625 %, échéance le 30/11/2034	114	0,25	États-Unis — 0,75 % (28 février 2022 : 1,01 %)						
180 Severn Trent Utilities Finance Plc, 2,000 %, échéance le 02/06/2040	114	0,25	USD	30 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,000 %, échéance le 15/11/2041	18	0,04			
252 South Eastern Power Networks Plc, 5,500 %, échéance le 05/06/2026	256	0,56	USD	200 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,375 %, échéance le 15/08/2042	150	0,33			
191 Southern Gas Networks Plc, 2,500 %, échéance le 03/02/2025	182	0,40	USD	230 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/08/2049	137	0,30			
380 Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,500 %, échéance le 02/05/2025	361	0,79	USD	70 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,000 %, échéance le 15/02/2050	39	0,08			
170 Tesco Corporate Treasury Services Plc, 5,500 %, échéance le 27/02/2035	165	0,36		344	0,75				
201 Tesco Property Finance 3 Plc, 5,744 %, échéance le 13/04/2040	196	0,43	Total des obligations et bons d'État (Coût 833£)			746	1,62		
328 Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, échéance le 13/07/2044	307	0,67	Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat (Coût 51 128£)						
190 UNITE Group Plc/The, 3,500 %, échéance le 15/10/2028	167	0,36		43 921	95,66				
250 UNITE USAF II Plc, 3,921 %, échéance le 30/06/2025	240	0,52	Contrats de change à terme — 0,06 % (28 février 2022 : 0,01 %)						
170 University of Oxford, 2,544 %, échéance le 08/12/2117	91	0,20	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)				27	0,06	
210 Vodafone Group plc, 5,125 %, 02/12/2052	185	0,40	Contrats à terme standardisés — 0,10 % (28 février 2022 : 0,08 %)						
160 Wellcome Trust Ltd/The, 2,517 %, échéance le 07/02/2118	87	0,19	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)				45	0,10	
470 Whitbread Group Plc, 2,375 %, échéance le 31/05/2027	405	0,88	Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat				43 993	95,82	
180 Yorkshire Building Society, 3,500 %, échéance le 21/04/2026	172	0,38	Contrats de change à terme — (0,02 %) (28 février 2022 : (0,05 %))						
140 Yorkshire Building Society, 3,511 %, échéance le 11/10/2030 *	121	0,26	Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)				(7)	(0,02)	
	19 306	42,05	Contrats à terme standardisés — (0,07 %) (28 février 2022 : (0,01 %))						
États-Unis — 18,87 % (28 février 2022 : 16,06 %)			Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)				(29)	(0,07)	
USD	100 Apache Corp, 4,750 %, échéance le 15/04/2043	64	0,14	Total des passifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat				(36)	(0,09)
	220 AT&T Inc, série GBP, 2,900 %, échéance le 04/12/2026	204	0,44	Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat				43 957	95,73
	190 AT&T Inc, 4,375 %, échéance le 15/09/2029	179	0,39	Autres éléments de l'actif hors passif				1 955	4,27
	200 AT&T Inc, 7,000 %, échéance le 30/04/2040	221	0,48	Total des actifs nets				45 912£	100,00
	383 AT&T Inc, 4,250 %, échéance le 01/06/2043	306	0,67	— Les montants désignés par « - » sont égaux à 0 £, inférieurs à 1 000 £, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.					
USD	450 Bank of America Corp, 4,948 %, échéance le 22/07/2028 *	366	0,80	* Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.					
	360 Bank of America Corp, 3,584 %, échéance le 27/04/2031 *	321	0,70	ABRÉVIATIONS :					
	180 Becton Dickinson and Co, 3,020 %, échéance le 24/05/2025	172	0,37	Perpétuelle	— Obligation sans date d'échéance. Les obligations perpétuelles ne sont pas rachetables, mais paient des intérêts réguliers.				
	260 Berkshire Hathaway Finance Corp, 2,625 %, échéance le 19/06/2059	163	0,35	EUR	— Euro				
	329 Citigroup Inc, 7,375 %, échéance le 01/09/2039	415	0,90	USD	— Dollar américain				
	170 Comcast Corp, 1,500 %, échéance le 20/02/2029	141	0,31	Analyse de l'actif total					
	60 CVS Health Corp, 4,125 %, échéance le 01/04/2040	41	0,09	Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé				95,00	
USD	240 GE Capital UK Funding Unlimited Co, 5,875 %, échéance le 18/01/2033	246	0,54	Instruments financiers dérivés				0,16	
	400 General Motors Financial Co Inc, 2,350 %, échéance le 03/09/2025	372	0,81	Autres actifs				4,84	
	309 Goldman Sachs Group Inc/The, 7,125 %, échéance le 07/08/2025	323	0,70	Actif total				100,00	
	280 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,125 %, échéance le 25/07/2029	244	0,53						
	110 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,875 %, échéance le 18/01/2038	118	0,26						

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
16-mai-2023	Citi	Achat	GBP 106	Vente	EUR 118	£ 2
16-mai-2023	Citi	Achat	USD 34	Vente	GBP 28	–
16-mai-2023	Citi	Achat	GBP 155	Vente	JPY 24 415	4
16-mai-2023	Citi	Achat	GBP 33	Vente	USD 40	–
16-mai-2023	Goldman Sachs	Achat	GBP 1 622	Vente	USD 1 961	(5)
16-mai-2023	JP Morgan	Achat	GBP 215	Vente	USD 260	(1)
16-mai-2023	UBS	Achat	GBP 1 069	Vente	EUR 1 188	21
16-mai-2023	UBS	Achat	USD 139	Vente	GBP 115	–
16-mai-2023	UBS	Achat	GBP 309	Vente	USD 373	(1)
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 8 £)						£ 27
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (35) £)						(7)
Plus-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (27) £)						£ 20

Tableau des contrats à terme standardisés

	Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
Euro-Bund mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	(2)	£ (234)	£ 15
Obligation japonaise 10 ans (OSE), mars 2023	Bank of America Merrill Lynch	(2)	(1 791)	19
Long Gilt juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	25	2 499	(12)
U.S. 10 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(26)	(2 413)	5
U.S. 5 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	44	3 916	(14)
U.S. Long Bond (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	9	937	(3)
U.S. Ultra Bond (CBT) juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(6)	(674)	6
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 59 £)				£ 45
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (10) £)				(29)
Plus-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 49 £)				£ 16

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des actifs — 0,19 % (28 février 2022 : 0,15 %)					
199 SMB Private Education Loan Trust 2020-A, série 2020 A, catégorie A2A, 144A, 2,230 %, échéance le 15/09/2037	183	0,19			
Total des titres adossés à des actifs (coût 2045)	183	0,19			
Obligations et bons d'entreprises — 96,16 % (28 février 2022 : 81,87 %)					
Australie — 0,59 % (28 février 2022 : 1,08 %)					
110 BHP Billiton Finance USA Ltd, 4,900 %, échéance le 28/02/2033	110	0,12			
100 CSL Finance Plc, 144A, 4,050 %, échéance le 27/04/2029	93	0,10			
90 CSL Finance Plc, 144A, 4,250 %, échéance le 27/04/2032	84	0,09			
40 Westpac Banking Corp, 5,405 %, échéance le 10/08/2033 *	38	0,04			
40 Westpac Banking Corp, 2,668 %, échéance le 15/11/2035 *	31	0,03			
130 Westpac Banking Corp, 3,020 %, échéance le 18/11/2036 *	100	0,10			
150 Westpac Banking Corp, 3,133 %, échéance le 18/11/2041	103	0,11			
	559	0,59			
Belgique — 0,22 % (28 février 2022 : 0,36 %)					
240 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, échéance le 15/04/2048	212	0,22			
Bermudes — 0,49 % (28 février 2022 : 0,15 %)					
500 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, échéance le 15/10/2025	461	0,49			
Brésil — 0,16 % (28 février 2022 : 0,57 %)					
190 Suzano Austria GmbH, série DM3N, 3,125 %, échéance le 15/01/2032	150	0,16			
Canada — 2,80 % (28 février 2022 : 1,86 %)					
67 Air Canada 2015-2 Class B Pass Through Trust, 144A, 5,000 %, échéance le 15/12/2023	66	0,07			
170 Bank of Nova Scotia/The, 3,450 %, échéance le 11/04/2025	163	0,17			
40 Bank of Nova Scotia/The, 4,588 %, échéance le 04/05/2037 *	35	0,04			
200 Bank of Nova Scotia/The, 8,625 %, échéance le 27/10/2082 *	211	0,22			
140 Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, échéance le 30/05/2041	140	0,15			
210 Canadian Pacific Railway Co, 2,450 %, échéance le 02/12/2031	175	0,19			
60 Canadian Pacific Railway Co, 3,000 %, échéance le 02/12/2041	46	0,05			
70 Canadian Pacific Railway Co, 3,100 %, échéance le 02/12/2051	48	0,05			
550 CI Financial Corp, 3,200 %, échéance le 17/12/2030	417	0,44			
110 Element Fleet Management Corp, 144A, 1,600 %, échéance le 06/04/2024	105	0,11			
70 GFL Environmental Inc, 144A, 5,125 %, échéance le 15/12/2026	67	0,07			
60 MEG Energy Corp, 144A, 7,125 %, échéance le 01/02/2027	61	0,06			
510 Banque Royale du Canada, 1,150 %, échéance le 14/07/2026	448	0,47			
30 Teck Resources Ltd, 3,900 %, échéance le 15/07/2030	27	0,03			
200 Teck Resources Ltd, 6,250 %, échéance le 15/07/2041	201	0,21			
10 Teck Resources Ltd, 5,400 %, échéance le 01/02/2043	9	0,01			
20 TransAlta Corp, 6,500 %, échéance le 15/03/2040	18	0,02			
240 Yamana Gold Inc, 4,625 %, échéance le 15/12/2027	226	0,24			
240 Yamana Gold Inc, 2,630 %, échéance le 15/08/2031	185	0,20			
	2 648	2,80			
Chine — 0,77 % (28 février 2022 : 0,44 %)					
200 Alibaba Group Holdings Ltd, 2,125 %, échéance le 09/02/2031	160	0,17			
240 Alibaba Group Holdings Ltd, 3,150 %, échéance le 09/02/2051	154	0,16			
240 BOC Aviation USA Corp, 144A, 1,625 %, échéance le 29/04/2024	229	0,24			
260 Tencent Holdings Ltd, 144A, 3,840 %, échéance le 22/04/2051	188	0,20			
	731	0,77			
Danemark — 1,82 % (28 février 2022 : 0,34 %)					
200 Danske Bank A/S, 144A, 3,244 %, échéance le 20/12/2025 *	190	0,20			
680 Danske Bank A/S, 144A, 6,466 %, échéance le 09/01/2026 *	685	0,72			
200 Danske Bank A/S, 144A, 1,549 %, échéance le 10/09/2027 *	174	0,18			
720 Danske Bank A/S, 144A, 4,298 %, échéance le 01/04/2028 *	679	0,72			
	1 728	1,82			
France — 4,69 % (28 février 2022 : 2,59 %)					
200 BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, échéance le 09/06/2026 *	185	0,20			
320 BNP Paribas SA, 144A, 1,323 %, échéance le 13/01/2027 *	283	0,30			
370 BNP Paribas SA, 144A, 1,675 %, échéance le 30/06/2027 *	325	0,34			
460 BNP Paribas SA, 144A, 5,125 %, échéance le 13/01/2029 *	453	0,48			
340 BNP Paribas SA, 144A, 2,159 %, échéance le 15/09/2029 *	281	0,30			
200 BNP Paribas SA, 144A, 9,250 %, perpétuelle *	214	0,23			
520 BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, perpétuelle *	531	0,56			
200 BPCE SA, 144A, 5,700 %, échéance le 22/10/2023	199	0,21			
370 BPCE SA, 144A, 3,116 %, échéance le 19/10/2032 *	286	0,30			
300 Credit Agricole SA, 144A, 5,301 %, échéance le 12/07/2028	299	0,31			
400 Crédit Agricole SA, 144A, 8,125 %, perpétuelle *	406	0,43			
250 Credit Agricole SA/London, 144A, 1,907 %, échéance le 16/06/2026 *	230	0,24			
200 Société Générale SA, 144A, 7,367 %, 10/01/2053	202	0,21			
430 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 3,750 %, échéance le 17/09/2024	410	0,43			
200 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 4,750 %, échéance le 17/09/2044	142	0,15			
	4 446	4,69			
Allemagne — 0,89 % (28 février 2022 : 0,04 %)					
30 Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750 %, échéance le 15/06/2030	36	0,04			
840 ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750 %, échéance le 29/04/2025	803	0,85			
	839	0,89			
Inde — 0,28 % (28 février 2022 : 0,31 %)					
330 Reliance Industries Ltd, 144A, 2,875 %, échéance le 12/01/2032	268	0,28			
Irlande — 1,18 % (28 février 2022 : 1,00 %)					
560 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,500 %, échéance le 15/09/2023	556	0,59			
260 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,150 %, échéance le 15/02/2024	254	0,27			
150 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,400 %, échéance le 29/10/2033	117	0,12			
180 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,850 %, échéance le 29/10/2041	132	0,14			
60 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 5,125 %, échéance le 01/10/2023	60	0,06			
	1 119	1,18			
Israël — 0,15 % (28 février 2022 : 0,01 %)					
160 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, échéance le 01/10/2026	140	0,15			
Italie — 1,76 % (28 février 2022 : 0,94 %)					
830 Enel Finance International NV, 144A, 6,800 %, échéance le 14/10/2025	851	0,90			
210 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, échéance le 26/06/2024	203	0,21			
400 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 7,000 %, échéance le 21/11/2025	409	0,43			
310 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,950 %, échéance le 01/06/2042 *	208	0,22			
	1 671	1,76			
Japon — 1,86 % (28 février 2022 : 1,19 %)					
210 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 4,080 %, échéance le 19/04/2028 *	200	0,21			
340 Nippon Life Insurance Co, 144A, 2,750 %, échéance le 21/01/2051 *	279	0,30			
550 Nissan Motor Co LLC, 144A, 3,043 %, échéance le 15/09/2023	541	0,57			
430 Nissan Motor Co LLC, 144A, 3,522 %, échéance le 17/09/2025	402	0,42			
200 NTT Finance Corp, 144A, 1,162 %, échéance le 03/04/2026	177	0,19			
200 NTT Finance Corp, 144A, 2,065 %, échéance le 03/04/2031	162	0,17			
	1 761	1,86			
Kazakhstan — 0,16 % (28 février 2022 : 0,10 %)					
200 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 3,500 %, échéance le 14/04/2033	150	0,16			
Luxembourg — 0,15 % (28 février 2022 : 0,03 %)					
110 ArcelorMittal SA, 6,550 %, échéance le 29/11/2027	113	0,12			
30 ArcelorMittal SA, 7,000 %, échéance le 15/10/2039	30	0,03			
	143	0,15			
Macao — 2,59 % (28 février 2022 : 1,07 %)					
580 Sands China Ltd, 5,625 %, échéance le 08/08/2025	563	0,59			
200 Sands China Ltd, 4,300 %, échéance le 01/08/2026	185	0,20			
400 Sands China Ltd, 5,900 %, échéance le 08/08/2028	379	0,40			
270 Sands China Ltd, 3,350 %, échéance le 03/08/2029	221	0,23			
200 Sands China Ltd, 4,875 %, échéance le 18/06/2030	174	0,19			
200 Sands China Ltd, 4,875 %, échéance le 18/06/2030	175	0,18			
600 Wynn Macau Ltd, 144A, 4,875 %, échéance le 01/10/2024	574	0,61			
200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, échéance le 15/01/2026	183	0,19			
	2 454	2,59			
Mexique — 0,62 % (28 février 2022 : 0,43 %)					
200 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Caiman, 144A, 8,375 %, perpétuelle *	197	0,21			
200 Comision Federal de Electricidad, 144A, 3,348 %, échéance le 09/02/2031	159	0,17			
220 Fresnillo Plc, 144A, 4,250 %, échéance le 02/10/2050	170	0,18			
60 Southern Copper Corp, 5,250 %, échéance le 08/11/2042	56	0,06			
	582	0,62			
Pays-Bas — 1,13 % (28 février 2022 : 0,56 %)					
550 Cooperative Rabobank UA, 4,375 %, échéance le 04/08/2025	533	0,56			
440 Cooperative Rabobank UA, 144A, 3,758 %, échéance le 06/04/2033 *	383	0,40			
120 Shell International Finance BV, 4,375 %, échéance le 11/05/2045	106	0,11			
70 Shell International Finance BV, 3,250 %, échéance le 06/04/2050	52	0,06			
	1 074	1,13			
Norvège — 0,50 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
490 DNB Bank ASA, 144A, 2,968 %, échéance le 28/03/2025 *	475	0,50			
Qatar — 0,18 % (28 février 2022 : 0,44 %)					
210 QatarEnergy, 144A, 2,250 %, échéance le 12/07/2031	173	0,18			

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
Afrique du Sud — 0,44 % (28 février 2022 : 0,27 %)					
200 Anglo American Capital Plc, 144A, 3,625 %, échéance le 11/09/2024	194	0,20	60 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, échéance le 20/04/2026	58	0,06
240 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,500 %, échéance le 15/03/2028	227	0,24	40 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, échéance le 20/04/2029	38	0,04
	421	0,44	280 American Express Co, 4,050 %, échéance le 03/05/2029	265	0,28
			70 American Express Co, 3,550 %, perpétuelle *	60	0,06
Espagne — 0,56 % (28 février 2022 : 0,33 %)					
400 Banco Santander SA, 1,722 %, échéance le 14/09/2027 *	345	0,36	110 American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, échéance le 15/01/2032	90	0,09
200 Banco Santander SA, 4,175 %, échéance le 24/03/2028 *	187	0,20	60 Americo Life Inc, 144A, 3,450 %, échéance le 15/04/2031	46	0,05
	532	0,56	100 AmFam Holdings Inc, 144A, 2,805 %, échéance le 11/03/2031	77	0,08
Supranational — 0,19 % (28 février 2022 : 0,11 %)					
200 African Export-Import Bank/The, 144A, 2,634 %, échéance le 17/05/2026	179	0,19	90 AmFam Holdings Inc, 144A, 3,833 %, échéance le 11/03/2051	60	0,06
Suisse — 5,06 % (28 février 2022 : 1,46 %)					
750 Crédit Suisse AG/New York NY, 1,000 %, échéance le 05/05/2023	742	0,78	90 Amgen Inc, 5,250 %, échéance le 02/03/2030	90	0,09
930 Crédit Suisse AG/New York NY, Series FXD, 0,520 %, échéance le 09/08/2023	900	0,95	570 Amgen Inc, 5,250 %, échéance le 02/03/2033	566	0,60
250 Credit Suisse Group AG, 3,800 %, échéance le 09/06/2023	247	0,26	60 Amgen Inc, 4,400 %, échéance le 01/05/2045	50	0,05
480 Crédit Suisse Group AG, 144A, 6,537 %, échéance le 12/08/2033 *	431	0,45	50 Amgen Inc, 4,663 %, échéance le 15/06/2051	43	0,05
250 Crédit Suisse Group AG, 144A, 9,016 %, échéance le 15/11/2033 *	263	0,28	240 Amgen Inc, 5,650 %, échéance le 02/03/2053	238	0,25
660 Crédit Suisse Group AG, 144A, 7,500 %, perpétuelle *†	604	0,64	80 Amgen Inc, 5,750 %, échéance le 02/03/2063	79	0,08
910 Crédit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, perpétuelle *†	826	0,87	190 Apple Inc, 2,650 %, échéance le 11/05/2050	128	0,13
200 UBS Group AG, 144A, 1,364 %, échéance le 30/01/2027 *	176	0,19	110 AT&T Inc, 3,800 %, échéance le 15/02/2027	104	0,11
300 UBS Group AG, 144A, 4,751 %, échéance le 12/05/2028 *	289	0,30	80 AT&T Inc, 4,250 %, échéance le 01/03/2027	78	0,08
200 UBS Group AG, 144A, 3,179 %, échéance le 11/02/2043 *	143	0,15	500 AT&T Inc, 6,950 %, échéance le 15/01/2028	519	0,55
200 UBS Group SA, 144A, 4,875 %, perpétuelle *	176	0,19	240 AT&T Inc, 4,300 %, échéance le 15/02/2030	225	0,24
	4 797	5,06	170 AT&T Inc, 2,550 %, échéance le 01/12/2033	130	0,14
Taiwan — 0,41 % (28 février 2022 : 0,37 %)					
280 TSMC Arizona Corp, 2,500 %, échéance le 25/10/2031	232	0,25	180 AT&T Inc, 4,500 %, échéance le 15/05/2035	162	0,17
200 TSMC Arizona Corp, 3,125 %, échéance le 25/10/2041	156	0,16	50 AT&T Inc, 6,375 %, échéance le 01/03/2041	53	0,06
	388	0,41	132 AT&T Inc, 3,500 %, échéance le 15/09/2053	91	0,10
Émirats arabes unis — 0,29 % (28 février 2022 : 0,31 %)					
290 DAE Funding LLC, 144A, 1,550 %, échéance le 01/08/2024	272	0,29	163 AT&T Inc, 3,550 %, échéance le 15/09/2055	111	0,12
Royaume-Uni — 2,38 % (28 février 2022 : 2,47 %)					
280 Barclays Plc, 5,088 %, échéance le 20/06/2030 *	260	0,27	170 AT&T Inc, 3,800 %, échéance le 01/12/2057	119	0,13
50 British Telecommunications Plc, 9,625 %, échéance le 15/12/2030	61	0,06	80 Aviation Capital Group LLC, 144A, 5,500 %, échéance le 15/12/2024	79	0,08
210 HSBC Holdings Plc, 1,589 %, échéance le 24/05/2027 *	184	0,19	940 Bank of America Corp, 0,981 %, échéance le 25/09/2025 *	873	0,92
60 HSBC Holdings Plc, 7,625 %, échéance le 17/05/2032	66	0,07	50 Bank of America Corp, 4,376 %, échéance le 27/04/2028 *	48	0,05
400 Lloyds Banking Group Plc, 3,511 %, échéance le 18/03/2026 *	382	0,40	132 Bank of America Corp, 3,419 %, échéance le 20/12/2028 *	120	0,13
200 Lloyds Banking Group Plc, 4,375 %, échéance le 22/03/2028	189	0,20	150 Bank of America Corp, 4,271 %, échéance le 23/07/2029 *	141	0,15
330 Natwest Group Plc, 5,847 %, échéance le 02/03/2027 *	330	0,35	70 Bank of America Corp, 3,974 %, échéance le 07/02/2030 *	64	0,07
340 Natwest Group Plc, 3,754 %, échéance le 01/11/2029 *	319	0,34	80 Bank of America Corp, 2,884 %, échéance le 22/10/2030 *	68	0,07
200 Natwest Group Plc, 6,016 %, échéance le 02/03/2034 *	200	0,21	200 Bank of America Corp, 2,687 %, échéance le 22/04/2032 *	162	0,17
200 Santander UK Group Holdings Plc, 6,833 %, échéance le 21/11/2026 *	203	0,22	350 Bank of America Corp, 2,299 %, échéance le 21/07/2032 *	274	0,29
60 Vodafone Group Plc, 6,150 %, échéance le 27/02/2037	62	0,07	130 Bank of America Corp, 2,572 %, échéance le 20/10/2032 *	104	0,11
	2 256	2,38	380 Bank of America Corp, 4,571 %, échéance le 27/04/2033 *	353	0,37
États-Unis — 63,41 % (28 février 2022 : 61,52 %)					
110 Abbott Laboratories, 4,750 %, échéance le 30/11/2036	109	0,12	120 Bank of America Corp, 5,015 %, échéance le 22/07/2033 *	116	0,12
530 AbbVie Inc, 3,200 %, échéance le 21/11/2029	469	0,49	430 Bank of America Corp, 2,482 %, échéance le 21/09/2036 *	322	0,34
20 AbbVie Inc, 4,550 %, échéance le 15/03/2035	19	0,02	100 Bank of America Corp, 2,676 %, échéance le 19/06/2041 *	69	0,07
250 AbbVie Inc, 4,050 %, échéance le 21/11/2039	211	0,22	130 Bank of America Corp, 3,311 %, échéance le 22/04/2042 *	97	0,10
10 AbbVie Inc, 4,250 %, échéance le 21/11/2049	8	0,01	20 Bank of America Corp, 4,443 %, échéance le 20/01/2048 *	17	0,02
310 Air Lease Corp, 3,375 %, échéance le 01/07/2025	292	0,31	60 Bank of America Corp, 4,330 %, échéance le 15/03/2050 *	51	0,05
230 Air Lease Corp, 1,875 %, échéance le 15/08/2026	201	0,21	100 Bank of America Corp, 2,831 %, échéance le 24/10/2051 *	64	0,07
240 Air Lease Corp, 5,850 %, échéance le 15/12/2027	239	0,25	60 Bank of New York Mellon Corp/The, 5,834 %, échéance le 25/10/2033 *	63	0,07
180 Air Lease Corp, 5,300 %, échéance le 01/02/2028	175	0,18	10 Bank of New York Mellon Corp. (The), 4,706 %, échéance le 01/02/2034 *	10	0,01
200 Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 5,500 %, échéance le 15/12/2027	194	0,20	170 Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, échéance le 15/02/2026	160	0,17
150 Alexandria Real Estate Equities Inc, 2,000 %, échéance le 18/05/2032	115	0,12	340 Blackstone Holdings Finance Co LLC, 144A, 6,200 %, échéance le 22/04/2033	349	0,37
190 Alexandria Real Estate Equities Inc, 3,000 %, échéance le 18/05/2051	123	0,13	90 Blackstone Holdings Finance Co LLC, 144A, 3,200 %, échéance le 30/01/2052	58	0,06
170 Amazon.com Inc, 2,100 %, échéance le 12/05/2031	140	0,15	130 Blackstone Mortgage Trust Inc, 5,500 %, échéance le 15/03/2027	116	0,12
60 Amazon.com Inc, 3,600 %, échéance le 13/04/2032	55	0,06	90 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, échéance le 15/12/2025	91	0,10
80 Amazon.com Inc, 3,875 %, échéance le 22/08/2037	71	0,07	120 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,625 %, échéance le 15/07/2026	117	0,12
100 Amazon.com Inc, 2,500 %, échéance le 03/06/2050	64	0,07	50 Bon Secours Mercy Health Inc, 3,464 %, échéance le 01/06/2030	45	0,05
40 Amazon.com Inc, 3,100 %, échéance le 12/05/2051	29	0,03	80 BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, échéance le 24/02/2050	54	0,06
50 Amazon.com Inc, 3,950 %, échéance le 13/04/2052	42	0,04	130 Bristol-Myers Squibb Co, 2,350 %, échéance le 13/11/2040	89	0,09
13 American Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust, 3,375 %, échéance le 01/05/2027	11	0,01	30 Bristol-Myers Squibb Co, 4,250 %, échéance le 26/10/2049	26	0,03
90 American Airlines 2016-1 Class AA Pass Through Trust, série AA, 3,575 %, échéance le 15/01/2028	82	0,09	244 Broadcom Inc, 144A, 3,187 %, échéance le 15/11/2036	177	0,19
160 American Airlines 2017-1 Class B Pass Through Trust, série B, 4,950 %, échéance le 15/02/2025	155	0,16	90 Burlington Northern Santa Fe LLC, 4,400 %, échéance le 15/03/2042	80	0,08
460 American Airlines Inc, 144A, 11,750 %, échéance le 15/07/2025	505	0,53	60 California Institute of Technology, 3,650 %, échéance le 01/09/2119	41	0,04
180 American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, échéance le 15/02/2028	176	0,19	40 Cameron LNG LLC, 144A, 3,701 %, échéance le 15/01/2039	33	0,03
			260 Capital One Financial Corp, 5,817 %, échéance le 01/02/2034 *	253	0,27
			50 Carlyle Finance LLC, 144A, 5,650 %, échéance le 15/09/2048	46	0,05
			100 Centene Corp, 3,000 %, échéance le 15/10/2030	82	0,09
			190 Charles Schwab Corp/The, série G, 5,375 %, perpétuelle *	188	0,20
			280 Charles Schwab Corp/The, série H, 4,000 %, perpétuelle *	237	0,25
			60 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,750 %, échéance le 15/02/2028	54	0,06
			50 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, échéance le 15/03/2028	46	0,05

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
États-Unis — (suite)					
60 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 2,250 %, échéance le 15/01/2029	48	0,05	130 Edison International, série B, 5,000 %, perpétuelle *	112	0,12
230 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, échéance le 01/06/2041	151	0,16	70 Edison International, série A, 5,375 %, perpétuelle *	64	0,07
140 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,950 %, échéance le 01/03/2042	90	0,10	280 El Paso Natural Gas Co LLC, 7,500 %, échéance le 15/11/2026	297	0,31
60 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, échéance le 01/07/2049	46	0,05	220 Elevance Health Inc, 4,100 %, échéance le 15/05/2032	202	0,21
80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,850 %, échéance le 01/04/2061	47	0,05	240 Elevance Health Inc, 5,500 %, échéance le 15/10/2032	244	0,26
90 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,950 %, échéance le 30/06/2062	54	0,06	50 Elevance Health Inc, 4,375 %, échéance le 01/12/2047	43	0,04
420 Chesapeake Energy Corp, 144A, 5,500 %, échéance le 01/02/2026	412	0,43	50 Eli Lilly & Co, 4,875 %, échéance le 27/02/2053	50	0,05
40 Chevron USA Inc, 2,343 %, échéance le 12/08/2050	25	0,03	50 Eli Lilly & Co, 4,950 %, échéance le 27/02/2063	50	0,05
110 Cigna Group Plc/The, 4,375 %, échéance le 15/10/2028	106	0,11	40 Endeavour Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 5,750 %, échéance le 30/01/2028	39	0,04
280 Cigna Group/The, 2,400 %, échéance le 15/03/2030	234	0,25	150 Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, échéance le 16/10/2028	142	0,15
110 Cigna Corp/The, 3,200 %, échéance le 15/03/2040	82	0,09	80 Enterprise Products Operating LLC, série D, 6,875 %, échéance le 01/03/2033	89	0,09
150 Cimarex Energy Co, 4,375 %, échéance le 15/03/2029	132	0,14	320 Enterprise Products Operating LLC, 4,250 %, échéance le 15/02/2048	260	0,27
820 Citigroup Inc, 0,981 %, échéance le 01/05/2025 *	775	0,82	130 Enterprise Products Operating LLC, 3,300 %, échéance le 15/02/2053	88	0,09
50 Citigroup Inc, 3,980 %, échéance le 20/03/2030 *	46	0,05	80 Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, échéance le 31/01/2060	59	0,06
230 Citigroup Inc, 2,976 %, échéance le 05/11/2030 *	196	0,21	390 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, échéance le 15/02/2078 *	327	0,34
580 Citigroup Inc, 2,561 %, échéance le 01/05/2032 *	466	0,49	150 EOG Resources Inc, 4,375 %, échéance le 15/04/2030	144	0,15
210 Citigroup Inc, 3,785 %, échéance le 17/03/2033 *	183	0,19	70 EQM Midstream Partners LP, 4,750 %, échéance le 15/07/2023	69	0,07
270 Citigroup Inc, 8,125 %, échéance le 15/07/2039	343	0,36	100 EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500 %, échéance le 01/06/2027	98	0,10
90 Citigroup Inc, 4,650 %, échéance le 23/07/2048	81	0,08	190 EQT Corp, 6,125 %, échéance le 01/02/2025	190	0,20
140 Clorox Co/The, 1,800 %, échéance le 15/05/2030	112	0,12	130 EQT Corp, 5,678 %, échéance le 01/10/2025	128	0,14
70 Coca-Cola Co/The, 1,375 %, échéance le 15/03/2031	55	0,06	60 EQT Corp, 144A, 3,125 %, échéance le 15/05/2026	55	0,06
50 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, échéance le 01/06/2040	36	0,04	100 EQT Corp, 3,900 %, échéance le 01/10/2027	92	0,10
130 Comcast Corp, 4,250 %, échéance le 15/10/2030	123	0,13	100 EQT Corp, 7,000 %, échéance le 01/02/2030	103	0,11
520 Comcast Corp, 4,650 %, échéance le 15/02/2033	502	0,53	20 EQT Corp, 144A, 3,625 %, échéance le 15/05/2031	17	0,02
40 Comcast Corp, 7,050 %, échéance le 15/03/2033	46	0,05	190 Equifax Inc, 2,350 %, échéance le 15/09/2031	150	0,16
91 Comcast Corp, 6,500 %, échéance le 15/11/2035	101	0,11	80 Extra Space Storage LP, 3,900 %, échéance le 01/04/2029	73	0,08
60 Comcast Corp, 3,750 %, échéance le 01/04/2040	49	0,05	40 Exxon Mobil Corp, 3,482 %, échéance le 19/03/2030	37	0,04
30 Comcast Corp, 3,969 %, échéance le 01/11/2047	24	0,03	30 Exxon Mobil Corp, 2,995 %, échéance le 16/08/2039	23	0,02
202 Comcast Corp, 2,887 %, échéance le 01/11/2051	131	0,14	110 Exxon Mobil Corp, 4,227 %, échéance le 19/03/2040	99	0,10
100 Comcast Corp, 4,950 %, échéance le 15/10/2058	93	0,10	40 Exxon Mobil Corp, 4,114 %, échéance le 01/03/2046	34	0,04
50 CommonSpirit Health, 2,782 %, échéance le 01/10/2030	42	0,04	30 Exxon Mobil Corp, 3,452 %, échéance le 15/04/2051	23	0,02
60 CommonSpirit Health, 3,910 %, échéance le 01/10/2050	46	0,05	30 FirstEnergy Corp, série C, 5,100 %, échéance le 15/07/2047	27	0,03
150 Constellation Brands Inc, 5,000 %, échéance le 02/02/2026	149	0,16	450 Florida Gas Transmission Co LLC, 144A, 2,300 %, échéance le 01/10/2031	354	0,37
40 Constellation Brands Inc, 3,700 %, échéance le 12/06/2026	38	0,04	20 Ford Motor Co, 4,750 %, échéance le 15/01/2043	15	0,02
50 Continental Resources Inc/OK, 4,500 %, échéance le 15/04/2023	50	0,05	200 Ford Motor Credit Co LLC, 2,300 %, échéance le 10/02/2025	184	0,19
70 Continental Resources Inc/OK, 144A, 2,268 %, échéance le 15/11/2026	61	0,06	450 Ford Motor Credit Co LLC, 6,950 %, échéance le 06/03/2026	451	0,48
240 Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, échéance le 15/01/2028	223	0,23	300 Ford Motor Credit Co LLC, 2,700 %, échéance le 10/08/2026	261	0,28
100 Continental Resources Inc/OK, 144A, 2,875 %, échéance le 01/04/2032	76	0,08	100 Fortinet Inc, 2,200 %, échéance le 15/03/2031	80	0,08
20 Costco Wholesale Corp, 1,750 %, échéance le 20/04/2032	16	0,02	200 Freeport-McMoRan Inc, 4,550 %, échéance le 14/11/2024	196	0,21
360 Coterra Energy Inc, 3,900 %, échéance le 15/05/2027	338	0,36	150 Freeport-McMoRan Inc, 5,400 %, échéance le 14/11/2034	141	0,15
109 CVS Health Corp, 4,300 %, échéance le 25/03/2028	104	0,11	40 GE Capital European Funding Unlimited Co, 6,025 %, échéance le 01/03/2038	50	0,05
70 CVS Health Corp, 3,250 %, échéance le 15/08/2029	62	0,06	20 GE Capital UK Funding Unlimited Co, 8,000 %, échéance le 14/01/2039	28	0,03
130 CVS Health Corp, 2,125 %, échéance le 15/09/2031	102	0,11	130 General Motors Co, 4,875 %, échéance le 02/10/2023	130	0,14
10 CVS Health Corp, 4,780 %, échéance le 25/03/2038	9	0,01	290 General Motors Co, 6,125 %, échéance le 01/10/2025	293	0,31
360 CVS Health Corp, 2,700 %, échéance le 21/08/2040	244	0,26	70 General Motors Co, 5,600 %, échéance le 15/10/2032	67	0,07
100 DCP Midstream Operating LP, 3,250 %, échéance le 15/02/2032	83	0,09	100 General Motors Co, 6,600 %, échéance le 01/04/2036	100	0,11
30 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, échéance le 03/11/2036	31	0,03	70 General Motors Co, 5,950 %, échéance le 01/04/2049	63	0,07
62 Dell International LLC / EMC Corp, 8,100 %, échéance le 15/07/2036	69	0,07	40 General Motors Financial Co Inc, 3,700 %, échéance le 09/05/2023	40	0,04
320 Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, échéance le 01/05/2025	327	0,34	630 Genting New York LLC / GENNY Capital Inc, 144A, 3,300 %, échéance le 15/02/2026	551	0,58
10 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, échéance le 15/01/2026	10	0,01	70 Gilead Sciences Inc, 4,000 %, échéance le 01/09/2036	62	0,06
440 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, échéance le 20/10/2025	428	0,45	150 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250 %, échéance le 21/10/2045	145	0,15
360 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, échéance le 20/10/2028	342	0,36	1 100 Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, échéance le 12/02/2026 *	999	1,05
60 Devon Energy Corp, 5,850 %, échéance 15/12/2025	60	0,06	280 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, échéance le 16/11/2026	263	0,28
132 Devon Energy Corp, 5,875 %, échéance 15/06/2028	133	0,14	600 Goldman Sachs Group Inc/The, série VAR, 1,093 %, échéance le 09/12/2026 *	528	0,56
194 Devon Energy Corp, 4,500 %, échéance 15/01/2030	181	0,19	270 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,615 %, échéance le 15/03/2028 *	251	0,26
50 Devon Energy Corp, 7,950 %, échéance 15/04/2032	57	0,06	70 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,800 %, échéance le 15/03/2030	64	0,07
80 Devon Energy Corp, 5,600 %, échéance 15/07/2041	74	0,08	220 Goldman Sachs Group Inc/The, série DMTN, 2,383 %, échéance le 21/07/2032 *	173	0,18
150 Devon Energy Corp, 5,000 %, échéance 15/06/2045	127	0,13	180 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,650 %, échéance le 21/10/2032 *	144	0,15
260 Devon OEI Operating LLC, 7,500 %, échéance le 15/09/2027	281	0,30	50 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, échéance le 22/05/2045	46	0,05
260 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, échéance le 01/12/2029	230	0,24	30 Halliburton Co, 2,920 %, échéance le 01/03/2030	26	0,03
110 Diamondback Energy Inc, 4,400 %, échéance le 24/03/2051	85	0,09	640 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, échéance le 20/01/2026	596	0,63
180 Diamondback Energy Inc, 6,250 %, échéance le 15/03/2053	177	0,19	70 HCA Inc, 5,125 %, échéance le 15/06/2039	62	0,07
520 DISH DBS Corp, 5,000 %, échéance le 15/03/2023	519	0,55	100 Hershey Co/The, 1,700 %, échéance le 01/06/2030	81	0,09
140 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, échéance le 01/12/2028	112	0,12	30 Home Depot Inc/The, 3,300 %, échéance le 15/04/2040	24	0,02
80 Diversified Healthcare Trust, 4,750 %, échéance le 01/05/2024	72	0,08	70 Home Depot Inc/The, 3,350 %, échéance le 15/04/2050	52	0,05
100 Edison International, 4,950 %, échéance le 15/04/2025	99	0,10	180 Humana Inc, 5,875 %, échéance le 01/03/2033	185	0,20
			50 Humana Inc, 4,950 %, échéance le 01/10/2044	45	0,05

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
États-Unis — (suite)					
380 ILFC E-Capital Trust I, 144A, 6,288 %, échéance le 21/12/2065 *	261	0,28	30 Morgan Stanley, 1,593 %, échéance le 04/05/2027 *	26	0,03
100 ILFC E-Capital Trust II, 144A, 6,538 %, échéance le 21/12/2065 *	71	0,07	50 Morgan Stanley, 1,794 %, échéance le 13/02/2032 *	38	0,04
100 Intel Corp, 2,800 %, échéance le 12/08/2041	68	0,07	90 Morgan Stanley, 2,239 %, échéance le 21/07/2032 *	70	0,07
50 Intel Corp, 4,900 %, échéance le 05/08/2052	44	0,05	150 Morgan Stanley, 2,511 %, échéance le 20/10/2032 *	119	0,12
150 Intel Corp, 3,200 %, échéance le 12/08/2061	94	0,10	50 Morgan Stanley, 6,342 %, échéance le 18/10/2033 *	53	0,06
190 Intercontinental Exchange Inc, 4,600 %, échéance le 15/03/2033	181	0,19	360 Morgan Stanley, 2,484 %, échéance le 16/09/2036 *	269	0,28
40 Intercontinental Exchange Inc, 4,950 %, échéance le 15/06/2052	38	0,04	110 Morgan Stanley, 5,297 %, échéance le 20/04/2037 *	103	0,11
270 Invitation Homes Operating Partnership LP, 4,150 %, échéance le 15/04/2032	238	0,25	100 Morgan Stanley, 5,948 %, échéance le 19/01/2038 *	98	0,10
40 Jersey Central Power & Light Co, 144A, 4,300 %, échéance le 15/01/2026	38	0,04	20 MPLX LP, 4,800 %, échéance le 15/02/2029	19	0,02
120 Johnson & Johnson, 2,100 %, échéance le 01/09/2040	82	0,09	220 MPLX LP, 5,000 %, échéance le 01/03/2033	207	0,22
60 Johnson & Johnson, 2,450 %, échéance le 01/09/2060	37	0,04	300 MPLX LP, 4,500 %, échéance le 15/04/2038	256	0,27
710 JPMorgan Chase & Co, 5,546 %, échéance le 15/12/2025 *	709	0,75	290 National General Holdings Corp, Series 0000, 144A, 6,750 %, échéance le 15/05/2024	291	0,31
250 JPMorgan Chase & Co, 2,005 %, échéance le 13/03/2026 *	233	0,25	100 New York Life Global Funding, 144A, 4,550 %, échéance le 28/01/2033	96	0,10
70 JPMorgan Chase & Co, 2,739 %, échéance le 15/10/2030 *	59	0,06	60 New York Life Insurance Co, 144A, 3,750 %, échéance le 15/05/2050	47	0,05
20 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, échéance le 22/04/2031 *	17	0,02	280 NextEra Energy Capital Holdings Inc, 6,051 %, échéance le 01/03/2025	282	0,30
400 JPMorgan Chase & Co, 2,956 %, échéance le 13/05/2031 *	336	0,35	50 NextEra Energy Operating Partners LP, 144A, 4,250 %, échéance le 15/07/2024	48	0,05
300 JPMorgan Chase & Co, 1,953 %, échéance le 04/02/2032 *	233	0,25	100 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 1,050 %, échéance le 08/03/2024	95	0,10
260 JPMorgan Chase & Co, 2,580 %, échéance le 22/04/2032 *	211	0,22	60 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 2,750 %, échéance le 09/03/2028	50	0,05
90 JPMorgan Chase & Co, 2,545 %, échéance le 08/11/2032 *	72	0,08	310 Nordstrom Inc, 2,300 %, échéance le 08/04/2024	293	0,31
380 JPMorgan Chase & Co, 4,586 %, échéance le 26/04/2033 *	354	0,37	120 Norfolk Southern Railway Co, 7,875 %, échéance le 15/05/2043	142	0,15
80 JPMorgan Chase & Co, 4,260 %, échéance le 22/02/2048 *	69	0,07	80 Northwest Pipeline LLC, 7,125 %, échéance le 01/12/2025	82	0,09
70 JPMorgan Chase & Co, 3,964 %, échéance le 15/11/2048 *	56	0,06	260 Northwest Pipeline LLC, 4,000 %, échéance le 01/04/2027	246	0,26
80 JPMorgan Chase & Co, 3,897 %, échéance le 23/11/2049 *	64	0,07	60 Northwestern Mutual Life Insurance Co/The, 144A, 3,850 %, échéance le 30/09/2047	48	0,05
10 JPMorgan Chase & Co, 3,328 %, échéance le 22/04/2052 *	7	0,01	60 Northwestern Mutual Life Insurance Co/The, 144A, 3,625 %, échéance le 30/09/2059	43	0,04
170 JPMorgan Chase & Co, série KK, 3,650 %, perpétuelle *	148	0,16	90 Nuveen LLC, 144A, 4,000 %, échéance le 01/11/2028	85	0,09
100 Kaiser Foundation Hospitals, série 2021, 2,810 %, échéance le 01/06/2041	73	0,08	30 NVIDIA Corp, 3,500 %, échéance le 01/04/2040	25	0,03
70 Kaiser Foundation Hospitals, série 2019, 3,266 %, échéance le 01/11/2049	52	0,05	30 NVIDIA Corp, 3,700 %, échéance le 01/04/2060	23	0,02
20 Kaiser Foundation Hospitals, série 2021, 3,002 %, échéance le 01/06/2051	14	0,01	50 Occidental Petroleum Corp, 7,875 %, échéance le 15/09/2031	54	0,06
220 Kimco Realty OP LLC, 2,250 %, échéance le 01/12/2031	171	0,18	50 Occidental Petroleum Corp, 7,950 %, échéance le 15/06/2039	55	0,06
40 Kinder Morgan Energy Partners LP, 7,300 %, échéance le 15/08/2033	44	0,05	100 Ohio Edison Co, 144A, 5,500 %, échéance le 15/01/2033	100	0,11
70 Kinder Morgan Inc, 5,300 %, échéance le 01/12/2034	66	0,07	190 Ohio Edison Co, 6,875 %, échéance le 15/07/2036	208	0,22
60 Kinder Morgan Inc, 5,200 %, échéance le 01/03/2048	52	0,05	30 Oncor Electric Delivery Co LLC, 4,150 %, échéance le 01/06/2032	28	0,03
90 KKR Group Finance Co III LLC, 144A, 5,125 %, échéance le 01/06/2044	79	0,08	10 Oncor Electric Delivery Co LLC, 3,100 %, échéance le 15/09/2049	7	0,01
40 KKR Group Finance Co VII LLC, 144A, 3,625 %, échéance le 25/02/2050	28	0,03	280 Oracle Corp, 6,250 %, échéance le 09/11/2032	292	0,31
100 KLA Corp, 4,650 %, échéance le 15/07/2032	98	0,10	240 Oracle Corp, 4,000 %, échéance le 15/07/2046	175	0,18
30 KLA Corp, 4,950 %, échéance le 15/07/2052	28	0,03	40 Oracle Corp, 6,900 %, échéance le 09/11/2052	43	0,05
280 Kyndryl Holdings Inc, 3,150 %, échéance le 15/10/2031	209	0,22	280 Oracle Corp, 5,550 %, échéance le 06/02/2053	257	0,27
190 Kyndryl Holdings Inc, 144A, 4,100 %, échéance le 15/10/2041	128	0,14	60 Otis Worldwide Corp, 2,565 %, échéance le 15/02/2030	51	0,05
90 Lam Research Corp, 1,900 %, échéance le 15/06/2030	73	0,08	130 Pacific Gas and Electric Co, 4,250 %, échéance le 01/08/2023	129	0,14
30 Lam Research Corp, 2,875 %, échéance le 15/06/2050	20	0,02	450 Pacific Gas and Electric Co, 3,150 %, échéance le 01/01/2026	418	0,44
100 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, échéance le 08/08/2024	96	0,10	70 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, échéance le 08/01/2027	60	0,06
70 Lennox International Inc, 1,700 %, échéance le 01/08/2027	60	0,06	100 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, échéance le 12/01/2027	89	0,09
100 Lincoln National Corp, série C, 9,250 %, perpétuelle *	110	0,12	120 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, échéance le 02/01/2031	94	0,10
60 Lithia Motors Inc, 144A, 4,625 %, échéance le 15/12/2027	55	0,06	10 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, échéance le 08/01/2040	7	0,01
80 Lowe's Cos Inc, 1,700 %, échéance le 15/10/2030	62	0,07	60 Pacific Gas and Electric Co, 4,750 %, échéance le 15/02/2044	47	0,05
80 Lowe's Cos Inc, 2,800 %, échéance le 15/09/2041	54	0,06	40 Pacific Gas and Electric Co, 4,950 %, échéance le 07/01/2050	32	0,03
100 Lowe's Cos Inc, 3,000 %, échéance le 15/10/2050	64	0,07	170 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, échéance le 15/02/2028	156	0,16
130 Mars Inc, 144A, 2,375 %, échéance le 16/07/2040	90	0,09	60 PayPal Holdings Inc, 2,300 %, échéance le 01/06/2030	50	0,05
190 Marsh & McLennan Cos Inc, 2,375 %, échéance le 15/12/2031	153	0,16	150 PayPal Holdings Inc, 4,400 %, échéance le 01/06/2032	141	0,15
40 Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 3,375 %, échéance le 15/04/2050	29	0,03	10 PayPal Holdings Inc, 3,250 %, échéance le 01/06/2050	7	0,01
100 Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 4,900 %, échéance le 01/04/2077	87	0,09	20 PayPal Holdings Inc, 5,050 %, échéance le 01/06/2052	18	0,02
110 Mastercard Inc, 3,350 %, échéance le 26/03/2030	101	0,11	160 PepsiCo Inc, 3,900 %, échéance le 18/07/2032	151	0,16
30 Mastercard Inc, 1,900 %, échéance le 15/03/2031	24	0,03	40 Pfizer Inc, 2,550 %, échéance le 28/05/2040	29	0,03
60 Mastercard Inc, 3,850 %, échéance le 26/03/2050	51	0,05	90 Pilgrim's Pride Corp, 144A, 5,875 %, échéance le 30/09/2027	88	0,09
80 McDonald's Corp, 2,125 %, échéance le 01/03/2030	66	0,07	130 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, échéance le 15/01/2031	103	0,11
90 McDonald's Corp, 4,450 %, échéance le 01/03/2047	78	0,08	50 Plains All American Pipeline LP, série B, 8,974 %, perpétuelle *	46	0,05
110 McDonald's Corp, 4,450 %, échéance le 01/09/2048	96	0,10	40 Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 6,700 %, échéance le 15/05/2036	40	0,04
130 MDC Holdings Inc, 2,500 %, échéance le 15/01/2031	96	0,10	190 PNC Financial Services Group Inc/The, Series W, 6,250 %, perpétuelle *	184	0,19
50 MDC Holdings Inc, 6,000 %, échéance le 15/01/2043	42	0,04	140 Prologis LP, 1,250 %, échéance le 15/10/2030	107	0,11
70 Merck & Co Inc, 2,350 %, échéance le 24/06/2040	49	0,05	120 Prudential Financial Inc, 6,750 %, échéance le 10/03/2053 *	121	0,13
80 Meta Platforms Inc, 3,850 %, échéance le 15/08/2032	72	0,08	50 QUALCOMM Inc, 4,500 %, échéance le 20/05/2052	45	0,05
70 Meta Platforms Inc, 4,450 %, échéance le 15/08/2052	58	0,06	161 Range Resources Corp, 4,875 %, échéance le 15/05/2025	157	0,17
190 Micron Technologies Inc, 2,703 %, échéance le 15/04/2032	144	0,15	80 Range Resources Corp, 8,250 %, échéance le 15/01/2029	82	0,09
120 Micron Technologies Inc, 5,875 %, échéance le 09/02/2033	116	0,12	50 Raymond James Financial Inc, 4,950 %, échéance le 15/07/2046	46	0,05
154 Microsoft Corp, 3,450 %, échéance le 08/08/2036	135	0,14	630 Regal Rexnord Corp, 144A, 6,050 %, échéance le 15/02/2026	625	0,66
59 Microsoft Corp, 2,921 %, échéance le 17/03/2052	42	0,04	190 Republic Services Inc, 3,375 %, échéance le 15/11/2027	176	0,19
360 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, échéance le 20/06/2027	360	0,38	80 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 2,875 %, échéance le 15/10/2026	69	0,07
20 Molson Coors Beverage Co, 3,000 %, échéance le 15/07/2026	19	0,02	50 S&P Global Inc, 1,250 %, échéance le 15/08/2030	39	0,04
60 Molson Coors Beverage Co, 4,200 %, échéance le 15/07/2046	47	0,05	30 S&P Global Inc, 3,250 %, échéance le 01/12/2049	22	0,02
40 Mondelez International Inc, 2,625 %, échéance le 04/09/2050	25	0,03	110 Salesforce Inc, 1,500 %, échéance le 15/07/2028	93	0,10
570 Morgan Stanley, Series I, 0,864 %, échéance le 20/10/2025 *	525	0,55	140 San Diego Gas & Electric Co, série VVW, 1,700 %, échéance le 01/10/2030	110	0,12
130 Morgan Stanley, 2,188 %, échéance le 28/04/2026 *	121	0,13			
830 Morgan Stanley, 0,985 %, échéance le 10/12/2026 *	730	0,77			

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
États-Unis — (suite)					
140 San Diego Gas & Electric Co, série RRR, 3,750 %, échéance le 01/06/2047	109	0,12	23 Walt Disney Co/The, 6,400 %, échéance le 15/12/2035	25	0,03
150 Southern California Edison Co, 2,250 %, échéance le 01/06/2030	123	0,13	80 Walt Disney Co/The, 6,650 %, échéance le 15/11/2037	91	0,10
150 Southern California Edison Co, série G, 2,500 %, échéance le 01/06/2031	123	0,13	30 Walt Disney Co/The, 5,400 %, échéance le 01/10/2043	30	0,03
10 Southern California Edison Co, 4,000 %, échéance le 01/04/2047	8	0,01	10 Walt Disney Co/The, 4,950 %, échéance le 15/10/2045	9	0,01
110 Southern California Edison Co, série C, 4,125 %, échéance le 01/03/2048	88	0,09	200 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 3,428 %, échéance le 15/03/2024	195	0,21
70 Southern California Edison Co, 3,650 %, échéance le 01/02/2050	52	0,05	120 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 4,279 %, échéance le 15/03/2032	104	0,11
140 Southwest Airlines Co, 5,250 %, échéance le 04/05/2025	139	0,15	280 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,050 %, échéance le 15/03/2042	227	0,24
40 Southwestern Energy Co, 8,375 %, échéance le 15/09/2028	42	0,04	430 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,141 %, échéance le 15/03/2052	337	0,36
30 Southwestern Energy Co, 4,750 %, échéance le 01/02/2032	26	0,03	120 Waste Management Inc, 3,150 %, échéance le 15/11/2027	111	0,12
120 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, échéance le 20/09/2025	121	0,13	110 Wells Fargo & Co, 2,406 %, échéance le 30/10/2025 *	104	0,11
400 SVB Financial Group, 4,570 %, échéance le 29/04/2033 *	361	0,38	300 Wells Fargo & Co, 4,540 %, échéance le 15/08/2026 *	293	0,31
190 Targa Resources Corp, 5,200 %, échéance le 01/07/2027	187	0,20	10 Wells Fargo & Co, 3,000 %, échéance le 23/10/2026	9	0,01
180 Targa Resources Corp, 4,200 %, échéance le 01/02/2033	157	0,17	10 Wells Fargo & Co, 3,196 %, échéance le 17/06/2027 *	9	0,01
130 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, échéance le 01/02/2031	118	0,12	80 Wells Fargo & Co, 3,584 %, échéance le 22/05/2028 *	74	0,08
120 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, échéance le 15/01/2032	102	0,11	60 Wells Fargo & Co, 3,068 %, échéance le 30/04/2041 *	44	0,05
30 Target Corp, 3,375 %, échéance le 15/04/2029	28	0,03	140 Wells Fargo & Co, 5,375 %, échéance le 02/11/2043	133	0,14
450 TD SYNNEX Corp, 1,250 %, échéance le 09/08/2024	421	0,44	120 Wells Fargo & Co, 4,750 %, échéance le 07/12/2046	103	0,11
70 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 4,270 %, échéance le 15/05/2047	60	0,06	170 Wells Fargo & Co, 5,013 %, échéance le 04/04/2051 *	157	0,16
190 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 7,000 %, échéance le 15/03/2027	200	0,21	330 Wells Fargo & Co, 4,611 %, échéance le 25/04/2053 *	286	0,30
240 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 7,000 %, échéance le 15/10/2028	255	0,27	60 Welltower OP LLC, 3,850 %, échéance le 15/06/2032	52	0,05
40 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, échéance le 01/03/2030	34	0,04	150 Western Midstream Operating LP, 3,350 %, échéance le 01/02/2025	142	0,15
80 Texas Instruments Inc, 2,250 %, échéance le 04/09/2029	69	0,07	230 Western Midstream Operating LP, 3,950 %, échéance le 01/06/2025	219	0,23
210 Texas Instruments Inc, 3,875 %, échéance le 15/03/2039	186	0,20	60 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, échéance le 15/08/2048	50	0,05
254 Time Warner Cable Enterprises LLC, 8,375 %, échéance le 15/07/2033	286	0,30	10 Williams Cos Inc/The, 3,500 %, échéance le 15/10/2051	7	0,01
310 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, échéance le 01/07/2038	311	0,33	60 Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, échéance le 01/03/2025	58	0,06
90 Time Warner Cable LLC, 6,750 %, échéance le 15/06/2039	87	0,09		60 094	63,41
40 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, échéance le 15/02/2029	34	0,04	Zambie — 0,43 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
120 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, échéance le 15/02/2031	98	0,10	420 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, échéance le 01/04/2025	408	0,43
70 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, échéance le 15/02/2031	58	0,06	Total des obligations et bons d'entreprises (coût 102 013\$)		
120 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, échéance le 15/11/2031	94	0,10		91 131	96,16
180 T-Mobile USA Inc, 2,700 %, échéance le 15/03/2032	146	0,15	Obligations et bons d'État — 1,69 % (28 février 2022 : 9,07 %)		
20 T-Mobile USA Inc, 4,375 %, échéance le 15/04/2040	17	0,02	Chili — 0,17 % (28 février 2022 : 0,20 %)		
130 T-Mobile USA Inc, 3,000 %, échéance le 15/02/2041	91	0,10	200 Obligation internationale de l'État chilien, 2,550 %, échéance le 27/07/2033	157	0,17
100 T-Mobile USA Inc, 3,300 %, échéance le 15/02/2051	67	0,07	Mexique — 1,20 % (28 février 2022 : 1,06 %)		
195 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, échéance le 01/02/2026	207	0,22	MXN 12 140 Mexican Bonos, série M 30, 8,500 %, échéance le 18/11/2038	620	0,65
460 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,250 %, échéance le 01/12/2026	480	0,51	290 Obligation internationale de l'État mexicain, 3,500 %, échéance le 12/02/2034	237	0,25
30 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 4,450 %, échéance le 01/08/2042	26	0,03	350 Obligation internationale de l'État mexicain, 4,280 %, échéance le 14/08/2041	280	0,30
100 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,950 %, échéance le 15/05/2050	78	0,08		1 137	1,20
270 Trust Financial Corp, 1,267 %, échéance le 02/03/2027 *	240	0,25	Panama — 0,21 % (28 février 2022 : 0,24 %)		
70 Union Pacific Corp, 2,973 %, échéance le 16/09/2062	44	0,05	270 Obligation internationale de l'État panaméen, 2,252 %, échéance le 29/09/2032	202	0,21
60 Union Pacific Corp, 3,750 %, échéance le 05/02/2070	44	0,05	Pérou — 0,06 % (28 février 2022 : 0,05 %)		
145 United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, 4,875 %, échéance le 15/01/2026	140	0,15	70 Obligation internationale de l'État péruvien, 2,783 %, échéance le 23/01/2031	58	0,06
80 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, échéance le 15/05/2030	66	0,07	États-Unis — 0,05 % (28 février 2022 : 5,69 %)		
540 UnitedHealth Group Inc, 5,350 %, échéance le 15/02/2033	553	0,58	50 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,500 %, échéance le 15/02/2033	48	0,05
50 UnitedHealth Group Inc, 3,500 %, échéance le 15/08/2039	41	0,04	Total des obligations et bons d'État (Coût 1 891\$)		
90 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, échéance le 15/05/2040	66	0,07		1 602	1,69
40 UnitedHealth Group Inc, 4,750 %, échéance le 15/07/2045	38	0,04	Billets d'emprunt — 0,34 % (28 février 2022 : 0,85 %)		
30 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, échéance le 15/12/2048	27	0,03	143 SkyMiles IP Ltd, 8,558 %, échéance le 16/09/2027 *	148	0,15
80 UnitedHealth Group Inc, 4,750 %, échéance le 15/05/2052	74	0,08	177 United Airlines Inc, 8,568 %, échéance le 14/04/2028 *	177	0,19
40 UnitedHealth Group Inc, 5,875 %, échéance le 15/02/2053	43	0,05	Total des billets d'emprunt (coût 318\$)		
60 US Airways 2012-2 Class A Pass Through Trust, 4,625 %, échéance le 03/06/2025	58	0,06		325	0,34
160 Verizon Communications Inc, 1,500 %, échéance le 18/09/2030	124	0,13	Obligations municipales — 0,74 % (28 février 2022 : 0,68 %)		
480 Verizon Communications Inc, 4,272 %, échéance le 15/01/2036	424	0,45	50 Alabama Economic Settlement Authority, 3,163 %, échéance le 15/09/2025	48	0,05
100 Verizon Communications Inc, 2,650 %, échéance le 20/11/2040	68	0,07	150 American Municipal Power Inc, 7,834 %, échéance le 15/02/2041	191	0,20
60 Verizon Communications Inc, 2,850 %, échéance le 03/09/2041	42	0,04	150 Port Authority of New York & New Jersey, 4,458 %, échéance le 01/10/2062	137	0,15
40 Verizon Communications Inc, 6,550 %, échéance le 15/09/2043	44	0,05	160 Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue, 4,132 %, échéance le 15/05/2032	151	0,16
50 Verizon Communications Inc, 4,000 %, échéance le 22/03/2050	40	0,04	100 État de Californie, 7,300 %, échéance le 01/10/2039	122	0,13
30 Verizon Communications Inc, 2,987 %, échéance le 30/10/2056	18	0,02	50 État de l'Illinois, 5,100 %, échéance le 01/06/2033	49	0,05
70 VICI Properties LP, 4,950 %, échéance le 15/02/2030	65	0,07	Total des obligations municipales (coût 737\$)		
60 Visa Inc, 2,050 %, échéance le 15/04/2030	51	0,05		698	0,74
50 Visa Inc, 2,700 %, échéance le 15/04/2040	38	0,04			
150 Vontier Corp, 1,800 %, échéance le 01/04/2026	131	0,14			
310 Vontier Corp, 2,400 %, échéance le 01/04/2028	254	0,27			
120 Walmart Inc, 1,800 %, échéance le 22/09/2031	97	0,10			
100 Walmart Inc, 2,650 %, échéance le 22/09/2051	68	0,07			
20 Walt Disney Co/The, 6,200 %, échéance le 15/12/2034	22	0,02			

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Actions privilégiées — 0,27 % (28 février 2022 : 0,29 %)		
États-Unis — 0,27 % (28 février 2022 : 0,29 %)		
8 KeyCorp	206	0,22
1 Lincoln National Corp, Series D	20	0,02
1 Prudential Financial Inc	27	0,03
	253	0,27
Total des actions privilégiées (coût 252\$)	253	0,27
Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat (Coût 105 415\$)		
	94 192	99,39
Contrats de change à terme — 0,04 % (28 février 2022 : 0,08 %)		
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	35	0,04
Contrats à terme standardisés — 0,01 % (28 février 2022 : 0,12 %)		
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	4	0,01
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	94 231	99,44
Swaps sur risque de crédit — (0,08 %) (28 février 2022 : 0,00 %)		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(74)	(0,08)
Contrats de change à terme — (0,43 %) (28 février 2022 : (0,99 %))		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(404)	(0,43)
Contrats à terme standardisés — (0,11 %) (28 février 2022 : (0,09 %))		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(103)	(0,11)
Total des passifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat	(581)	(0,62)
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	93 650	98,82
Autres éléments de l'actif hors passif	1 125	1,18
Total des actifs nets	94 775\$	100,00

Tableau des swaps sur risque de crédit

Contrepartie	Entité de référence – protection achat/vente	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 5,000 % - achat	20-juin-2027	1 040	\$ (29)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 5,000 % - achat	20-déc-2027	460	(7)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % - achat	20-déc-2027	1 330	(14)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % - achat	20-juin-2027	1 875	(24)
Plus-value latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				\$ –
Moins-value latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				(74)
Moins-value nette des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : – USD)				\$ (74)

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)	Devise de vente (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat USD 2 438	Vente GBP 2 015	\$ 13
15-mar-2023	BNY Mellon	Achat GBP 67 107	Vente USD 81 103	(361)
18-avr-2023	BNP Paribas	Achat EUR 416	Vente USD 451	(9)
18-avr-2023	Goldman Sachs	Achat MXN 3 333	Vente USD 168	12
18-avr-2023	JP Morgan	Achat JPY 64 420	Vente USD 511	(34)
18-avr-2023	JP Morgan	Achat BRL 1 460	Vente USD 273	4
18-avr-2023	Morgan Stanley	Achat USD 427	Vente GBP 350	6
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 143 \$)				\$ 35
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (1 739) \$)				(404)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (1 596) \$)				\$ (369)

Tableau des contrats à terme standardisés

	Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
U.S. 10 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	4	USD 447	\$ –
U.S. 10 Year Ultra Note, juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	17	1 992	–
U.S. 2 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	(6)	(1 222)	4
U.S. 5 Year Note (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	104	11 134	(43)
U.S. Long Bond (CBT), juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	10	1 252	(4)
U.S. Ultra Bond (CBT) juin 2023	Bank of America Merrill Lynch	54	7 293	(56)
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 202 \$)				\$ 4
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (158) \$)				(103)
Moins-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 44 \$)				\$ (99)

– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 28 654 000\$, soit 30,18 % de l'actif net.

* Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.

† Illiquide à compter de l'exercice clos le 28 février 2023.

‡ Le titre est en défaut à la date de clôture ou depuis la clôture de l'exercice le 30 juin 2022 (capital et/ou intérêts).

ABRÉVIATIONS :

Perpétuelle – Obligation sans date d'échéance. Les obligations perpétuelles ne sont pas rachetables, mais paient des intérêts réguliers.

EUR – Euro

GBP – Livre britannique

MXN – Peso mexicain

Analyse de l'actif total	% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	96,54
Autres valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	0,33
Instruments financiers dérivés	0,04
Autres actifs	3,09
Actif total	100,00

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

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

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des actifs — 2,61 % (28 février 2022 : 3,57 %)					
260 Ameriquest Mortgage Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Cfts Ser 2004-R10, série 2004 R10, catégorie M6, 6,672 %, échéance le 25/11/2034 *	222	1,20	10 MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, échéance le 01/02/2029	9	0,05
27 Ameriquest Mortgage Securities Trust 2006-R1, série 2006 R1, catégorie M1, 5,202 %, échéance le 25/03/2036 *	27	0,14	40 Banque Royale du Canada, 1,150 %, échéance le 10/06/2025	36	0,20
49 RAMP Series 2006-RZ3 Trust, série 2006 RZ3, catégorie M1, 4,967 %, échéance le 25/08/2036 *	47	0,26	10 Teck Resources Ltd, 3,900 %, échéance le 15/07/2030	9	0,05
100 Saxon Asset Securities Trust 2006-3, série 2006 3, catégorie A4, 5,097 %, échéance le 25/10/2046 *	86	0,47	70 Toronto-Dominion Bank/The, 1,150 %, échéance le 12/06/2025	64	0,34
101 Soundview Home Loan Trust 2006-2, série 2006 2, catégorie M2, 5,142 %, échéance le 25/03/2036 *	99	0,54		204	1,11
Total des titres adossés à des actifs (coût 521 \$)	481	2,61			
Titres adossés à des hypothèques — 19,86 % (28 février 2022 : 17,27 %)					
100 BANK 2017-BNK7, série 2017 BNK7, catégorie C, 4,013 %, échéance le 15/09/2060 *	86	0,47	Colombie — 0,36 % (28 février 2022 : 0,40 %)		
7 834 Benchmark 2018-B7 Mortgage Trust, série 2018 B7, catégorie XA, 0,426 %, échéance le 15/05/2053 *	130	0,70	100 Ecopetrol SA, 5,875 %, échéance le 28/05/2045	66	0,36
100 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, série 2021 R03, catégorie 1B1, 144A, 7,234 %, échéance le 25/12/2041 *	94	0,51	France — 1,03 % (28 février 2022 : 0,97 %)		
19 Fannie Mae Pool 'AM8700', 2,930 %, échéance le 01/06/2030	17	0,09	200 BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, échéance le 14/08/2028	189	1,03
19 Fannie Mae Pool 'AN5386', 3,250 %, échéance le 01/05/2029	18	0,10	Irlande — 0,32 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
21 Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, échéance le 01/07/2043	19	0,10	59 Avolon TLB Borrower 1 (US) LLC, 6,848 %, échéance le 01/12/2027 *	59	0,32
40 Fannie Mae Pool 'BM6898', 2,149 %, échéance le 01/02/2032 *	33	0,18	Israël — 1,21 % (28 février 2022 : 1,04 %)		
86 Fannie Mae Pool 'BR4393', 2,000 %, échéance le 01/03/2051	71	0,38	120 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, échéance le 21/07/2023	119	0,64
129 Fannie Mae Pool 'CA5220', 3,000 %, échéance le 01/02/2050	114	0,62	120 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, échéance le 01/10/2026	105	0,57
89 Fannie Mae Pool 'CB1878', 3,000 %, échéance le 01/10/2051	79	0,43		224	1,21
182 Fannie Mae Pool 'CB2164', 3,000 %, échéance le 01/11/2051	161	0,88	Macao — 0,93 % (28 février 2022 : 0,79 %)		
92 Fannie Mae Pool 'CB2375', 2,500 %, échéance le 01/12/2051	79	0,43	200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, échéance le 26/08/2028	171	0,93
290 Fannie Mae Pool 'FM3445', 4,000 %, échéance le 01/09/2048	276	1,50	Mexique — 0,51 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
90 Fannie Mae Pool 'FM9195', 2,500 %, échéance le 01/10/2051	77	0,42	100 Southern Copper Corp, 5,250 %, échéance le 08/11/2042	94	0,51
89 Fannie Mae Pool 'FM9292', 3,000 %, échéance le 01/11/2051	79	0,43	Royaume-Uni — 1,25 % (28 février 2022 : 0,35 %)		
90 Fannie Mae Pool 'FM9579', 2,000 %, échéance le 01/07/2051	74	0,40	40 BAT Capital Corp, 3,557 %, échéance le 15/08/2027	36	0,20
92 Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, échéance le 01/02/2052	76	0,41	40 BAT Capital Corp, 4,540 %, échéance le 15/08/2047	29	0,15
89 Fannie Mae Pool 'FS1107', 2,500 %, échéance le 01/12/2051	77	0,42	200 Vmed Q2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, échéance le 15/07/2031	166	0,90
189 Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, échéance le 01/06/2049	175	0,95		231	1,25
75 Fannie Mae Pool 'MA4158', 2,000 %, échéance le 01/10/2050	62	0,33	États-Unis — 22,39 % (28 février 2022 : 20,29 %)		
85 Fannie Mae Pool 'MA4305', 2,000 %, échéance le 01/04/2051	70	0,38	10 Abbott Laboratories, 3,750 %, échéance le 30/11/2026	10	0,05
76 Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, échéance le 01/11/2050	65	0,35	10 Abbott Laboratories, 4,750 %, échéance le 30/11/2036	10	0,05
86 Freddie Mac Pool 'RA5921', 2,500 %, échéance le 09/01/2051	73	0,40	20 Abbott Laboratories, 4,900 %, échéance le 30/11/2046	20	0,11
72 Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, échéance le 01/10/2041	58	0,31	100 AbbVie Inc, 3,600 %, échéance le 14/05/2025	96	0,52
18 Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, échéance le 01/11/2041	15	0,08	80 AbbVie Inc, 3,200 %, échéance le 21/11/2029	71	0,38
350 Freddie Mac Pool 'SD0176', 3,500 %, échéance le 01/12/2049	321	1,74	20 AbbVie Inc, 4,250 %, échéance le 21/11/2049	17	0,09
91 Freddie Mac Pool 'SD0777', 3,000 %, échéance le 01/11/2051	77	0,42	10 Air Lease Corp, 5,300 %, échéance le 01/02/2028	10	0,05
95 Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, série 2020 DNA2, catégorie M2, 144A, 6,467 %, échéance le 25/02/2050 *	96	0,52	20 Alphabet Inc, 1,100 %, échéance le 15/08/2030	16	0,09
104 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, série 2021 DNA5, catégorie M2, 144A, 6,134 %, échéance le 25/01/2034 *	103	0,56	20 Alphabet Inc, 2,050 %, échéance le 15/08/2050	12	0,07
145 Ginnie Mae II Pool 'MA6658', 4,000 %, échéance le 20/05/2050	139	0,75	32 Altria Group Inc, 4,400 %, échéance le 14/02/2026	31	0,17
233 Ginnie Mae II Pool 'MA7473', 3,000 %, échéance le 20/07/2051	209	1,13	8 Altria Group Inc, 4,800 %, échéance le 14/02/2029	8	0,04
249 Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, arrivant à échéance le 20/09/2051	223	1,21	20 Altria Group Inc, 5,800 %, échéance le 14/02/2039	18	0,10
94 Ginnie Mae II Pool 'MA7883', 3,500 %, échéance le 20/02/2052	87	0,47	30 Altria Group Inc, 5,950 %, échéance le 14/02/2049	27	0,15
100 Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 5,000 % ±	99	0,54	50 Amazon.com Inc, 1,500 %, échéance le 03/06/2030	32	0,17
98 Government National Mortgage Association, série 2022 3, catégorie IO, 0,640 %, échéance le 16/02/2061 *	5	0,03	50 Amazon.com Inc, 2,500 %, échéance le 03/06/2050	32	0,17
36 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, série 2021 NQ2R, catégorie A3, 144A, 1,353 %, échéance le 25/10/2058 *	32	0,17	50 AT&T Inc, 1,650 %, échéance le 01/02/2028	43	0,23
250 Towd Point Mortgage Trust 2017-4, série 2017 4, catégorie B2, 144A, 3,497 %, échéance le 25/06/2057 *	193	1,05	10 Ball Corp, 3,125 %, échéance le 15/09/2031	8	0,04
Total des titres adossés à des hypothèques (coût 4 088 \$)	3 662	19,86	20 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, échéance le 15/01/2049	18	0,10
Obligations et bons d'entreprises — 31,20 % (28 février 2022 : 27,98 %)					
Australie — 0,42 % (28 février 2022 : 0,30 %)					
20 BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000 %, échéance le 30/09/2043	19	0,10	40 Boeing Co/The, 4,875 %, échéance le 01/05/2023	39	0,21
20 Glencore Finance Canada Ltd, 144A, 6,000 %, échéance le 15/11/2041	20	0,11	50 Boeing Co/The, 5,150 %, échéance le 01/05/2030	48	0,26
40 Glencore Funding LLC, 144A, 4,000 %, échéance le 27/03/2027	38	0,21	40 Boeing Co/The, 5,705 %, échéance le 01/05/2040	38	0,21
	77	0,42	50 Boeing Co/The, 5,805 %, échéance le 01/05/2050	48	0,26
Belgique — 0,29 % (28 février 2022 : 0,49 %)					
40 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, échéance le 01/06/2030	36	0,20	40 BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, échéance le 04/05/2026	38	0,21
20 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, échéance le 01/06/2040	18	0,09	20 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, échéance le 06/04/2030	18	0,10
	54	0,29	20 BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, échéance le 24/02/2050	14	0,07
Brésil — 1,38 % (28 février 2022 : 1,75 %)					
110 Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, échéance le 01/02/2029	105	0,57	13 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, échéance le 26/07/2029	12	0,06
60 Suzano Austria GmbH, série DM3N, 3,125 %, échéance le 15/01/2032	47	0,26	260 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, échéance le 01/05/2032	206	1,12
100 Vale Overseas Ltd, 6,875 %, échéance le 21/11/2036	103	0,55	10 Centene Corp, 4,250 %, échéance le 15/12/2027	9	0,05
	255	1,38	10 Centene Corp, 4,625 %, échéance le 15/12/2029	9	0,05
Canada — 1,11 % (28 février 2022 : 0,96 %)					
30 Banque de Montréal, 1,850 %, échéance le 01/05/2025	28	0,15	40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, échéance le 23/07/2025	39	0,21
20 Bank of Nova Scotia/The, 1,300 %, échéance le 11/06/2025	18	0,10	80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, échéance le 15/03/2028	74	0,40
20 Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, échéance le 30/05/2041	20	0,11	40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, échéance le 01/04/2038	34	0,18
20 Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,950 %, échéance le 23/06/2023	20	0,11	10 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, échéance le 01/07/2049	8	0,04
			40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, échéance le 01/03/2050	29	0,16
			10 Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, échéance le 31/01/2032	8	0,04
			40 UNITE Group Plc/The, 4,375 %, échéance le 15/10/2028	38	0,21
			20 Cigna Corp, 4,800 %, échéance le 15/08/2038	18	0,10
			20 Cigna Corp, 4,900 %, échéance le 15/12/2048	18	0,10
			150 Citigroup Inc, 5,500 %, échéance le 13/09/2025	150	0,82
			200 Citigroup Inc, 2,572 %, échéance le 03/06/2031 *	164	0,89
			10 Citigroup Inc, 8,125 %, échéance le 15/07/2039	13	0,07
			50 Citigroup Inc, 4,650 %, échéance le 23/07/2048	45	0,24
			50 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, échéance le 15/03/2051	33	0,18
			40 Comcast Corp, 4,150 %, échéance le 15/10/2028	38	0,21
			10 Consolidated Edison Co of New York Inc, série 20A, 3,350 %, échéance le 01/04/2030	9	0,05

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

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

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
États-Unis — (suite)					
60 Coterra Energy Inc, 144A, 4,375 %, échéance le 15/03/2029	55	0,30			
30 Deere & Co, 3,750 %, échéance le 15/04/2050	26	0,14			
150 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, échéance le 15/01/2026	155	0,84			
160 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, échéance le 20/10/2028	152	0,82			
40 Devon Energy Corp, 5,850 %, échéance 15/12/2025	40	0,22			
40 Devon Energy Corp, 5,000 %, échéance 15/06/2045	34	0,18			
20 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, échéance le 01/12/2029	18	0,10			
10 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, échéance le 01/12/2026	8	0,05			
30 Elevance Health Inc, 3,650 %, échéance le 01/12/2027	28	0,15			
20 Energy Transfer LP, 5,250 %, échéance le 15/04/2029	20	0,11			
20 Energy Transfer LP, 6,250 %, échéance le 15/04/2049	19	0,10			
10 Energy Transfer LP, série G, 7,125 %, perpétuelle *	9	0,05			
20 EOG Resources Inc, 4,375 %, échéance le 15/04/2030	19	0,10			
20 EOG Resources Inc, 4,950 %, échéance le 15/04/2050	19	0,10			
150 EQT Corp, 5,000 %, échéance le 15/01/2029	141	0,76			
10 Exelon Corp, 5,625 %, échéance le 15/06/2035	10	0,05			
10 Ford Motor Co, 6,100 %, échéance le 19/08/2032	9	0,05			
230 Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, échéance le 28/05/2027	215	1,16			
220 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, échéance le 13/11/2030	184	1,00			
20 General Motors Co, 5,950 %, échéance le 01/04/2049	18	0,10			
20 Home Depot Inc/The, 3,250 %, échéance le 15/04/2032	18	0,10			
40 Home Depot Inc/The, 3,300 %, échéance le 15/04/2040	32	0,17			
20 Humana Inc, 3,700 %, échéance le 23/03/2029	18	0,10			
10 Intel Corp, 5,125 %, échéance le 10/02/2030	10	0,05			
10 JPMorgan Chase & Co, 3,897 %, échéance le 23/01/2049 *	8	0,04			
20 Kinder Morgan Inc, 5,200 %, échéance le 01/03/2048	17	0,09			
40 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, échéance le 08/08/2024	39	0,21			
10 MDC Holdings Inc, 6,000 %, échéance le 15/01/2043	8	0,05			
30 Merck & Co Inc, 1,450 %, échéance le 24/06/2030	24	0,13			
99 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, échéance le 20/06/2027	99	0,54			
40 Mondelez International Inc, 1,500 %, échéance le 04/05/2025	37	0,20			
110 Morgan Stanley, 2,188 %, échéance le 28/04/2026 *	103	0,56			
70 Morgan Stanley, 3,622 %, échéance le 01/04/2031 *	62	0,34			
20 MPLX LP, 4,800 %, échéance le 15/02/2029	19	0,10			
20 MPLX LP, 5,500 %, échéance le 15/02/2049	18	0,10			
20 NIKE Inc, 3,375 %, échéance le 27/03/2050	16	0,08			
40 Northrop Grumman Corp, 3,250 %, échéance le 15/01/2028	37	0,20			
20 Northrop Grumman Corp, 5,250 %, échéance le 01/05/2050	20	0,11			
20 PepsiCo Inc, 1,625 %, échéance le 01/05/2030	16	0,09			
20 Philip Morris International Inc, 2,100 %, échéance le 01/05/2030	16	0,09			
20 Philip Morris International Inc, 4,500 %, échéance le 20/03/2042	17	0,09			
40 Raytheon Technologies Corp, 2,250 %, échéance le 01/07/2030	33	0,18			
10 Raytheon Technologies Corp, 4,500 %, échéance le 01/06/2042	9	0,05			
60 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, échéance le 20/09/2025	60	0,33			
10 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, échéance le 01/02/2031	9	0,05			
10 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, échéance le 15/02/2026	9	0,05			
10 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, échéance le 15/02/2029	9	0,05			
10 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, échéance le 15/04/2030	9	0,05			
70 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, échéance le 15/02/2031	57	0,31			
10 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, échéance le 15/02/2031	8	0,04			
20 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, échéance le 15/04/2031	17	0,09			
20 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, échéance le 01/02/2026	21	0,11			
50 Union Pacific Corp, 2,891 %, échéance le 06/04/2036	39	0,21			
40 Union Pacific Corp, 3,839 %, échéance le 20/03/2060	31	0,17			
10 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, échéance le 15/04/2026	9	0,05			
20 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, échéance le 15/04/2029	18	0,10			
40 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, échéance le 15/05/2030	33	0,18			
20 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, échéance le 15/05/2040	15	0,08			
20 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, échéance le 15/08/2049	16	0,09			
40 US Bancorp, 1,450 %, échéance le 12/05/2025	37	0,20			
10 Verizon Communications Inc, 4,500 %, échéance le 10/08/2033	9	0,05			
20 Visa Inc, 2,050 %, échéance le 15/04/2030	17	0,09			
30 Visa Inc, 4,300 %, échéance le 14/12/2045	27	0,15			
140 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, échéance le 01/02/2050	114	0,62			
20 Williams Cos Inc/The, 4,850 %, échéance le 01/03/2048	17	0,09			
10 Workday Inc, 3,500 %, échéance le 01/04/2027	9	0,05			
10 Workday Inc, 3,700 %, échéance le 01/04/2029	9	0,05			
	4 130	22,39			
Total des obligations et bons d'entreprises (coût 6 987 \$)	5 754	31,20			
Obligations et bons d'État — 27,36 % (28 février 2022 : 33,90 %)					
Bésil — 1,33 % (28 février 2022 : 1,98 %)					
BRL 579 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTN-F, 10,000 %, échéance le 01/01/2033	91	0,50			
200 Obligation internationale de l'État brésilien, 5,000 %, échéance le 27/01/2045	154	0,83			
	245	1,33			
Indonésie — 2,35 % (28 février 2022 : 2,20 %)					
200 Obligation internationale de l'État indonésien, 4,625 %, échéance le 15/04/2043	184	1,00			
IDR 1 145 000 Bon du Trésor indonésien, série FR59, 7,000 %, échéance le 15/05/2027	76	0,41			
IDR 2 677 000 Bon du Trésor indonésien, série FR87, 6,500 %, échéance le 15/02/2031	173	0,94			
	433	2,35			
Mexique — 7,42 % (28 février 2022 : 6,36 %)					
MXN 25 890 Mexican Bonos, série M, 7,750 %, échéance le 13/11/2042	1 214	6,58			
200 Obligation internationale de l'État mexicain, 4,350 %, échéance le 15/01/2047	155	0,84			
	1 369	7,42			
Pérou — 0,17 % (28 février 2022 : 0,29 %)					
30 Obligation internationale de l'État péruvien, 6,550 %, échéance le 14/03/2037	32	0,17			
Russie — 0,12 % (28 février 2022 : 0,84 %)					
RUB 33 741 Obligation fédérale russe — OFZ, 0,000 %, échéance le 23/05/2029 ty	22	0,12			
États-Unis — 15,97 % (28 février 2022 : 21,99 %)					
240 Obligations indexées sur l'inflation du Trésor des États-Unis, 1,125 %, échéance le 15/01/2033 B	231	1,25			
60 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 0,375 %, échéance le 31/12/2025	53	0,29			
10 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 30/04/2027	9	0,05			
280 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 0,625 %, échéance le 31/12/2027	237	1,28			
210 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 1,125 %, échéance le 29/02/2028	181	0,98			
10 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 0,625 %, échéance le 15/08/2030	8	0,04			
10 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 15/02/2032	8	0,05			
230 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 1,750 %, échéance le 15/08/2041	159	0,87			
10 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 2,375 %, échéance le 15/02/2042	8	0,04			
90 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 4,000 %, échéance le 15/05/2042	89	0,48			
50 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2049	41	0,22			
50 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/08/2049	36	0,20			
200 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 1,375 %, échéance le 15/08/2050	115	0,62			
230 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 1,625 %, échéance le 15/11/2050	141	0,76			
470 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 15/02/2051	307	1,67			
630 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 2,375 %, échéance le 15/05/2051	463	2,51			
50 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 2,000 %, échéance le 15/08/2051	34	0,18			
370 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 15/11/2051	241	1,31			
152 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/02/2052	108	0,59			
367 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2052	301	1,63			
160 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/08/2052	134	0,73			
40 Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 4,000 %, échéance le 15/11/2052	41	0,22			
	2 945	15,97			
Total des obligations et bons d'État (coût 6 765 \$)	5 046	27,36			
Billets d'emprunt — 5,39 % (28 février 2022 : 7,67 %)					
51 1011778 BC ULC, 6,320 %, échéance le 14/11/2026 *	51	0,28			
59 Allied Universal Holdco LLC, 8,411 %, échéance le 14/05/2028 *	57	0,31			
10 AmWINS Group, Inc., 6,820 %, échéance le 17/02/2028 *	10	0,05			
20 Brown Group Holding LLC, 7,047 %, échéance le 07/06/2028 *	20	0,11			
69 Charter Communications Operating LLC, 6,320 %, échéance le 30/04/2025 *	68	0,37			
49 Citadell Securities, 7,176 %, échéance le 27/02/2028 *	49	0,27			
10 DCert Buyer, Inc., 8,696 %, échéance le 16/10/2026 *	10	0,05			
44 Energizer Holdings, Inc., 6,928 %, échéance le 16/12/2027 *	44	0,24			
20 Gainwell Acquisition Corp, 8,730 %, échéance le 01/10/2027 *	19	0,10			
69 Genesee & Wyoming Inc, 6,730 %, échéance le 30/12/2026 *	68	0,37			
65 Grifols Worldwide Operations USA Inc, 6,570 %, échéance le 15/11/2027 *	64	0,35			
10 GVC Holdings Gibraltar Ltd, 7,230 %, échéance le 16/03/2027 *	10	0,05			
59 Harbour Freight Tools USA Inc, 7,320 %, échéance le 19/10/2027 *	57	0,31			
50 Hunter Douglas Inc, 7,859 %, échéance le 09/02/2029 *	46	0,25			
24 ICON Luxembourg Sarl, 7,000 %, échéance le 01/07/2028 *	24	0,13			
9 iHeartCommunications Inc, 7,570 %, échéance le 01/05/2026 *	9	0,05			
6 Indigo Merger Sub, Inc., 7,000 %, échéance le 01/07/2028 *	6	0,03			
36 Jazz Financing Lux Sarl, 8,070 %, échéance le 22/04/2028 *	35	0,19			
35 Nexstar Broadcasting Inc, 7,070 %, échéance le 19/09/2026 *	35	0,19			
20 Quikrete Holdings, Inc., 7,570 %, échéance le 11/06/2028 *	20	0,11			
10 Rackspace Technology Global, Inc, 7,595 %, échéance le 09/02/2028 *	6	0,03			
60 Sotera Health, 7,575 %, échéance le 13/12/2026 *	58	0,31			
29 Station Casinos LLC, 6,820 %, échéance le 08/02/2027 *	29	0,16			
18 UFC Holding LLC, 7,570 %, échéance le 29/04/2026 *	18	0,10			
29 United Airlines Inc, 8,568 %, échéance le 14/04/2028 *	29	0,16			
20 Unison Communications Inc, 7,820 %, échéance le 24/03/2026 *	10	0,05			
69 Verscend Holding Corp., 8,570 %, échéance le 27/08/2025 *	69	0,37			
60 Virgin Media Bristol LLC, 7,088 %, échéance le 04/01/2028 *	59	0,32			
15 Zebra Buyer LLC, 7,750 %, échéance le 22/04/2028 *	15	0,08			
Total des billets d'emprunt (coût 1 014 \$)	995	5,39			

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

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

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Contrats (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Organismes de placement collectif — 7,28 % (28 février 2022 : 5,54 %)					
1 342 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	1 342	7,28	– U.S. 5 Year, avril 2023, achat 108,75, échéance le 24/03/2023 – Morgan Stanley	–	–
Total des organismes de placement collectif (coût 1 342 \$)	1 342	7,28	– U.S. 5 Year, avril 2023, achat 109,00, échéance le 24/03/2023 – Morgan Stanley	–	–
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (coût 20 717 \$)			– U.S. 5 Year, avril 2023, achat 109,75, échéance le 24/03/2023 – Morgan Stanley	–	–
	17 280	93,70	– U.S. 5 Year, avril 2023, achat 110,00, échéance le 24/03/2023 – Morgan Stanley	–	–
			– U.S. 5 Year, avril 2023, achat 110,50, échéance le 24/03/2023 – Morgan Stanley	–	–
			– U.S. 5 Year, avril 2023, achat 108,25, échéance le 24/03/2023 – Morgan Stanley	(3)	(0,02)
			– Obligation des États-Unis, avril 2023, achat 128,00, échéance le 24/03/2023 – Morgan Stanley	(1)	(0,01)
			– Obligation des États-Unis, avril 2023, achat 124,00, échéance le 24/03/2023 – Morgan Stanley	(1)	(0,01)
			Total des options souscrites (coût 39 \$)	(38)	(0,21)
			Swaps d'indices — (0,01 %) (28 février 2022 : 0,00 %)		
			Moins-valeur latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(2)	(0,01)
			Contrats de change à terme — (0,31 %) (28 février 2022 : (0,86 %))		
			Moins-valeur latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(58)	(0,31)
			Contrats à terme standardisés — (0,65 %) (28 février 2022 : (2,43 %))		
			Moins-valeur latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(120)	(0,65)
			Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	(218)	(1,18)
			Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	18 147	98,41
			Autres éléments de l'actif hors passif	294	1,59
			Total des actifs nets	18 441 \$	100,00
			– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.		
			144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 1 457 000 \$, soit 7,93 % de l'actif net.		
			* Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.		
			± Titres achetés sur la base d'une détermination future.		
			β Le taux d'intérêt de ce type de titre est lié à l'indice des prix à la consommation (IPC)/indice des prix de détail (Retail Price Index - RPI). Le taux du coupon est celui au 28 février 2023.		
			+ Illiquide.		
			γ Le titre ne génère plus de revenus pendant et/ou après l'exercice clos le 28 février 2023 en raison de l'incertitude des paiements d'intérêts.		
			ABRÉVIATIONS :		
			Perpétuelle – Obligation sans date d'échéance. Les obligations perpétuelles ne sont pas rachetables, mais paient des intérêts réguliers.		
			REMIC – Société relais de placements immobiliers hypothécaires (Real Estate Mortgage Investment Conduit).		
			TBA – À communiquer.		
			BRL – Réal brésilien		
			IDR – Rupiah indonésienne		
			MXN – Peso mexicain		
			RUB – Rouble russe		
			Analyse de l'actif total		% de l'actif total
			Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé		77,33
			Autres valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé		5,15
			Organismes de placement collectif		6,94
			Instruments financiers dérivés		5,61
			Autres actifs		4,97
			Actif total		100,00

Tableau des swaps sur risque de crédit

Contrepartie	Entité de référence – protection achat/vente	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Morgan Stanley	CDX.NA.HY, 5,000 % – vente	20 déc. 2027	490	\$ 8
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % – vente	20 déc. 2027	4 702	49
Plus-valeur latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : 171 \$)				\$ 57
Moins-valeur latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				–
Plus-valeur nette des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : 171 \$)				\$ 57

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

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

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des swaps d'indices

Contrepartie	Entité de référence	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Morgan Stanley	Paie fixe 1,130 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15 août 2028	613	\$ 83
Morgan Stanley	Paie fixe 1,220 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15 août 2028	122	16
Morgan Stanley	Paie fixe 1,520 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15 fév. 2047	325	98
Morgan Stanley	Paie fixe 1,630 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15 mai 2047	1 540	440
Morgan Stanley	Paie fixe 1,650 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15 août 2047	73	21
Morgan Stanley	Paie fixe 2,000 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	18 mars 2032	239	30
Morgan Stanley	Paie fixe 2,500 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	21 avr. 2052	150	21
Morgan Stanley	Paie fixe 2,600 %, reçoit flottant USD SOFR OIS Compound	15 fév. 2048	285	37
Morgan Stanley	Paie fixe 2,850 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	15 fév. 2029	377	20
Morgan Stanley	Paie fixe 3,050 %, reçoit flottant USD SOFR OIS Compound	15 fév. 2048	139	7
Morgan Stanley	Paie fixe 3,250 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	30 sep. 2029	568	17
Morgan Stanley	Paie fixe 3,270 %, reçoit flottant USD SOFR Compound	30 avr. 2029	1 665	52
Morgan Stanley	Paie fixe 3,850 %, reçoit flottant USD SOFR OIS Compound	30 juin 2029	1 002	(2)
Plus-value latente des swaps d'indices (28 février 2022 (en milliers) : 238 \$)				\$ 842
Moins-value latente des swaps d'indices (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				(2)
Moins-value nette des swaps d'indices (28 février 2022 (en milliers) : 238 \$)				\$ 840

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
18 avr. 2023	BNP Paribas	Achat	USD 156	Vente	EUR 144	\$ 3
18 avr. 2023	Goldman Sachs	Achat	USD 223	Vente	MXN 4 418	(16)
18 avr. 2023	Goldman Sachs	Achat	JPY 9 295	Vente	USD 71	(2)
18 avr. 2023	JP Morgan	Achat	USD 669	Vente	CNH 4 585	7
18 avr. 2023	JP Morgan	Achat	IDR 439 327	Vente	USD 28	1
18 avr. 2023	JP Morgan	Achat	CAD 1 012	Vente	USD 757	(16)
18 avr. 2023	Morgan Stanley	Achat	NOK 1 920	Vente	EUR 181	(6)
18 avr. 2023	Morgan Stanley	Achat	USD 38	Vente	GBP 31	–
18 avr. 2023	Morgan Stanley	Achat	AUD 771	Vente	USD 538	(18)
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 120 \$)						\$ 11
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (189) \$)						(58)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (69) \$)						\$ (47)

Tableau des contrats à terme standardisés

	Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
Indice SOFR 3 mois décembre 2023	Morgan Stanley	(40)	\$ (9 475)	\$ 82
Indice SOFR 3 mois décembre 2024	Morgan Stanley	(20)	(4 809)	13
Indice SOFR 3 mois décembre 2025	Morgan Stanley	4	966	2
Indice SOFR 3 mois septembre 2023	Morgan Stanley	2	473	(3)
90 Day Euro\$, mars 2023	Morgan Stanley	1	237	–
Obligation australienne 10 ans, mars 2023	Morgan Stanley	5	396	(16)
Devise dollar australien, mars 2023	Morgan Stanley	3	202	(4)
Devise euro, mars 2023	Morgan Stanley	3	397	(5)
Euro-Bund mars 2023	Morgan Stanley	1	141	(5)
Obligation Euro-Buxl 30 ans, mars 2023	Morgan Stanley	(1)	(142)	28
Euro-OAT, mars 2023	Morgan Stanley	2	270	(20)
Fed Fund 30 jours, février 2023	Morgan Stanley	(10)	(3 976)	(1)
Devise yen japonais, mars 2023	Morgan Stanley	4	368	(4)
Long Gilt juin 2023	Morgan Stanley	2	240	(1)
Devise peso mexicain, mars 2023	Morgan Stanley	7	191	12
U.S. 10 Year Note (CBT), juin 2023	Morgan Stanley	15	1 675	(1)
U.S. 10 Year Ultra Note, juin 2023	Morgan Stanley	(9)	(1 055)	(1)
U.S. 2 Year Note (CBT), juin 2023	Morgan Stanley	(9)	(1 834)	3
U.S. 5 Year Note (CBT), juin 2023	Morgan Stanley	112	11 990	(30)
U.S. Long Bond (CBT), juin 2023	Morgan Stanley	(18)	(2 254)	16
U.S. Ultra Bond (CBT) juin 2023	Morgan Stanley	31	4 187	(29)
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 191 \$)				\$ 156
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (533) \$)				(120)
Plus-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (342) \$)				\$ 36

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative		
Obligations et bons d'entreprises — 86,70 % (28 février 2022 : 92,11 %)				EUR	100	Segro Capital Sarl, 1,875 %, échéance le 23/03/2030	89	0,99	
Australie — 1,16 % (28 février 2022 : 1,25 %)				EUR	100	SSE Plc, 4,000 %, perpétuelle *	96	1,07	
EUR	100	AusNet Services Holdings Pty Ltd, 1,625 %, échéance le 11/03/2081 *	89	0,99	200	Standard Chartered Plc, 144A, 2,608 %, échéance le 12/01/2028 *	178	1,98	
	20	Westpac Banking Corp, 2,668 %, échéance le 15/11/2035 *	16	0,17	GBP	100	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,500 %, échéance le 02/05/2025	114	1,27
			105	1,16			1 184	13,16	
Belgique — 2,09 % (28 février 2022 : 2,46 %)				États-Unis — 27,59 % (28 février 2022 : 29,46 %)					
EUR	100	Elia Transmission Belgium SA, 3,625 %, échéance le 18/01/2033	103	1,14	50	AbbVie Inc, 3,200 %, échéance le 21/11/2029	44	0,49	
EUR	100	UCB SA, 1,000 %, échéance le 30/03/2028	85	0,95	60	AbbVie Inc, 4,875 %, échéance le 14/11/2048	55	0,61	
			188	2,09	100	Air Lease Corp, 1,875 %, échéance le 15/08/2026	87	0,97	
Canada — 0,94 % (28 février 2022 : 0,00 %)				10	Air Lease Corp, 5,300 %, échéance le 01/02/2028	10	0,11		
	90	Toronto-Dominion Bank/The, 4,456 %, échéance le 08/06/2032	85	0,94	20	Amgen Inc, 5,250 %, échéance le 02/03/2033	20	0,22	
Danemark — 3,39 % (28 février 2022 : 2,14 %)				20	Amgen Inc, 5,650 %, échéance le 02/03/2053	20	0,22		
	200	Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, échéance le 12/01/2024	199	2,22	130	AT&T Inc, 3,500 %, échéance le 15/09/2053	89	0,99	
EUR	100	Orsted AS, 3,625 %, échéance le 01/03/2026	106	1,17	60	Bank of America Corp, 3,550 %, échéance le 05/03/2024 *	60	0,67	
			305	3,39	80	Bank of America Corp, 2,676 %, échéance le 19/06/2041 *	55	0,61	
Finlande — 1,01 % (28 février 2022 : 1,09 %)				19	Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, échéance le 26/07/2029	18	0,19		
EUR	100	Neste Oyj, 0,750 %, échéance le 25/03/2028	90	1,01	40	Centene Corp, 4,625 %, échéance le 15/12/2029	37	0,41	
France — 8,18 % (28 février 2022 : 10,08 %)				60	Cigna Corp, 2,400 %, échéance le 15/03/2030	50	0,56		
EUR	100	AXA SA, 5,125 %, échéance le 04/07/2043 *	106	1,18	60	Cigna Corp, 3,400 %, échéance le 15/03/2050	42	0,47	
	230	BNP Paribas SA, 144A, 3,052 %, échéance le 13/01/2031 *	195	2,16	60	Citigroup Inc, 8,125 %, échéance le 15/07/2039	76	0,85	
EUR	100	Engie SA, 0,500 %, échéance le 24/10/2030	81	0,91	50	Coca-Cola Co/The, 2,500 %, échéance le 15/03/2051	33	0,36	
EUR	200	GELF Bond Issuer I SA, 1,125 %, échéance le 18/07/2029	166	1,84	90	Comcast Corp, 4,150 %, échéance le 15/10/2028	86	0,96	
EUR	100	Orange SA, 5,000 %, perpétuelle *	106	1,18	80	CVS Health Corp, 5,050 %, échéance le 25/03/2048	72	0,80	
EUR	100	Terega SA, 0,875 %, échéance le 17/09/2030	82	0,91	20	Devon Energy Corp, 5,000 %, échéance le 15/06/2045	17	0,19	
			736	8,18	30	Elevance Health Inc, 3,650 %, échéance le 01/12/2027	28	0,31	
Allemagne — 9,60 % (28 février 2022 : 9,38 %)				70	Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, échéance le 15/02/2078 *	59	0,65		
	200	Allianz SE, 3,200 %, perpétuelle *	151	1,68	30	Exelon Corp, 3,400 %, échéance le 15/04/2026	28	0,31	
EUR	100	alstria office REIT-AG, 1,500 %, échéance le 15/11/2027	77	0,86	70	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,375 %, échéance le 27/03/2025	73	0,82	
EUR	100	Amprion GmbH, 3,971 %, échéance le 22/09/2032	105	1,17	80	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, échéance le 22/05/2045	74	0,83	
	60	Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750 %, échéance le 15/06/2030	71	0,79	80	HCA Inc, 3,500 %, échéance le 01/09/2030	69	0,77	
EUR	100	Hannover Rueck SE, 1,125 %, échéance le 09/10/2039 *	83	0,92	30	Humana Inc, 3,125 %, échéance le 15/08/2029	26	0,29	
EUR	100	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG à Muenchen, 3,250 %, échéance le 26/05/2049 *	96	1,06	10	Humana Inc, 5,875 %, échéance le 01/03/2033	10	0,11	
EUR	100	Sirius Real Estate Ltd, 1,125 %, échéance le 22/06/2026	85	0,95	100	JPMorgan Chase & Co, 1,090 %, échéance le 11/03/2027 *	96	1,07	
EUR	120	Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, échéance le 01/10/2024	122	1,36	50	Lowe's Cos Inc, 3,000 %, échéance le 15/10/2050	32	0,35	
EUR	100	Vonovia SE, 0,750 %, échéance le 01/09/2032	73	0,81	70	McDonald's Corp, 3,700 %, échéance le 30/01/2026	68	0,75	
			863	9,60	120	Microsoft Corp, 2,921 %, échéance le 17/03/2052	87	0,96	
Irlande — 1,33 % (28 février 2022 : 1,44 %)				100	Morgan Stanley, 3,622 %, échéance le 01/04/2031 *	89	0,99		
	150	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, échéance le 30/01/2032	120	1,33	10	Morgan Stanley, 5,948 %, échéance le 19/01/2038 *	10	0,11	
Italie — 4,25 % (28 février 2022 : 4,79 %)				30	MPLX LP, 4,500 %, échéance le 15/04/2038	26	0,29		
	150	Enel Finance International NV, 144A, 6,000 %, échéance le 07/10/2039	143	1,59	EUR	100	Prologis Euro Finance LLC, 3,875 %, échéance le 31/01/2030	103	1,14
	200	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, échéance le 01/06/2032 *	151	1,68	30	Prudential Financial Inc, 3,000 %, échéance le 10/03/2040	22	0,25	
EUR	100	Terna — Rete Elettrica Nazionale, 2,375 %, perpétuelle *	89	0,98	EUR	100	Schneider Electric SE, 3,375 %, échéance le 13/04/2034	103	1,14
			383	4,25	80	Texas Instruments Inc, 3,875 %, échéance le 15/03/2039	71	0,79	
Pays-Bas — 4,04 % (28 février 2022 : 4,23 %)				90	UnitedHealth Group Inc, 4,000 %, échéance le 15/05/2029	85	0,95		
EUR	80	ABN AMRO Bank NV, 1,000 %, échéance le 16/04/2025	80	0,90	120	Verizon Communications Inc, 5,250 %, échéance le 16/03/2037	117	1,30	
EUR	200	Coöperatieve Rabobank UA, 3,250 %, perpétuelle *	180	2,00	90	Visa Inc, 4,300 %, échéance le 14/12/2045	81	0,90	
EUR	100	ING Groep NV, 2,500 %, échéance le 15/02/2029 *	103	1,14	20	Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,050 %, échéance le 15/03/2042	16	0,18	
			363	4,04	EUR	100	Wells Fargo & Co, 1,000 %, échéance le 02/02/2027	94	1,04
Portugal — 1,02 % (28 février 2022 : 1,05 %)				60	Wells Fargo & Co, 5,013 %, échéance le 04/04/2051 *	55	0,62		
EUR	100	EDP — Energias de Portugal SA, 1,875 %, échéance le 02/08/2081 *	91	1,02	130	Williams Cos Inc/The, 3,500 %, échéance le 15/10/2051	89	0,99	
Afrique du Sud — 2,16 % (28 février 2022 : 2,18 %)						2 482	27,59		
	200	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, échéance le 10/04/2027	194	2,16	Total des obligations et bons d'entreprises (coût 9 466 \$)			7 798	86,70
Espagne — 1,67 % (28 février 2022 : 1,89 %)				Obligations et bons d'État — 8,26 % (28 février 2022 : 2,87 %)					
EUR	100	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 1,375 %, échéance le 26/01/2032	87	0,96	Allemagne — 3,90 % (28 février 2022 : 0,00 %)				
	60	Telefonica Emisiones SA, 7,045 %, échéance le 20/06/2036	63	0,71	EUR	100	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, échéance le 15/02/2029	92	1,02
			150	1,67	EUR	90	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/08/2029	81	0,90
Suède — 1,18 % (28 février 2022 : 1,14 %)				EUR	70	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, série 03, 4,750 %, échéance le 04/07/2034	89	0,99	
EUR	100	Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, échéance le 02/03/2028 *	106	1,18	EUR	70	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, série 2007, 4,250 %, échéance le 04/07/2039	89	0,99
Suisse — 3,93 % (28 février 2022 : 4,36 %)						351	3,90		
	200	Credit Suisse Group AG, 6,375 %, perpétuelle *†‡	148	1,65	États-Unis — 4,36 % (28 février 2022 : 2,87 %)				
EUR	200	UBS Group AG, 1,500 %, échéance le 30/11/2024	205	2,28	140	Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 2,000 %, échéance le 15/02/2025	133	1,48	
			353	3,93	50	Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2032	46	0,51	
Royaume-Uni — 13,16 % (28 février 2022 : 13,23 %)				40	Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 15/08/2032	36	0,40		
EUR	100	Annington Funding Plc, 1,650 %, échéance le 12/07/2024	101	1,12	10	Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 4,125 %, échéance le 15/11/2032	10	0,11	
GBP	100	Associated British Foods Plc, 2,500 %, échéance le 16/06/2034	96	1,07	112	Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/02/2052	80	0,89	
EUR	100	Barclays Plc, 3,375 %, échéance le 02/04/2025 *	105	1,17	40	Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2052	33	0,37	
GBP	100	Barclays Plc, 1,700 %, échéance le 03/11/2026 *	109	1,21	40	Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/08/2052	34	0,37	
	200	HSBC Holdings Plc, 4,950 %, échéance le 31/03/2030	193	2,14	20	Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 4,000 %, échéance le 15/11/2052	20	0,23	
GBP	100	Lloyds Banking Group Plc, 1,985 %, échéance le 15/12/2031 *	103	1,14			392	4,36	
					Total des obligations et bons d'État (coût 806 \$)			743	8,26
				Organismes de placement collectif — 0,33 % (28 février 2022 : 0,65 %)					
					30	Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund — Class WA (Distributing)	30	0,33	
				Total des organismes de placement collectif (Coût 30 \$)				30	0,33
				Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (coût 10 302 \$)				8 571	95,29

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Contrats de change à terme — 1,02 % (28 février 2022 : 2,73 %)		
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	92	1,02
Contrats à terme standardisés — 0,66 % (28 février 2022 : 0,21 %)		
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	59	0,66
Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat	8 722	96,97
Contrats de change à terme — (1,18 %) (28 février 2022 : (0,26 %))		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(107)	(1,18)
Contrats à terme standardisés — (0,05 %) (28 février 2022 : 0,00 %)		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(5)	(0,05)
Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	(112)	(1,23)
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	8 610	95,74
Autres éléments de l'actif hors passif	385	4,26
Total des actifs nets	8 995 \$	100,00

– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 1 076 000 \$, soit 11,97 % de l'actif net.

* Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.

† Liquidité à compter de l'exercice clos le 28 février 2023.

⋈ Le titre est en défaut à la date de clôture ou à compter de la clôture de l'exercice clos le 28 février 2023 (capital et/ou intérêts).

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)	Devise de vente (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
02 mars 2023	BNY Mellon	Achat USD	2 658	28
02 mars 2023	BNY Mellon	Achat BRL	13 773	(76)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat USD	4	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat USD	1	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat GBP	33	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat EUR	76	(2)
04 avr. 2023	BNY Mellon	Achat BRL	13 347	(29)
16 mai 2023	BNP Paribas	Achat USD	166	2
16 mai 2023	Citi	Achat USD	1 946	27
16 mai 2023	Citi	Achat USD	427	3
16 mai 2023	Citi	Achat EUR	6	–
16 mai 2023	Goldman Sachs	Achat USD	1 952	28
16 mai 2023	JP Morgan	Achat USD	101	2
16 mai 2023	Morgan Stanley	Achat USD	156	2
16 mai 2023	Morgan Stanley	Achat USD	13	–
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 270 \$)				\$ 92
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (26) \$)				(107)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 244 \$)				\$ (15)

Tableau des contrats à terme standardisés

	Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
Euro-Bobl, mars 2023	Morgan Stanley	(6)	\$ (731)	\$ 27
Euro-Bund mars 2023	Morgan Stanley	(1)	(141)	5
Obligation Euro-Buxl 30 ans, mars 2023	Morgan Stanley	(1)	(142)	27
Long Gilt juin 2023	Morgan Stanley	1	120	(1)
U.S. 5 Year Note (CBT), juin 2023	Morgan Stanley	8	857	(3)
U.S. Long Bond (CBT), juin 2023	Morgan Stanley	4	501	(1)
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 21 \$)				\$ 59
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				(5)
Plus-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 21 \$)				\$ 54

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — 14,55 % (28 février 2022 : 7,64 %)			
Allemagne — 5,33 % (28 février 2022 : 0,00 %)			
	8 900 Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,250 %, échéance le 19/10/2023	8 630	5,33
Supranational — 9,22 % (28 février 2022 : 7,64 %)			
RUB	368 000 International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, échéance le 22/01/2026	3 254	2,01
ZAR	56 200 International Bank for Reconstruction & Development, 6,500 %, échéance le 21/01/2027	2 852	1,76
RUB	349 000 International Bank for Reconstruction & Development, 6,750 %, échéance le 21/01/2027	3 038	1,87
MXN	62 000 International Bank for Reconstruction & Development, 7,250 %, échéance le 21/01/2027	3 097	1,91
BRL	15 600 International Bank for Reconstruction & Development, 9,500 %, échéance le 09/02/2029	2 705	1,67
		14 946	9,22
Total des obligations et bons d'entreprises (coût 27 104 \$)		23 576	14,55
Obligations et bons d'État — 84,35 % (28 février 2022 : 90,20 %)			
Brésil — 4,34 % (28 février 2022 : 3,35 %)			
BRL	38 410 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTN-F, 10,000 %, échéance le 01/01/2025	7 033	4,34
Canada — 2,83 % (28 février 2022 : 0,00 %)			
CAD	6 500 Province de Manitoba Canada, 2,450 %, échéance le 02/06/2025	4 585	2,83
Chili — 0,87 % (28 février 2022 : 0,74 %)			
	1 690 Obligation internationale de l'État chilien, 2,450 %, échéance le 31/01/2031	1 413	0,87
Colombie — 4,89 % (28 février 2022 : 4,14 %)			
COP	51 000 000 TES colombien, série B, 6,000 %, échéance le 28/04/2028	7 920	4,89
Allemagne — 5,44 % (28 février 2022 : 0,00 %)			
EUR	9 000 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, échéance le 15/08/2032	8 814	5,44
Mexique — 13,18 % (28 février 2022 : 10,64 %)			
MXN	94 700 Mexican Bonos, série M, 20, 8,500 %, échéance le 31/05/2029	4 952	3,06
MXN	101 000 Mexican Bonos, série M, 30, 8,500 %, échéance le 18/11/2038	5 157	3,18
MXN	99 700 Mexican Bonos, série M, 7,750 %, échéance le 13/11/2042	4 675	2,89
MXN	137 000 Mexican Bonos, série M, 8,000 %, échéance le 07/11/2047	6 568	4,05
		21 352	13,18
Nouvelle-Zélande — 1,27 % (28 février 2022 : 4,10 %)			
NZD	2 370 Obligation de l'État néo-zélandais, série 0534, 4,250 %, échéance le 15/05/2034	1 420	0,88
NZD	1 480 Obligation de l'État néo-zélandais, série 0551, 2,750 %, échéance le 15/05/2051	642	0,39
		2 062	1,27
Norvège — 3,78 % (28 février 2022 : 4,30 %)			
NOK	63 700 Obligation de l'État norvégien, série 475, 144A, 2,000 %, échéance le 24/05/2023	6 120	3,78
Pologne — 4,34 % (28 février 2022 : 5,99 %)			
PLN	46 010 Obligation de l'État polonais, série 0432, 1,750 %, échéance le 25/04/2032	7 036	4,34
Afrique du Sud — 4,06 % (28 février 2022 : 4,07 %)			
ZAR	92 900 Obligation de l'État sud-africain, série R214, 6,500 %, échéance le 28/02/2041	3 188	1,97
ZAR	79 600 Obligation de l'État sud-africain, série 2048, 8,750 %, échéance le 28/02/2048	3 382	2,09
		6 570	4,06
Corée du Sud — 5,42 % (28 février 2022 : 5,42 %)			
KRW	13 300 000 Bon du Trésor coréen, série 4412, 2,750 %, échéance le 10/12/2044	8 781	5,42
Royaume-Uni — 4,35 % (28 février 2022 : 5,31 %)			
GBP	5 940 Fonds d'État du Royaume-Uni, 0,750 %, échéance le 22/07/2023	7 053	4,35

Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
États-Unis — 29,58 % (28 février 2022 : 24,77 %)			
	10 720 Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 3,334 %, échéance le 31/07/2024 *	10 717	6,62
	27 980 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 15/11/2051	18 206	11,24
	12 910 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/02/2052	9 209	5,68
	11 640 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/08/2052	9 788	6,04
		47 920	29,58
Total des obligations et bons d'État (coût 166 098 \$)		136 659	84,35
Organismes de placement collectif — 2,53 % (28 février 2022 : 1,92 %)			
	4 095 Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	4 095	2,53
Total des organismes de placement collectif (coût 4 095 \$)		4 095	2,53
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (coût 197 297 \$)			
		164 330	101,43
Contrats de change à terme : 1,94 % (28 février 2022 : 1,98 %)			
	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	3 132	1,94
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat			
		167 462	103,37
Contrats de change à terme : (2,45 % (28 février 2022 : (2,08 %)))			
	Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(3 966)	(2,45)
Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat			
		(3 966)	(2,45)
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat			
		163 496	100,92
Excédent du passif par rapport aux autres éléments de l'actif			
		(1 487)	(0,92)
Total des actifs nets		162 009 \$	100,00

– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 6 120 000 \$, soit 3,78 % de l'actif net.

* Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.

ABRÉVIATIONS :

BRL	– Réal brésilien
CAD	– Dollar canadien
COP	– Peso colombien
EUR	– Euro
GBP	– Livre britannique
KRW	– Won sud-coréen
MXN	– Peso mexicain
NOK	– Couronne norvégienne
NZD	– Dollar néo-zélandais
PLN	– Zloty polonais
RUB	– Rouble russe
ZAR	– Rand sud-africain

	% de l'actif total
Analyse de l'actif total	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	94,02
Organismes de placement collectif	2,40
Instruments financiers dérivés	1,84
Autres actifs	1,74
Actif total	100,00

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
03 mars 2023	HSBC	Achat	USD 1 834	Vente	GBP 1 490	\$ 41
03 mars 2023	JP Morgan	Achat	USD 8 919	Vente	GBP 7 410	5
03 mars 2023	JP Morgan	Achat	GBP 8 900	Vente	USD 10 941	(235)
06 mars 2023	HSBC	Achat	USD 5 121	Vente	CLP 4 510 000	(323)
06 mars 2023	HSBC	Achat	USD 4 307	Vente	CLP 3 470 000	118
06 mars 2023	HSBC	Achat	CLP 7 980 000	Vente	USD 8 781	852
07 mars 2023	HSBC	Achat	AUD 520	Vente	USD 350	1
07 mars 2023	JP Morgan	Achat	USD 4 130	Vente	AUD 6 070	44
07 mars 2023	JP Morgan	Achat	AUD 6 660	Vente	USD 4 625	(142)
08 mars 2023	Citi	Achat	USD 4 746	Vente	KRW 6 170 000	79
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR –	Vente	AUD –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP 98	Vente	AUD 172	3
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 358	Vente	AUD 559	4
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 545	Vente	AUD 786	16
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 695	Vente	CAD 932	12
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 458	Vente	CAD 663	(2)
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR –	Vente	CAD 1	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP 126	Vente	CAD 204	2
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR –	Vente	CNY 1	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 1 464	Vente	CNY 9 920	33
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP 264	Vente	CNY 2 158	7
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 963	Vente	CNY 7 056	2
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP –	Vente	CNY –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 71	Vente	DKK 530	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR –	Vente	DKK –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 108	Vente	DKK 745	2
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP 20	Vente	DKK 163	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	ILS 15	Vente	EUR 3	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SEK 3	Vente	EUR –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD 8	Vente	EUR 6	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SEK 23	Vente	EUR 2	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 52	Vente	EUR 49	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP –	Vente	EUR –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP 2 066	Vente	EUR 2 304	45
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD 31	Vente	EUR 19	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD –	Vente	EUR –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD –	Vente	EUR –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 11 744	Vente	EUR 10 867	242
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	ILS –	Vente	EUR –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD –	Vente	EUR –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	PLN 26	Vente	EUR 6	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD 4	Vente	EUR 2	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CNY 32	Vente	EUR 4	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	JPY 1	Vente	EUR –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CNY 351	Vente	EUR 47	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CAD –	Vente	EUR –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	MXN 196	Vente	EUR 8	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CAD 34	Vente	EUR 25	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	DKK –	Vente	EUR –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	DKK 28	Vente	EUR 3	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NOK –	Vente	EUR –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NOK 24	Vente	EUR 2	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	JPY 27 005	Vente	EUR 187	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	JPY 6 869	Vente	GBP 43	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NOK 5	Vente	GBP –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	JPY 3	Vente	GBP –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD –	Vente	GBP –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	PLN –	Vente	GBP –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	ILS 3	Vente	GBP –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NOK –	Vente	GBP –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SEK 1	Vente	GBP –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD –	Vente	GBP –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SEK 4	Vente	GBP –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 1 694	Vente	GBP 1 406	5
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD –	Vente	GBP –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	MXN 49	Vente	GBP 2	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	MXN –	Vente	GBP –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	ILS –	Vente	GBP –	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 110	Vente	GBP 94	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	PLN 5	Vente	GBP –	–

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des Contrats de change à terme – (suite)

								Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)				
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD	2	Vente	GBP	–	\$ –
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD	–	Vente	GBP	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD	6	Vente	GBP	4	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CAD	–	Vente	GBP	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	DKK	5	Vente	GBP	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CNY	93	Vente	GBP	10	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CAD	7	Vente	GBP	5	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CNY	3	Vente	GBP	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	DKK	–	Vente	GBP	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	1 184	Vente	GBP	1 061	(25)
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	–	Vente	GBP	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	116	Vente	ILS	398	7
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	–	Vente	ILS	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	–	Vente	ILS	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	77	Vente	ILS	283	4
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	21	Vente	ILS	87	2
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	3 511	Vente	JPY	499 103	44
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	5 334	Vente	JPY	701 458	174
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	–	Vente	JPY	9	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	962	Vente	JPY	152 690	35
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	–	Vente	JPY	1	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	–	Vente	MXN	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	185	Vente	MXN	3 842	(13)
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	–	Vente	MXN	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	50	Vente	MXN	1 176	(3)
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	282	Vente	MXN	5 399	(13)
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	–	Vente	NOK	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	66	Vente	NOK	670	1
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	44	Vente	NOK	477	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	12	Vente	NOK	147	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	52	Vente	NZD	87	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	77	Vente	NZD	122	2
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	–	Vente	NZD	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	13	Vente	NZD	26	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	28	Vente	PLN	147	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	–	Vente	PLN	1	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	–	Vente	PLN	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	155	Vente	PLN	678	2
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	102	Vente	PLN	482	(1)
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	12	Vente	SEK	150	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	66	Vente	SEK	692	(1)
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	–	Vente	SEK	1	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	–	Vente	SEK	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	44	Vente	SEK	491	(1)
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	28	Vente	SGD	45	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	–	Vente	SGD	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	102	Vente	SGD	146	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	155	Vente	SGD	204	3
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	JPY	41 357	Vente	USD	304	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	PLN	27	Vente	USD	6	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD	77	Vente	USD	52	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	ILS	16	Vente	USD	5	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NOK	65	Vente	USD	7	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	JPY	27 836	Vente	USD	207	(2)
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	DKK	72	Vente	USD	10	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CAD	91	Vente	USD	67	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	3 119	Vente	USD	3 765	(11)
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	11 909	Vente	USD	12 857	(255)
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD	7	Vente	USD	4	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD	5	Vente	USD	3	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD	20	Vente	USD	15	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CNY	968	Vente	USD	140	(1)
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	MXN	498	Vente	USD	27	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	PLN	39	Vente	USD	9	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	ILS	24	Vente	USD	7	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SEK	65	Vente	USD	7	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	–	Vente	USD	–	–
14 mars 2023	JP Morgan	Achat	USD	1 955	Vente	JPY	265 000	5
14 mars 2023	JP Morgan	Achat	JPY	4 953 000	Vente	USD	36 706	(252)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	15	Vente	AUD	21	–

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des Contrats de change à terme – (suite)

Date d'échéance	Contrepartie		Devise d'achat (en milliers)			Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	1 262	Vente	EUR	1 174	\$ 18
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	946	Vente	GBP	781	6
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	126	Vente	GBP	105	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	10 810	Vente	USD	13 063	(58)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	1	Vente	USD	1	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD	589	Vente	USD	410	(13)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	4 001	Vente	USD	4 299	(66)
20 mars 2023	Citi	Achat	USD	6 673	Vente	NOK	65 800	329
20 mars 2023	HSBC	Achat	USD	1 838	Vente	NZD	2 940	20
20 mars 2023	JP Morgan	Achat	USD	1 234	Vente	NOK	12 200	58
20 mars 2023	Morgan Stanley	Achat	NOK	78 000	Vente	USD	8 039	(520)
21 mars 2023	Barclays	Achat	USD	2 234	Vente	MYR	9 800	47
21 mars 2023	Barclays	Achat	MYR	9 800	Vente	USD	2 287	(101)
14 avr. 2023	HSBC	Achat	USD	6 771	Vente	SEK	69 700	96
14 avr. 2023	HSBC	Achat	SEK	69 700	Vente	USD	6 752	(77)
19 avr.-2023	HSBC	Achat	USD	6 234	Vente	BRL	32 300	121
20 avr.-2023	HSBC	Achat	USD	1 207	Vente	PLN	5 280	24
25 avril 2023	Citi	Achat	USD	4 772	Vente	CAD	6 350	116
25 avril 2023	Citi	Achat	CAD	6 350	Vente	USD	4 717	(60)
27 avril 2023	JP Morgan	Achat	USD	4 069	Vente	COP	19 180 000	169
27 avril 2023	JP Morgan	Achat	COP	6 540 000	Vente	USD	1 421	(91)
28 avril 2023	Citi	Achat	USD	20 933	Vente	MXN	401 700	(774)
28 avril 2023	Morgan Stanley	Achat	MXN	14 000	Vente	USD	733	23
05 mai 2023	JP Morgan	Achat	EUR	26 090	Vente	USD	28 518	(814)
12 mai 2023	HSBC	Achat	THB	50 200	Vente	USD	1 505	(74)
15 mai 2023	HSBC	Achat	USD	9 699	Vente	ZAR	173 500	313
17 mai 2023	HSBC	Achat	CNH	11 070	Vente	USD	1 639	(38)
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 4 267 \$)								\$ 3 132
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (4 493) \$)								(3 966)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (226) \$)								\$ (834)

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques : 21,89 % (28 février 2022 : 5,38 %)			Organismes de placement collectif : 5,67 % (28 février 2022 : 0,10 %)		
991 Angel Oak Mortgage Trust 2019-6, série 2019 6, catégorie A1, 144A, 2,620 %, échéance le 25/11/2059 *	956	0,18	30 565 Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	30 565	5,67
4 559 Angel Oak Mortgage Trust 2020-1, série 2020 1, catégorie A1, 144A, 2,466 %, échéance le 25/12/2059 *	4 301	0,80	Total des organismes de placement collectif (coût 30 565 \$)	30 565	5,67
11 380 COMM 2017-COR2 Mortgage Trust, série 2017 COR2, catégorie A3, 3,510 %, échéance le 10/09/2050	10 557	1,96	Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (coût 556 208 \$)	538 707	99,90
4 950 COMM 2017-PANW Mortgage Trust, série 2017 PANW, catégorie D, 144A, 3,935 %, échéance le 10/10/2029 *	4 531	0,84	Contrats de change à terme : 2,41 % (28 février 2022 : 2,92 %)		
11 711 Fannie Mae Pool 'MAA4733', 4,500 %, échéance le 01/09/2052	11 297	2,09	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	13 024	2,41
4 126 Fannie Mae Pool 'MAA4785', 5,000 %, échéance le 01/10/2052	4 060	0,75	Contrats à terme : 0,41 % (28 février 2022 : 0,17 %)		
10 506 Fannie Mae Pool 'MAA4841', 5,000 %, échéance le 01/12/2052	10 340	1,92	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	2 190	0,41
10 839 Fannie Mae Pool 'MAA4842', 5,500 %, échéance le 01/12/2052	10 842	2,01	Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	553 921	102,72
4 079 Freddie Mac Pool 'RA7790', 5,000 %, échéance le 01/08/2052	4 017	0,74	Contrats de change à terme : (4,38 %) (28 février 2022 : (2,95 %))		
8 118 Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, échéance le 01/09/2052	7 831	1,45	Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(23 627)	(4,38)
6 606 Freddie Mac Pool 'SD8257', 4,500 %, échéance le 01/10/2052	6 372	1,18	Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	(23 627)	(4,38)
5 889 Freddie Mac Pool 'SD8267', 5,000 %, échéance le 01/11/2052	5 796	1,07	Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	530 294	98,34
16 467 Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, échéance le 01/12/2052	16 460	3,05	Autres éléments de l'actif hors passif	8 977	1,66
8 350 Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C34, série 2017 C34, catégorie A3, 3,276 %, échéance le 15/11/2052	7 644	1,42	Total des actifs nets	539 271 \$	100,00
EUR 1 650 Newgate Funding Plc, série 2007 1X, catégorie BB, 2,204 %, échéance le 01/12/2050 *	1 530	0,29	– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.		
EUR 2 578 Newgate Funding Plc, série 2007 2X, catégorie BB, 2,296 %, échéance le 15/12/2050 *	2 488	0,46	144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 45 083 000 \$, soit 8,37 % de l'actif net.		
2 570 Towd Point Mortgage Trust 2018-3, série 2018 3, catégorie A2, 144A, 3,875 %, échéance le 25/05/2058 *	2 354	0,44	* Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.		
7 154 Towd Point Mortgage Trust 2018-5, série 2018 5, catégorie A1, 144A, 3,250 %, échéance le 25/07/2058 *	6 670	1,24			
Total des titres adossés à des hypothèques (coût 122 579 \$)	118 046	21,89	ABRÉVIATIONS :		
Obligations et bons d'entreprises : 7,26 % (28 février 2022 : 19,33 %)			BRL – Réal brésilien		
Australie : 4,87 % (28 février 2022 : 3,62 %)			COP – Peso colombien		
15 460 Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,151 %, échéance le 14/03/2025 *	15 531	2,88	EUR – Euro		
10 640 Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207 %, échéance le 22/11/2024	10 740	1,99	MXN – Peso mexicain		
	26 271	4,87	NZD – Dollar néo-zélandais		
États-Unis : 2,39 % (28 février 2022 : 8,23 %)			PEN – Nouveau sol péruvien		
10 300 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,700 %, échéance le 01/11/2024	10 365	1,92	PLN – Zloty polonais		
3 065 Jabil Inc, 3,000 %, échéance le 15/01/2031	2 523	0,47	ZAR – Rand sud-africain		
	12 888	2,39			
Total des obligations et bons d'entreprises (coût 39 410 \$)	39 159	7,26			
Obligations et bons d'État : 65,08 % (28 février 2022 : 70,51 %)			Analyse de l'actif total		% de l'actif total
Brésil : 7,30 % (28 février 2022 : 5,12 %)			Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé		89,50
BRL 158 800 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTN F, 10,000 %, échéance le 01/01/2031	25 671	4,76	Organismes de placement collectif		5,38
BRL 87 000 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTN F, 10,000 %, échéance le 01/01/2033	13 677	2,54	Instruments financiers dérivés		2,68
	39 348	7,30	Autres actifs		2,44
Colombie : 5,75 % (28 février 2022 : 3,16 %)			Actif total		100,00
COP 40 660 000 TES colombien, série B, 6,000 %, échéance le 28/04/2028	6 314	1,17			
COP 63 090 000 TES colombien, série B, 9,250 %, échéance le 28/05/2042	9 374	1,74			
COP 135 410 000 TES colombien, série B, 7,250 %, échéance le 26/10/2050	15 331	2,84			
	31 019	5,75			
Mexique : 5,75 % (28 février 2022 : 6,24 %)					
MXN 183 800 Mexican Bonos, série M, 8,000 %, échéance le 07/11/2047	8 811	1,63			
MXN 465 600 Mexican Bonos, série M, 8,000 %, échéance le 31/07/2053	22 194	4,12			
	31 005	5,75			
Nouvelle-Zélande : 2,68 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
NZD 33 290 Obligation de l'État néo-zélandais, série 0551, 2,750 %, échéance le 15/05/2051	14 430	2,68			
Pérou : 3,69 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
PEN 86 000 Obligation de l'État péruvien, 6,150 %, échéance le 12/08/2032	19 905	3,69			
Pologne : 4,28 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
PLN 150 900 Obligation de l'État polonais, série 0432, 1,750 %, échéance le 25/04/2032	23 077	4,28			
Afrique du Sud : 2,91 % (28 février 2022 : 3,96 %)					
ZAR 369 800 Obligation de l'État sud-africain, série 2048, 8,750 %, échéance le 28/02/2048	15 712	2,91			
États-Unis : 32,72 % (28 février 2022 : 32,83 %)					
46 165 Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 3,334 %, échéance le 31/07/2024 *	46 153	8,56			
3 710 Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 4,936 %, échéance le 31/01/2025 *	3 714	0,69			
139 260 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 15/08/2032	126 574	23,47			
	176 441	32,72			
Total des obligations et bons d'État (coût 363,654 \$)	350 937	65,08			

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
06 mars 2023	HSBC	Achat	USD 22 303	Vente	CLP 18 840 000	\$ (441)
06 mars 2023	HSBC	Achat	CLP 18 840 000	Vente	USD 20 732	2 012
07 mars 2023	Barclays	Achat	USD 27 453	Vente	AUD 39 910	590
07 mars 2023	Barclays	Achat	AUD 40 230	Vente	USD 28 640	(1 561)
07 mars 2023	Morgan Stanley	Achat	USD 27 772	Vente	AUD 40 230	694
07 mars 2023	Morgan Stanley	Achat	AUD 15 670	Vente	USD 10 544	3
08 mars 2023	Citi	Achat	USD 26 504	Vente	KRW 33 800 000	942
08 mars 2023	Citi	Achat	KRW 33 800 000	Vente	USD 25 997	(435)
10 mars 2023	HSBC	Achat	USD 30 842	Vente	THB 1 063 300	725
10 mars 2023	HSBC	Achat	THB 1 063 300	Vente	USD 30 820	(702)
13 mars 2023	Barclays	Achat	USD 28 163	Vente	CHF 25 920	601
13 mars 2023	Citi	Achat	CHF 10 740	Vente	USD 11 492	(71)
13 mars 2023	Goldman Sachs	Achat	USD 49 260	Vente	CHF 45 180	1 216
13 mars 2023	JP Morgan	Achat	USD 767	Vente	CHF 700	22
14 mars 2023	Citi	Achat	USD 10 881	Vente	JPY 1 419 000	437
14 mars 2023	JP Morgan	Achat	USD 15 674	Vente	JPY 2 115 000	108
14 mars 2023	JP Morgan	Achat	JPY 2 808 000	Vente	USD 21 471	(804)
14 mars 2023	Morgan Stanley	Achat	USD 5 140	Vente	JPY 693 000	40
14 mars 2023	Morgan Stanley	Achat	JPY 1 419 000	Vente	USD 11 213	(769)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD –	Vente	GBP –	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 5	Vente	GBP 4	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP 10 227	Vente	USD 12 360	(55)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 125 381	Vente	USD 134 748	(2 007)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD 246 873	Vente	USD 171 679	(5 460)
20 mars 2023	Barclays	Achat	USD 16 735	Vente	NZD 25 790	788
20 mars 2023	Barclays	Achat	NZD 43 680	Vente	USD 28 430	(1 421)
20 mars 2023	Goldman Sachs	Achat	USD 54 011	Vente	NZD 84 740	1 615
20 mars 2023	Goldman Sachs	Achat	NOK 217 000	Vente	USD 22 016	(1 097)
20 mars 2023	Goldman Sachs	Achat	NZD 41 060	Vente	USD 26 165	(777)
20 mars 2023	JP Morgan	Achat	NZD 2 060	Vente	USD 1 305	(31)
20 mars 2023	Morgan Stanley	Achat	NZD 18 090	Vente	USD 11 157	28
20 mars 2023	Morgan Stanley	Achat	NOK 281 400	Vente	USD 28 945	(1 817)
14 avr. 2023	Barclays	Achat	SEK 286 700	Vente	USD 27 789	(333)
14 avr. 2023	HSBC	Achat	USD 27 447	Vente	SEK 286 700	(9)
19 avr.-2023	HSBC	Achat	USD 30 537	Vente	BRL 159 380	372
19 avr.-2023	HSBC	Achat	BRL 89 670	Vente	USD 17 395	(424)
20 avr.-2023	HSBC	Achat	USD 22 429	Vente	PLN 98 120	452
20 avr.-2023	Morgan Stanley	Achat	USD 1 703	Vente	PLN 7 460	32
25 avril 2023	Citi	Achat	CAD 21 600	Vente	USD 16 043	(204)
25 avril 2023	JP Morgan	Achat	CAD 700	Vente	USD 526	(13)
27 avril 2023	JP Morgan	Achat	COP 23 680 000	Vente	USD 4 740	76
27 avril 2023	JP Morgan	Achat	COP 79 560 000	Vente	USD 17 281	(1 101)
28 avril 2023	Citi	Achat	USD 20 922	Vente	MXN 401 500	(773)
28 avril 2023	JP Morgan	Achat	USD 10 700	Vente	MXN 207 700	(523)
05 mai 2023	Citi	Achat	EUR 50 930	Vente	USD 55 905	(1 825)
05 mai 2023	HSBC	Achat	EUR 25 440	Vente	USD 27 764	(751)
05 mai 2023	JP Morgan	Achat	USD 60 850	Vente	EUR 55 670	1 737
09 mai 2023	HSBC	Achat	USD 19 966	Vente	PEN 77 000	(223)
15 mai 2023	HSBC	Achat	USD 16 531	Vente	ZAR 295 700	534
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 21 946 \$)						\$ 13 024
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (22 185) \$)						(23 627)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (239) \$)						\$ (10 603)

Tableau des contrats à terme standardisés

	Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
Obligation japonaise 10 ans (OSE), mars 2023	Morgan Stanley	(209)	\$ (225 110)	\$ 2 086
U.S. 10 Year Note (CBT), juin 2023	Morgan Stanley	473	52 813	104
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 1 272 \$)				\$ 2 190
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (4 865) \$)				–
Plus-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (3 593) \$)				\$ 2 190

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global High Yield Fund^

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises : 95,87 % (28 février 2022 : 91,17 %)					
Australie : 0,37 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
45 FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 144A, 4,375 %, échéance le 01/04/2031	38	0,37	40 New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, échéance le 30/09/2026	37	0,35
Brésil : 2,19 % (28 février 2022 : 4,98 %)					
295 MercadoLibre Inc, 3,125 %, échéance le 14/01/2031	228	2,19	70 NFP Corp, 144A, 7,500 %, échéance le 01/10/2030	67	0,64
Canada : 3,28 % (28 février 2022 : 2,60 %)					
245 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, échéance le 15/02/2026	222	2,13	75 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 3,450 %, échéance le 15/03/2023	75	0,72
130 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, échéance le 15/04/2029	119	1,15	80 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 3,875 %, échéance le 21/09/2023	79	0,76
	341	3,28	100 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, échéance le 15/02/2028	92	0,88
Chine : 1,88 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
200 Lenovo Group Ltd, 144A, 6,536 %, échéance le 27/07/2032	195	1,88	35 PDC Energy Inc, 144A, 6,125 %, échéance le 15/09/2024	35	0,33
Colombie : 1,29 % (28 février 2022 : 3,21 %)					
180 Ecopetrol SA, 4,625 %, échéance le 02/11/2031	134	1,29	205 PDC Energy Inc, 144A, 5,750 %, échéance le 15/05/2026	196	1,89
Finlande : 0,28 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
30 Nokia Oyj, 6,625 %, échéance le 15/05/2039	29	0,28	40 PennyMac Financial Services Inc, 144A, 5,750 %, échéance le 15/09/2031	32	0,31
Israël : 3,42 % (28 février 2022 : 2,46 %)					
80 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,500 %, échéance le 30/03/2024	78	0,75	120 Playtika Holding Corp, 144A, 4,250 %, échéance le 15/03/2029	97	0,94
100 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, échéance le 30/03/2028	90	0,87	30 PRA Group Inc, 144A, 7,375 %, échéance le 01/09/2025	30	0,29
50 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,500 %, échéance le 30/06/2027	48	0,46	20 PRA Group Inc, 144A, 8,375 %, échéance le 01/02/2028	20	0,19
149 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, échéance le 30/06/2030	140	1,34	105 PROG Holdings Inc, 144A, 6,000 %, échéance le 15/11/2029	89	0,86
	356	3,42	30 QVC Inc, 4,750 %, échéance le 15/02/2027	19	0,18
Mexique : 1,49 % (28 février 2022 : 5,19 %)					
200 Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, échéance le 15/11/2029	154	1,49	75 QVC Inc, 4,375 %, échéance le 01/09/2028	42	0,40
Nigeria : 1,58 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
200 IHS Holding Ltd, 144A, 6,250 %, échéance le 29/11/2028	165	1,58	70 Radian Group Inc, 4,500 %, échéance le 01/10/2024	69	0,66
Porto Rico : 0,53 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
55 Popular Inc, 6,125 %, échéance le 14/09/2023	55	0,53	55 ROBLOX Corp, 144A, 3,875 %, échéance le 01/05/2030	45	0,44
Royaume-Uni : 2,55 % (28 février 2022 : 5,36 %)					
45 British Airways 2019-1 Class A Pass Through Trust, 144A, 3,300 %, échéance le 15/12/2032	38	0,37	175 ROCC Holdings LLC, 144A, 9,250 %, échéance le 15/08/2026	185	1,78
245 Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 144A, 6,750 %, échéance le 01/10/2026	227	2,18	50 Rocket Mortgage LLC, 144A, 5,250 %, échéance le 15/01/2028	45	0,43
	265	2,55	40 Sabre GLBL Inc, 144A, 9,250 %, échéance le 15/04/2025	39	0,38
États-Unis : 77,01 % (28 février 2022 : 57,01 %)					
50 Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250 %, échéance le 15/02/2026	48	0,46	105 Sabre GLBL Inc, 144A, 7,375 %, échéance le 01/09/2025	98	0,95
365 Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, échéance le 15/12/2027	326	3,14	100 Signature Bank/New York NY, 4,000 %, échéance le 15/10/2030 *	91	0,88
115 Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, échéance le 15/08/2027	113	1,09	105 Solaris Midstream Holdings LLC, 144A, 7,625 %, échéance le 01/04/2026	104	1,00
310 ANGI Group SA, 144A, 3,875 %, échéance le 15/08/2028	239	2,30	25 Standard Industries Inc/NJ, 144A, 4,375 %, échéance le 15/07/2030	21	0,20
380 Arko Corp, 144A, 5,125 %, échéance le 15/11/2029	301	2,90	55 Station Casinos LLC, 144A, 4,500 %, échéance le 15/02/2028	49	0,47
100 Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, échéance le 01/02/2026	93	0,90	50 Station Casinos LLC, 144A, 4,625 %, échéance le 01/12/2031	41	0,39
45 Burford Capital Finance LLC, 6,125 %, échéance le 12/08/2025	42	0,41	55 Synchrony Financial, 7,250 %, échéance le 02/02/2023	53	0,51
220 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, échéance le 15/04/2030	190	1,83	100 Synecos Health Inc, 144A, 3,625 %, échéance le 15/01/2029	83	0,79
140 Cargo Aircraft Management Inc, 144A, 4,750 %, échéance le 01/02/2028	122	1,17	85 Texas Capital Bancshares Inc, 4,000 %, échéance le 06/05/2031 *	76	0,73
110 Cimarex Energy Co, 3,900 %, échéance le 15/05/2027	96	0,92	130 TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, échéance le 15/03/2026	128	1,24
160 Cimarex Energy Co, 4,375 %, échéance le 15/03/2029	140	1,35	75 Travel + Leisure Co, 144A, 4,500 %, échéance le 01/12/2029	63	0,61
55 Civitas Resources Inc, 144A, 5,000 %, échéance le 15/10/2026	51	0,49	65 Travel + Leisure Co, 144A, 4,625 %, échéance le 01/03/2030	55	0,53
100 Cobra AcquisitionCo LLC, 144A, 6,375 %, échéance le 01/11/2029	64	0,61	200 Turning Point Brands Inc, 144A, 5,625 %, échéance le 15/02/2026	181	1,74
155 Credit Acceptance Corp, 144A, 5,125 %, échéance le 31/12/2024	145	1,40	55 Twilio Inc, 3,625 %, échéance le 15/03/2029	46	0,44
165 Credit Acceptance Corp, 6,625 %, échéance le 15/03/2026	155	1,49	155 Uber Technologies Inc, 144A, 7,500 %, échéance le 15/05/2025	157	1,51
15 DraftKings Holdings Inc, coupon zéro, échéance le 15/03/2028	11	0,10	45 United States Cellular Corp, 6,700 %, échéance le 15/12/2033	41	0,39
205 FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, échéance le 01/01/2030	182	1,75	145 United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,750 %, échéance le 15/06/2027	128	1,23
55 Forestar Group Inc, 144A, 5,000 %, échéance le 01/03/2028	47	0,46	195 United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, échéance le 15/04/2029	162	1,55
275 Freedom Mortgage Corp, 144A, 7,625 %, échéance le 01/05/2026	235	2,26	105 Vector Group Ltd, 5,750 %, échéance le 01/02/2029	90	0,87
180 Freedom Mortgage Corp, 144A, 6,625 %, échéance le 15/01/2027	147	1,41	280 Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, échéance le 01/02/2029	241	2,32
85 GrubHub Holdings Inc, 144A, 5,500 %, échéance le 01/07/2027	67	0,65	85 ViaSat Inc, 144A, 5,625 %, échéance le 15/04/2027	78	0,75
105 Hightower Holding LLC, 144A, 6,750 %, échéance le 15/04/2029	89	0,86	152 Viking Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, échéance le 15/05/2025	141	1,36
155 Home BancShares Inc/AR, 3,125 %, échéance le 30/01/2032 *	128	1,23	355 Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, échéance le 15/05/2025	378	3,63
50 Hyundai Capital America, 144A, 2,100 %, échéance le 15/09/202	41	0,40	45 Western Alliance Bancorp, 3,000 %, échéance le 15/06/2031 *	39	0,38
210 LCPR Senior Secured Financing DAC, 144A, 6,750 %, échéance le 15/10/2027	194	1,87	100 WMG Acquisition Corp, 2,250 %, échéance le 15/08/2031	79	0,76
75 Liberty Interactive LLC, 8,250 %, échéance le 01/02/2030	31	0,29	220 World Acceptance Corp, 144A, 7,000 %, échéance le 01/11/2026	171	1,65
250 Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, échéance le 01/08/2026	240	2,31	60 Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, échéance le 01/03/2025	58	0,56
210 Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, échéance le 01/10/2026	194	1,86		8 004	77,01
75 Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp, 144A, 4,875 %, échéance le 01/05/2029	64	0,62	Total des obligations et bons d'entreprises (coût 10 136 \$)		
45 Nathan's Famous Inc, 144A, 6,625 %, échéance le 01/11/2025	45	0,43	Organismes de placement collectif : 3,81 % (28 février 2022 : 4,64 %)		
20 New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, échéance le 15/09/2025	19	0,18	396 Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	396	3,81
			Total des organismes de placement collectif (coût 396 \$)		
			Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (coût 10 532 \$)		
			Contrats de change à terme : 0,10 % (28 février 2022 : 0,44 %)		
			Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
			Contrats à terme : 0,01 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
			Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
			Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
			Contrats de change à terme : (1,94 %) (28 février 2022 : (0,18 %))		
			Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
			Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
			Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
			Autres éléments de l'actif hors passif		
			Total des actifs nets		

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 8 039 000 \$, soit 77,37 % de l'actif net.

* Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.

ABRÉVIATIONS :

EUR – Euro

Analyse de l'actif total	% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	92,17
Organismes de placement collectif	3,66
Instruments financiers dérivés	0,11
Autres actifs	4,06
Actif total	100,00

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)			Devise de vente (en milliers)			Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
03 mars 2023	JP Morgan	Achat	USD	168	Vente	GBP	140	\$ –
03 mars 2023	JP Morgan	Achat	GBP	140	Vente	USD	169	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CHF	–	Vente	CAD	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SEK	–	Vente	CAD	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SEK	–	Vente	CAD	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CHF	–	Vente	CAD	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	4	Vente	CAD	6	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	44	Vente	CAD	62	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	205	Vente	CAD	277	3
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	–	Vente	CHF	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CAD	3	Vente	CHF	2	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CAD	2 499	Vente	EUR	1 724	7
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	10	Vente	EUR	11	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CAD	247	Vente	GBP	153	(3)
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	–	Vente	GBP	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SEK	–	Vente	GBP	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	2	Vente	GBP	2	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CHF	–	Vente	GBP	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CHF	–	Vente	GBP	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	–	Vente	SEK	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CAD	3	Vente	SEK	22	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	46	Vente	USD	55	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CAD	11 079	Vente	USD	8 266	(146)
05 mai 2023	JP Morgan	Achat	EUR	1 680	Vente	USD	1 836	(53)
02 juin 2023	JP Morgan	Achat	GBP	150	Vente	USD	181	–
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 50 \$)								\$ 10
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (20) \$)								(202)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 30 \$)								\$ (192)

Tableau des contrats à terme standardisés

	Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
U.S. 10 Year Note (CBT), juin 2023	Citi	4	\$ 447	\$ 2
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				\$ 2
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				–
Plus-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				\$ 2

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Portefeuille d’investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques : 13,19 % (28 février 2022 : 0,90 %)			
1 625	Fannie Mae Pool ‘MA4785’, 5,000 %, échéance le 01/10/2052	1 599	0,78
3 427	Fannie Mae Pool ‘MA4841’, 5,000 %, échéance le 01/12/2052	3 373	1,64
3 885	Fannie Mae Pool ‘MA4842’, 5,500 %, échéance le 01/12/2052	3 885	1,89
1 552	Freddie Mac Pool ‘RA7790’, 5,000 %, échéance le 01/08/2052	1 528	0,74
1 908	Freddie Mac Pool ‘SD8267’, 5,000 %, échéance le 01/11/2052	1 877	0,92
5 414	Freddie Mac Pool ‘SD8277’, 5,500 %, échéance le 01/12/2052	5 412	2,64
9 442	Ginnie Mae II Pool, ‘MA8348’, 5,000 %, échéance le 20/10/2052	9 349	4,56
EUR	44 IM Pastor 4 FTA 4, catégorie A, 2,221 %, échéance le 22/03/2044 *	40	0,02
Total des titres adossés à des hypothèques (coût 26 895 \$)		27 063	13,19
Obligations et bons d’entreprises : 6,05 % (28 février 2022 : 18,49 %)			
Australie : 4,12 % (28 février 2022 : 3,73 %)			
4 260	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,151 %, échéance le 14/03/2025 *	4 279	2,08
4 140	Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207 %, échéance le 22/11/2024	4 179	2,04
		8 458	4,12
États-Unis : 1,93 % (28 février 2022 : 8,07 %)			
3 930	Jackson National Life Global Funding, 144A, 5,613 %, échéance le 28/06/2024 *	3 951	1,93
Total des obligations et bons d’entreprises (coût 12 321 \$)		12 409	6,05
Obligations et bons d’État : 78,56 % (28 février 2022 : 78,35 %)			
Brésil : 5,44 % (28 février 2022 : 5,18 %)			
BRL	29 620 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTN F, 10,000 %, échéance le 01/01/2027	5 180	2,53
BRL	9 240 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTN F, 10,000 %, échéance le 01/01/2029	1 545	0,75
BRL	9 230 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTN F, 10,000 %, échéance le 01/01/2031	1 492	0,73
BRL	18 690 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTN F, 10,000 %, échéance le 01/01/2033	2 940	1,43
		11 157	5,44
Canada : 0,74 % (28 février 2022 : 0,00 %)			
CAD	2 110 Obligation de l’État canadien, 2,000 %, échéance le 01/09/2023	1 527	0,74
Colombie : 5,87 % (28 février 2022 : 3,29 %)			
COP	12 600 000 TES colombien, série B, 6,250 %, échéance le 26/11/2025	2 241	1,09
COP	21 200 000 TES colombien, série B, 6,000 %, échéance le 28/04/2028	3 292	1,60
COP	14 690 000 TES colombien, série B, 7,000 %, échéance le 26/03/2031	2 146	1,05
COP	24 290 000 TES colombien, série B, 9,250 %, échéance le 28/05/2042	3 609	1,76
COP	6 640 000 TES colombien, série B, 7,250 %, échéance le 26/10/2050	752	0,37
		12 040	5,87
Allemagne : 5,84 % (28 février 2022 : 0,00 %)			
EUR	1 450 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,500 %, échéance le 15/02/2023	1 530	0,74
EUR	10 680 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, échéance le 15/08/2052	10 460	5,10
		11 990	5,84
Malaisie : 2,82 % (28 février 2022 : 4,45 %)			
MYR	13 430 Obligation de l’État malaisien, série 0313, 3,480 %, échéance le 15/03/2023	2 993	1,46
MYR	2 630 Obligation de l’État malaisien, série 0115, 3,955 %, échéance le 15/09/2025	593	0,29
MYR	9 735 Obligation de l’État malaisien, série 0417, 3,899 %, échéance le 16/11/2027	2 192	1,07
		5 778	2,82
Mexique : 12,40 % (28 février 2022 : 9,09 %)			
MXN	111 600 Mexican Bonos, série M, 20, 8,500 %, échéance le 31/05/2029	5 836	2,84
MXN	118 500 Mexican Bonos, série M, 30, 8,500 %, échéance le 18/11/2038	6 051	2,95
MXN	116 700 Mexican Bonos, série M, 7,750 %, échéance le 13/11/2042	5 472	2,67
MXN	80 300 Mexican Bonos, série M, 8,000 %, échéance le 07/11/2047	3 849	1,88
MXN	88 900 Mexican Bonos, série M, 8,000 %, échéance le 31/07/2053	4 238	2,06
		25 446	12,40
Nouvelle-Zélande : 0,82 % (28 février 2022 : 4,01 %)			
NZD	3 860 Obligation de l’État néo-zélandais, série 0551, 2,750 %, échéance le 15/05/2051	1 673	0,82
Norvège : 0,74 % (28 février 2022 : 4,13 %)			
NOK	15 800 Obligation de l’État norvégien, série 475, 144A, 2,000 %, échéance le 24/05/2023	1 518	0,74
Pologne : 4,04 % (28 février 2022 : 8,75 %)			
PLN	54 170 Obligation de l’État polonais, série 0432, 1,750 %, échéance le 25/04/2032	8 284	4,04
Russie : 0,03 % (28 février 2022 : 0,17 %)			
RUB	83 000 Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 10/04/2030 ty	55	0,03
Afrique du Sud : 3,69 % (28 février 2022 : 4,13 %)			
ZAR	108 600 Obligation de l’État sud-africain, série R214, 6,500 %, échéance le 28/02/2041	3 727	1,82
ZAR	90 500 Obligation de l’État sud-africain, série 2048, 8,750 %, échéance le 28/02/2048	3 845	1,87
		7 572	3,69

Valeur nominale (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Corée du Sud : 6,80 % (28 février 2022 : 7,17 %)			
KRW	15 700 000 Bon du Trésor coréen, série 3106, 2,000 %, échéance le 10/06/2031	10 415	5,07
KRW	6 600 000 Bon du Trésor coréen, série 5103, 1,875 %, échéance le 10/03/2051	3 542	1,73
		13 957	6,80
Royaume-Uni : 0,76 % (28 février 2022 : 5,08 %)			
GBP	1 310 Fonds d’État du Royaume-Uni, 0,750 %, échéance le 22/07/2023	1 556	0,76
États-Unis : 28,57 % (28 février 2022 : 6,30 %)			
7 080	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l’émission, 3,334 %, échéance le 31/07/2024 *	7 078	3,45
11 700	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l’émission, 4,936 %, échéance le 31/01/2025 *	11 713	5,71
5 660	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 15/02/2032	4 796	2,34
23 370	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 15/11/2051	15 206	7,41
14 370	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/02/2052	10 251	5,00
11 380	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/08/2052	9 570	4,66
		58 614	28,57
Total des obligations et bons d’État (coût 192 944 \$)		161 167	78,56
Organismes de placement collectif : 1,99 % (28 février 2022 : 1,36 %)			
4 087	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	4 087	1,99
Total des organismes de placement collectif (coût 4,087 \$)		4 087	1,99
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (coût 236 247 \$)		204 726	99,79
Contrats de change à terme : 0,71 % (28 février 2022 : 1,17 %)			
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		1 448	0,71
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		206 174	100,50
Contrats de change à terme : (2,07 %) (28 février 2022 : (1,67 %))			
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		(4 239)	(2,07)
Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		(4 239)	(2,07)
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		201 935	98,43
Autres éléments de l’actif hors passif		3 211	1,57
Total des actifs nets		205 146 \$	100,00

- Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.
- 144A Valeurs mobilières exemptées de l’obligation d’enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu’amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d’enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s’élevaient à 13 927 000 \$, soit 6,79 % de l’actif net.
- * Titre à taux variable. Le taux d’intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.
- † Illiquide.
- γ Le titre ne génère plus de revenus pendant et/ou après l’exercice clos le 28 février 2023 en raison de l’incertitude des paiements d’intérêts.

ABRÉVIATIONS :

- BRL – Réal brésilien
- CAD – Dollar canadien
- COP – Peso colombien
- EUR – Euro
- GBP – Livre britannique
- KRW – Won sud-coréen
- MXN – Peso mexicain
- MYR – Ringgit malaisien
- NOK – Couronne norvégienne
- NZD – Dollar néo-zélandais
- PLN – Zloty polonais
- RUB – Rouble russe
- ZAR – Rand sud-africain

Analyse de l’actif total

	% de l’actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	91,58
Organismes de placement collectif	1,87
Instruments financiers dérivés	0,66
Autres actifs	5,89
Actif total	100,00

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie		Devise d'achat (en milliers)			Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
03 mars 2023	HSBC	Achat	GBP	4 930	Vente	USD	6 066	\$ (136)
03 mars 2023	JP Morgan	Achat	USD	15 254	Vente	GBP	12 670	14
03 mars 2023	JP Morgan	Achat	GBP	7 740	Vente	USD	9 532	(222)
07 mars 2023	JP Morgan	Achat	USD	5 041	Vente	AUD	7 410	54
07 mars 2023	JP Morgan	Achat	AUD	7 410	Vente	USD	5 146	(158)
08 mars 2023	Citi	Achat	USD	7 415	Vente	KRW	9 640 000	124
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD	366	Vente	AUD	335	1
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	34	Vente	AUD	60	1
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	44	Vente	CAD	70	1
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD	468	Vente	CAD	397	(2)
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD	985	Vente	CNY	4 222	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD	–	Vente	CNY	1	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	92	Vente	CNY	749	2
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD	73	Vente	DKK	317	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	7	Vente	DKK	56	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	699	Vente	EUR	779	15
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD	7 518	Vente	EUR	4 397	(6)
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	ILS	2	Vente	GBP	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SEK	2	Vente	GBP	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD	–	Vente	GBP	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD	–	Vente	GBP	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	47	Vente	GBP	40	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NOK	2	Vente	GBP	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD	1 107	Vente	GBP	582	(14)
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	PLN	2	Vente	GBP	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	JPY	2 051	Vente	GBP	12	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CAD	3	Vente	GBP	2	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	30	Vente	GBP	26	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD	3	Vente	GBP	1	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CNY	29	Vente	GBP	3	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	MXN	15	Vente	GBP	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	DKK	2	Vente	GBP	–	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD	78	Vente	ILS	169	2
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	8	Vente	ILS	30	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD	3 590	Vente	JPY	298 606	23
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	333	Vente	JPY	52 914	12
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	18	Vente	MXN	408	(1)
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD	189	Vente	MXN	2 301	(8)
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	5	Vente	NOK	51	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD	44	Vente	NOK	285	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	DKK	13	Vente	NZD	3	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	MXN	89	Vente	NZD	8	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD	3	Vente	NZD	5	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NOK	11	Vente	NZD	2	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	284	Vente	NZD	456	2
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	JPY	12 326	Vente	NZD	147	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CNY	173	Vente	NZD	41	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	ILS	8	Vente	NZD	3	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	5	Vente	NZD	9	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	180	Vente	NZD	307	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SEK	11	Vente	NZD	2	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	PLN	12	Vente	NZD	5	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	23	Vente	NZD	45	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CAD	16	Vente	NZD	19	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD	14	Vente	NZD	15	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD	105	Vente	PLN	289	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	9	Vente	PLN	52	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD	44	Vente	SEK	294	(1)
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	4	Vente	SEK	52	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	9	Vente	SGD	15	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD	105	Vente	SGD	87	–
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	NZD	11 147	Vente	USD	7 057	(164)
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	1 036	Vente	USD	1 250	(3)
14 mars 2023	JP Morgan	Achat	JPY	5 913 000	Vente	USD	43 820	(301)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	–	Vente	EUR	–	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	13	Vente	GBP	11	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	–	Vente	USD	–	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	123	Vente	USD	149	(1)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	1	Vente	USD	1	–
20 mars 2023	HSBC	Achat	USD	2 698	Vente	NOK	26 400	153

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des Contrats de change à terme – (suite)

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
20 mars 2023	HSBC	Achat	USD 1 381	Vente	NZD 2 210	\$ 15
20 mars 2023	HSBC	Achat	NOK 17 400	Vente	USD 1 683	(5)
20 mars 2023	Morgan Stanley	Achat	USD 505	Vente	NOK 5 200	3
20 mars 2023	Morgan Stanley	Achat	NOK 100 500	Vente	USD 10 358	(670)
21 mars 2023	Barclays	Achat	USD 6 054	Vente	MYR 26 560	128
21 mars 2023	Barclays	Achat	MYR 3 160	Vente	USD 736	(31)
14 avr. 2023	HSBC	Achat	USD 7 496	Vente	SEK 78 300	(2)
14 avr. 2023	HSBC	Achat	USD 2 698	Vente	SEK 27 500	65
14 avr. 2023	HSBC	Achat	SEK 105 800	Vente	USD 10 249	(117)
19 avr.-2023	HSBC	Achat	USD 5 143	Vente	BRL 26 650	100
20 avr.-2023	HSBC	Achat	PLN 4 300	Vente	USD 983	(20)
25 avril 2023	Barclays	Achat	USD 2 679	Vente	CAD 3 580	54
25 avril 2023	Citi	Achat	CAD 8 340	Vente	USD 6 195	(79)
25 avril 2023	HSBC	Achat	CAD 1 590	Vente	USD 1 173	(7)
27 avril 2023	JP Morgan	Achat	USD 5 992	Vente	COP 28 240 000	248
27 avril 2023	JP Morgan	Achat	COP 10 400 000	Vente	USD 2 259	(144)
28 avril 2023	Citi	Achat	USD 18 989	Vente	MXN 364 400	(702)
05 mai 2023	HSBC	Achat	EUR 1 260	Vente	USD 1 341	(3)
05 mai 2023	JP Morgan	Achat	EUR 24 240	Vente	USD 26 496	(756)
08 mai 2023	HSBC	Achat	USD 5 130	Vente	CLP 4 310 000	(30)
08 mai 2023	HSBC	Achat	USD 7 436	Vente	CLP 6 060 000	181
08 mai 2023	HSBC	Achat	CLP 10 370 000	Vente	USD 12 939	(524)
12 mai 2023	HSBC	Achat	THB 81 800	Vente	USD 2 452	(120)
15 mai 2023	Barclays	Achat	ZAR 5 600	Vente	USD 306	(3)
15 mai 2023	HSBC	Achat	USD 7 737	Vente	ZAR 138 400	250
02 juin 2023	HSBC	Achat	GBP 920	Vente	USD 1 109	–
02 juin 2023	JP Morgan	Achat	GBP 4 930	Vente	USD 5 950	(9)
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 2 854 \$)						\$ 1 448
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (4 074) \$)						(4 239)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (1 220) \$)						\$ (2 791)

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques : 17,87 % (28 février 2022 : 15,72 %)			Canada : 2,19 % (28 février 2022 : 1,85 %)		
3 018 Bellemeade Re 2020-3 Ltd, série 2020 3A, catégorie M1C, 144A, 8,317 %, échéance le 25/10/2030 *	3 067	0,25	8,023 Air Canada 2020-2 Class A Pass Through Trust, 144A, 5,250 %, échéance le 01/04/2029	7 713	0,64
6 100 Bellemeade Re 2020-3 Ltd, série 2020 3 A, catégorie M2, 144A, 9,467 %, échéance le 25/10/2030 *	6 344	0,52	5 590 Antares Holdings LP, 144A, 2,750 %, échéance le 15/01/2027	4 628	0,38
6 264 Bellemeade Re Ltd, série 2021 2A, catégorie M1A, 144A, 5,684 %, échéance le 25/06/2031 *	6 235	0,52	8 930 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, échéance le 15/02/2026	8 079	0,67
220 COMM 2017-PANW Mortgage Trust, série 2017 PANW, catégorie D, 144A, 3,935 %, échéance le 10/10/2029 *	201	0,02	6 600 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, échéance le 15/04/2029	6 042	0,50
11 135 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, série 2020 SBT1, catégorie 1M2, 144A, 8,267 %, échéance le 25/02/2040 *	11 262	0,93		26 462	2,19
12 085 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, série 2020 SBT1, catégorie 2M2, 144A, 8,267 %, échéance le 25/02/2040 *	12 334	1,02	Chili : 0,99 % (28 février 2022 : 0,54 %)		
295 Eagle RE 2021-1 Ltd, série 2021 1, catégorie M1C, 144A, 7,184 %, échéance le 25/10/2033 *	295	0,03	6 680 ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, échéance le 27/04/2026	5 878	0,49
200 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2017 C01, catégorie 1B1, 10,367 %, échéance le 25/07/2029 *	221	0,02	6 729 Kenbourne Invest SA, 6,875 %, échéance le 26/11/2024	6 089	0,50
7 602 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2017 C02, catégorie 2M2C, 8,267 %, échéance le 25/09/2029 *	7 932	0,65		11 967	0,99
2 604 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2017 C06, catégorie 2M2, 7,417 %, échéance le 25/02/2030 *	2 652	0,22	Chine : 1,27 % (28 février 2022 : 0,59 %)		
21 338 Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, échéance le 01/09/2052	20 584	1,70	4 435 Alibaba Group Holdings Ltd, 4,200 %, échéance le 06/12/2047	3 465	0,29
8 403 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, série 2020 DNA3, catégorie B1, 144A, 9,717 %, échéance le 25/06/2050 *	8 935	0,74	1 060 JD.com Inc, 3,375 %, échéance le 14/01/2030	940	0,08
2 731 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA4, série 2020 HQA4, catégorie B1, 144A, 9,867 %, échéance le 25/09/2050 *	2 885	0,24	705 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 3,400 %, échéance le 01/05/2030	610	0,05
3 000 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-HQA2, série 2021 HQA2, catégorie B1, 144A, 7,634 %, échéance le 25/12/2033 *	2 637	0,22	4 375 Tencent Holdings Ltd, 144A, 3,680 %, échéance le 22/04/2041	3 287	0,27
1 904 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, série 2019 DNA3, catégorie M2, 144A, 6,667 %, échéance le 25/07/2049 *	1 905	0,16	2 395 Tencent Holdings Ltd, 144A, 3,240 %, échéance le 03/06/2050	1 547	0,13
5 935 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA4, série 2019 DNA4, catégorie B1, 144A, 7,317 %, échéance le 25/10/2049 *	5 965	0,49	740 Tencent Holdings Ltd, 144A, 3,840 %, échéance le 22/04/2051	534	0,04
579 Freddie Mac STACR Trust 2019-HQA2, série 2019 HQA2, catégorie M2, 144A, 6,667 %, échéance le 25/04/2049 *	580	0,05	340 Tencent Music Entertainment Group, 2,000 %, échéance le 03/09/2030	259	0,02
5 855 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, série 2020 HQA5, catégorie B1, 144A, 8,484 %, échéance le 25/11/2050 *	5 912	0,49	5 735 Xiaomi Best Time International Ltd, 144A, 3,375 %, échéance le 29/04/2030	4 685	0,39
19 385 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, série 2021 DNA2, catégorie M2, 144A, 6,784 %, échéance le 25/08/2033 *	19 441	1,61		15 327	1,27
11 780 Ginnie Mae II Pool, 'MA8645', 4,000 %, échéance le 20/02/2053	11 141	0,92	Colombie : 0,95 % (28 février 2022 : 0,26 %)		
24 502 Ginnie Mae II Pool, 'MA8646', 4,500 %, échéance le 20/02/2053	23 788	1,96	3 715 Ecopetrol SA, 4,125 %, échéance le 16/01/2025	3 558	0,29
189 Home RE 2021-1 Ltd, série 2021 1, catégorie M1B, 144A, 6,167 %, échéance le 25/07/2033 *	189	0,02	3 100 Ecopetrol SA, 8,875 %, échéance le 13/01/2033	3 041	0,25
571 Radnor RE 2021-1 Ltd, série 2021 1, catégorie M1A, 144A, 6,134 %, échéance le 27/12/2033 *	571	0,05	1 860 Ecopetrol SA, 5,875 %, échéance le 28/05/2045	1 228	0,10
5 347 Radnor RE 2021-2 Ltd, série 2021 2, catégorie M1A, 144A, 6,334 %, échéance le 25/11/2031 *	5 349	0,44	4 420 Geopark Ltd, 144A, 5,500 %, échéance le 17/01/2027	3 739	0,31
5 000 Radnor RE 2021-2 Ltd, série 2021 2, catégorie M1B, 144A, 8,184 %, échéance le 25/11/2031 *	5 070	0,42		11 566	0,95
3 232 STACR Trust 2018-HRP2, série 2018 HRP2, catégorie B1, 144A, 8,817 %, échéance le 25/02/2047 *	3 319	0,27	Allemagne : 0,35 % (28 février 2022 : 0,27 %)		
5 893 Towd Point Mortgage Trust 2017-6, série 2017 6, catégorie B2, 144A, 3,236 %, échéance le 25/10/2057 *	4 536	0,37	4 485 Siemens Financieringsmaatschappij NV, 144A, 0,650 %, échéance le 11/03/2024	4 269	0,35
17 590 Towd Point Mortgage Trust 2018-2, série 2018 2, catégorie B1, 144A, 3,480 %, échéance le 25/03/2058 *	14 379	1,19	Israël : 0,76 % (28 février 2022 : 1,42 %)		
6 755 Towd Point Mortgage Trust 2018-3, série 2018 3, catégorie B1, 144A, 3,740 %, échéance le 25/05/2058 *	5 212	0,43	2 870 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,500 %, échéance le 30/03/2024	2 797	0,23
9 125 Triangle Re 2021-3 Ltd, série 2021 3, catégorie M1A, 144A, 6,384 %, échéance le 25/02/2034 *	9 128	0,75	6 925 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,875 %, échéance le 30/03/2026	6 432	0,53
290 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5, série 2016 NXS5, catégorie C, 4,981 %, échéance le 15/01/2059 *	252	0,02		9 229	0,76
14 975 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14, série 2014 LC14, catégorie D, 144A, 4,586 %, échéance le 15/03/2047 *	13 934	1,15	Japon : 0,73 % (28 février 2022 : 0,61 %)		
Total des titres adossés à des hypothèques (coût 226 724 \$)	216 255	17,87	9 715 Nissan Motor Co LLC, 144A, 4,345 %, échéance le 17/09/2027	8 862	0,73
Obligations et bons d'entreprises : 58,40 % (28 février 2022 : 56,53 %)			Luxembourg : 0,79 % (28 février 2022 : 0,74 %)		
Australie : 0,40 % (28 février 2022 : 0,32 %)			2 535 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, échéance le 15/08/2029	2 076	0,17
AUD 730 NBN Co Ltd, 2,200 %, échéance le 16/12/2030	388	0,03	10 770 Altice France Holding SA, 144A, 6,000 %, échéance le 15/02/2028	7 502	0,62
5 430 NBN Co Ltd, 2,625 %, échéance le 05/05/2031	4 417	0,37		9 578	0,79
	4 805	0,40	Mexique : 0,24 % (28 février 2022 : 0,31 %)		
Brésil : 2,47 % (28 février 2022 : 2,72 %)			3 770 Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, échéance le 15/11/2029	2 915	0,24
1 880 Amaggi Luxembourg International Sarl, 5,250 %, échéance le 28/01/2028	1 641	0,13	Norvège : 0,37 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
4 900 B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, échéance le 20/09/2031	4 066	0,34	1 410 Var Energi ASA, 144A, 7,500 %, échéance le 15/01/2028	1 457	0,12
4 710 Banco do Brasil SA/Caimans, 144A, 3,250 %, échéance le 30/09/2026	4 291	0,35	2 915 Var Energi ASA, 144A, 8,000 %, échéance le 15/11/2032	3 046	0,25
1 205 BRF SA, 144A, 3,950 %, échéance le 22/05/2023	1 194	0,10		4 503	0,37
1 335 Embraer Netherlands Finance BV, 144A, 6,950 %, échéance le 17/01/2028	1,340	0,11	Panama : 0,29 % (28 février 2022 : 0,21 %)		
6 645 Rumo Luxembourg Sarl, 144A, 4,200 %, échéance le 18/01/2032	5 283	0,44	3 955 AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, échéance le 31/05/2030	3 461	0,29
13 775 XP Inc, 144A, 3,250 %, échéance le 01/07/2026	12 100	1,00	Corée du Sud : 0,39 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
	29 915	2,47	4 995 SK Hynix Inc, 2,375 %, échéance le 19/01/2031	3 698	0,31
			1 000 SK Hynix Inc, 144A, 6,500 %, échéance le 17/01/2033	985	0,08
				4 683	0,39
			Supranational : 1,11 % (28 février 2022 : 0,93 %)		
			8 685 Arab Petroleum Investments Corp, 1,483 %, échéance le 06/10/2026	7 750	0,64
			MXN 61 000 International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, échéance le 22/01/2026	2 842	0,24
			BRL 17 100 International Bank for Reconstruction & Development, 5,000 %, échéance le 22/01/2026	2 794	0,23
				13 386	1,11
			Suisse : 0,15 % (28 février 2022 : 0,12 %)		
			1 930 UBS AG/Londres, 144A, 0,700 %, échéance le 09/08/2024	1 808	0,15
			Royaume-Uni : 1,17 % (28 février 2022 : 0,84 %)		
			2 220 Ashtead Capital Inc, 144A, 5,500 %, échéance le 11/08/2032	2 131	0,17
			5 610 HSBC Holdings Plc, 4,292 %, échéance le 12/09/2026 *	5 403	0,45
			1 075 Nationwide Building Society, 5,750 %, perpétuelle *	1 173	0,10
			400 Natwest Group Plc, 2,359 %, échéance le 22/05/2024 *	397	0,03
			3 625 NatWest Group Plc, 4,600 %, perpétuelle *	2 668	0,22
			2 900 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, échéance le 15/07/2031	2 404	0,20
				14 176	1,17

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)					
États-Unis : 42,28 % (28 février 2022 : 43,77 %)					
3 665 Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250 %, échéance le 15/02/2026	3 530	0,29	12 365 OWL Rock Core Income Corp, 3,125 %, échéance le 23/09/2026	10 712	0,88
5 100 Air Lease Corp, 0,800 %, échéance le 18/08/2024	4 738	0,39	2 550 OWL Rock Core Income Corp., 144A, 7,750 %, 16/09/2027	2 548	0,21
7 208 Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust, 144A, 4,800 %, échéance le 15/08/2027	7 006	0,58	4 040 Owl Rock Technology Finance Corp, 144A, 4,750 %, échéance le 15/12/2025	3 688	0,30
6 140 AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp, 5,625 %, échéance le 20/05/2024	6 008	0,50	10 861 Owl Rock Technology Finance Corp, 144A, 3,750 %, échéance le 17/06/2026	9 452	0,78
2 021 Antero Resources Corp, 144A, 7,625 %, échéance le 01/02/2029	2 038	0,17	5 345 Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC, 144A, 4,000 %, échéance le 15/10/2027	4 668	0,39
5 515 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 4,125 %, échéance le 15/08/2026	5 024	0,41	1 640 Regal Rexnord Corp, 144A, 6,300 %, échéance le 15/02/2030	1 606	0,13
435 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, échéance le 15/08/2027	358	0,03	1 640 Regal Rexnord Corp, 144A, 6,400 %, échéance le 15/04/2033	1 615	0,13
9 530 Ares Capital Corp, 3,250 %, échéance le 15/07/2025	8 871	0,73	4 430 ROBLOX Corp, 144A, 3,875 %, échéance le 01/05/2030	3 646	0,30
9 063 Ares Capital Corp, 2,150 %, échéance le 15/07/2026	7 814	0,65	890 Seagate HDD Cayman, 4,125 %, échéance le 15/01/2031	739	0,06
2 530 Ares Capital Corp, 2,875 %, échéance le 15/06/2028	2 080	0,17	12 350 Sealed Air Corp, 144A, 1,573 %, échéance le 15/10/2026	10 648	0,88
3 890 AT&T Inc, 1,700 %, échéance le 25/03/2026	3 497	0,29	12 250 Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC, 144A, 5,152 %, échéance le 20/03/2028	12 119	1,00
11 500 AT&T Inc, 2,750 %, échéance le 01/06/2031	9 508	0,79	11 750 Stellantis Finance US Inc, 144A, 6,375 %, échéance le 12/09/2032	12 025	0,99
11 980 Athene Global Funding, 144A, 0,914 %, échéance le 19/08/2024	11 082	0,92	1 220 Stellantis NV, 5,250 %, échéance le 15/04/2023	1 218	0,10
9 925 Bain Capital Specialty Finance Inc, 2,950 %, échéance le 15/03/2026	8 841	0,73	4 681 SVB Financial Group, 1,800 %, échéance le 02/02/2031	3 479	0,29
1 545 Blackstone Secured Lending Fund, 3,650 %, échéance le 14/07/2023	1 533	0,13	4 065 Synchrony Financial, 7,250 %, échéance le 02/02/2023	3 917	0,32
2 280 Blackstone Secured Lending Fund, 3,625 %, échéance le 15/01/2026	2 092	0,17	4 130 Syneos Health Inc, 144A, 3,625 %, échéance le 15/01/2029	3 408	0,28
9 170 Blackstone Secured Lending Fund, 2,125 %, échéance le 15/02/2027	7 727	0,64	5 600 Talos Production Inc, 12,000 %, échéance le 15/01/2026	5 916	0,49
2 645 Blackstone Secured Lending Fund, 2,850 %, échéance le 30/09/2028	2 138	0,18	3 530 TEGNA Inc, 144A, 4,750 %, échéance le 15/03/2026	3 357	0,28
4 645 Block Financial LLC, 3,875 %, échéance le 15/08/2030	4 075	0,34	4 315 Travel + Leisure Co, 144A, 6,625 %, échéance le 31/07/2026	4 234	0,35
4 105 Broadcom Inc, 144A, 1,950 %, échéance le 15/02/2028	3 481	0,29	12 860 Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC, 144A, 7,875 %, échéance le 15/02/2025	13 118	1,08
437 Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, échéance le 15/11/2035	322	0,03	4 080 Univision Communications Inc, 144A, 6,625 %, échéance le 01/06/2027	3 878	0,32
353 Broadcom Inc, 144A, 4,926 %, échéance le 15/05/2037	307	0,03	14 235 Valero Energy Corp, 3,650 %, échéance le 01/12/2051	10 110	0,84
6 055 Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 2,742 %, échéance le 31/12/2039	4 801	0,40	7 940 ViaSat Inc, 144A, 5,625 %, échéance le 15/04/2027	7 252	0,60
7 540 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 8,000 %, échéance le 15/03/2026	7 361	0,61	7 500 Viking Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, échéance le 15/05/2025	6 961	0,57
551 CNX Resources Corp, 144A, 7,250 %, échéance le 14/03/2027	547	0,04	3 820 Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, échéance le 15/05/2025	4 064	0,34
11 635 CommScope Inc, 144A, 7,125 %, échéance le 01/07/2028	9 177	0,76	1 070 Vista Outdoor Inc, 144A, 4,500 %, échéance le 15/03/2029	869	0,07
6 860 Consolidated Communications Inc, 144A, 5,000 %, échéance le 01/10/2028	4 571	0,38	5 955 Vontier Corp, 1,800 %, échéance le 01/04/2026	5 197	0,43
8 000 Credit Acceptance Corp, 6,625 %, échéance le 15/03/2026	7 499	0,62	5 240 Vontier Corp, 2,400 %, échéance le 01/04/2028	4 298	0,35
1 560 Dell International LLC / EMC Corp, 6,020 %, échéance le 15/06/2026	1 580	0,13	13 920 Vontier Corp, 2,950 %, échéance le 01/04/2031	10 618	0,88
4 597 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, échéance le 20/10/2025	4 468	0,37	7 110 World Acceptance Corp, 144A, 7,000 %, échéance le 01/11/2026	5 528	0,46
12 530 Devon Energy Corp, 5,600 %, échéance le 15/07/2041	11 570	0,96	12 480 Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, échéance le 01/03/2025	12 123	1,00
195 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, échéance le 01/12/2028	156	0,01	511 694	42,28	
27 582 DISH Network Corp, 3,375 %, échéance le 15/08/2026	17 765	1,47	Zambie : 1,50 % (28 février 2022 : 1,03 %)		
2 530 FedEx Corp, 0,450 %, échéance le 04/05/2029	2 129	0,18	3 541 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,500 %, échéance le 01/03/2024	3 511	0,29
6 000 Freedom Mortgage Corp, 144A, 8,250 %, échéance le 15/04/2025	5 690	0,47	15 590 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, échéance le 15/10/2027	14 640	1,21
8 115 FS KKR Capital Corp, 3,125 %, échéance le 12/10/2028	6 680	0,55	18 151	1,50	
6 820 Goldman Sachs Group Inc/The, 0,673 %, échéance le 08/03/2024 *	6 800	0,56	706 757	58,40	
3 545 Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, échéance le 12/02/2026 *	3 220	0,27	Total des obligations et bons d'entreprises (coût 800 247 \$)		
9 560 Golub Capital BDC Inc, 2,500 %, échéance le 24/08/2026	8 280	0,68	Obligations et bons d'État : 11,58 % (28 février 2022 : 16,67 %)		
6 560 Golub Capital BDC Inc, 2,050 %, échéance le 15/02/2027	5 479	0,45	Brésil : 3,45 % (28 février 2022 : 3,08 %)		
13 773 Graham Packaging Co Inc, 144A, 7,125 %, échéance le 15/08/2028	11 862	0,98	BRL 265 490 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTNf, 10,000 %, échéance le 01/01/2033	41 738	3,45
2 695 Harsco Corp, 144A, 5,750 %, échéance le 31/07/2027	2 290	0,19	Colombie : 2,95 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
4 090 HCA Inc, 5,000 %, échéance le 15/03/2024	4 064	0,34	COP 244 435 000 TES colombien, série B, 7,000 %, échéance le 26/03/2031	35 719	2,95
5 060 HP Inc, 4,750 %, échéance le 15/01/2028	4 872	0,40	Allemagne : 1,69 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
11 040 Hyundai Capital America, 144A, 2,000 %, échéance le 15/06/2028	9 202	0,76	EUR 23 260 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,800 %, échéance le 15/02/2053	20 521	1,69
4 870 Intel Corp, 4,150 %, échéance le 05/08/2032	4 490	0,37	Mexique : 2,93 % (28 février 2022 : 0,76 %)		
2 247 Covanta Holding Corp, 144A, 7,000 %, échéance le 15/06/2025	2 243	0,19	MXN 742 900 Mexican Bonos, série M, 8,000 %, échéance le 31/07/2053	35 412	2,93
3 025 Jabil Inc, 1,700 %, échéance le 15/04/2026	2 695	0,22	États-Unis : 0,56 % (28 février 2022 : 12,04 %)		
6 580 Level 3 Financing Inc, 144A, 3,750 %, échéance le 15/07/2029	4 145	0,34	9 520 Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/02/2052	6 791	0,56
1 025 Liberty Interactive LLC, 8,250 %, échéance le 01/02/2030	420	0,03	Total des obligations et bons d'État (coût 152 725 \$)		
12 100 Main Street Capital Corp, 3,000 %, échéance le 14/07/2026	10 597	0,88	Notes de prêt : 0,43 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
6 945 MicroStrategy Inc, 144A, 6,125 %, échéance le 15/06/2028	5 773	0,48	5 250 Flutter Financing BV, 0,000 %, échéance le 04/07/2028 *	5 258	0,43
12 713 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, échéance le 20/06/2027	12 725	1,05	Total des billets d'emprunt (coût 5 139 \$)		
8 820 Affinity Gaming, 144A, 8,000 %, échéance le 01/02/2026	8 271	0,68	Organismes de placement collectif : 7,05 % (28 février 2022 : 2,53 %)		
19 660 New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, échéance le 15/09/2025	18 457	1,52	85 354 Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	85 354	7,05
4 480 New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, échéance le 30/09/2026	4 105	0,34	Total des organismes de placement collectif (coût 85 354 \$)		
3 830 Nexstar Media Inc, 144A, 4,750 %, échéance le 01/11/2028	3 352	0,28	Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (coût 1 270 189 \$)		
1 705 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 2,750 %, échéance le 09/03/2028	1 410	0,12	1 153 805	95,33	
3 255 Nordstrom Inc, 2,300 %, échéance le 08/04/2024	3 079	0,25	Swap sur défaillance de crédit : 0,11 % (28 février 2022 : 1,41 %)		
1 160 Owl Rock Capital Corp, 4,000 %, échéance le 30/03/2025	1 101	0,09	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	1 309	0,11
4 330 Owl Rock Capital Corp, 2,625 %, échéance le 15/01/2027	3 687	0,30	Contrats de change à terme : 0,29 % (28 février 2022 : 0,57 %)		
			Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	3 510	0,29
			Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
			1 158 624	95,73	
			Swap sur défaillance de crédit : 0,07 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
			Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(878)	(0,07)

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises — (suite)		
Contrats de change à terme : (1,02 %) (28 février 2022 : (1,07 %))		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(12 389)	(1,02)
Contrats à terme : (0,31 %) (28 février 2022 : (0,08 %))		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(3 704)	(0,31)
Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	(16 971)	(1,40)
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	1 141 653	94,33
Autres éléments de l'actif hors passif	68 652	5,67
Total des actifs nets	1 210 305 \$	100,00

- Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.
- 144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 558 808 000 \$, soit 46,17 % de l'actif net.
- * Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.

ABRÉVIATIONS :

Perpétuelle	– Obligation sans date d'échéance. Les obligations perpétuelles ne sont pas rachetables, mais paient des intérêts réguliers.
REMIC	– Société relais de placements immobiliers hypothécaires (Real Estate Mortgage Investment Conduit).
AUD	– Dollar australien
BRL	– Réal brésilien
COP	– Peso colombien
EUR	– Euro
GBP	– Livre britannique
MXN	– Peso mexicain

Analyse de l'actif total

	% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	86,08
Autres valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	0,43
Organismes de placement collectif	6,91
Instruments financiers dérivés	0,39
Autres actifs	6,19
Actif total	100,00

Tableau des swaps sur risque de crédit

Contrepartie	Entité de référence – protection achat/vente	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Citi	CDX.NA.HY, 5,000 % – vente	20 déc. 2023	53 518	\$ 1 309
JP Morgan	Altice France SA, 5,000 % – vente	20 déc. 2025	3 390	(3)
JP Morgan	Altice France SA, 5,000 % – vente	20 juin 2026	15 700	(265)
JP Morgan	Altice France SA, 5,000 % – vente	20 déc. 2025	1 605	(1)
JP Morgan	Altice Luxembourg SA, 5,000 % – vente	20 déc. 2025	1 605	(192)
JP Morgan	Altice Luxembourg SA, 5,000 % – vente	20 déc. 2025	3 495	(417)
Plus-value latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : 22 750 \$)				\$ 1 309
Moins-value latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				(878)
Plus-value nette des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : 22 750 \$)				\$ 431

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
02 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 2 292	Vente	BRL 11 873	\$ 25
02 mars 2023	BNY Mellon	Achat	BRL 11 872	Vente	USD 2 333	(66)
07 mars 2023	HSBC	Achat	USD 30 215	Vente	AUD 43 950	633
07 mars 2023	JP Morgan	Achat	USD 3 041	Vente	AUD 4 530	(8)
07 mars 2023	JP Morgan	Achat	AUD 48 480	Vente	USD 32 982	(351)
14 mars 2023	Barclays	Achat	USD 6 467	Vente	JPY 880 000	(10)
14 mars 2023	HSBC	Achat	USD 24 685	Vente	JPY 3 258 000	706
14 mars 2023	HSBC	Achat	JPY 4 138 000	Vente	USD 32 493	(2 038)
14 mars 2023	JP Morgan	Achat	USD 30 269	Vente	JPY 3 955 000	1 160
14 mars 2023	JP Morgan	Achat	JPY 3 955 000	Vente	USD 30 190	(1 082)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 310	Vente	AUD 454	5
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 16	Vente	CHF 15	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 28	Vente	CNH 192	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 120	Vente	EUR 114	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 14 826	Vente	EUR 13 896	112
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 1 290	Vente	GBP 1 065	10
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 3	Vente	GBP 3	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 91	Vente	SEK 953	1
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 91	Vente	SGD 123	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 2 762	Vente	SGD 3 692	23
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 422 239	Vente	USD 453 823	(6 795)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SEK 22 078	Vente	USD 2 091	20
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 50	Vente	USD 51	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP 38 570	Vente	USD 46 615	(207)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP 1 260	Vente	USD 1 512	4
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD 86 281	Vente	USD 65 147	(1 136)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CZK 638	Vente	USD 29	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SEK 4	Vente	USD –	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CNH 6 221	Vente	USD 917	(21)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CHF 469	Vente	USD 511	(12)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD 7 473	Vente	USD 5 196	(165)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD 41	Vente	USD 30	–
04 avr. 2023	BNY Mellon	Achat	BRL 11 630	Vente	USD 2 232	(25)
19 avr.-2023	HSBC	Achat	USD 7 230	Vente	BRL 37 460	140

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des Contrats de change à terme – (suite)

								Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)				
19 avr.-2023	HSBC	Achat	BRL	22 500	Vente	USD	4 433	\$ (175)
28 avril 2023	Citi	Achat	USD	2 725	Vente	MXN	52 300	(101)
05 mai 2023	HSBC	Achat	USD	30 689	Vente	EUR	28 270	671
05 mai 2023	JP Morgan	Achat	EUR	6 320	Vente	USD	6 908	(197)
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 9 078 \$)								\$ 3 510
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (17 153) \$)								(12 389)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (8 075) \$)								\$ (8 879)

Tableau des contrats à terme standardisés

	Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
Obligation japonaise 10 ans (OSE), mars 2023	Citi	(237)	\$ (255 268)	\$ (2 581)
U.S. Ultra Bond (CBT) juin 2023	Citi	2 201	297 272	(1 123)
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				\$ –
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (1 309) \$)				(3 704)
Moins-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (1 309) \$)				\$ (3 704)

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques : 81,49 % (28 février 2022 : 56,32 %)			Obligations et bons d'État : 4,43 % (28 février 2022 : 7,89 %)		
915 Bellemeade Re 2020-2 Ltd, série 2020 2A, catégorie M2, 144A, 10,617 %, échéance le 26/08/2030 *	936	2,00	Brésil : 1,90 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
440 Bellemeade Re 2020-3 Ltd, série 2020 3 A, catégorie M2, 144A, 9,467 %, échéance le 25/10/2030 *	457	0,98	BRL 5 660 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTN F, 10,000 %, échéance le 01/01/2033	890	1,90
2 180 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC15, série 2013 GC15, catégorie C, 5,170 %, échéance le 10/09/2046 *	2 102	4,50	Colombie : 1,72 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
1 297 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC17, série 2013 GC17, catégorie C, 5,110 %, échéance le 10/11/2046 *	1 255	2,68	COP 7 080 000 TES colombien, série B, 7,250 %, échéance le 26/10/2050	802	1,72
460 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, série 2014 GC23, catégorie D, 144A, 4,480 %, échéance le 10/07/2047 *	406	0,87	États-Unis : 0,81 % (28 février 2022 : 5,24 %)		
745 COMM 2014-CCRE18 Mortgage Trust, série 2014 CR18, catégorie AM, 4,103 %, échéance le 15/07/2047	721	1,54	380 Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 2,046 %, échéance le 30/04/2024 *	379	0,81
982 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R04, série 2019 R04, catégorie ZB1, 144A, 9,867 %, échéance le 25/06/2039 *	1 010	2,16	Total des obligations et bons d'État (coût 2,287 \$)		
1 448 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, série 2019 R05, catégorie 1B1, 144A, 8,717 %, échéance le 25/07/2039 *	1 487	3,18	Organismes de placement collectif : 4,74 % (28 février 2022 : 3,67 %)		
1 180 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R06, série 2019 R06, catégorie ZB1, 144A, 8,367 %, échéance le 25/09/2039 *	1 179	2,52	2 216 Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	2 216	4,74
1 180 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, série 2019 R07, catégorie 1B1, 144A, 8,017 %, échéance le 25/10/2039 *	1 173	2,51	Total des organismes de placement collectif (coût 2,216 \$)		
570 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, série 2020 R01, catégorie 1B1, 144A, 7,867 %, échéance le 25/01/2040 *	557	1,19	Actions ordinaires : 0,05 % (28 février 2022 : 0,06 %)		
982 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2016 C07, catégorie 2M2, 8,967 %, échéance le 25/05/2029 *	1 027	2,20	États-Unis : 0,05 % (28 février 2022 : 0,06 %)		
590 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2017 C01, catégorie 1B1, 10,367 %, échéance le 25/07/2029 *	653	1,40	8 Danimer Scientific Inc	22	0,05
430 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2017 C06, catégorie 1B1, 8,767 %, échéance le 25/02/2030 *	453	0,97	Total des actions ordinaires (coût 534 \$)		
1 300 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2018 C01, catégorie 1B1, 8,167 %, échéance le 25/07/2030 *	1 357	2,90	Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (coût 47 103 \$)		
1 635 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2018 C01, catégorie 1M2, 6,867 %, échéance le 25/07/2030 *	1 655	3,54	45 793	97,94	
1 415 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2018 C03, catégorie 1B1, 8,367 %, échéance le 25/10/2030 *	1 489	3,19	Contrats de change à terme : 0,86 % (28 février 2022 : 0,15 %)		
795 Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, échéance le 01/09/2052	767	1,64	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
1 501 Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, échéance le 01/12/2052	1 501	3,21	403	0,86	
1 508 Fannie Mae Pool 'MA4876', 6,000 %, échéance le 01/12/2052	1 528	3,27	Contrats à terme : 0,15 % (28 février 2022 : 0,16 %)		
891 Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, échéance le 01/09/2052	860	1,84	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
1 496 Freddie Mac Pool 'SD8278', 6,000 %, échéance le 01/12/2052	1 516	3,24	69	0,15	
1 143 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA4, série 2020 DNA4, catégorie B1, 144A, 10,617 %, échéance le 25/08/2050 *	1 241	2,65	Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat		
1 900 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, série 2021 DNA3, catégorie M2, 144A, 6,584 %, échéance le 25/10/2033 *	1 890	4,04	46 265	98,95	
1 849 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7, série 2021 DNA7, catégorie M1, 144A, 5,334 %, échéance le 25/11/2041 *	1 820	3,89	Swap sur défaillance de crédit : (0,08 %) (28 février 2022 : 0,00 %)		
EUR 1 746 GC Pastor Hipotecario 5 FTA 5, catégorie A2, 2,233 %, échéance le 21/06/2046 *	1 588	3,40	Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
30 094 GS Mortgage Securities Trust 2017-GS5, série 2017 GS5, catégorie XA, 0,827 %, échéance le 10/03/2050 *	795	1,70	(37)	(0,08)	
EUR 600 IM Pastor 3 FTH 3, catégorie B, 2,371 %, échéance le 22/03/2043 *	352	0,75	Contrats de change à terme : (0,81 %) (28 février 2022 : (0,28 %))		
920 JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C28, série 2015 C28, catégorie C, 4,145 %, échéance le 15/10/2048 *	846	1,81	Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
EUR 932 Landmark Mortgage Securities No 2 Plc 2, catégorie BC, 2,662 %, échéance le 17/06/2039 *	862	1,84	(379)	(0,81)	
1 832 Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C14, série 2014 C14, catégorie A5, 4,064 %, échéance le 15/02/2047	1 806	3,86	Contrats à terme : (0,38 %) (28 février 2022 : (0,15 %))		
442 STACR Trust 2018-DNA3, série 2018 DNA3, catégorie M2A, 144A, 6,717 %, échéance le 25/09/2048 *	445	0,95	Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
1 015 STACR Trust 2018-HRP2, série 2018 HRP2, catégorie B1, 144A, 8,817 %, échéance le 25/02/2047 *	1 043	2,23	(175)	(0,38)	
645 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28, série 2015 C28, catégorie D, 4,083 %, échéance le 15/05/2048 *	543	1,16	Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
50 611 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-LC22, série 2015 LC22, catégorie XA, 0,756 %, échéance le 15/09/2058 *	783	1,68	(591)	(1,27)	
Total des titres adossés à des hypothèques (coût 38 466 \$)			45 674	97,68	
Obligations et bons d'entreprises : 7,23 % (28 février 2022 : 11,46 %)			Autres éléments de l'actif hors passif		
Japon : 0,45 % (28 février 2022 : 0,92 %)			1 082	2,32	
230 Nissan Motor Co Ltd, 4,345 %, échéance le 17/09/2027	210	0,45	Total des actifs nets		
États-Unis : 6,78 % (28 février 2022 : 9,05 %)			46 756 \$	100,00	
270 Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, échéance le 15/12/2027	241	0,51	ABRÉVIATIONS : - REMIC – Société relais de placements immobiliers hypothécaires (Real Estate Mortgage Investment Conduit). - BRL – Réal brésilien - COP – Peso colombien - EUR – Euro		
720 Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, échéance le 15/08/2027	708	1,51			
250 Credit Acceptance Corp, 6,625 %, échéance le 15/03/2026	234	0,50			
325 DISH Network Corp, 3,375 %, échéance le 15/08/2026	209	0,45			
530 Freedom Mortgage Corp, 144A, 7,625 %, échéance le 01/05/2026	453	0,97			
795 Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, échéance le 01/08/2026	762	1,63	% de l'actif total		
530 Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, échéance le 15/05/2025	564	1,21	Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	91,80	
	3 171	6,78	Organismes de placement collectif	4,67	
Total des obligations et bons d'entreprises (coût 3 600 \$)			Instruments financiers dérivés	0,99	
	3 381	7,23	Autres actifs	2,54	
			Actif total		
				100,00	

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des swaps sur risque de crédit

Contrepartie	Entité de référence – protection achat/vente	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Citi	CDX.NA.IG, 5,000 % – achat	20 déc. 2027	2 350	\$ (37)
Plus-value latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : 154 \$)				\$ –
Moins-value latente des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : – \$)				(37)
Plus-value nette des swaps sur risque de crédit (28 février 2022 (en milliers) : 154 \$)				\$ (37)

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
03 mars 2023	Goldman Sachs	Achat	GBP 1 010	Vente	USD 1 221	\$ (6)
03 mars 2023	JP Morgan	Achat	USD 2 383	Vente	GBP 1 980	1
03 mars 2023	JP Morgan	Achat	GBP 970	Vente	USD 1 168	(2)
07 mars 2023	Citi	Achat	USD 977	Vente	AUD 1 420	21
07 mars 2023	JP Morgan	Achat	AUD 1 420	Vente	USD 966	(10)
08 mars 2023	Citi	Achat	USD 991	Vente	KRW 1 260 000	38
08 mars 2023	Citi	Achat	KRW 1 260 000	Vente	USD 969	(16)
10 mars 2023	HSBC	Achat	USD 990	Vente	THB 33 900	30
10 mars 2023	HSBC	Achat	THB 33 900	Vente	USD 983	(22)
14 mars 2023	Barclays	Achat	USD 2 483	Vente	JPY 326 000	83
14 mars 2023	Citi	Achat	USD 1 393	Vente	JPY 186 000	24
14 mars 2023	Citi	Achat	USD 1 455	Vente	JPY 198 000	(2)
14 mars 2023	Goldman Sachs	Achat	JPY 249 000	Vente	USD 1 956	(123)
14 mars 2023	JP Morgan	Achat	USD 3 222	Vente	JPY 430 000	57
14 mars 2023	JP Morgan	Achat	JPY 565 000	Vente	USD 4 248	(90)
14 mars 2023	UBS	Achat	JPY 326 000	Vente	USD 2 408	(9)
20 mars 2023	Goldman Sachs	Achat	NZD 1 500	Vente	USD 959	(31)
20 mars 2023	UBS	Achat	USD 942	Vente	NZD 1 500	15
18 avr. 2023	JP Morgan	Achat	USD 1 890	Vente	IDR 28 630 000	15
18 avr. 2023	JP Morgan	Achat	IDR 28 630 000	Vente	USD 1 902	(27)
19 avr.-2023	HSBC	Achat	USD 893	Vente	BRL 4 700	4
25 avril 2023	Citi	Achat	CAD 1 280	Vente	USD 951	(12)
25 avril 2023	HSBC	Achat	USD 952	Vente	CAD 1 280	13
27 avril 2023	JP Morgan	Achat	USD 421	Vente	COP 2 070 000	–
27 avril 2023	JP Morgan	Achat	USD 471	Vente	COP 2 300 000	4
28 avril 2023	Morgan Stanley	Achat	USD 477	Vente	MXN 9 300	(26)
28 avril 2023	Morgan Stanley	Achat	MXN 9 300	Vente	USD 480	22
05 mai 2023	JP Morgan	Achat	USD 942	Vente	EUR 890	(3)
05 mai 2023	JP Morgan	Achat	USD 2 525	Vente	EUR 2 310	72
05 mai 2023	Morgan Stanley	Achat	USD 183	Vente	EUR 170	2
02 juin 2023	JP Morgan	Achat	USD 1 171	Vente	GBP 970	2
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 79 \$)						\$ 403
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (145) \$)						(379)
Plus-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (66) \$)						\$ 24

Tableau des contrats à terme standardisés

	Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
E-Mini Nasdaq 100 Index, mars 2023	Citi	(5)	\$ (1 207)	\$ (14)
Obligation Euro-Buxl 30 ans, mars 2023	Citi	(8)	(1 136)	17
Obligation japonaise 10 ans (OSE), mars 2023	Citi	(5)	(5 386)	(74)
Russell 2000 Index, mars 2023	Citi	(27)	(2 564)	(87)
S&P 500 Index, mars 2023	Citi	(13)	(2 584)	34
U.S. 5 Year Note (CBT), juin 2023	Citi	(55)	(5 888)	18
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 86 \$)				\$ 69
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (81) \$)				(175)
Moins-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 5 \$)				\$ (106)

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d'entreprises : 96,27 % (28 février 2022 : 88,64 %)		
Australie : 0,71 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
70 FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 144A, 4,375 %, échéance le 01/04/2031	59	0,71
Brésil : 2,26 % (28 février 2022 : 5,68 %)		
245 MercadoLibre Inc, 3,125 %, échéance le 14/01/2031	189	2,26
Canada : 3,03 % (28 février 2022 : 2,28 %)		
170 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, échéance le 15/02/2026	154	1,83
110 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, échéance le 15/04/2029	101	1,20
	255	3,03
Chine : 2,32 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
200 Lenovo Group Ltd, 144A, 6,536 %, échéance le 27/07/2032	195	2,32
Israël : 7,10 % (28 février 2022 : 4,56 %)		
95 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,500 %, échéance le 30/03/2024	93	1,10
95 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, échéance le 30/03/2028	86	1,02
40 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,500 %, échéance le 30/06/2027	38	0,46
140 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, échéance le 30/06/2030	131	1,57
250 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, échéance le 21/07/2023	247	2,95
	595	7,10
Italie : 1,15 % (28 février 2022 : 1,08 %)		
EUR 100 Verde Bidco SpA, 4,625 %, échéance le 01/10/2026	97	1,15
Mexique : 1,84 % (28 février 2022 : 5,70 %)		
200 Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, échéance le 15/11/2029	155	1,84
Royaume-Uni : 2,13 % (28 février 2022 : 3,48 %)		
36 British Airways 2019-1 Class A Pass Through Trust, 144A, 3,300 %, échéance le 15/12/2032	31	0,36
160 Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 6,750 %, échéance le 01/10/2026	148	1,77
	179	2,13
États-Unis : 73,37 % (28 février 2022 : 50,72 %)		
245 Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, échéance le 15/12/2027	219	2,61
105 Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, échéance le 15/08/2027	103	1,23
230 ANGI Group SA, 144A, 3,875 %, échéance le 15/08/2028	177	2,11
245 Arko Corp, 144A, 5,125 %, échéance le 15/11/2029	194	2,32
345 Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625 %, échéance le 01/09/2028	302	3,60
65 Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, échéance le 01/02/2026	61	0,72
200 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, échéance le 15/04/2030	173	2,06
125 Carnival Corp, 144A, 4,000 %, échéance le 01/08/2028	106	1,26
20 Cimarex Energy Co, 3,900 %, échéance le 15/05/2027	17	0,21
120 Cimarex Energy Co, 4,375 %, échéance le 15/03/2029	105	1,25
50 Civitas Resources Inc, 144A, 5,000 %, échéance le 15/10/2026	46	0,55
100 Cobra AcquisitionCo LLC, 144A, 6,375 %, échéance le 01/11/2029	64	0,76
145 Credit Acceptance Corp, 144A, 5,125 %, échéance le 31/12/2024	136	1,62
105 Credit Acceptance Corp, 6,625 %, échéance le 15/03/2026	98	1,17
45 FirstCash Inc, 144A, 4,625 %, échéance le 01/09/2028	39	0,47
100 FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, échéance le 01/01/2030	89	1,06
50 Forestar Group Inc, 144A, 5,000 %, échéance le 01/03/2028	43	0,51
260 Freedom Mortgage Corp, 144A, 7,625 %, échéance le 01/05/2026	222	2,65
155 Freedom Mortgage Corp, 144A, 6,625 %, échéance le 15/01/2027	126	1,51
115 Home BancShares Inc/AR, 3,125 %, échéance le 30/01/2032 *	95	1,13
225 Horizon Therapeutics USA Inc, 144A, 5,500 %, échéance le 01/08/2027	229	2,73
35 Hyundai Capital America, 144A, 2,100 %, échéance le 15/09/202	29	0,35
200 LCPR Senior Secured Financing DAC, 144A, 6,750 %, échéance le 15/10/2027	185	2,21
200 Liberty Interactive LLC, 8,250 %, échéance le 01/02/2030	82	0,98
185 Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, échéance le 01/08/2026	177	2,11
120 Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, échéance le 01/10/2026	111	1,32
75 New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, échéance le 15/09/2025	70	0,84
40 NFP Corp, 144A, 7,500 %, échéance le 01/10/2030	38	0,45
167 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 3,450 %, échéance le 15/03/2023	167	1,99
65 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 3,875 %, échéance le 21/09/2023	64	0,77
75 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, échéance le 15/02/2028	69	0,82
35 PDC Energy Inc, 144A, 6,125 %, échéance le 15/09/2024	35	0,41
135 PDC Energy Inc, 144A, 5,750 %, échéance le 15/05/2026	129	1,54
30 PennyMac Financial Services Inc, 144A, 5,750 %, échéance le 15/09/2031	24	0,28
200 Playtika Holding Corp, 144A, 4,250 %, échéance le 15/03/2029	162	1,93

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
40 PRA Group Inc, 144A, 7,375 %, échéance le 01/09/2025	40	0,48
85 PROG Holdings Inc, 144A, 6,000 %, échéance le 15/11/2029	72	0,86
145 ROCC Holdings LLC, 144A, 9,250 %, échéance le 15/08/2026	153	1,83
45 Rocket Mortgage LLC, 144A, 5,250 %, échéance le 15/01/2028	41	0,48
45 Solaris Midstream Holdings LLC, 144A, 7,625 %, échéance le 01/04/2026	45	0,53
25 Speedway Motorsports LLC / Speedway Funding II Inc, 144A, 4,875 %, échéance le 01/11/2027	23	0,28
20 Standard Industries Inc/NJ, 144A, 4,375 %, échéance le 15/07/2030	17	0,20
90 Texas Capital Bancshares Inc, 4,000 %, échéance le 06/05/2031 *	81	0,96
275 TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, échéance le 15/03/2026	272	3,24
65 Travel + Leisure Co, 144A, 4,500 %, échéance le 01/12/2029	55	0,65
55 Travel + Leisure Co, 144A, 4,625 %, échéance le 01/03/2030	46	0,55
215 Turning Point Brands Inc, 144A, 5,625 %, échéance le 15/02/2026	195	2,32
360 Uber Technologies Inc, 144A, 7,500 %, échéance le 15/05/2025	364	4,34
35 United States Cellular Corp, 6,700 %, échéance le 15/12/2033	32	0,38
75 United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,750 %, échéance le 15/06/2027	66	0,79
170 United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, échéance le 15/04/2029	141	1,68
265 Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, échéance le 01/02/2029	228	2,72
105 ViaSat Inc, 144A, 5,625 %, échéance le 15/04/2027	96	1,14
30 VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, échéance le 15/02/2028	27	0,32
30 Western Alliance Bancorp, 3,000 %, échéance le 15/06/2031 *	26	0,31
75 Winnebago Industries Inc, 144A, 6,250 %, échéance le 15/07/2028	71	0,85
80 Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, échéance le 01/03/2025	78	0,93
	6 155	73,37

Zambie : 2,36 % (28 février 2022 : 2,09 %)		
200 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,500 %, échéance le 01/03/2024	198	2,36
Total des obligations et bons d'entreprises (coût 8 336 \$)	8 077	96,27
Organismes de placement collectif : 4,90 % (28 février 2022 : 8,68 %)		
411 Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	411	4,90
Total des organismes de placement collectif (coût 411 \$)	411	4,90
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (coût 8 747 \$)	8 488	101,17
Contrats de change à terme : 0,00 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	–	–
Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat	8 488	101,17
Contrats de change à terme : (2,29 %) (28 février 2022 : (1,93 %))		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(192)	(2,29)
Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	(192)	(2,29)
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	8 296	98,88
Autres éléments de l'actif hors passif	93	1,12
Total des actifs nets	8 389\$	100,00

– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 6 696 000 \$, soit 79,80 % de l'actif net.

* Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.

ABRÉVIATIONS :

EUR	– Euro
Analyse de l'actif total	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	91,97
Organismes de placement collectif	4,68
Autres actifs	3,35
Actif total	100,00

FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)	
03 mars 2023	JP Morgan	Achat	USD	181	Vente	GBP	150 \$ –
03 mars 2023	JP Morgan	Achat	GBP	150	Vente	USD	181 –
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	60	Vente	CAD	87 –
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	198	Vente	GBP	178 (4)
10 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	6 095	Vente	USD	6 591 (140)
05 mai 2023	JP Morgan	Achat	EUR	1 540	Vente	USD	1 683 (48)
02 juin 2023	JP Morgan	Achat	GBP	170	Vente	USD	205 –
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : – \$)							\$ –
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (196) \$)							(192)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (196) \$)							\$ (192)

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques : 13,31 % (28 février 2022 : 0,00 %)			Organismes de placement collectif : 5,60 % (28 février 2022 : 4,07 %)		
1 600 Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, échéance le 01/09/2052	1 543	2,22	30 Franklin Templeton Global Funds Plc – FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund – LM Class US\$ Accumulating	3 886	5,60
496 Fannie Mae Pool 'MA4785', 5,000 %, échéance le 01/10/2052	488	0,70	Total des organismes de placement collectif (coût 3,500 \$)	3 886	5,60
1 182 Fannie Mae Pool 'MA4841', 5,000 %, échéance le 01/12/2052	1 163	1,67	Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (coût 76 433 \$)	69 694	100,41
1 344 Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, échéance le 01/12/2052	1 344	1,94	Contrats de change à terme : 0,36 % (28 février 2022 : 3,38 %)		
498 Freddie Mac Pool 'RA7790', 5,000 %, échéance le 01/08/2052	490	0,71	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	249	0,36
1 056 Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, échéance le 01/09/2052	1 019	1,47	Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat	69 943	100,77
749 Freddie Mac Pool 'SD8257', 4,500 %, échéance le 01/10/2052	723	1,04	Contrats de change à terme : (5,02 %) (28 février 2022 : (4,37 %))		
606 Freddie Mac Pool 'SD8267', 5,000 %, échéance le 01/11/2052	597	0,86	Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(3 482)	(5,02)
1 873 Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, échéance le 01/12/2052	1 872	2,70	Contrats à terme : (0,41 %) (28 février 2022 : (1,37 %))		
Total des titres adossés à des hypothèques (coût 9 207 \$)	9 239	13,31	Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(283)	(0,41)
Obligations et bons d'entreprises : 7,90 % (28 février 2022 : 16,70 %)			Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	(3 765)	(5,43)
Australie : 4,12 % (28 février 2022 : 3,75 %)			Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	66 178	95,34
1 470 Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,151 %, échéance le 14/03/2025 *	1 477	2,13	Autres éléments de l'actif hors passif	3 232	4,66
1 370 Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207 %, échéance le 22/11/2024	1 383	1,99	Total des actifs nets	69 410\$	100,00
	2 860	4,12			
États-Unis : 3,78 % (28 février 2022 : 8,20 %)					
1 270 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,700 %, échéance le 01/11/2024	1 278	1,84			
1,340 Jackson National Life Global Funding, 144A, 5,613 %, échéance le 28/06/2024 *	1 347	1,94			
	2 625	3,78			
Total des obligations et bons d'entreprises (coût 5 446 \$)	5 485	7,90			
Obligations et bons d'État : 73,60 % (28 février 2022 : 76,03 %)					
Brésil : 11,00 % (28 février 2022 : 10,36 %)					
BRL 25 840 Brazil Notas do Tesouro Nacional Série F, série NTN-F, 10,000 %, échéance le 01/01/2029	4 319	6,22			
BRL 20 530 Brazil Notas do Tesouro Nacional Série F, série NTN-F, 10,000 %, échéance le 01/01/2031	3 319	4,78			
	7 638	11,00			
Colombie : 7,24 % (28 février 2022 : 3,21 %)					
COP 12 000 000 TES colombien, série B, 6,000 %, échéance le 28/04/2028	1 863	2,69			
COP 22 555 000 TES colombien, série B, 7,000 %, échéance le 30/06/2032	3 160	4,55			
	5 023	7,24			
République tchèque : 4,84 % (28 février 2022 : 4,86 %)					
CZK 97 300 Obligation de l'État tchèque, série 138, 1,750 %, échéance le 23/06/2032	3 362	4,84			
Malaisie : 2,61 % (28 février 2022 : 3,74 %)					
MYR 4 080 Obligation de l'État malaisien, série 0313, 3,480 %, échéance le 15/03/2023	909	1,31			
MYR 930 Obligation de l'État malaisien, série 0115, 3,955 %, échéance le 15/09/2025	210	0,30			
MYR 3 070 Obligation de l'État malaisien, série 0417, 3,899 %, échéance le 16/11/2027	691	1,00			
	1 810	2,61			
Mexique 20,07 % (28 février 2022 : 17,20 %)					
MXN 39 500 Mexican Bonos, série M, 20, 8,500 %, échéance le 31/05/2029	2 066	2,97			
MXN 39 100 Mexican Bonos, série M, 30, 8,500 %, échéance le 18/11/2038	1 996	2,88			
MXN 168 300 Mexican Bonos, série M, 7,750 %, échéance le 13/11/2042	7 892	11,37			
MXN 41 300 Mexican Bonos, série M, 8,000 %, échéance le 07/11/2047	1 980	2,85			
	13 934	20,07			
Afrique du Sud : 8,58 % (28 février 2022 : 9,44 %)					
ZAR 33 800 Obligation de l'État sud-africain, série R214, 6,500 %, échéance le 28/02/2041	1 160	1,67			
ZAR 112 800 Obligation de l'État sud-africain, série 2048, 8,750 %, échéance le 28/02/2048	4 793	6,91			
	5 953	8,58			
Corée du Sud : 6,52 % (28 février 2022 : 6,92 %)					
KRW 5 130 000 Bon du Trésor coréen, série 3106, 2,000 %, échéance le 10/06/2031 *	3 403	4,90			
KRW 2 090 000 Bon du Trésor coréen, série 5103, 1,875 %, échéance le 10/03/2051 *	1 122	1,62			
	4 525	6,52			
États-Unis : 12,74 % (28 février 2022 : 9,65 %)					
7 560 Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 3,334 %, échéance le 31/07/2024	7 558	10,89			
1 280 Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 4,936 %, échéance le 31/01/2025	1 281	1,85			
	8 839	12,74			
Total des obligations et bons d'État (coût 58 280 \$)	51 084	73,60			

– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 4 207 000 \$, soit 6,06 % de l'actif net.

* Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.

ABRÉVIATIONS :

BRL	– Réal brésilien
COP	– Peso colombien
CZK	– Couronne tchèque
KRW	– Won sud-coréen
MXN	– Peso mexicain
MYR	– Ringgit malaisien
ZAR	– Rand sud-africain

Analyse de l'actif total

	% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	89,21
Organismes de placement collectif	5,27
Instruments financiers dérivés	0,34
Autres actifs	5,18
Actif total	100,00

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
03 mars 2023	Barclays	Achat	GBP 5 820	Vente	USD 7 166	\$ (165)
03 mars 2023	JP Morgan	Achat	USD 7 010	Vente	GBP 5 820	9
07 mars 2023	HSBC	Achat	AUD 170	Vente	USD 117	(2)
07 mars 2023	JP Morgan	Achat	AUD 2 390	Vente	USD 1 626	(17)
08 mars 2023	Citi	Achat	USD 2 277	Vente	KRW 2 950 000	46
10 mars 2023	HSBC	Achat	THB 85 200	Vente	USD 2 472	(59)
14 mars 2023	Barclays	Achat	JPY 33 000	Vente	USD 258	(15)
14 mars 2023	JP Morgan	Achat	JPY 1 934 000	Vente	USD 14 351	(117)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 2 269	Vente	AUD 3 318	35
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD –	Vente	GBP –	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 3	Vente	SGD 3	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD 106 876	Vente	USD 74 323	(2 364)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP 3	Vente	USD 4	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD 101	Vente	USD 76	(1)
20 mars 2023	HSBC	Achat	NZD 6 890	Vente	USD 4 309	(48)
20 mars 2023	HSBC	Achat	NOK 34 500	Vente	USD 3 541	(216)
21 mars 2023	Barclays	Achat	MYR 600	Vente	USD 140	(6)
14 avr. 2023	Citi	Achat	USD 7 140	Vente	SEK 74 200	34
14 avr. 2023	Citi	Achat	SEK 1 300	Vente	USD 126	(2)
14 avr. 2023	HSBC	Achat	SEK 72 900	Vente	USD 7 062	(81)
25 avril 2023	Citi	Achat	CAD 10 050	Vente	USD 7 465	(95)
27 avril 2023	JP Morgan	Achat	USD 1 861	Vente	COP 8 770 000	77
08 mai 2023	HSBC	Achat	CLP 5 610 000	Vente	USD 7 000	(284)
15 mai 2023	HSBC	Achat	USD 576	Vente	ZAR 10 300	19
18 mai 2023	Barclays	Achat	USD 3 390	Vente	CZK 75 000	29
02 juin 2023	JP Morgan	Achat	GBP 5 820	Vente	USD 7 024	(10)
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 3 520 \$)						\$ 249
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (4 556) \$)						(3 482)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (1 036) \$)						\$ (3 233)

Tableau des contrats à terme standardisés

Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
Euro-BTP mars 2023	Morgan Stanley	54	\$ 6 436
Plus-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : 1 151 \$)			\$ –
Moins-value latente des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (1 426) \$)			(283)
Moins-value nette des contrats à terme standardisés (28 février 2022 (en milliers) : (275) \$)			\$ (283)

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Titres adossés à des hypothèques : 18,58 %					
600 Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01, série 2022 R01, catégorie 1M2, 144A, 6,384 %, échéance le 25/12/2041 *	586	3,96	220 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, échéance le 15/10/2027	207	1,39
248 Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, série 2022 R04, catégorie 1M1, 144A, 6,484 %, échéance le 25/03/2042 *	249	1,69	175 FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 144A, 4,375 %, échéance le 01/04/2031	148	1,00
339 Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, échéance le 01/09/2052	327	2,21	175 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, échéance le 15/02/2026	158	1,07
242 Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, échéance le 01/09/2052	234	1,58		513	3,46
165 Freddie Mac Pool 'SD8257', 4,500 %, échéance le 01/10/2052	160	1,08	Multi-national : 3,87 %		
600 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7, série 2021 DNA7, catégorie M2, 144A, 6,284 %, échéance le 25/11/2041 *	575	3,88	220 Arab Petroleum Investments Corp, 144A, 1,483 %, échéance le 06/10/2026	196	1,33
600 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, série 2022 HQA2, catégorie M1B, 144A, 8,484 %, échéance le 25/07/2042 *	619	4,18	MXN 4 040 International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, échéance le 22/01/2026	188	1,27
			BRL 1 150 International Bank for Reconstruction & Development, 5,000 %, échéance le 22/01/2026	188	1,27
				572	3,87
Total des titres adossés à des hypothèques (coût 2 691 \$)					
	2 750	18,58	Pétrole et gaz : 8,11 %		
Obligations et bons d'entreprises : 59,55 %					
Compagnies aériennes : 1,76 %					
129 Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust, 144A, 4,800 %, échéance le 15/08/2027	125	0,85	150 Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250 %, échéance le 15/02/2026	145	0,98
135 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, échéance le 20/06/2027	135	0,91	150 CNX Resources Corp, 144A, 7,250 %, échéance le 14/03/2027	149	1,01
	260	1,76	155 Ecopetrol SA, 4,125 %, échéance le 16/01/2025	148	1,00
			120 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,875 %, échéance le 30/03/2026	111	0,75
Constructeurs automobiles : 4,84 %					
190 General Motors Co, 5,600 %, échéance le 15/10/2032	181	1,22	140 Occidental Petroleum Corp, 6,125 %, échéance le 01/01/2031	141	0,95
185 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 2,750 %, échéance le 09/03/2028	153	1,03	140 Talos Production Inc, 12,000 %, échéance le 15/01/2026	148	1,00
200 Stellantis NV, 5,250 %, échéance le 15/04/2023	200	1,35	165 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, échéance le 15/04/2029	151	1,02
EUR 195 Volvo Car AB, 2,500 %, échéance le 07/10/2027	183	1,24	200 Var Energi ASA, 144A, 7,500 %, échéance le 15/01/2028	207	1,40
	717	4,84		1 200	8,11
Banques : 7,54 %					
155 Bank of America Corp, 2,456 %, échéance le 22/10/2025 *	147	0,99	Emballages et contenants : 2,04 %		
EUR 200 BNP Paribas SA, 0,375 %, échéance le 14/10/2027 *	184	1,24	90 Graham Packaging Co Inc, 144A, 7,125 %, échéance le 15/08/2028	78	0,52
220 Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, échéance le 12/02/2026 *	200	1,35	85 Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC, 144A, 4,000 %, échéance le 15/10/2027	74	0,50
200 JPMorgan Chase & Co, 0,768 %, échéance le 09/08/2025 *	186	1,26	175 Sealed Air Corp, 144A, 1,573 %, échéance le 15/10/2026	151	1,02
200 Natwest Group Plc, 2,359 %, échéance le 22/05/2024 *	198	1,34		303	2,04
215 UBS AG/Londres, 144A, 0,700 %, échéance le 09/08/2024	201	1,36	Pipelines : 1,98 %		
	1 116	7,54	190 Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 2,742 %, échéance le 31/12/2039	151	1,02
Ordinateurs : 1,01 %					
155 HP Inc, 4,750 %, échéance le 15/01/2028	149	1,01	155 New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, échéance le 30/09/2026	142	0,96
Services financiers diversifiés : 3,70 %					
160 Air Lease Corp, 0,800 %, échéance le 18/08/2024	149	1,00		293	1,98
260 World Acceptance Corp, 144A, 7,000 %, échéance le 01/11/2026	202	1,37	OPCVM : 1,03 %		
225 XP Inc, 144A, 3,250 %, échéance le 01/07/2026	197	1,33	150 Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC, 144A, 7,875 %, échéance le 15/02/2025	153	1,03
	548	3,70	Semi-conducteurs : 1,21 %		
Électrique : 1,42 %					
240 AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, échéance le 31/05/2030	210	1,42	235 Micron Technologies Inc, 2,703 %, échéance le 15/04/2032	178	1,21
Electron : 2,06 %					
170 Jabil Inc, 3,600 %, échéance le 15/01/2030	150	1,01	Télécommunications : 2,32 %		
190 Vontier Corp, 2,400 %, échéance le 01/04/2028	156	1,05	180 AT&T Inc, 2,750 %, échéance le 01/06/2031	149	1,01
	306	2,06	215 Kenbourne Invest SA, 6,875 %, échéance le 26/11/2024	194	1,31
Énergie - Sources alternatives : 1,17 %					
EUR 205 Vestas Wind Systems Finance BV, 2,000 %, échéance le 15/06/2034	173	1,17		343	2,32
Ingénierie et construction : 0,75 %					
120 Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, échéance le 01/02/2026	112	0,75	Transports : 1,25 %		
Alimentation : 3,42 %					
200 BRF SA, 144A, 3,950 %, échéance le 22/05/2023	198	1,34	EUR 220 FedEx Corp, 0,450 %, échéance le 04/05/2029	185	1,25
GBP 135 Co-Operative Group Ltd, 5,125 %, échéance le 17/05/2024	160	1,08	Eau : 1,00 %		
155 JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc, 144A, 5,125 %, échéance le 01/02/2028	148	1,00	150 Solaris Midstream Holdings LLC, 144A, 7,625 %, échéance le 01/04/2026	148	1,00
	506	3,42	Total des obligations et bons d'entreprises (coût 8 882 \$)		
Gaz : 0,99 %					
150 AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp, 5,625 %, échéance le 20/05/2024	147	0,99	Obligations et bons d'État : 10,56 %		
Services de santé : 2,03 %					
160 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 8,000 %, échéance le 15/03/2026	156	1,06	Souveraine : 10,56 %		
145 HCA Inc, 5,000 %, échéance le 15/03/2024	144	0,97	BRL 640 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTNf, 10,000 %, échéance le 01/01/2031	104	0,70
	300	2,03	BRL 2 560 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTNf, 10,000 %, échéance le 01/01/2033	403	2,72
Sociétés d'investissement : 2,59 %					
135 Ares Capital Corp, 2,150 %, échéance le 15/07/2026	117	0,79	COP 2 990 000 TES colombien, série B, 7,000 %, échéance le 26/03/2031	437	2,95
130 Main Street Capital Corp, 3,000 %, échéance le 14/07/2026	114	0,77	200 Export-Import Bank of India, 144A, 5,500 %, échéance le 18/01/2033	196	1,33
180 Owl Rock Capital Corp, 2,625 %, échéance le 15/01/2027	153	1,03	MXN 8 900 Mexican Bonos, série M, 8,000 %, échéance le 31/07/2053	424	2,86
	384	2,59		1 564	10,56
			Total des obligations et bons d'État (coût 1 601 \$)		
			Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (coût 13 174 \$)		
			Swap sur défaillance de crédit : 0,22 %		
			Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
			Contrats de change à terme : 0,58 %		
			Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
			Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
			Contrats de change à terme : (0,43 %)		
			Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
			Contrats à terme : (0,83 %)		
			Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
			Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	13 062	88,23
Autres éléments de l'actif hors passif	1 742	11,77
Total des actifs nets	14 804 \$	100,00

– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 6 070 000 \$, soit 41,02 % de l'actif net.

* Titre à taux variable. Le taux d'intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.

ABRÉVIATIONS :

REMIC	– Société relais de placements immobiliers hypothécaires (Real Estate Mortgage Investment Conduit).
BRL	– Réal brésilien
COP	– Peso colombien
EUR	– Euro
GBP	– Livre britannique
MXN	– Peso mexicain

	% de l'actif total
Analyse de l'actif total	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	87,41
Instruments financiers dérivés	0,79
Autres actifs	11,80
Actif total	100,00

Tableau des swaps sur risque de crédit

Contrepartie	Entité de référence – protection achat/vente	Date d'échéance	Montant notionnel (en milliers)	Valeur (en milliers)
Citi	CDX.NA.HY, 5,000 % – vente	20 déc. 2023	1 350	\$ 33
Plus-value latente des swaps sur risque de crédit				\$ 33
Moins-value latente des swaps sur défaillance de crédit				–
Plus-value nette des swaps sur défaillance de crédit				\$ 33

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)	Devise de vente (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
03 mars 2023	JP Morgan	Achat GBP 110	Vente USD 133	\$ –
03 mars 2023	UBS	Achat USD 135	Vente GBP 110	3
07 mars 2023	HSBC	Achat USD 385	Vente AUD 560	8
07 mars 2023	JP Morgan	Achat AUD 560	Vente USD 381	(4)
14 mars 2023	Barclays	Achat USD 66	Vente JPY 9 000	–
14 mars 2023	HSBC	Achat USD 303	Vente JPY 40 000	9
14 mars 2023	HSBC	Achat JPY 49 000	Vente USD 385	(24)
14 mars 2023	JP Morgan	Achat USD 375	Vente JPY 49 000	14
14 mars 2023	JP Morgan	Achat JPY 49 000	Vente USD 374	(14)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat GBP 20	Vente USD 24	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat EUR 98	Vente USD 105	(2)
19 avr.-2023	HSBC	Achat USD 369	Vente BRL 1 910	7
19 avr.-2023	HSBC	Achat BRL 940	Vente USD 185	(7)
28 avril 2023	Citi	Achat USD 172	Vente MXN 3 300	(6)
05 mai 2023	HSBC	Achat USD 326	Vente EUR 300	7
05 mai 2023	JP Morgan	Achat USD 1 322	Vente EUR 1 210	38
05 mai 2023	UBS	Achat EUR 830	Vente USD 888	(7)
02 juin 2023	JP Morgan	Achat USD 133	Vente GBP 110	–
Plus-value latente sur les contrats de change à terme				\$ 86
Moins-value latente sur les contrats de change à terme				(64)
Plus-value nette des contrats de change à terme				\$ 22

Tableau des contrats à terme standardisés

	Contrepartie	Valeur nominale	Valeur notionnelle (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
Obligation Euro-Buxl 30 ans, mars 2023	Citi	2	\$ 284	\$ (62)
Obligation japonaise 10 ans (OSE), mars 2023	Citi	(3)	(3 231)	(47)
U.S. Ultra Bond (CBT) juin 2023	Citi	27	3 646	(14)
Plus-value latente sur les contrats à terme standardisés				\$ –
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés				(123)
Moins-value latente sur les contrats à terme				\$ (123)

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Organismes de placement collectif : 4,11 % (28 février 2022 : 4,24 %)		
41 Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	41	1,62
– iShares Russell 1000 Value ETF – ETF	63	2,49
Total des organismes de placement collectif (coût 105 \$)	104	4,11
Actions ordinaires : 97,85 % (28 février 2022 : 98,48 %)		
Publicité : 1,66 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
– Omnicom Group Inc	42	1,66
Vêtements : 0,44 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
– Capri Holdings Ltd	3	0,14
– Tapestry Inc	8	0,30
	11	0,44
Banques : 5,61 % (28 février 2022 : 22,10 %)		
– BOK Financial Corp	5	0,21
– Comerica Inc	14	0,54
1 Fifth Third Bancorp	38	1,50
1 KeyCorp	20	0,80
1 Regions Financial Corp	32	1,25
– Synovus Financial Corp	9	0,36
– Truist Financial Corp	20	0,81
– UMB Financial Corp	4	0,14
	142	5,61
Biotechnologie : 1,26 % (28 février 2022 : 2,90 %)		
– Amgen Inc	32	1,26
Matériaux de construction : 1,73 % (28 février 2022 : 2,73 %)		
– Builders FirstSource Inc	31	1,21
– Fortune Brands Innovations Inc	8	0,31
– Louisiana-Pacific Corp	5	0,21
	44	1,73
Produits chimiques : 1,89 % (28 février 2022 : 1,45 %)		
– Huntsman Corp	14	0,54
– LyondellBasell Industries NV	22	0,88
– Mosaic Co/The	12	0,47
	48	1,89
Services commerciaux : 1,90 % (28 février 2022 : 0,24 %)		
– FleetCor Technologies Inc.	18	0,70
– ManpowerGroup Inc	8	0,31
– Service Corp International/US	22	0,89
	48	1,90
Ordinateurs : 0,25 % (28 février 2022 : 2,37 %)		
– DXC Technology Co	6	0,25
Cosmétiques et soins personnels : 1,03 % (28 février 2022 : 2,00 %)		
– Procter & Gamble Co/The	26	1,03
Distribution et commerce de gros : 1,43 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
1 LKQ Corp	36	1,43
Services financiers diversifiés : 7,16 % (28 février 2022 : 5,87 %)		
– Ameriprise Financial Inc	56	2,21
– Capital One Financial Corp	46	1,83
– Credit Acceptance Corp	8	0,30
– Discover Financial Services	35	1,39
– Lazard Ltd 'A'	3	0,14
– OneMain Holdings Inc	4	0,14
– SLM Corp	4	0,17
1 Synchro Financial	25	0,98
	181	7,16
Électrique : 1,92 % (28 février 2022 : 4,34 %)		
1 Exelon Corp	34	1,32
– NextEra Energy Inc	15	0,60
	49	1,92
Composants et équipements électriques : 0,15 % (28 février 2022 : 0,07 %)		
– Acuity Brands Inc.	4	0,15
Electron 0,39 % (28 février 2022 : 1,42 %)		
– Arrow Electronics Inc	10	0,39
Alimentation : 3,71 % (28 février 2022 : 1,88 %)		
1 Kroger Co/The	56	2,21
– Mondelez International Inc	6	0,25
1 Tyson Foods Inc, A	32	1,25
	94	3,71
Produits forestiers et papier : 0,60 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
– International Paper Co.	15	0,60

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Services de santé : 4,51 % (28 février 2022 : 9,44 %)		
– DaVita Inc	17	0,67
– Laboratory Corp of America Holdings	48	1,92
– Quest Diagnostics Inc	49	1,92
	114	4,51
Constructeurs d'habitations : 0,95 % (28 février 2022 : 1,66 %)		
– PulteGroup Inc	24	0,95
Mobilier de maison : 0,15 % (28 février 2022 : 0,85 %)		
– Leggett & Platt Inc	4	0,15
Assurances : 16,01 % (28 février 2022 : 8,03 %)		
1 Aflac Inc	64	2,54
1 American International Group Inc	70	2,74
– Assurant Inc	4	0,17
– Chubb Ltd	79	3,10
– Equitable Holdings Inc	4	0,14
– Fidelity National Financial Inc	11	0,45
– First American Financial Corp	5	0,20
– Hanover Insurance Group Inc/The	6	0,22
– Hartford Financial Services Group Inc/The	38	1,48
– Old Republic International Corp	9	0,37
– Principal Financial Group Inc	33	1,30
– RLJ Corp	4	0,16
– Travelers Cos Inc/The	65	2,57
– Unum Group	11	0,44
– Voya Financial Inc	3	0,13
	406	16,01
Temps libre : 0,31 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
– Polaris Inc	8	0,31
Machines - Construction et exploitation minière : 3,26 % (28 février 2022 : 1,19 %)		
– Caterpillar Inc	83	3,26
Machines - Diversifiées : 0,22 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
– Crane Holdings Co	6	0,22
Médias : 1,59 % (28 février 2022 : 2,20 %)		
– Charter Communications Inc	4	0,17
– Nextstar Media Group Inc, A	21	0,81
– Walt Disney Co/The	15	0,61
	40	1,59
Exploitation minière : 1,40 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
– Southern Copper Corp	36	1,40
Diverses industries manufacturières : 2,97 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
1 3M Co	75	2,97
Pétrole et gaz : 4,99 % (28 février 2022 : 0,94 %)		
– Chevron Corp	11	0,43
– ConocoPhillips	8	0,32
– Exxon Mobil Corp	13	0,52
– Marathon Oil Corp	12	0,48
– Marathon Petroleum Corp.	32	1,26
– Pioneer Natural Resources Co	50	1,98
	126	4,99
Produits pharmaceutiques : 5,47 % (28 février 2022 : 7,05 %)		
– Bristol-Myers Squibb Co	13	0,52
– Cigna Group/The	45	1,78
– CVS Health Corp	11	0,43
– Johnson & Johnson	36	1,40
– Merck & Co Inc	13	0,51
1 Pfizer Inc	21	0,83
	139	5,47
Capital-investissement : 0,79 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
– Blackstone Inc	20	0,79
Détail : 9,36 % (28 février 2022 : 8,29 %)		
– Advance Auto Parts Inc	18	0,70
– Best Buy Co Inc	25	0,99
– Dick's Sporting Goods Inc	16	0,65
– Murphy USA Inc	13	0,51
– Penske Automotive Group Inc	23	0,89
– Target Corp	45	1,77
– Ulta Beauty Inc	52	2,07
– Walmart Inc	26	1,02
– Williams-Sonoma Inc	19	0,76
	237	9,36

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Semi-conducteurs : 2,53 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
– KLA Corp	56	2,20
– Teradyne Inc	8	0,33
	64	2,53
Télécommunications : 5,19 % (28 février 2022 : 1,47 %)		
2 Cisco Systems Inc	111	4,37
1 Corning Inc	20	0,82
	131	5,19
Transports : 7,02 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
– CH Robinson Worldwide, Inc.	14	0,57
1 CSX Corp	35	1,37
– FedEx Corp.	44	1,73
– Union Pacific Corp	85	3,35
	178	7,02
Total des actions ordinaires (coût 2 395 \$)	2 479	97,85
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (coût 2 500 \$)	2 583	101,96
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	2 583	101,96
Contrats de change à terme : (0,81 %) (28 février 2022 : (1,32 %))		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	(20)	(0,81)
Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	(20)	(0,81)
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	2 563	101,15
Excédent du passif par rapport aux autres éléments de l'actif	(29)	(1,15)
Total des actifs nets	2 534 \$	100,00

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)	Devise de vente (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	1 264
		Vente	USD	1 358
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 1 \$)				\$ –
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (29) \$)				(20)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (28) \$)				\$ (20)

– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

ABRÉVIATIONS :

ETF – Fonds négocié en bourse (Exchange Traded Fund).

Analyse de l'actif total	% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	94,94
Organismes de placement collectif	3,98
Autres actifs	1,08
Actif total	100,00

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF ClearBridge Value Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Actions ordinaires : 99,17 % (28 février 2022 : 96,99 %)		
Aérospatial et défense : 1,64 % (28 février 2022 : 1,43 %)		
EUR 117 Airbus SE	15 257	1,64
Compagnies aériennes : 0,82 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
147 United Airlines Holdings Inc	7 614	0,82
Constructeurs automobiles : 0,80 % (28 février 2022 : 1,26 %)		
193 General Motors Co	7 485	0,80
Banques : 10,33 % (28 février 2022 : 12,59 %)		
872 Bank of America Corp	29 878	3,21
49 Goldman Sachs Group Inc/The	17 151	1,85
108 M&T Bank Corp	16 685	1,79
82 Signature Bank/New York NY	9 416	1,01
491 Wells Fargo & Co	22 938	2,47
	96 068	10,33
Boissons : 1,17 % (28 février 2022 : 1,10 %)		
48 Constellation Brands Inc, A	10 847	1,17
Biotechnologie : 5,57 % (28 février 2022 : 5,27 %)		
45 Biogen Inc	12 082	1,30
204 BioMarin Pharmaceutical Inc	20 310	2,19
55 BioNTech SE, ADR	7 189	0,77
42 Vertex Pharmaceuticals Inc	12 188	1,31
	51 769	5,57
Produits chimiques : 2,02 % (28 février 2022 : 0,75 %)		
EUR 51 Air Liquide SA	8 147	0,88
199 Mosaic Co/The	10 594	1,14
	18 741	2,02
Cosmétiques et soins personnels : 2,71 % (28 février 2022 : 1,61 %)		
1 546 Coty Inc, A	17 449	1,88
GBP 1 992 Haleon Plc	7 710	0,83
	25 159	2,71
Distribution et commerce de gros : 1,10 % (28 février 2022 : 0,94 %)		
JPY 799 Marubeni Corp	10 195	1,10
Services financiers diversifiés : 2,60 % (28 février 2022 : 5,81 %)		
145 Capital One Financial Corp	15 796	1,70
194 OneMain Holdings Inc	8 358	0,90
	24 154	2,60
Électrique : 6,47 % (28 février 2022 : 3,02 %)		
792 AES Corp/The	19 541	2,10
147 American Electric Power Co Inc	12 885	1,39
199 Constellation Energy Corp	14 905	1,60
585 Vistra Corp	12 860	1,38
	60 191	6,47
Electron : 1,32 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
242 Sensata Technologies Holding plc	12 252	1,32
Énergie - Sources alternatives : 1,79 % (28 février 2022 : 1,74 %)		
341 Fluence Energy Inc	6 361	0,68
32 SolarEdge Technologies Inc	10 301	1,11
	16 662	1,79
Produits de santé : 1,96 % (28 février 2022 : 3,40 %)		
147 Zimmer Biomet Holdings Inc	18 177	1,96
Services de santé : 2,09 % (28 février 2022 : 2,15 %)		
117 Tenet Healthcare Corp	6 857	0,74
26 UnitedHealth Group Inc	12 546	1,35
	19 403	2,09
Sociétés holding - Diversifiées : 0,00 % (28 février 2022 : 0,32 %)		
142 East Resources Acquisition Co	25	–
Assurances : 7,60 % (28 février 2022 : 6,77 %)		
489 American International Group Inc	29 832	3,21
585 Equitable Holdings Inc	18 385	1,98
30 Everest Re Group Ltd	11 326	1,22
807 MGIC Investment Corp	11 095	1,19
	70 638	7,60
Internet : 6,89 % (28 février 2022 : 5,54 %)		
103 Altria Group Inc	11 212	1,21
173 Meta Platforms Inc, A	30 245	3,25
680 Uber Technologies Inc	22 618	2,43
	64 075	6,89
Hébergement : 2,97 % (28 février 2022 : 2,61 %)		
196 Las Vegas Sands Corp	11 244	1,21
381 MGM Resorts International	16 382	1,76
	27 626	2,97
Machines - Diversifiées : 1,57 % (28 février 2022 : 1,08 %)		
884 CNH Industrial NV	14 568	1,57

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Exploitation minière : 5,43 % (28 février 2022 : 2,86 %)		
186 Alcoa Corp	9 090	0,98
625 Freeport-McMoRan Inc	25 628	2,76
133 Royal Gold Inc	15 749	1,69
	50 467	5,43
Diverses industries manufacturières : 1,21 % (28 février 2022 : 2,31 %)		
EUR 73 Siemens AG	11 251	1,21
Pétrole et gaz : 9,97 % (28 février 2022 : 9,93 %)		
336 APA Corp	12 896	1,39
710 EQT Corp	23 551	2,53
136 Hess Corp	18 277	1,96
480 Atlassian Corp Plc	19 988	2,15
291 TotalEnergies SE, ADR	18 025	1,94
	92 737	9,97
Forage pétrolier et gazier 3,46 % (28 février 2022 : 1,57 %)		
611 Baker Hughes Co, A	18 678	2,01
254 Schlumberger Ltd	13 499	1,45
	32 177	3,46
Produits pharmaceutiques : 4,16 % (28 février 2022 : 3,33 %)		
74 AbbVie Inc	11 447	1,23
197 AstraZeneca Plc, ADR	12 832	1,38
172 CVS Health Corp	14 368	1,55
	38 647	4,16
Pipelines : 1,90 % (28 février 2022 : 2,08 %)		
471 Enbridge Inc	17 662	1,90
Immobilier : 0,86 % (28 février 2022 : 0,94 %)		
97 Howard Hughes Corp/The	8 038	0,86
Détail : 0,78 % (28 février 2022 : 1,09 %)		
279 Bloomin' Brands Inc	7 290	0,78
Semi-conducteurs : 2,44 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
247 Micron Technology Inc	14 295	1,54
97 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd, ADR	8 410	0,90
	22 705	2,44
Logiciels 5,91 % (28 février 2022 : 4,85 %)		
157 Black Knight Inc	9 344	1,00
147 Fiserv Inc	16 925	1,82
292 Oracle Corp	25 492	2,74
29 VMware Inc	3 229	0,35
	54 990	5,91
Télécommunications : 1,63 % (28 février 2022 : 3,09 %)		
106 T-Mobile US Inc	15 116	1,63
Total des actions ordinaires (coût 844 998 \$)		
	921 986	99,17
Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat (Coût 844 998\$)		
	921 986	99,17
Contrats de change à terme : 0,00 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
	10	–
Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat		
	921 996	99,17
Contrats de change à terme : (0,10 %) (28 février 2022 : (0,07 %))		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
	(976)	(0,10)
Total des passifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat		
	(976)	(0,10)
Total des actifs et passifs financiers à leur juste valeur selon le compte de résultat		
	921 020	99,07
Autres éléments de l'actif hors passif		
	8 706	0,93
Total des actifs nets		
	929 726 \$	100,00

– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

ABRÉVIATIONS :

ADR	– Certificat américain de dépôt (American Depositary Receipt).
EUR	– Euro
GBP	– Livre britannique
JPY	– Yen japonais

Analyse de l'actif total

	% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	98,03
Instruments financiers dérivés	–
Autres actifs	1,97
Actif total	100,00

FTGF ClearBridge Value Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 6	Vente	EUR 6	\$ –
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 1 001	Vente	EUR 938	9
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 9	Vente	SGD 11	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 6	Vente	SGD 8	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 59 107	Vente	USD 63 523	(947)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 287	Vente	USD 303	1
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD 2 387	Vente	USD 1 801	(29)
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 14 \$)						\$ 10
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (641) \$)						(976)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (627) \$)						\$ (966)

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Actions ordinaires : 93,97 % (28 février 2022 : 95,93 %)		
Constructeurs automobiles : 0,44 % (28 février 2022 : 0,60 %)		
22 General Motors Co	835	0,44
Banques : 5,28 % (28 février 2022 : 6,86 %)		
100 Bank of America Corp	3 423	1,81
38 JPMorgan Chase & Co	5 384	2,84
25 US Bancorp	1 199	0,63
	10 006	5,28
Boissons : 2,85 % (28 février 2022 : 2,50 %)		
40 Coca-Cola Co/The	2 396	1,26
17 PepsiCo Inc	3 017	1,59
	5 413	2,85
Matériaux de construction : 0,85 % (28 février 2022 : 0,61 %)		
9 Vulcan Materials Co	1 618	0,85
Produits chimiques : 4,64 % (28 février 2022 : 4,36 %)		
12 Air Products & Chemicals Inc	3 385	1,79
9 Ecolab Inc	1 367	0,72
20 PPG Industries Inc	2 656	1,40
6 Sherwin-Williams Co/The	1 387	0,73
	8 795	4,64
Services commerciaux : 2,23 % (28 février 2022 : 1,69 %)		
17 Automatic Data Processing Inc	3 687	1,95
7 PayPal Holdings Inc	534	0,28
	4 221	2,23
Ordinateurs : 5,41 % (28 février 2022 : 6,40 %)		
70 Apple Inc	10 257	5,41
Cosmétiques et soins personnels : 1,47 % (28 février 2022 : 1,48 %)		
20 Procter & Gamble Co/The	2 789	1,47
Services financiers diversifiés : 4,58 % (28 février 2022 : 4,04 %)		
9 CME Group Inc	1 759	0,93
14 Intercontinental Exchange Inc	1 429	0,75
25 Visa Inc, A	5 506	2,90
	8 694	4,58
Électrique : 1,27 % (28 février 2022 : 0,77 %)		
15 NextEra Energy Inc	1 046	0,55
9 Sempra Energy	1 368	0,72
	2 414	1,27
Composants et équipements électriques : 0,89 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
20 Emerson Electric Co	1 690	0,89
Electron 2,46 % (28 février 2022 : 2,16 %)		
24 Honeywell International Inc	4 660	2,46
Énergie - Sources alternatives : 0,26 % (28 février 2022 : 0,48 %)		
2 Enphase Energy Inc	493	0,26
Contrôle de l'environnement : 1,68 % (28 février 2022 : 1,43 %)		
21 Waste Management Inc	3 179	1,68
Alimentation : 1,29 % (28 février 2022 : 0,99 %)		
5 McCormick & Co Inc/MD	335	0,18
32 Mondelez International Inc	2 108	1,11
	2 443	1,29
Produits de santé : 3,08 % (28 février 2022 : 2,88 %)		
7 Stryker Corp	1 817	0,96
7 Thermo Fisher Scientific Inc	4 023	2,12
	5 840	3,08
Services de santé : 3,11 % (28 février 2022 : 2,83 %)		
12 UnitedHealth Group Inc	5 899	3,11
Assurances : 7,66 % (28 février 2022 : 6,35 %)		
– Berkshire Hathaway Inc	6 474	3,41
13 Hartford Financial Services Group Inc/The	1 003	0,53
17 Progressive Corp/The	2 455	1,30
25 Travelers Cos Inc/The	4 590	2,42
	14 522	7,66
Internet : 5,69 % (28 février 2022 : 10,60 %)		
28 Alphabet Inc	2 490	1,31
32 Alphabet Inc, A	2 925	1,54
47 Amazon.com Inc	4 446	2,35
4 Meta Platforms Inc, A	700	0,37
1 Palo Alto Networks Inc	235	0,12
	10 796	5,69
Fer/acier : 1,09 % (28 février 2022 : 0,99 %)		
68 ArcelorMittal SA	2 065	1,09
Hébergement : 0,39 % (28 février 2022 : 0,16 %)		
4 Marriott International Inc/MD	739	0,39

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Médias : 1,98 % (28 février 2022 : 2,92 %)		
66 Comcast Corp	2 454	1,29
13 Walt Disney Co/The	1 308	0,69
	3 762	1,98
Diverses industries manufacturières : 1,03 % (28 février 2022 : 0,57 %)		
11 Eaton Corp Plc	1 960	1,03
Pétrole et gaz : 1,53 % (28 février 2022 : 1,62 %)		
14 Pioneer Natural Resources Co	2 897	1,53
Emballages et contenants : 0,65 % (28 février 2022 : 0,90 %)		
22 Ball Corp	1 231	0,65
Produits pharmaceutiques : 9,05 % (28 février 2022 : 6,90 %)		
4 AbbVie Inc	688	0,36
9 Becton Dickinson and Co	2 173	1,15
7 Eli Lilly & Co	2 137	1,13
29 Johnson & Johnson	4 461	2,35
50 Merck & Co Inc	5 302	2,80
59 Pfizer Inc	2 393	1,26
	17 154	9,05
Pipelines : 0,73 % (28 février 2022 : 0,51 %)		
81 Kinder Morgan Inc	1 384	0,73
Détail : 5,87 % (28 février 2022 : 4,29 %)		
2 Costco Wholesale Corp	1 146	0,60
11 Home Depot Inc/The	3 137	1,66
59 TJX Cos Inc/The	4 514	2,38
16 Walmart Inc	2 329	1,23
	11 126	5,87
Semi-conducteurs : 1,79 % (28 février 2022 : 1,45 %)		
3 ASML Holding NV	1 725	0,91
7 NVIDIA Corp	1 667	0,88
	3 392	1,79
Logiciels : 9,29 % (28 février 2022 : 11,76 %)		
6 Adobe Inc	2 088	1,10
52 Microsoft Corp	13 012	6,86
29 Oracle Corp	2 514	1,33
	17 614	9,29
Télécommunications : 2,55 % (28 février 2022 : 3,33 %)		
7 Arista Networks Inc	1 024	0,54
17 T-Mobile US Inc	2 385	1,26
37 Verizon Communications Inc	1 434	0,75
	4 843	2,55
Transports : 2,88 % (28 février 2022 : 2,75 %)		
18 Canadian Pacific Railway Ltd	1 352	0,72
4 Union Pacific Corp	895	0,47
18 United Parcel Service Inc, B	3 207	1,69
	5 454	2,88
Total des actions ordinaires (coût 140 839\$)		
	178 185	93,97
Real Estate Investment Trusts : 1,32 % (28 février 2022 : 1,25 %)		
OPCVM : 1,32 % (28 février 2022 : 1,25 %)		
13 American Tower Corp	2 496	1,32
Total des fonds communs immobiliers (coût 2 121 \$)		
	2 496	1,32
Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat		
	180 681	95,29
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
	180 681	95,29
Autres éléments de l'actif hors passif		
	8 929	4,71
Total des actifs nets		
	189 610 \$	100,00
– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.		
Analyse de l'actif total		% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé		95,09
Autres actifs		4,91
Actif total		100,00

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Actions ordinaires : 94,00 % (28 février 2022 : 97,57 %)		
Vêtements : 2,34 % (28 février 2022 : 1,68 %)		
242 NIKE Inc	28 726	2,34
Constructeurs automobiles : 0,78 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
46 Tesla Inc	9 526	0,78
Pièces et équipements automobiles : 1,59 % (28 février 2022 : 1,54 %)		
168 Aptiv Plc	19 492	1,59
Boissons : 2,54 % (28 février 2022 : 1,63 %)		
306 Monster Beverage Corp	31 089	2,54
Produits chimiques : 1,40 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
78 Sherwin-Williams Co/The	17 190	1,40
Services financiers : 4,38 % (28 février 2022 : 3,83 %)		
292 PayPal Holdings Inc	21 466	1,75
94 S&P Global Inc	32 228	2,63
	53 694	4,38
Ordinateurs : 4,50 % (28 février 2022 : 4,50 %)		
374 Apple Inc	55 121	4,50
Cosmétiques et soins personnels : 1,77 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
89 Estee Lauder Cos., Inc. (The) 'A'	21 700	1,77
Distribution et commerce de gros : 2,87 % (28 février 2022 : 2,08 %)		
53 WW Grainger Inc	35 181	2,87
Services financiers diversifiés : 5,87 % (28 février 2022 : 4,64 %)		
327 Visa Inc, A	71 892	5,87
Électrique : 0,97 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
167 NextEra Energy Inc	11 886	0,97
Electron 2,13 % (28 février 2022 : 1,97 %)		
136 Honeywell International Inc	26 106	2,13
Produits de santé : 8,51 % (28 février 2022 : 6,23 %)		
358 Alcon Inc	24 406	1,99
97 Intuitive Surgical Inc	22 179	1,81
92 Stryker Corp	24 102	1,97
62 Thermo Fisher Scientific Inc	33 647	2,74
	104 334	8,51
Services de santé : 3,99 % (28 février 2022 : 3,99 %)		
103 UnitedHealth Group Inc	48 925	3,99
Assurances : 1,78 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
135 Marsh & McLennan Cos.	21 872	1,78
Internet : 16,25 % (28 février 2022 : 23,84 %)		
781 Amazon.com Inc	73 548	6,00
176 Meta Platforms Inc, A	30 721	2,51
110 Netflix Inc	35 467	2,89
164 Palo Alto Networks Inc	30 935	2,52
139 Sea Ltd, ADR	8 668	0,71
598 Uber Technologies Inc	19 901	1,62
	199 240	16,25
Diverses industries manufacturières : 2,55 % (28 février 2022 : 1,67 %)		
178 Eaton Corp Plc	31 219	2,55
Produits pharmaceutiques : 4,30 % (28 février 2022 : 3,43 %)		
208 Dexcom Inc	23 117	1,89
177 Zoetis Inc	29 530	2,41
	52 647	4,30

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Détail : 1,08 % (28 février 2022 : 4,67 %)		
91 Advance Auto Parts Inc	13 250	1,08
Semi-conducteurs : 7,23 % (28 février 2022 : 6,96 %)		
38 ASML Holding NV	23 680	1,93
347 Intel Corp	8 634	0,71
242 NVIDIA Corp	56 270	4,59
	88 584	7,23
Logiciels : 15,08 % (28 février 2022 : 19,87 %)		
54 Adobe Inc	17 332	1,41
92 Atlassian Corp	15 037	1,23
353 Microsoft Corp	88 024	7,18
156 Salesforce Inc	25 448	2,08
170 Splunk Inc	17 454	1,42
123 Unity Software Inc	3 733	0,31
96 Workday Inc, A	17 798	1,45
	184 826	15,08
Transports : 2,09 % (28 février 2022 : 2,84 %)		
141 United Parcel Service Inc, B	25 643	2,09
Total des actions ordinaires (coût 1 007 153 \$)		
	1 152 143	94,00
Fonds de placement immobilier : 1,68 % (28 février 2022 : 1,51 %)		
OPCVM : 1,68 % (28 février 2022 : 1,51 %)		
30 Equinix Inc	20 644	1,68
Total des fonds communs immobiliers (coût 14 198 \$)		
	20 644	1,68
Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat (Coût 1 021 351 \$)		
	1 172 787	95,68
Contrats de change à terme : 0,02 % (28 février 2022 : 0,26 %)		
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
	286	0,02
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
	1 173 073	95,70
Contrats de change à terme : (0,12 %) (28 février 2022 : (0,10 %))		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
	(1 551)	(0,12)
Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
	(1 551)	(0,12)
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
	1 171 522	95,58
Autres éléments de l'actif hors passif		
	54 213	4,42
Total des actifs nets		
	1 225 735 \$	100,00

– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

ABRÉVIATIONS :

ADR – Certificat américain de dépôt (American Depositary Receipt).

	% de l'actif total
Analyse de l'actif total	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	95,13
Instruments financiers dérivés	0,02
Autres actifs	4,85
Actif total	100,00

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)	Devise de vente (en milliers)	Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
02 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 25 581	Vente BRL 132 514 \$ 272
02 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 2 659	Vente BRL 14 000 (15)
02 mars 2023	BNY Mellon	Achat	BRL 146 513	Vente USD 28 783 (798)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 1 382	Vente EUR 1 294 11
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 11	Vente EUR 10 –
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 29 433	Vente USD 31 631 (471)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 16	Vente USD 17 –
04 avr. 2023	BNY Mellon	Achat	USD 478	Vente BRL 2 500 3
04 avr. 2023	BNY Mellon	Achat	BRL 122 438	Vente USD 23 492 (267)
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 4 603 \$)				\$ 286
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (1 709) \$)				(1 551)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 2 894 \$)				\$ (1 265)

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Actions ordinaires : 95,22 % (28 février 2022 : 99,69 %)		
Boissons : 1,70 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
22 Diageo Plc, ADR	3 825	1,70
Biotechnologie : 14,46 % (28 février 2022 : 14,56 %)		
28 Biogen Inc	7 588	3,37
40 Guardant Health Inc	1 235	0,55
123 Ionis Pharmaceuticals Inc	4 409	1,96
56 Ultragenyx Pharmaceutical Inc	2 486	1,11
58 Vertex Pharmaceuticals Inc	16 787	7,47
	32 505	14,46
Matériaux de construction : 3,56 % (28 février 2022 : 2,69 %)		
128 Johnson Controls International plc	7 995	3,56
Ordinateurs : 6,43 % (28 février 2022 : 7,53 %)		
7 Accenture Plc, A	1 784	0,80
54 CrowdStrike Holdings Inc	6 480	2,88
74 Seagate Technology Holdings Plc	4 745	2,11
37 Western Digital Corp	1 433	0,64
	14 442	6,43
Services financiers diversifiés : 0,67 % (28 février 2022 : 0,50 %)		
21 Cohen & Steers Inc	1 507	0,67
Electron : 6,57 % (28 février 2022 : 6,74 %)		
116 TE Connectivity Ltd	14 779	6,57
Divertissement : 4,72 % (28 février 2022 : 4,52 %)		
53 Madison Square Garden Entertainment Corp	3 195	1,42
39 Madison Square Garden Sports Corp	7 409	3,30
	10 604	4,72
Produits de santé : 2,10 % (28 février 2022 : 2,03 %)		
17 Insulet Corp	4 717	2,10
Services de santé : 9,41 % (28 février 2022 : 8,72 %)		
21 Charles River Laboratories International Inc	4 684	2,08
35 UnitedHealth Group Inc	16 473	7,33
	21 157	9,41
Mobilier de maison : 1,46 % (28 février 2022 : 1,41 %)		
40 Dolby Laboratories Inc, A	3 284	1,46
Internet : 5,83 % (28 février 2022 : 10,96 %)		
32 Airbnb Inc	3 940	1,75
44 Etsy Inc	5 373	2,39
113 Lyft Inc	1 128	0,50
29 Match Group Inc	1 203	0,54
8 Meta Platforms Inc, A	1 453	0,65
	13 097	5,83
Médias : 10,44 % (28 février 2022 : 17,93 %)		
38 AMC Networks Inc	842	0,37
271 Comcast Corp	10 084	4,48
32 Liberty Broadband Corp	2 802	1,25
16 Liberty Broadband Corp	1 411	0,63
74 Liberty Media Corp-Liberty Formula One, C	5 028	2,24
49 Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	1 591	0,71
110 Warner Bros Discovery Inc	1 710	0,76
	23 468	10,44
Exploitation minière : 1,49 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
81 Freeport-McMoRan Inc	3 340	1,49
Produits pharmaceutiques : 2,14 % (28 février 2022 : 1,04 %)		
31 AbbVie Inc	4 818	2,14
Semi-conducteurs : 11,40 % (28 février 2022 : 11,73 %)		
30 Broadcom Inc	17 772	7,90
106 Wolfspeed Inc	7 861	3,50
	25 633	11,40
Logiciels : 12,84 % (28 février 2022 : 9,33 %)		
58 Autodesk Inc	11 555	5,14
40 DocuSign Inc, A	2 472	1,10
81 Doximity Inc	2 721	1,21
21 HubSpot Inc	8 114	3,61
26 Flocon de neige Inc	4 006	1,78
	28 868	12,84
Total des actions ordinaires (coût 169 098 \$)		
	214 039	95,22
Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat (Coût 169 098\$)		
	214 039	95,22

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Contrats de change à terme : 0,00 % (28 février 2022 : 0,02 %)		
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
	4	–
Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat		
	214 043	95,22
Contrats de change à terme : (0,10 %) (28 février 2022 : (0,02 %))		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
	(229)	(0,10)
Total des passifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat		
	(229)	(0,10)
Total des actifs et passifs financiers à leur juste valeur selon le compte de résultat		
	213 814	95,12
Autres éléments de l'actif hors passif		
	10 979	4,88
Total des actifs nets		
	224 793 \$	100,00

– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

ABRÉVIATIONS :

ADR – Certificat américain de dépôt (American Depositary Receipt).

	% de l'actif total
Analyse de l'actif total	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	94,76
Instruments financiers dérivés	–
Autres actifs	5,24
Actif total	100,00

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)			Devise de vente (en milliers)			Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	209	Vente	AUD	310	\$ –
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	3	Vente	AUD	5	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	2	Vente	CHF	2	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	45	Vente	CNH	314	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	170	Vente	CNH	1 159	4
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	33	Vente	EUR	31	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	3	Vente	EUR	2	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	15	Vente	GBP	13	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	1	Vente	SEK	8	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	60	Vente	SGD	81	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	731	Vente	USD	786	(12)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	302	Vente	USD	364	(2)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD	1	Vente	USD	–	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SEK	1	Vente	USD	–	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD	1 922	Vente	USD	1 451	(25)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CHF	47	Vente	USD	51	(1)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CNH	8 276	Vente	USD	1 221	(28)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SEK	196	Vente	USD	19	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD	7 259	Vente	USD	5 048	(161)
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 113 \$)								\$ 4
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (123) \$)								(229)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (10) \$)								\$ (225)

Les notes annexes font partie intégrante des états financiers.

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Actions ordinaires : 78,26 % (28 février 2022 : 74,41 %)			Capital-investissement : 1,83 % (28 février 2022 : 1,72 %)		
Aérospatial et défense : 2,40 % (28 février 2022 : 1,75 %)			8 Blackstone Inc	705	1,83
1 L3Harris Technologies Inc	199	0,52	Semi-conducteurs : 7,20 % (28 février 2022 : 6,30 %)		
7 Raytheon Technologies Corp	725	1,88	– ASML Holding NV	217	0,57
	924	2,40	2 Broadcom Inc	1 345	3,49
Banques : 3,73 % (28 février 2022 : 3,47 %)			1 NXP Semiconductors NV	266	0,69
21 Bank of America Corp	713	1,85	5 QUALCOMM Inc	586	1,52
5 JPMorgan Chase & Co	724	1,88	2 Texas Instruments Inc	359	0,93
	1 437	3,73		2 773	7,20
Boissons : 1,83 % (28 février 2022 : 1,71 %)			Logiciels : 9,72 % (28 février 2022 : 9,22 %)		
12 Coca-Cola Co/The	707	1,83	6 Activision Blizzard Inc	490	1,27
Biotechnologie : 1,29 % (28 février 2022 : 1,13 %)			8 Microsoft Corp	2 102	5,45
2 Amgen Inc	499	1,29	10 Oracle Corp	888	2,31
Produits chimiques : 2,33 % (28 février 2022 : 2,08 %)			2 Paychex Inc	266	0,69
2 Air Products & Chemicals Inc	457	1,18		3 746	9,72
15 Huntsman Corp	442	1,15	Télécommunications : 2,44 % (28 février 2022 : 2,88 %)		
	899	2,33	10 Cisco Systems Inc	484	1,26
Ordinateurs : 4,70 % (28 février 2022 : 6,60 %)			12 Verizon Communications Inc	454	1,18
12 Apple Inc	1 812	4,70		938	2,44
Cosmétiques et soins personnels : 1,56 % (28 février 2022 : 1,58 %)			Transports : 1,45 % (28 février 2022 : 0,74 %)		
4 Procter & Gamble Co/The	602	1,56	1 Union Pacific Corp	195	0,51
Services financiers diversifiés : 3,69 % (28 février 2022 : 3,57 %)			2 United Parcel Service Inc, B	363	0,94
3 Apollo Global Management Inc	229	0,59		558	1,45
39 Blue Owl Capital Inc, A	481	1,25	Total des actions ordinaires (coût 22 275\$)		
1 CME Group Inc	276	0,72		30 154	78,26
4 Intercontinental Exchange Inc	435	1,13	Obligations et bons d'entreprises : 1,45 % (28 février 2022 : 1,93 %)		
	1 421	3,69	Compagnies aériennes : 1,45 % (28 février 2022 : 1,43 %)		
Électrique : 4,78 % (28 février 2022 : 3,22 %)			460 American Airlines Group Inc, 6,500 %, échéance le 01/07/2025	557	1,45
CAD			Total des obligations et bons d'entreprises (coût 488\$)		
4 Brookfield Renewable Corp	114	0,30		557	1,45
19 Brookfield Renewable Energy Partners LP/CA, MLP #	498	1,29	Actions privilégiées : 6,35 % (28 février 2022 : 13,76 %)		
5 DTE Energy Co	518	1,35	Pièces et équipements automobiles : 1,15 % (28 février 2022 : 1,18 %)		
4 NextEra Energy Inc	295	0,76	4 Aptiv Plc, série A	444	1,15
7 PPL Corp	179	0,46	Électrique : 1,34 % (28 février 2022 : 2,51 %)		
2 Sempra Energy	238	0,62	11 NextEra Energy Inc	518	1,34
	1 842	4,78	Gaz : 0,38 % (28 février 2022 : 0,96 %)		
Composants et équipements électriques : 0,94 % (28 février 2022 : 0,94 %)			3 Spire Inc, série A	146	0,38
4 Emerson Electric Co	361	0,94	Produits de santé : 0,37 % (28 février 2022 : 1,88 %)		
Electron : 0,50 % (28 février 2022 : 0,49 %)			1 Boston Scientific Corp, série A	141	0,37
2 TE Connectivity Ltd	194	0,50	Médias : 0,69 % (28 février 2022 : 1,05 %)		
Énergie - Sources alternatives : 0,97 % (28 février 2022 : 0,92 %)			9 Paramount Global, série A	264	0,69
6 NextEra Energy Partners LP	374	0,97	Capital-investissement : 2,42 % (28 février 2022 : 2,41 %)		
Outils à main/machine : 0,49 % (28 février 2022 : 1,81 %)			14 KKR & Co Inc, série C	933	2,42
2 Stanley Black & Decker Inc	187	0,49	Total des actions privilégiées (coût 2 636\$)		
Produits de santé : 1,60 % (28 février 2022 : 0,00 %)				2 446	6,35
2 Danaher Corp	615	1,60	Fonds de placement immobilier : 8,91 % (28 février 2022 : 7,43 %)		
Produits et articles ménagers : 0,97 % (28 février 2022 : 0,90 %)			OPCVM : 8,91 % (28 février 2022 : 7,43 %)		
3 Kimberly-Clark Corp	375	0,97	43 AGNC Investment Corp.	468	1,21
Assurances : 0,88 % (28 février 2022 : 1,32 %)			4 Alexandria Real Estate Equities Inc	534	1,39
2 Chubb Ltd	341	0,88	2 American Tower Corp	444	1,15
Sociétés d'investissement : 1,97 % (28 février 2022 : 3,58 %)			6 Apartment Income REIT Corp	232	0,60
16 Ares Capital Corp	301	0,78	1 Crown Castle Inc	162	0,42
23 Barings BDC Inc	203	0,53	1 Equinix Inc	395	1,03
19 Trinity Capital Inc	256	0,66	3 Equity LifeStyle Properties Inc	190	0,49
	760	1,97	7 Gaming and Leisure Properties Inc	398	1,03
Machines - Diversifiées : 1,89 % (28 février 2022 : 1,26 %)			9 Global Medical REIT Inc	93	0,24
9 Otis Worldwide Corp	728	1,89	2 Prologis Inc	239	0,62
Pétrole et gaz : 0,48 % (28 février 2022 : 0,00 %)			1 SBA Communications Corp, A	183	0,48
2 ConocoPhillips	184	0,48	3 Weyerhaeuser Co	95	0,25
Produits pharmaceutiques : 6,46 % (28 février 2022 : 5,07 %)				3 433	8,91
3 Johnson & Johnson	523	1,36	Total des fonds communs immobiliers (coût 2 874 \$)		
10 Merck & Co Inc	1 082	2,81		3 433	8,91
22 Pfizer Inc	883	2,29	Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (coût 28 273 \$)		
	2 488	6,46		36 590	94,97
Pipelines : 12,16 % (28 février 2022 : 11,23 %)			Contrats de change à terme : 0,00 % (28 février 2022 : 0,05 %)		
7 DT Midstream Inc	329	0,85	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
18 Enbridge Inc	680	1,76		1	–
59 Equitrans Midstream Corp	356	0,92	Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat		
37 Kinder Morgan Inc	634	1,65		36 591	94,97
6 ONEOK Inc	376	0,98	Contrats de change à terme : (0,14 %) (28 février 2022 : (0,09 %))		
62 Plains GP Holdings LP, A	868	2,25	Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
10 TC Energy Corp	380	0,99		(56)	(0,14)
35 Williams Cos Inc/The	1 061	2,76	Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
	4 684	12,16		(56)	(0,14)
			Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
				36 535	94,83
			Autres éléments de l'actif hors passif		
				1 993	5,17
			Total des actifs nets		
				38 528\$	100,00

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

Société en commandite ouverte (MLP).

ABRÉVIATIONS :

CAD – Dollar canadien

Analyse de l'actif total	% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	94,49
Instruments financiers dérivés	–
Autres actifs	5,51
Actif total	100,00

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 28	Vente	AUD 42	\$ –
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 2	Vente	CNH 14	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 29	Vente	EUR 27	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 22	Vente	EUR 20	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 19	Vente	SGD 26	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 34	Vente	SGD 45	1
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD 882	Vente	USD 666	(11)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 850	Vente	USD 914	(14)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CNH 432	Vente	USD 64	(2)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD 1 325	Vente	USD 921	(29)
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 20 \$)						\$ 1
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (38) \$)						(56)
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : (18) \$)						\$ (55)

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Actions ordinaires : 96,28 % (28 février 2022 : 100,01 %)			Médias : 1,56 % (28 février 2022 : 3,15 %)		
Vêtements : 1,61 % (28 février 2022 : 1,63 %)			258 Walt Disney Co/The		
222 NIKE Inc	26 365	1,61	25 686	1,56	
Pièces et équipements automobiles : 1,25 % (28 février 2022 : 1,33 %)			Diverses industries manufacturières : 2,29 % (28 février 2022 : 3,51 %)		
177 Aptiv Plc	20 507	1,25	215 Eaton Corp Plc	37 593	2,29
Banques : 6,59 % (28 février 2022 : 6,68 %)			Emballages et contenants : 1,50 % (28 février 2022 : 2,10 %)		
120 Bank of America Corp	41 816	2,55	438 Ball Corp	24 647	1,50
219 First Republic Bank/CA	26 957	1,64	Produits pharmaceutiques : 5,46 % (28 février 2022 : 2,62 %)		
408 Morgan Stanley	39 356	2,40	386 CVS Health Corp	32 220	1,97
	108 129	6,59	179 Johnson & Johnson	27 457	1,67
Biotechnologie : 3,47 % (28 février 2022 : 3,26 %)			211 Novo Nordisk A/S ADR	29 807	1,82
281 BioMarin Pharmaceutical Inc	27 976	1,71		89 484	5,46
359 Gilead Sciences Inc	28 903	1,76	Détail : 5,83 % (28 février 2022 : 6,37 %)		
	56 879	3,47	84 Costco Wholesale Corp	40 669	2,48
Matériaux de construction : 3,27 % (28 février 2022 : 1,47 %)			114 Home Depot Inc/The	33 653	2,05
190 Trane Technologies Plc	35 113	2,14	170 Williams-Sonoma Inc	21 229	1,30
362 Trex Co Inc	18 502	1,13		95 551	5,83
	53 615	3,27	Semi-conducteurs : 3,66 % (28 février 2022 : 3,87 %)		
Chimie : 1,43 % (28 février 2022 : 1,19 %)			44 ASML Holding NV	27 176	1,66
147 Ecolab Inc	23 455	1,43	424 ON Semiconductor Corp	32 835	2,00
Services commerciaux : 1,20 % (28 février 2022 : 0,97 %)				60 011	3,66
524 Progyny Inc	19 670	1,20	Logiciels : 8,95 % (28 février 2022 : 11,51 %)		
Ordinateurs : 6,53 % (28 février 2022 : 5,47 %)			398 Microsoft Corp	99 261	6,05
89 Accenture Plc, A	23 709	1,44	148 Salesforce Inc	24 269	1,48
566 Apple Inc	83 411	5,09	64 Synopsys Inc	23 203	1,42
	107 120	6,53		146 733	8,95
Services financiers diversifiés : 5,42 % (28 février 2022 : 5,28 %)			Télécommunications : 1,86 % (28 février 2022 : 1,92 %)		
34 BlackRock Inc	23 494	1,43	631 Cisco Systems Inc	30 523	1,86
396 Charles Schwab Corp/The	30 823	1,88	Total des actions ordinaires (coût 1 631 475\$)		
157 Visa Inc, A	34 559	2,11		1 578 969	96,28
	88 876	5,42	Real Estate Investment Trusts : 3,05 % (28 février 2022 : 1,22 %)		
Électrique : 1,29 % (28 février 2022 : 3,15 %)			REITS : 3,05 % (28 février 2022 : 1,22 %)		
CAD 759 Brookfield Renewable Corp	21 126	1,29	30 Equinix Inc	20 929	1,27
Electroniques : 3,82 % (28 février 2022 : 3,84 %)			236 Prologis Inc	29 135	1,78
182 Keysight Technologies Inc	29 089	1,77		50 064	3,05
264 TE Connectivity Ltd	33 544	2,05	Total des fonds communs immobiliers (coût 48 550\$)		
	62 633	3,82		50 064	3,05
Énergie - Sources alternatives : 4,53 % (28 février 2022 : 2,25 %)			Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat (Coût 1 680 025\$)		
58 Enphase Energy Inc	12 292	0,75		1 629 033	99,33
311 NextEra Energy Partners LP	20 599	1,26	Contrats de change à terme : 0,00 % (28 février 2022 : 0,01 %)		
733 Shoals Technologies Group Inc 'A'	17 968	1,09	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
74 SolarEdge Technologies Inc	23 463	1,43		22	–
	74 322	4,53	Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
Alimentation : 1,68 % (28 février 2022 : 3,77 %)				1 629 055	99,33
371 McCormick & Co Inc/MD	27 589	1,68	Contrats de change à terme : -0,05 % (28 février 2022 : -0,13 %)		
Outils à main/machine : 2,35 % (28 février 2022 : 2,14 %)			Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
244 Regal Rexnord Corp	38 524	2,35		-840	-0,05
Produits de santé : 5,15 % (28 février 2022 : 5,71 %)			Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
74 Cooper Cos Inc/The	24 117	1,47		-840	-0,05
121 Danaher Corp	30 009	1,83	Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
56 Thermo Fisher Scientific Inc	30 316	1,85		1 628 215	99,28
	84 442	5,15	Autres éléments de l'actif hors passif		
Services de santé : 2,71 % (28 février 2022 : 2,93 %)				11 764	0,72
94 UnitedHealth Group Inc	44 479	2,71	Total des actifs nets		
Assurances : 4,57 % (28 février 2022 : 3,99 %)				1 639 979	100,00
478 Hartford Financial Services Group Inc/The	37 432	2,28	– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.		
261 Progressive Corp/The	37 528	2,29			
	74 960	4,57	ABRÉVIATIONS :		
Internet : 5,25 % (28 février 2022 : 4,21 %)			ADR – Certificat américain de dépôt (American Depositary Receipt).		
361 Alphabet Inc, A	32 522	1,99	CAD – Dollar canadien		
15 Booking Holdings Inc	37 593	2,29			
131 Etsy Inc	15 930	0,97			
	86 045	5,25			
Machines - Construction et exploitation minière : 0,86 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
651 Bloom Energy Corp, A	14 110	0,86			
Machines - Diversifiées : 2,19 % (28 février 2022 : 1,51 %)					
86 Deere & Co	35 895	2,19			

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)	
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	1 400	Vente	EUR	1 317 \$ 8
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	27	Vente	EUR	25 –
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	2 920	Vente	GBP	2 416 11
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	130	Vente	GBP	109 -1
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	30 569	Vente	USD	32 854 -489
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	65 150	Vente	USD	78 738 -350
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	89	Vente	USD	106 1
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	687	Vente	USD	725 2
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 145 \$)							\$ 22
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : -2 099 \$)							-840
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : -1 954 \$)							\$ -818

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

ACTIONS (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	ACTIONS (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Actions ordinaires : 97,30 % (28 février 2022 : 89,23 %)					
Australie : 1,09 % (28 février 2022 : 0,45 %)					
AUD 17 Brambles Ltd	143	1,09	AUD 7 Computershare Ltd	122	0,92
Canada : 3,76 % (28 février 2022 : 4,08 %)			23 Coty Inc, A	254	1,93
CAD – Constellation Software Inc/Canada	186	1,41	– Deere & Co	130	0,99
CAD 1 Loblaw Cos Ltd	124	0,94	2 Dexcom Inc	192	1,45
CAD – Lumine Group Inc ∞	3	0,02	1 Eli Lilly & Co	302	2,29
CAD 1 Shopify Inc 'A'	39	0,30	1 Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	168	1,28
CAD 1 Thomson Reuters Corp	144	1,09	33 Haleon Plc	129	0,97
	496	3,76	2 Intercontinental Exchange Inc	249	1,89
Chine : 3,72 % (28 février 2022 : 0,31 %)			– Karuna Therapeutics Inc	35	0,26
HKD 12 Alibaba Group Holding Ltd	135	1,02	6 Kroger Co/The	267	2,03
HKD 3 Tencent Holdings Ltd	153	1,16	1 Marriott International Inc/MD	143	1,09
HKD 46 TravelSky Technology Ltd	92	0,70	3 Marvell Technology Inc	141	1,07
3 Zai Lab Ltd, ADR	110	0,84	2 Microsoft Corp	560	4,25
	490	3,72	CHF 2 Nestlé SA	235	1,79
France : 3,20 % (28 février 2022 : 5,56 %)			– Netflix Inc	68	0,51
EUR 3 BNP Paribas SA	189	1,43	3 NextEra Energy Inc	195	1,48
EUR – EssilorLuxottica SA	65	0,50	1 NVIDIA Corp	238	1,80
EUR – LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	167	1,27	– Old Dominion Freight Line Inc	98	0,75
	421	3,20	1 Procter & Gamble Co/The	172	1,31
Allemagne : 4,64 % (28 février 2022 : 1,66 %)			2 Raymond James Financial Inc	186	1,41
EUR 1 Deutsche Boerse AG	158	1,20	1 S&P Global Inc	251	1,91
EUR 13 Deutsche Telekom AG	289	2,19	1 Salesforce Inc	105	0,79
EUR 1 SAP SE	165	1,25	2 Sensient Technologies Corp	132	1,00
	612	4,64	– SolarEdge Technologies Inc	105	0,80
Hong Kong : 2,63 % (28 février 2022 : 1,51 %)			1 Stryker Corp	156	1,19
HKD 18 AIA Group Ltd	195	1,48	2 Sysco Corp	132	1,00
HKD 4 Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	152	1,15	1 Target Corp	147	1,11
	347	2,63	1 Tesla Inc	214	1,62
Irlande : 0,93 % (28 février 2022 : 2,20 %)			– Thermo Fisher Scientific Inc	259	1,97
3 CRH Plc, ADR	123	0,93	2 TJX Cos Inc/The	129	0,98
Israël : 0,93 % (28 février 2022 : 0,84 %)			1 Union Pacific Corp	251	1,90
1 Nice Ltd, ADR	123	0,93	1 United Parcel Service Inc, B	131	0,99
Japon : 5,48 % (28 février 2022 : 2,92 %)			– United Rentals Inc	141	1,07
JPY 6 Daiichi Sankyo Co Ltd	195	1,48	1 UnitedHealth Group Inc	261	1,98
JPY – Hoya Corp	–	–	– Vertex Pharmaceuticals Inc	106	0,80
JPY – Keyence Corp	194	1,47	1 Workday Inc, A	103	0,78
JPY 11 Olympus Corp	181	1,38		7 874	59,75
JPY 2 Sony Group Corp	152	1,15			
	722	5,48			
Pays Bas : 1,61 % (28 février 2022 : 1,59 %)					
– Argenx SE, ADR	105	0,80			
EUR – ASML Holding NV	107	0,81			
	212	1,61			
Portugal : 1,63 % (28 février 2022 : 1,31 %)					
EUR 43 EDP – Energias de Portugal SA	215	1,63			
Espagne : 0,78 % (28 février 2022 : 0,73 %)					
2 Iberdrola SA, ADR	103	0,78			
Suède : 1,02 % (28 février 2022 : 2,21 %)					
SEK 7 Sandvik AB	135	1,02			
Suisse : 1,84 % (28 février 2022 : 4,34 %)					
CHF 2 Alcon Inc	125	0,95			
CHF 1 Straumann Holding AG	117	0,89			
	242	1,84			
Royaume-Uni : 4,29 % (28 février 2022 : 4,33 %)					
1 Diageo Plc, ADR	187	1,42			
GBP 1 London Stock Exchange Group Plc	119	0,90			
GBP 5 RELX Plc	140	1,06			
GBP 19 Rentokil Initial Plc	119	0,91			
	565	4,29			
États-Unis : 59,75 % (28 février 2022 : 51,62 %)					
1 AbbVie Inc	134	1,02			
1 Accenture Plc, A	169	1,28			
1 Aflac Inc	91	0,69			
3 Alphabet Inc, A	235	1,79			
2 Amazon.com Inc	197	1,50			
3 Apple Inc	422	3,20			
5 Avantor Inc	119	0,91			

AUD 7 Computershare Ltd	122	0,92
23 Coty Inc, A	254	1,93
– Deere & Co	130	0,99
2 Dexcom Inc	192	1,45
1 Eli Lilly & Co	302	2,29
1 Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	168	1,28
33 Haleon Plc	129	0,97
2 Intercontinental Exchange Inc	249	1,89
– Karuna Therapeutics Inc	35	0,26
6 Kroger Co/The	267	2,03
1 Marriott International Inc/MD	143	1,09
3 Marvell Technology Inc	141	1,07
2 Microsoft Corp	560	4,25
CHF 2 Nestlé SA	235	1,79
– Netflix Inc	68	0,51
3 NextEra Energy Inc	195	1,48
1 NVIDIA Corp	238	1,80
– Old Dominion Freight Line Inc	98	0,75
1 Procter & Gamble Co/The	172	1,31
2 Raymond James Financial Inc	186	1,41
1 S&P Global Inc	251	1,91
1 Salesforce Inc	105	0,79
2 Sensient Technologies Corp	132	1,00
– SolarEdge Technologies Inc	105	0,80
1 Stryker Corp	156	1,19
2 Sysco Corp	132	1,00
1 Target Corp	147	1,11
1 Tesla Inc	214	1,62
– Thermo Fisher Scientific Inc	259	1,97
2 TJX Cos Inc/The	129	0,98
1 Union Pacific Corp	251	1,90
1 United Parcel Service Inc, B	131	0,99
– United Rentals Inc	141	1,07
1 UnitedHealth Group Inc	261	1,98
– Vertex Pharmaceuticals Inc	106	0,80
1 Workday Inc, A	103	0,78
	7 874	59,75

Total des actions ordinaires (coût 12 642\$)	12 823	97,30
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	12 823	97,30
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	12 823	97,30
Autres éléments de l'actif hors passif	356	2,70
Total des actifs nets	13 179\$	100,00

– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

∞ Le titre est évalué de bonne foi à sa juste valeur par le comité d'évaluation ou à sa discrétion.

ABRÉVIATIONS :

ADR	– Certificat américain de dépôt (American Depositary Receipt).
AUD	– Dollar australien
CAD	– Dollar canadien
CHF	– Franc suisse
EUR	– Euro
GBP	– Livre britannique
HKD	– Dollar de Hong Kong
JPY	– Yen japonais
SEK	– Couronne suédoise

Analyse de l'actif total	% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	96,99
Autres actifs	3,01
Actif total	100,00

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) €	% de la valeur liquidative
Actions ordinaires — 93,42 % (28 février 2022 : 90,15 %)		
Australie — 5,07 % (28 février 2022 : 1,90 %)		
AUD 4 042 Atlas Arteria Ltd	17 548	1,65
AUD 4 035 Transurban Group	36 285	3,42
	53 833	5,07
Brésil — 1,70 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
BRL 2 914 Centrais Eletricas Brasileiras SA	18 045	1,70
Canada — 8,77 % (28 février 2022 : 8,49 %)		
CAD 1 652 Gibson Energy Inc	26 257	2,47
CAD 937 Pembina Pipeline Corp	29 091	2,74
CAD 1 006 TC Energy Corp	37 840	3,56
	93 188	8,77
France — 6,89 % (28 février 2022 : 9,99 %)		
3 006 Getlink SE	47 747	4,49
238 Vinci SA	25 529	2,40
	73 276	6,89
Italie — 3,23 % (28 février 2022 : 2,55 %)		
4 861 Terna – Rete Elettrica Nazionale	34 362	3,23
Japon — 6,02 % (28 février 2022 : 3,05 %)		
JPY 239 Central Japan Railway Co	25 345	2,39
JPY 809 East Japan Railway Co	38 596	3,63
	63 941	6,02
Portugal — 3,39 % (28 février 2022 : 2,60 %)		
7 579 EDP – Energias de Portugal SA	36 082	3,39
Espagne — 11,53 % (28 février 2022 : 11,97 %)		
179 Aena SME SA, 144A	26 127	2,46
959 Cellnex Telecom SA, 144A	34 037	3,20
941 Ferrovial SA	24 683	2,32
3 481 Iberdrola SA	37 714	3,55
	122 561	11,53
Royaume-Uni — 10,87 % (28 février 2022 : 7,75 %)		
GBP 1 416 Severn Trent Plc	44 216	4,16
GBP 2 260 SSE Plc	44 709	4,21
GBP 2 308 United Utilities Group Plc	26 641	2,50
	115 566	10,87
États-Unis — 35,95 % (28 février 2022 : 41,85 %)		
USD 161 American Water Works Co Inc	21 392	2,01
USD 179 Cheniere Energy Inc	26 648	2,51
USD 351 Constellation Energy Corp	24 859	2,34
USD 1 282 CSX Corp	36 941	3,48
USD 252 Entergy Corp	24 464	2,30
USD 724 NextEra Energy Inc	48 627	4,57
USD 764 OGE Energy Corp	25 815	2,43
USD 2 970 PG&E Corp	43 852	4,13
USD 1 448 PPL Corp	37 051	3,49
USD 589 Public Service Enterprise Group Inc	33 646	3,16
USD 349 Southwest Gas Holdings Inc	20 760	1,95
USD 194 Union Pacific Corp	38 008	3,58
	382 063	35,95
Total des actions ordinaires (coût 1 010 810€)	992 917	93,42
Fonds communs immobiliers — 3,73 % (28 février 2022 : 6,41 %)		
États-Unis — 3,73 % (28 février 2022 : 6,41 %)		
USD 212 American Tower Corp	39 593	3,73
Total des fonds communs immobiliers (coût 50 532€)	39 593	3,73
Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat (Coût 1 061 342€)	1 032 510	97,15
Contrats de change à terme — 0,18 % (28 février 2022 : 0,48 %)		
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	1 921	0,18
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	1 034 431	97,33
Contrats de change à terme — -0,10 % (28 février 2022 : -0,07 %)		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	-1 058	-0,10
Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	-1 058	-0,10
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	1 033 373	97,23
Autres éléments de l'actif hors passif	29 460	2,77
Total des actifs nets	1 062 833€	100,00

— Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 €, inférieurs à 1 000 €, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 60 164 000 €, soit 5,66 % de l'actif net.

ABRÉVIATIONS :

AUD	– Dollar australien
BRL	– Réal brésilien
CAD	– Dollar canadien
GBP	– Livre britannique
JPY	– Yen japonais
USD	– Dollar américain

Analyse de l'actif total	% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	96,65
Instruments financiers dérivés	0,18
Autres actifs	3,17
Actif total	100,00

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie		Devise d'achat (en milliers)			Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
02 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	2 981	Vente	BRL	16 291	€ 39
02 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	144	Vente	BRL	800	-1
02 mars 2023	BNY Mellon	Achat	BRL	17 091	Vente	EUR	3 086	1
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	625	Vente	AUD	974	5
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	211	Vente	CNH	1 549	1
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	65	Vente	CNH	480	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD	4 957	Vente	EUR	3 207	-54
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CNH	176 346	Vente	EUR	24 188	-198
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CNH	795	Vente	EUR	108	1
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD	6 702	Vente	EUR	4 706	-9
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD	120	Vente	EUR	85	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	368	Vente	EUR	413	5
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	122 054	Vente	EUR	113 566	1 718
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	88	Vente	EUR	84	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	194	Vente	SGD	278	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	268	Vente	SGD	380	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	1 679	Vente	USD	1 798	-20
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	41	Vente	USD	43	–
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	1 020	Vente	AUD	1 574	19
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CAD	3 444	Vente	AUD	3 710	25
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	669	Vente	AUD	1 170	17
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	347	Vente	BRL	1 944	-3
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	228	Vente	BRL	1 435	1
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	9	Vente	BRL	50	–
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CAD	1 172	Vente	BRL	4 575	-11
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	1 441	Vente	CAD	2 342	16
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	2 312	Vente	CAD	3 319	15
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CAD	19 890	Vente	EUR	13 855	-86
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD	20	Vente	EUR	13	–
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	BRL	36	Vente	EUR	7	–
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	JPY	1 749	Vente	EUR	12	–
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	3 902	Vente	EUR	4 417	17
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	89	Vente	EUR	83	1
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	2 551	Vente	GBP	2 253	-11
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CAD	8 254	Vente	GBP	5 080	-59
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CAD	4 093	Vente	JPY	405 550	13
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	1 211	Vente	JPY	172 245	13
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	795	Vente	JPY	128 007	14
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	191	Vente	USD	201	–
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	5 132	Vente	USD	6 238	-60
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	7 814	Vente	USD	8 394	-114
17 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CAD	26 405	Vente	USD	19 770	-392
04 avril 2023	BNY Mellon	Achat	BRL	15 586	Vente	EUR	2 829	-40
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 3 195 €)								€ 1 921
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : -438 €)								-1 058
Plus-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 2 757 €)								€ 863

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Actions ordinaires — 90,92 % (28 février 2022 : 90,89 %)		
Australie — 9,91 % (28 février 2022 : 9,51 %)		
AUD 2 422 APA Group	17 466	4,30
AUD 2 394 Atlas Arteria Ltd	10 994	2,71
AUD 1 239 Transurban Group	11 784	2,90
	40 244	9,91
Brésil — 3,91 % (28 février 2022 : 3,30 %)		
BRL 2 008 CCR SA	4 218	1,04
BRL 1 362 CPFL Energia SA	7 870	1,94
BRL 504 Engie Brasil Energia SA	3 783	0,93
	15 871	3,91
Canada — 10,67 % (28 février 2022 : 13,00 %)		
CAD 149 Enbridge Inc	5 599	1,38
CAD 527 Gibson Energy Inc	8 856	2,18
CAD 321 Pembina Pipeline Corp	10 554	2,60
CAD 460 TC Energy Corp	18 325	4,51
	43 334	10,67
Chine — 1,17 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
HKD 1 119 China Resources Gas Group Ltd	4 729	1,16
HKD 178 China Tower Corp Ltd, 144A	19	0,01
	4 748	1,17
Italie — 4,87 % (28 février 2022 : 4,00 %)		
EUR 1 242 Italgas SpA	7 062	1,74
EUR 2 578 Snam SpA	12 718	3,13
	19 780	4,87
Japon — 3,51 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
JPY 367 West Japan Railway Co	14 256	3,51
Portugal — 5,27 % (28 février 2022 : 2,59 %)		
EUR 4 248 EDP - Energias de Portugal SA	21 387	5,27
Espagne — 11,64 % (28 février 2022 : 13,05 %)		
EUR 697 Enagas SA	12 512	3,08
EUR 338 Ferrovial SA	9 374	2,31
EUR 1 700 Iberdrola SA	19 485	4,80
EUR 355 Red Elctrica Corp SA	5 881	1,45
	47 252	11,64
Royaume-Uni — 14,11 % (28 février 2022 : 11,53 %)		
GBP 1 298 National Grid Plc	16 288	4,01
GBP 904 Pennon Group Plc	8 949	2,20
GBP 978 SSE Plc	20 463	5,04
GBP 952 United Utilities Group Plc	11 618	2,86
	57 318	14,11
États-Unis — 25,86 % (28 février 2022 : 25,48 %)		
CAD 222 Brookfield Renewable Corp	6 175	1,52
202 Clearway Energy Inc, C	6 348	1,56
65 Constellation Energy Corp	4 866	1,20
99 Edison International	6 559	1,62
100 Entergy Corp	10 285	2,53
121 NextEra Energy Partners LP	8 011	1,97
333 OGE Energy Corp	11 907	2,93
308 Public Service Enterprise Group Inc	18 608	4,58
196 Southern Co/The	12 364	3,05
110 Southwest Gas Holdings Inc	6 925	1,71
33 Union Pacific Corp	6 739	1,66
206 Williams Cos Inc/The	6 202	1,53
	104 989	25,86
Total des actions ordinaires (coût 393 163\$)	369 179	90,92
Actions privilégiées — 1,42 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
Brésil — 1,42 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
BRL 836 Centrais Eletricas Brasileiras SA	5 743	1,42
Total des actions privilégiées (coût 7 702\$)	5 743	1,42
Fonds communs immobiliers — 6,00 % (28 février 2022 : 3,77 %)		
États-Unis — 6,00 % (28 février 2022 : 2,80 %)		
58 American Tower Corp	11 561	2,85
98 Crown Castle Inc	12 807	3,15
	24 368	6,00
Total des fonds communs immobiliers (coût 27 841\$)	24 368	6,00
Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat (Coût 428 706\$)	399 290	98,34

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Contrats de change à terme — 0,01 % (28 février 2022 : 0,05 %)		
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	24	0,01
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	399 314	98,35
Contrats de change à terme — -0,55 % (28 février 2022 : -0,19 %)		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	-2 229	-0,55
Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	-2 229	-0,55
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	397 085	97,80
Autres éléments de l'actif hors passif	8 963	2,20
Total des actifs nets	406 048\$	100,00

— Les montants désignés par « - » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 19 000 \$, soit 0,01 % de l'actif net.

ABRÉVIATIONS :

AUD	— Dollar australien
BRL	— Réal brésilien
CAD	— Dollar canadien
EUR	— Euro
GBP	— Livre britannique
HKD	— Dollar de Hong Kong
JPY	— Yen japonais

	% de l'actif total
Analyse de l'actif total	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	96,27
Instruments financiers dérivés	0,01
Autres actifs	3,72
Actif total	100,00

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)	
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 555	Vente	AUD 818	\$ 4	
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 262	Vente	AUD 389	–	
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 248	Vente	EUR 235	-1	
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 1 684	Vente	EUR 1 583	7	
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 1 268	Vente	SGD 1 692	13	
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 4	Vente	SGD 5	–	
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD 90 507	Vente	USD 68 306	-1 159	
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP 4 871	Vente	USD 5 883	-23	
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD 8	Vente	USD 6	–	
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 44 492	Vente	USD 47 824	-720	
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 9	Vente	USD 10	–	
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CNH 9 553	Vente	USD 1 406	-30	
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD 13 387	Vente	USD 9 310	-296	
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 82 \$)						\$ 24	
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : -332 \$)						-2 229	
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : -250 \$)						\$ -2 205	

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Organismes de placement collectif — 4,39 % (28 février 2022 : 4,57 %)		
32 545 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Distributing)	32 545	4,39
Total des organismes de placement collectif (Coût 32 545\$)	32 545	4,39
Actions ordinaires — 95,04 % (28 février 2022 : 95,20 %)		
Publicité — 0,59 % (28 février 2022 : 0,09 %)		
617 Entravision Communications Corp	4 051	0,54
317 Marin Software Inc	347	0,05
	4 398	0,59
Aérospatiale et défense — 5,27 % (28 février 2022 : 4,91 %)		
101 AAR Corp	5 477	0,74
280 Astronics Corp	4 276	0,58
66 Barnes Group Inc	2 794	0,38
103 Ducommun Inc	5 520	0,74
59 Hexcel Corp	4 294	0,58
67 Kaman Corp	1 728	0,23
189 Kratos Defense & Security Solutions Inc	2 392	0,32
215 Leonardo DRS Inc	2 791	0,38
43 Mercury Systems Inc	2 223	0,30
95 Spirit AeroSystems Holdings Inc, A	3 260	0,44
344 Triumph Group Inc	4 337	0,58
	39 092	5,27
Compagnies aériennes — 0,67 % (28 février 2022 : 1,43 %)		
52 Alaska Air Group Inc.	2 469	0,33
17 Allegiant Voyage Co	1 714	0,23
262 Mesa Air Group Inc	793	0,11
	4 976	0,67
Prêt-à-porter — 1,12 % (28 février 2022 : 1,44 %)		
344 Fossil Group Inc	1 495	0,20
173 Lakeland Industries Inc	2 635	0,35
75 Rocky Brands Inc	2 010	0,27
49 Skechers USA Inc	2 190	0,30
	8 330	1,12
Constructeurs automobiles — 0,76 % (28 février 2022 : 0,64 %)		
206 Wabash National Corp	5 629	0,76
Accessoiristes et équipementiers automobiles — 2,78 % (28 février 2022 : 3,05 %)		
85 Adient Plc	3 633	0,49
570 Commercial Vehicle Group Inc	4 504	0,61
156 Dana Inc	2 467	0,33
510 Garrett Motion Inc	3 936	0,53
187 Goodyear Tire & Rubber Co/The	2 118	0,29
152 Shift Group Inc/The	3 932	0,53
	20 590	2,78
Banques — 1,67 % (28 février 2022 : 2,27 %)		
145 BayCom Corp	2 991	0,40
83 First Bancshares Inc/The	2 612	0,35
110 Hilltop Holdings Inc	3 635	0,49
103 Seacoast Banking Corp of Florida	3 149	0,43
	12 387	1,67
Biotechnologie — 0,31 % (28 février 2022 : 0,27 %)		
137 NeoGenomics Inc	2 302	0,31
Matériaux de construction — 2,89 % (28 février 2022 : 2,09 %)		
25 Apogee Enterprises Inc	1 161	0,16
76 Gibraltar Industries Inc	4 086	0,55
102 Griffon Corp	3 721	0,50
265 Modine Manufacturing Co	6 475	0,87
97 PGT Innovations Inc	2 060	0,28
133 Summit Materials Inc, A	3 930	0,53
	21 433	2,89
Produits chimiques — 1,84 % (28 février 2022 : 2,35 %)		
115 Huntsman Corp	3 370	0,45
136 Livent Corp	3 177	0,43
70 Mativ Holdings Inc	1 818	0,24
142 Tronox Holdings Plc	2 219	0,30
298 Unifi Inc	3 088	0,42
	13 672	1,84
Services commerciaux — 3,90 % (28 février 2022 : 3,39 %)		
99 Acacia Research Corp	429	0,06
29 Adtalem Global Education Inc	1 138	0,15
387 Arlo Technologies Inc	1 472	0,20
90 Cross Country Healthcare Inc	2 391	0,32
102 Evercel Inc	233	0,03
297 Healthcare Services Group Inc	3 930	0,53

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
34 Herc Holdings Inc	4 948	0,67
70 Korn Ferry	3 906	0,53
33 LiveRamp Holdings Inc	772	0,10
217 Resources Connection Inc	3 918	0,53
97 Sterling Check Corp	1 231	0,16
143 TrueBlue Inc	2 674	0,36
41 V2X Inc	1 905	0,26
	28 947	3,90
Ordinateurs — 1,39 % (28 février 2022 : 0,62 %)		
568 Conduent Inc	2 251	0,30
161 Kyndryl Holdings Inc	2 519	0,34
343 SecureWorks Corp	2 627	0,36
72 TTEC Holdings Inc	2 895	0,39
	10 292	1,39
Cosmétiques et produits de beauté — 0,30 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
19 Inter Parfums Inc	2 240	0,30
Distribution et commerce de gros — 3,30 % (28 février 2022 : 3,50 %)		
399 Hudson Technologies Inc	4 046	0,55
504 Manitex International Inc	2 596	0,35
286 MRC Global Inc	3 202	0,43
182 Resideo Technologies Inc	3 341	0,45
50 Univar Solutions Inc	1 724	0,23
107 VSE Corp	6 120	0,83
21 WESCO International Inc	3 443	0,46
	24 472	3,30
Services financiers diversifiés — 2,13 % (28 février 2022 : 1,48 %)		
112 Air Lease Corp, A	4 854	0,66
62 Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	2 026	0,27
118 B Riley Financial Inc	4 704	0,63
37 Focus Financial Partners Inc 'A'	1 929	0,26
54 Moelis & Co, A	2 301	0,31
	15 814	2,13
Composantes et équipements électriques — 1,16 % (28 février 2022 : 0,32 %)		
351 American Superconductor Corp	1 891	0,26
108 Insteel Industries Inc	3 203	0,43
311 nLight Inc	3 522	0,47
	8 616	1,16
Électronique — 5,34 % (28 février 2022 : 5,13 %)		
53 Advanced Energy Industries Inc	4 969	0,67
41 Avnet Inc	1 847	0,25
157 Benchmark Electronics Inc	3 730	0,50
70 Coherent Corp	3 036	0,41
293 Comtech Telecommunications Corp	4 695	0,63
119 CTS Corp	5 169	0,70
233 Identiv Inc	1 629	0,22
212 Knowles Corp	3 601	0,49
243 Stoneridge Inc	5 783	0,78
132 Vishay Intertechnology Inc	2 809	0,38
53 Vishay Precision Group Inc	2 299	0,31
	39 567	5,34
Énergie – autres sources — 0,34 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
217 TPI Composites Inc	2 502	0,34
Ingénierie et construction — 3,93 % (28 février 2022 : 2,83 %)		
33 Arcosa Inc	2 010	0,27
17 Comfort Systems USA Inc	2 401	0,32
528 Concrete Pumping Holdings Inc	4 117	0,56
153 Construction Partners Inc 'A'	4 148	0,56
311 Limbach Holdings Inc	4 406	0,60
476 Mistras Group Inc	2 609	0,35
648 Orion Group Holdings Inc	1 804	0,24
167 Primoris Services Corp	4 598	0,62
79 Sterling Infrastructure Inc	3 030	0,41
	29 123	3,93
Divertissement — 0,32 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
127 IMAX Corp	2 346	0,32
Contrôle environnemental — 0,55 % (28 février 2022 : 0,48 %)		
9 CECO Environmental Corp	136	0,02
109 Heritage-Crystal Clean Inc	3 910	0,53
	4 046	0,55
Secteur alimentaire — 0,51 % (28 février 2022 : 0,80 %)		
120 Krispy Kreme Inc	1 560	0,21
CAD 284 SunOpta Inc	2 186	0,30
	3 746	0,51

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Actions ordinaires — (suite)					
Outils/machines-outils — 0,80 % (28 février 2022 : 0,61 %)					
41 Hurco Cos Inc	1 211	0,16			
285 Luxfer Holdings Plc	4 719	0,64			
	5 930	0,80			
Secteur de la santé – produits — 2,02 % (28 février 2022 : 1,26 %)					
1 047 Accuray Inc	3 046	0,41			
229 Apyx Medical Corp	738	0,10			
213 Artivion Inc	2 820	0,38			
63 CareDx Inc	1 066	0,14			
242 MiMedx Group Inc	1 162	0,16			
171 Tactile Systems Technology Inc	2 469	0,33			
208 Varex Imaging Corp	3 679	0,50			
	14 980	2,02			
Secteur de la santé – services — 1,33 % (28 février 2022 : 0,97 %)					
384 Community Health Systems Inc	2 327	0,31			
CAD 121 Quipt Home Medical Corp	762	0,10			
159 RadNet Inc	3 748	0,51			
110 Select Medical Holdings Corp	3 002	0,41			
	9 839	1,33			
Constructeurs de maisons — 2,86 % (28 février 2022 : 2,73 %)					
113 Beazer Homes USA Inc	1 681	0,23			
12 Cavco Industries Inc	3 435	0,46			
33 Century Communities Inc	1 986	0,27			
28 M/I Homes Inc	1 608	0,22			
69 Skyline Champion Corp	4 744	0,64			
95 Taylor Morrison Home Corp 'A'	3 419	0,46			
33 Toll Brothers Inc	1 966	0,26			
98 Tri Pointe Homes Inc	2 341	0,32			
	21 180	2,86			
Ameublement — 0,18 % (28 février 2022 : 0,99 %)					
422 VIA Optronics AG ADR	1 358	0,18			
Produits et articles ménagers — 0,40 % (28 février 2022 : 0,77 %)					
16 Helen of Troy Ltd	1 849	0,25			
17 Spectrum Brands Holdings Inc	1 114	0,15			
	2 963	0,40			
Assurance — 0,33 % (28 février 2022 : 1,24 %)					
43 Brighthouse Financial Inc	2 468	0,33			
Internet — 3,78 % (28 février 2022 : 1,82 %)					
166 Cars.com Inc	3 178	0,43			
779 comScore Inc	912	0,12			
65 Criteo SA ADR	2 167	0,29			
555 DHI Group Inc	2 349	0,32			
454 Edgio Inc	556	0,07			
208 EverQuote Inc	2 837	0,38			
61 IAC Inc	3 154	0,43			
167 Innovid Corp	282	0,04			
357 LifeMD Inc	638	0,09			
326 Magnite Inc	3 626	0,49			
100 Overstock.com Inc	1 945	0,26			
378 QuinStreet Inc	6 406	0,86			
	28 050	3,78			
Fer/acier — 3,20 % (28 février 2022 : 2,81 %)					
144 ATI Inc	5 842	0,79			
105 Carpenter Technology Corp	5 076	0,68			
191 Cleveland-Cliffs Inc	4 073	0,55			
71 Commercial Metals Co	3 657	0,49			
93 Haynes International Inc	5 086	0,69			
	23 734	3,20			
Hébergement — 0,61 % (28 février 2022 : 0,61 %)					
142 Century Casinos Inc	1 317	0,18			
197 Marcus Corp/The	3 178	0,43			
	4 495	0,61			
Machines – construction et exploitation minière — 1,43 % (28 février 2022 : 0,65 %)					
53 Argan Inc	2 066	0,28			
729 Babcock & Wilcox Enterprises Inc	4 719	0,63			
63 BWX Technologies Inc	3 844	0,52			
	10 629	1,43			
Machines – diversifiées — 2,02 % (28 février 2022 : 1,67 %)					
118 CIRCOR International Inc	3 442	0,46			
165 Ichor Holdings Ltd	5 425	0,73			
535 Intevac Inc	3 873	0,52			
193 Power Solutions International Inc	557	0,08			
158 Twin Disc Inc	1 708	0,23			
	15 005	2,02			
Médias — 0,48 % (28 février 2022 : 1,23 %)					
149 Thryv Holdings Inc	3 552	0,48			
Produits et composants métalliques — 2,27 % (28 février 2022 : 1,84 %)					
33 Helios Technologies Inc	2 236	0,30			
59 Mayville Engineering Co Inc	955	0,13			
751 NN Inc	1 394	0,19			
135 Northwest Pipe Co	5 210	0,70			
55 Olympic Steel Inc	2 857	0,38			
230 TimkenSteel Corp	4 203	0,57			
	16 855	2,27			
Exploitation minière — 1,17 % (28 février 2022 : 2,28 %)					
167 Century Aluminum Co	2 019	0,27			
708 Ferroglobe Plc	3 534	0,48			
CAD 397 Major Drilling Group International Inc	3 100	0,42			
	8 653	1,17			
Divers production — 1,63 % (28 février 2022 : 3,11 %)					
41 EnPro Industries Inc	4 367	0,59			
29 Fabrinet	3 518	0,47			
150 Trinity Industries Inc	4 197	0,57			
	12 082	1,63			
Ameublement pour bureaux — 0,13 % (28 février 2022 : 0,84 %)					
112 Interface Inc 'A'	989	0,13			
Pétrole et gaz — 2,57 % (28 février 2022 : 2,84 %)					
CAD 435 435 Baytex Energy Corp	1 680	0,23			
47 47 Chesapeake Energy Corp	3 799	0,51			
292 292 Earthstone Energy Inc 'A'	4 066	0,55			
81 81 Matador Resources Co	4 372	0,59			
107 107 Northern Oil and Gas Inc	3 307	0,44			
353 353 Southwestern Energy Co	1 871	0,25			
	19 095	2,57			
Pétrole et gaz – services — 2,41 % (28 février 2022 : 0,99 %)					
339 Archrock Inc	3 759	0,51			
114 DMC Global Inc	3 048	0,41			
436 Mammoth Energy Services Inc	2 444	0,33			
454 Matrix Service Co	2 875	0,39			
165 NOW Inc	2 114	0,28			
182 Ranger Energy Services Inc	1 955	0,26			
192 Solaris Oilfield Infrastructure Inc 'A'	1 713	0,23			
	17 908	2,41			
Emballages et conteneurs — 0,47 % (28 février 2022 : 0,50 %)					
115 TriMas Corp	3 451	0,47			
Produits pharmaceutiques — 0,93 % (28 février 2022 : 1,65 %)					
122 Option Care Health Inc	3 748	0,51			
89 Organon & Co	2 174	0,29			
679 Societal CDMO Inc	995	0,13			
	6 917	0,93			
Capital-investissement — 0,17 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
115 P10 Inc	1 235	0,17			
Immobilier — 0,17 % (28 février 2022 : 0,43 %)					
215 Anywhere Real Estate Inc	1 242	0,17			
Commerce de détail — 7,40 % (28 février 2022 : 8,23 %)					
20 Asbury Automotive Group Inc	4 608	0,62			
89 Aspen Aerogels Inc	965	0,13			
399 Barnes & Noble Education Inc	803	0,11			
46 BlueLinx Holdings Inc	3 843	0,52			
191 Caleres Inc	4 985	0,67			
528 Carrols Restaurant Group Inc	1 109	0,15			
403 Chico's FAS Inc	2 318	0,31			
282 Designer Brands Inc	2 761	0,37			
13 Dillard's Inc	4 606	0,62			
623 Express Inc	632	0,09			
69 Franchise Group Inc	1 925	0,26			
561 iMedia Brands Inc	436	0,06			
132 J Jill Inc	3 663	0,49			
349 JOANN Inc	1 270	0,17			
42 Movado Group Inc	1 462	0,20			
577 Noodles & Co 'A'	3 363	0,45			
98 Nordstrom Inc	1 917	0,26			
35 Patrick Industries Inc	2 553	0,35			
153 Ruth's Hospitality Group Inc	2 843	0,38			
45 Sonic Automotive Inc 'A'	2 584	0,35			
224 Sportsman's Warehouse Holdings Inc	2 011	0,27			
121 Vera Bradley Inc	645	0,09			
90 Victoria's Secret & Co	3 565	0,48			
	54 867	7,40			

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Actions ordinaires — (suite)			Contrats de change à terme — -0,22 % (28 février 2022 : -0,20 %)		
Épargne et prêts — 0,52 % (28 février 2022 : 0,52 %)			Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
81 Axos Financial Inc	3 832	0,52		-1 623	-0,22
Semi-conducteurs — 5,09 % (28 février 2022 : 5,12 %)			Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
83 Alpha & Omega Semiconductor Ltd	2 222	0,30		-1 623	-0,22
147 Amkor Technology Inc	3 791	0,51	Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
365 Amtech Systems Inc	3 492	0,47		742 640	100,15
160 Cohu Inc	5 972	0,81	Excédent du passif par rapport aux autres éléments de l'actif		
121 FormFactor Inc	3 643	0,49		-1 111	-0,15
52 inTEST Corp	768	0,10	Total des actifs nets		
76 Kulicke & Soffa Industries Inc	4 053	0,55		741 529\$	100,00
49 Onto Innovation Inc	4 016	0,54	— Les montants désignés par « — » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.		
147 Ultra Clean Holdings Inc	4 700	0,63	∞ Le titre est évalué de bonne foi à sa juste valeur par le comité d'évaluation ou à sa discrétion.		
239 Veeco Instruments Inc	5 099	0,69	ABRÉVIATIONS :		
	37 756	5,09	ADR — Certificat américain de dépôt (American Depositary Receipt).		
Logiciels — 1,81 % (28 février 2022 : 2,90 %)			CAD — Dollar canadien		
141 ACV Auctions Inc	1 732	0,23	Analyse de l'actif total		
113 Avid Technology Inc	3 287	0,44	% de l'actif total		
83 Digi International Inc	2 770	0,38	Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé		
119 Digital Turbine Inc	1 283	0,17		95,17	
131 HireRight Holdings Corp	1 446	0,20	Organismes de placement collectif		
322 Immersion Corp	2 465	0,33		4,35	
106 Viant Technology Inc	420	0,06	Instruments financiers dérivés		
	13 403	1,81		0,02	
Télécommunications — 4,15 % (28 février 2022 : 5,02 %)			Autres actifs		
216 A10 Networks Inc	3 281	0,44		0,46	
214 ADTRAN Holdings Inc	3 729	0,50	Actif total		
112 Aviat Networks Inc	3 968	0,54		100,00	
536 CalAmp Corp	2 283	0,31			
152 Cambium Networks Corp	3 053	0,41			
363 DZS Inc	3 856	0,52			
137 Frequency Electronics Inc	867	0,12			
338 Infinera Corp	2 390	0,32			
237 Ooma Inc	3 094	0,42			
556 PCTEL Inc	2 500	0,34			
174 Ribbon Communications Inc	775	0,10			
357 Terran Orbital Corp	949	0,13			
	30 745	4,15			
Transports — 3,64 % (28 février 2022 : 3,50 %)					
262 Ardmore Shipping Corp	4 762	0,64			
468 Daseke Inc	3 802	0,51			
292 Diana Shipping Inc	1 347	0,18			
183 Dorian LPG Ltd	4 007	0,54			
44 Hub Group Inc 'A'	4 049	0,55			
267 Navigator Holdings Ltd	3 696	0,50			
384 Radiant Logistics Inc	2 188	0,30			
52 Scorpio Tankers Inc	3 132	0,42			
	26 983	3,64			
Total des actions ordinaires (coût 682 879\$)					
	704 716	95,04			
Fonds communs immobiliers — 0,91 % (28 février 2022 : 2,12 %)					
Sociétés de placement immobilier (REIT) — 0,91 % (28 février 2022 : 2,12 %)					
111 Braemar Hotels & Resorts Inc	519	0,07			
70 Chatham Lodging Trust	855	0,11			
274 Macerich Co/The	3 274	0,44			
10 Ryman Hospitality Properties Inc	935	0,13			
63 Tanger Factory Outlet Centers Inc	1 198	0,16			
	6 781	0,91			
Total des fonds communs immobiliers (coût 6 920\$)					
	6 781	0,91			
Droits — 0,00 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
Services commerciaux — 0,00 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
6 Acacia Research Corp Rights ∞	—	—			
Total des droits (coût \$-)					
	—	—			
Bon de souscription — 0,01 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
Aérospatiale et défense — 0,01 % (28 février 2022 : 0,00 %)					
94 Triumph Group Inc	71	0,01			
Total des bons de souscription (coût 154\$)					
	71	0,01			
Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat (Coût 722 498\$)					
	744 113	100,35			
Contrats de change à terme — 0,02 % (28 février 2022 : 0,16 %)					
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)					
	150	0,02			
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat					
	744 263	100,37			

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
02 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 8 379	Vente	BRL 43 439	\$ 82
02 mars 2023	BNY Mellon	Achat	BRL 43 439	Vente	USD 8 542	-245
03 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 50	Vente	CNH 349	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 878	Vente	AUD 1 274	19
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 419	Vente	CNH 2 854	8
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 5	Vente	EUR 5	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 2 711	Vente	EUR 2 535	27
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 14	Vente	GBP 12	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 8	Vente	SEK 83	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 1 518	Vente	SGD 2 029	13
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 35	Vente	SGD 47	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CNH 19 156	Vente	USD 2 824	-64
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CNH 349	Vente	USD 50	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD 9 915	Vente	USD 6 889	-215
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD 37 186	Vente	USD 28 063	-473
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP 392	Vente	USD 473	-2
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	PLN 16 728	Vente	USD 3 776	-20
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SEK 901	Vente	USD 85	1
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SEK 12	Vente	USD 1	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 123	Vente	USD 131	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 32 704	Vente	USD 35 152	-528
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD 3	Vente	USD 3	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD 1	Vente	USD 1	–
04 avril 2023	BNY Mellon	Achat	BRL 34 767	Vente	USD 6 671	-76
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 1 468 \$)						\$ 150
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : -1 791 \$)						-1 623
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : -323 \$)						\$ -1 473

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Organismes de placement collectif — 3,48 % (28 février 2022 : 3,45 %)		
11 iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	1 619	2,07
1 100 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribution)	1 100	1,41
Total des organismes de placement collectif (Coût 2 651\$)	2 719	3,48
Actions ordinaires — 97,23 % (28 février 2022 : 97,15 %)		
Aérospatiale et défense — 1,09 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
65 Leonardo DRS Inc	849	1,09
Prêt-à-porter — 2,41 % (28 février 2022 : 1,62 %)		
6 Carter's Inc	415	0,53
15 Steven Madden Ltd	556	0,71
54 Wolverine World Wide Inc	910	1,17
	1 881	2,41
Accessoiristes et équipementiers automobiles — 3,47 % (28 février 2022 : 4,77 %)		
53 Gentex Corp	1 500	1,92
44 Miller Industries Inc/TN	1 214	1,55
	2 714	3,47
Matériaux de construction — 2,02 % (28 février 2022 : 4,76 %)		
27 Louisiana-Pacific Corp	1 579	2,02
Produits chimiques — 3,48 % (28 février 2022 : 3,30 %)		
16 Innospec Inc	1 787	2,29
5 Quaker Chemical Corp	935	1,19
	2 722	3,48
Services commerciaux — 7,42 % (28 février 2022 : 9,47 %)		
7 AMN Healthcare Services Inc	639	0,82
114 Computer Task Group Inc	852	1,09
84 Dun & Bradstreet Holdings Inc	1 010	1,29
50 Forrester Research Inc	1 638	2,10
30 Korn Ferry	1 658	2,12
	5 797	7,42
Cosmétiques et produits de beauté — 2,16 % (28 février 2022 : 2,01 %)		
14 Inter Parfums Inc	1 687	2,16
Distribution et commerce de gros — 2,20 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
85 Hudson Technologies Inc	858	1,10
21 IAA Inc	859	1,10
	1 717	2,20
Services financiers diversifiés — 7,55 % (28 février 2022 : 5,50 %)		
45 Air Lease Corp, A	1 959	2,51
49 Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	1 610	2,06
20 Houlihan Lokey Inc 'A'	1 916	2,45
11 Lazard Ltd 'A'	410	0,53
	5 895	7,55
Électronique — 5,96 % (28 février 2022 : 5,29 %)		
22 Brady Corp 'A'	1 197	1,53
30 FARO Technologies Inc	808	1,04
53 Kimball Electronics Inc	1 329	1,70
30 Vishay Precision Group Inc	1 321	1,69
	4 655	5,96
Ingénierie et construction — 2,22 % (28 février 2022 : 3,64 %)		
29 Arcosa Inc	1 737	2,22
Contrôle environnemental — 0,88 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
19 Heritage-Crystal Clean Inc	684	0,88
Secteur de la santé – produits — 5,87 % (28 février 2022 : 4,64 %)		
30 Bio-Techne Corp	2 151	2,75
33 Enovis Corp	1 927	2,47
4 UFP Technologies Inc	505	0,65
	4 583	5,87
Constructeurs de maisons — 3,71 % (28 février 2022 : 1,60 %)		
10 LCI Industries	1 129	1,44
26 Skyline Champion Corp	1 773	2,27
	2 902	3,71
Assurance — 4,88 % (28 février 2022 : 4,13 %)		
12 RLI Corp	1 627	2,08
2 White Mountains Insurance Group Ltd	2 185	2,80
	3 812	4,88
Internet — 2,92 % (28 février 2022 : 1,67 %)		
29 Ziff Davis Inc	2 277	2,92
Loisirs — 1,59 % (28 février 2022 : 2,40 %)		
14 Brunswick Corp/DE	1 241	1,59

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Hébergement — 1,99 % (28 février 2022 : 2,40 %)		
168 Century Casinos Inc	1 555	1,99
Machines – diversifiées — 3,50 % (28 février 2022 : 3,41 %)		
24 Esab Corp	1 416	1,81
6 Kadant Inc	1 318	1,69
	2 734	3,50
Produits et composants métalliques — 0,65 % (28 février 2022 : 0,53 %)		
13 Northwest Pipe Co	505	0,65
Divers production — 5,33 % (28 février 2022 : 4,62 %)		
21 ESCO Technologies Inc	1 949	2,50
20 John Bean Technologies Corp	2 212	2,83
	4 161	5,33
Pétrole et gaz – services — 1,54 % (28 février 2022 : 1,92 %)		
CAD 113 Pason Systems Inc	1 206	1,54
Produits pharmaceutiques — 3,27 % (28 février 2022 : 3,26 %)		
28 Catalyst Pharmaceuticals Inc	431	0,55
25 Harmony Biosciences Holdings Inc	1 107	1,42
90 Ironwood Pharmaceuticals Inc 'A'	1 013	1,30
	2 551	3,27
Immobilier — 3,88 % (28 février 2022 : 3,72 %)		
141 Kennedy-Wilson Holdings Inc	2 357	3,02
20 Marcus & Millichap Inc	672	0,86
	3 029	3,88
Commerce de détail — 1,49 % (28 février 2022 : 1,67 %)		
34 Movado Group Inc	1 160	1,49
Semi-conducteurs — 9,18 % (28 février 2022 : 10,20 %)		
31 Cohu Inc	1 166	1,50
65 FormFactor Inc	1 947	2,49
8 Kulicke & Soffa Industries Inc	423	0,54
23 MKS Instruments Inc	2 233	2,86
17 Onto Innovation Inc	1 397	1,79
	7 166	9,18
Logiciels — 2,94 % (28 février 2022 : 6,42 %)		
47 Avid Technology Inc	1 365	1,75
24 Simulations Plus Inc	932	1,19
	2 297	2,94
Transports — 3,63 % (28 février 2022 : 2,01 %)		
11 Forward Air Corp	1 146	1,46
9 Landstar System Inc	1 693	2,17
	2 839	3,63
Total des actions ordinaires (coût 72 866\$)	75 935	97,23
Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat (Coût 75 517\$)	78 654	100,71
Contrats de change à terme — 0,00 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
	–	–
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	78 654	100,71
Contrats de change à terme — 0,00 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)		
	-2	–
Total des passifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat	-2	–
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	78 652	100,71
Excédent du passif par rapport aux autres éléments de l'actif	-554	-0,71
Total des actifs nets	78 098\$	100,00

– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

ABRÉVIATIONS :

ETF – Fonds négocié en bourse (Exchange Traded Fund).
CAD – Dollar canadien

	% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	96,34
Organismes de placement collectif	3,45
Autres actifs	0,21
Actif total	100,00

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)			Devise de vente (en milliers)			Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	9	Vente	EUR	8	\$ –
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	–	Vente	SEK	1	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SEK	1	Vente	USD	–	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SEK	17	Vente	USD	2	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	101	Vente	USD	108	-2
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 1 \$)								–
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : -5 \$)								-2
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : -4 \$)								\$ -2

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Organismes de placement collectif — 4,24 % (28 février 2022 : 3,09 %)		
180 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribution)	180	4,24
Total des organismes de placement collectif (Coût 180\$)	180	4,24
Actions ordinaires — 96,21 % (28 février 2022 : 97,25 %)		
Australie — 3,53 % (28 février 2022 : 6,94 %)		
AUD 23 Hansen Technologies Ltd	73	1,72
AUD 14 IPH Ltd	77	1,81
	150	3,53
Brésil — 1,03 % (28 février 2022 : 1,10 %)		
BRL 20 Odontoprev SA	44	1,03
Canada — 1,16 % (28 février 2022 : 1,45 %)		
1 Ritchie Bros Auctioneers Inc	49	1,16
Allemagne — 1,79 % (28 février 2022 : 1,77 %)		
EUR – New Work SE	76	1,79
Italie — 3,01 % (28 février 2022 : 4,05 %)		
EUR 1 Carel Industries SpA, 144A	31	0,73
EUR – DiaSorin SpA	41	0,97
EUR 11 GVS SpA, 144A	56	1,31
	128	3,01
Japon — 11,67 % (28 février 2022 : 11,32 %)		
JPY 1 As One Corp	29	0,69
JPY 4 BML Inc	84	1,97
JPY 1 Fukui Computer Holdings Inc	24	0,58
JPY 3 JCU Corp	75	1,77
JPY 2 Meitec Corp	29	0,67
JPY 3 OBIC Business Consultants Co Ltd	94	2,21
JPY 3 TKC Corp	86	2,03
JPY 2 USS Co Ltd	31	0,72
JPY 2 Zuken Inc	44	1,03
	496	11,67
Pays-Bas — 2,14 % (28 février 2022 : 2,75 %)		
EUR – IMCD NV	58	1,37
EUR 8 Marel hf, 144A	33	0,77
	91	2,14
Pologne — 1,33 % (28 février 2022 : 1,37 %)		
PLN 3 Asseco Poland SA	57	1,33
Singapour — 1,01 % (28 février 2022 : 2,74 %)		
GBP 2 XP Power Ltd	43	1,01
Corée du Sud — 1,99 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
KRW 1 Douzone Bizon Co Ltd	27	0,63
KRW 6 NICE Information Service Co Ltd	58	1,36
	85	1,99
Suède — 1,07 % (28 février 2022 : 2,99 %)		
SEK 9 Karnov Group AB	46	1,07
Suisse — 1,79 % (28 février 2022 : 1,96 %)		
CHF – Kardex Holding AG	33	0,78
CHF 1 VZ Holding AG	43	1,01
	76	1,79
Royaume-Uni — 12,45 % (28 février 2022 : 10,02 %)		
GBP 1 Croda International Plc	51	1,19
GBP 1 Diploma Plc	47	1,10
GBP 7 DiscoverIE Group Plc	76	1,79
GBP 1 Intertek Group Plc	42	0,99
GBP 53 Learning Technologies Group Plc	90	2,12
GBP 10 Marlowe Plc	56	1,32
GBP 19 Restore Plc	73	1,71
GBP – Spirax-Sarco Engineering Plc	54	1,27
GBP 2 Victrex Plc	41	0,96
	530	12,45
États-Unis — 52,24 % (28 février 2022 : 48,79 %)		
1 Arcosa Inc	67	1,59
1 Avid Technology Inc	31	0,72
1 Brunswick Corp/DE	76	1,78
1 Cognex Corp	39	0,92
1 Colliers International Group Inc	81	1,91
1 Dorman Products Inc	79	1,86
1 Enovis Corp	53	1,25
1 Esab Corp	51	1,20
1 ESCO Technologies Inc	54	1,28
1 FirstService Corporation	87	2,04
3 FormFactor Inc	78	1,82

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
2 Forrester Research Inc	57	1,33
1 Forward Air Corp	72	1,71
2 Gentex Corp	56	1,32
1 Haemonetics Corp	67	1,58
– Houlihan Lokey Inc 'A'	35	0,83
1 IAA Inc	43	1,00
1 Innospec Inc	73	1,73
1 Inter Parfums Inc	93	2,19
1 John Bean Technologies Corp	66	1,54
– Kadant Inc	74	1,74
5 Kennedy-Wilson Holdings Inc	78	1,84
– Landstar System Inc	53	1,25
– LCI Industries	56	1,32
– Lincoln Electric Holdings Inc	61	1,43
– Littelfuse Inc	38	0,90
1 LKQ Corp	31	0,72
– Marcus & Millichap Inc	17	0,39
1 MKS Instruments Inc	78	1,84
– Quaker Chemical Corp	79	1,87
1 Ralph Lauren Corp 'A'	82	1,93
– Rogers Corp	24	0,57
1 SEI Investments Co	69	1,61
– TechTarget Inc	17	0,39
1 UFP Industries Inc	66	1,54
– Valmont Industries Inc	65	1,52
1 Ziff Davis Inc	76	1,78
	2 222	52,24
Total des actions ordinaires (coût 4 561\$)	4 093	96,21
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
	4 273	100,45
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat		
	4 273	100,45
Excédent du passif par rapport aux autres éléments de l'actif		
	-19	-0,45
Total des actifs nets	4 254\$	100,00

– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 120 000 \$, soit 2,81 % de l'actif net.

ABRÉVIATIONS :

AUD	– Dollar australien
BRL	– Réal brésilien
CHF	– Franc suisse
EUR	– Euro
GBP	– Livre britannique
JPY	– Yen japonais
KRW	– Won sud-coréen
PLN	– Zloty polonais
SEK	– Couronne suédoise

	% de l'actif total
Analyse de l'actif total	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	95,61
Organismes de placement collectif	4,20
Autres actifs	0,19
Actif total	100,00

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^μ

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) €
Actions ordinaires — 0,00 % (28 février 2022 : 97,09 %)	
Russie : 0,00 % (28 février 2022 : 0,45 %)	
GBP 54 Evraz Plc †	—
Total des actions ordinaires (coût 313€)	—
Excédent du passif par rapport aux autres éléments de l'actif	—
Total des actifs nets	— €

— Les montants désignés par « — » sont égaux à 0 €, inférieurs à 1 000 €, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

† Illiquide.

μ À compter du 11 juillet 2022, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^μ a cessé ses activités.

ABRÉVIATIONS :

GBP — Livre britannique

Analyse de l'actif total	% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	—
Autres actifs	100,00
Actif total	100,00

^μ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

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

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Analyse de l'actif total	% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	97,81
Autres actifs	2,19
Actif total	100,00

Tableau des contrats de change à terme

								Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)	
Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)			Devise de vente (en milliers)				
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	87	Vente	AUD	128	\$	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	6	Vente	CNH	42		–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	1	Vente	PLN	5		–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	1	Vente	SGD	2		–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	PLN	–	Vente	USD	–		–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	PLN	163	Vente	USD	37		–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CNH	1 246	Vente	USD	184		-4
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD	3 914	Vente	USD	2 720		-85
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD	45	Vente	USD	34		-1
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 34 \$)									–
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : -139 \$)									-90
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : -105 \$)								\$	-90

Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund[^]_F

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$
Actions ordinaires — 0,00 % (28 février 2022 : 0,00 %)	
Grèce : 0,00 % (28 février 2022 : 0,00 %)	
EUR 1 FF Group †	—
Hong Kong — 0,00 % (28 février 2022 : 0,00 %)	
HKD 38 Hanergy Mobile Energy Holding Group Co Ltd †	—
Total des actions ordinaires (coût 44\$)	—
Excédent du passif par rapport aux autres éléments de l'actif	—
Total des actifs nets	— \$

— Les montants désignés par « — » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

† Illiquide.

F À compter du 14 avril 2021, le Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund[^] a cessé de négocier.

ABRÉVIATIONS :

EUR — Euro

HKD — Dollar de Hong Kong

Analyse de l'actif total	% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	—
Autres actifs	100,00
Actif total	100,00

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

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

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$
Actions ordinaires — 0,00 % (28 février 2022 : 90,46 %)	
Russie — 0,00 % (28 février 2022 : 0,16 %)	
8 Gazprom PJSC, ADR †	—
Total des actions ordinaires (coût 54\$)	—
Excédent du passif par rapport aux autres éléments de l'actif	—
Total des actifs nets	— \$

— Les montants désignés par « — » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

† Illiquide.

α À compter du 27 avril 2022, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] a cessé ses activités.

Analyse de l'actif total	% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	—
Autres actifs	100,00
Actif total	100,00

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

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

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Actions (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Analyse de l'actif total	% de l'actif total		
Organismes de placement collectif — 4,05 % (28 février 2022 : 0,00 %)				Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	95,23		
HKD	23	iShares Core MSCI Asia ex Japan ETF – ETF	143	4,05	Organismes de placement collectif	3,94	
Total des organismes de placement collectif (Coût 1475)				Autres actifs	0,83		
				143	4,05	Actif total	100,00
Actions ordinaires — 97,66 % (28 février 2022 : 95,93 %)							
Chine — 36,39 % (28 février 2022 : 33,22 %)							
HKD	14	Alibaba Group Holding Ltd	149	4,23			
HKD	112	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	120	3,39			
HKD	9	ENN Energy Holdings Ltd	124	3,51			
HKD	86	Guangdong Investment Ltd	87	2,46			
HKD	3	JD.com Inc	68	1,93			
HKD	2	Meituan 'B', 144A	36	1,03			
HKD	38	Minth Group Ltd	99	2,79			
HKD	14	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	96	2,70			
HKD	43	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	70	1,97			
HKD	6	Shenzhou International Group Holdings Ltd	66	1,86			
HKD	5	Tencent Holdings Ltd	224	6,34			
HKD	36	Tongcheng Travel Holdings Ltd	71	2,00			
HKD	39	TravelSky Technology Ltd	77	2,18			
			1 287	36,39			
Hong Kong — 7,56 % (28 février 2022 : 11,51 %)							
HKD	17	AIA Group Ltd	183	5,17			
HKD	9	Techtronic Industries Co Ltd	84	2,39			
			267	7,56			
Inde — 7,09 % (28 février 2022 : 11,79 %)							
INR	10	HDFC Bank Ltd	197	5,56			
INR	1	Tata Consultancy Services Ltd	54	1,53			
			251	7,09			
Indonésie — 1,88 % (28 février 2022 : 2,24 %)							
IDR	261	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	67	1,88			
Singapour — 15,89 % (28 février 2022 : 12,02 %)							
SGD	48	Singapore Technologies Engineering Ltd	128	3,61			
SGD	82	Singapore Telecommunications Ltd	144	4,06			
SGD	7	United Overseas Bank Ltd	159	4,51			
SGD	10	Venture Corp Ltd	131	3,71			
			562	15,89			
Corée du Sud — 16,49 % (28 février 2022 : 13,49 %)							
KRW	1	Hansol Chemical Co Ltd	89	2,50			
KRW	1	LEENO Industrial Inc	70	1,97			
KRW	–	LG Chem Ltd	117	3,31			
KRW	–	LG Energy Solution Ltd	75	2,12			
KRW	5	Samsung Electronics Co Ltd	233	6,59			
			584	16,49			
Taiwan — 12,36 % (28 février 2022 : 11,66 %)							
TWD	13	Accton Technology Corp	119	3,37			
TWD	6	Feng TAY Enterprise Co Ltd	36	1,02			
TWD	17	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	282	7,97			
			437	12,36			
Total des actions ordinaires (coût 4 0155)				3 455	97,66		
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat				3 598	101,71		
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat				3 598	101,71		
Excédent du passif par rapport aux autres éléments de l'actif				-60	-1,71		
Total des actifs nets				3 538\$	100,00		

– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 36 000 \$, soit 1,03 % de l'actif net.

ABRÉVIATIONS :

ETF	– Fonds négocié en bourse (Exchange Traded Fund).
HKD	– Dollar de Hong Kong
IDR	– Rupiah indonésienne
INR	– Roupie indienne
KRW	– Won sud-coréen
SGD	– Dollar de Singapour
TWD	– Dollar de Taïwan

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

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

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Actions ordinaires — 101,05 % (28 février 2022 : 100,64 %)		
Chine — 3,03 % (28 février 2022 : 5,85 %)		
HKD 611 Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	4 272	3,03
Danemark — 3,50 % (28 février 2022 : 3,01 %)		
DKK 43 Coloplast A/S	4 935	3,50
France — 10,14 % (28 février 2022 : 7,01 %)		
EUR 7 Kering SA	3 874	2,75
EUR 15 L'Oreal SA	6 073	4,31
EUR 21 Pernod Ricard SA	4 348	3,08
	14 295	10,14
Hong Kong — 3,04 % (28 février 2022 : 2,86 %)		
HKD 404 AIA Group Ltd	4 292	3,04
Irlande — 5,88 % (28 février 2022 : 7,96 %)		
EUR 32 Kerry Group Plc	3 076	2,18
EUR 80 Kingspan Group Plc	5 215	3,70
	8 291	5,88
Italie — 8,65 % (28 février 2022 : 7,27 %)		
EUR 23 Ferrari NV	5 893	4,18
EUR 103 Moncler SpA	6 314	4,47
	12 207	8,65
Pays-Bas — 5,90 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
EUR 14 ASML Holding NV	8 322	5,90
Suède — 9,97 % (28 février 2022 : 10,75 %)		
SEK 172 Assa Abloy AB	4 205	2,98
SEK 456 Atlas Copco AB	5 427	3,85
SEK 400 Hexagon AB	4 432	3,14
	14 064	9,97
Royaume-Uni — 7,55 % (28 février 2022 : 6,55 %)		
GBP 37 Croda International Plc	2 902	2,06
GBP 204 Dr Martens Plc	389	0,27
21 Linde Plc	7 358	5,22
	10 649	7,55
États-Unis — 43,39 % (28 février 2022 : 38,07 %)		
AUD 10 Adobe Inc	3 213	2,28
15 ANSYS Inc	4 416	3,13
17 Autodesk Inc	3 468	2,46
23 CSL Ltd	4 608	3,27
14 Illumina Inc	2 751	1,95
26 Masimo Corp	4 332	3,07
16 Mastercard Inc	5 513	3,91
28 Microsoft Corp	6 903	4,89
37 NIKE Inc	4 445	3,15
35 NVIDIA Corp	8 051	5,71
27 ResMed Inc	5 815	4,12
21 Veeva Systems Inc 'A'	3 426	2,43
26 Zoetis Inc	4 261	3,02
	61 202	43,39
Total des actions ordinaires (coût 159 607\$)	142 529	101,05
Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat (Coût 159 607\$)	142 529	101,05
Contrats de change à terme — 0,03 % (28 février 2022 : 0,12 %)		
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	41	0,03
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	142 570	101,08
Contrats de change à terme — -1,01 % (28 février 2022 : -1,25 %)		
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	-1 422	-1,01
Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	-1 422	-1,01
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	141 148	100,07
Excédent du passif par rapport aux autres éléments de l'actif	-99	-0,07
Total des actifs nets	141 049\$	100,00

ABRÉVIATIONS :

AUD	– Dollar australien
DKK	– Couronne danoise
EUR	– Euro
GBP	– Livre britannique
HKD	– Dollar de Hong Kong
SEK	– Couronne suédoise

Analyse de l'actif total	% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	99,70
Instruments financiers dérivés	0,03
Autres actifs	0,27
Actif total	100,00

– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 4 272 000 \$, soit 3,03 % de l'actif net.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

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

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)		
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	1 803	Vente	EUR	1 707	\$ -5
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	4 494	Vente	EUR	4 207	41
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	53	Vente	GBP	44	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	115	Vente	GBP	96	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	88 601	Vente	USD	95 208	-1 405
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	2 283	Vente	USD	2 760	-12
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR	28	Vente	USD	30	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	GBP	30	Vente	USD	34	–
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 197 \$)								\$ 41
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : -2 114 \$)								-1 422
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : -1 917 \$)								\$ -1 381

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative
Actions ordinaires — 56,65 % (28 février 2022 : 54,78 %)			Droits — 0,14 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
Australie — 13,13 % (28 février 2022 : 11,72 %)			Hong Kong — 0,14 % (28 février 2022 : 0,00 %)		
AUD 155 AGL Energy Ltd	721	2,87	HKD 37 Link REIT ∞	35	0,14
AUD 74 APA Group	533	2,12	Total des droits (coût \$-)	35	0,14
AUD 419 Aurizon Holdings Ltd	933	3,71	Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat (Coût 27 162\$)	24 963	99,37
AUD 117 Transurban Group	1 112	4,43	Contrats de change à terme — 0,00 % (28 février 2022 : 0,04 %)		
	3 299	13,13	Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	1	—
Chine — 13,32 % (28 février 2022 : 11,69 %)			Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	24 964	99,37
HKD 526 China Merchants Port Holdings Co Ltd	739	2,94	Contrats de change à terme — -0,07 % (28 février 2022 : -0,04 %)		
HKD 4 854 China Tower Corp Ltd, 144A	529	2,10	Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	-19	-0,07
HKD 1 322 Guangdong Investment Ltd	1 338	5,33	Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	-19	-0,07
HKD 1 318 Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	741	2,95	Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	24 945	99,30
	3 347	13,32	Autres éléments de l'actif hors passif	176	0,70
Hong Kong — 5,49 % (28 février 2022 : 6,17 %)			Total des actifs nets	25 121\$	100,00
HKD 112 CLP Holdings Ltd	788	3,14	— Les montants désignés par « — » sont égaux à 0 \$, inférieurs à 1 000 \$, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.		
HKD 587 HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd	376	1,50	144A Valeurs mobilières exemptées de l'obligation d'enregistrement conformément à la règle 144A de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933, telle qu'amendée. Ces titres peuvent uniquement être revendus, dans le cadre de transactions dispensées d'enregistrement, aux acheteurs institutionnels qualifiés. Au 28 février 2023, ces valeurs s'élevaient à 529 000 \$, soit 2,10 % de l'actif net.		
HKD 39 Wharf Real Estate Investment Co Ltd	214	0,85	∞ Le titre est évalué de bonne foi à sa juste valeur par et à la seule discrétion de la société de gestion ou du gestionnaire concerné du compartiment.		
	1 378	5,49	ABRÉVIATIONS :		
Inde — 7,70 % (28 février 2022 : 8,08 %)			AUD — Dollar australien		
INR 1 635 NHPC Ltd	786	3,13	HKD — Dollar de Hong Kong		
INR 428 Power Grid Corp of India Ltd	1 148	4,57	INR — Roupie indienne		
	1 934	7,70	MYR — Ringgit malaisien		
Malaisie — 2,57 % (28 février 2022 : 2,53 %)			NZD — Dollar néo-zélandais		
MYR 56 Petronas Gas Bhd	207	0,82	PHP — Peso philippin		
MYR 541 Westports Holdings Bhd	440	1,75	SGD — Dollar de Singapour		
	647	2,57	THB — Baht thaïlandais		
Nouvelle-Zélande — 5,98 % (28 février 2022 : 2,83 %)					
NZD 166 Chorus Ltd	846	3,37			
NZD 138 Contact Energy Ltd	656	2,61			
	1 502	5,98			
Philippines — 1,10 % (28 février 2022 : 3,60 %)					
PHP 48 Manila Electric Co	277	1,10			
Singapour — 4,14 % (28 février 2022 : 3,43 %)					
SGD 759 Capitaland India Trust	628	2,50			
SGD 642 NETLINK NBN TRUST	411	1,64			
	1 039	4,14			
Thaïlande — 3,22 % (28 février 2022 : 4,73 %)					
THB 2 156 Digital Telecommunications Infrastructure Fund	808	3,22			
Total des actions ordinaires (coût 15 467\$)	14 231	56,65			
Fonds communs immobiliers — 42,58 % (28 février 2022 : 44,07 %)					
Australie — 20,53 % (28 février 2022 : 21,10 %)					
AUD 89 Charter Hall Long Wale REIT	273	1,09			
AUD 416 Charter Hall Retail REIT	1 114	4,43			
AUD 199 GPT Group/The	628	2,50			
AUD 369 Region RE Ltd	630	2,51			
AUD 637 Scentre Group	1 273	5,07			
AUD 185 Stockland	477	1,90			
AUD 555 Vicinity Ltd	762	3,03			
	5 157	20,53			
Hong Kong — 8,91 % (28 février 2022 : 6,65 %)					
HKD 1 213 Fortune Real Estate Investment Trust	1 024	4,08			
HKD 185 Link REIT	1 215	4,83			
	2 239	8,91			
Inde — 4,22 % (28 février 2022 : 5,04 %)					
INR 285 Embassy Office Parks REIT	1 059	4,22			
Nouvelle-Zélande — 2,04 % (28 février 2022 : 1,31 %)					
NZD 893 Kiwi Property Group Ltd	513	2,04			
Singapour — 6,88 % (28 février 2022 : 9,97 %)					
SGD 635 CapitaLand Integrated Commercial Trust	911	3,62			
SGD 119 Frasers Centrepoint Trust	198	0,79			
SGD 355 Mapletree Industrial Trust	620	2,47			
	1 729	6,88			
Total des fonds communs immobiliers (coût 11 695\$)	10 697	42,58			

Analyse de l'actif total	% de l'actif total
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé	98,80
Instruments financiers dérivés	—
Autres actifs	1,20
Actif total	100,00

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)			Devise de vente (en milliers)			Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	17	Vente	AUD	25	\$ 1
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	–	Vente	CNH	–	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD	13	Vente	SGD	18	–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	AUD	585	Vente	USD	406	13)
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	SGD	434	Vente	USD	328	-6
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	CNH	8	Vente	USD	1	–
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 11 \$)								\$ 1
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : -10 \$)								-19
Moins-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 1 \$)								\$ -18

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Actions (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	Actions (en milliers)		Valeur (en milliers) \$	% de la valeur liquidative	
Actions ordinaires — 99,55 % (28 février 2022 : 99,59 %)				États-Unis — 2,42 % (28 février 2022 : 0,94 %)				
Brésil — 6,02 % (28 février 2022 : 5,07 %)				2 EPAM Systems Inc				
BRL	223	B3 SA – Brasil Bolsa Balcao	449	1,29		521	1,50	
BRL	190	Cosan SA	544	1,57		319	0,92	
BRL	141	Odontoprev SA	309	0,89		840	2,42	
BRL	105	WEG SA	787	2,27				
			2 089	6,02				
Chili — 2,16 % (28 février 2022 : 1,89 %)				Total des actions ordinaires (coût 42 519\$)				
GBP	40	Antofagasta Plc	751	2,16		34 547	99,55	
Chine — 28,67 % (28 février 2022 : 28,01 %)				Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat				
HKD	55	Alibaba Group Holding Ltd	610	1,76		34 547	99,55	
	8	Alibaba Group Holding Ltd ADR	660	1,90				
HKD	82	Brilliance China Automotive Holdings Ltd	41	0,12				
HKD	132	China Merchants Bank Co Ltd	716	2,06				
CNH	11	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	608	1,75				
HKD	30	ENN Energy Holdings Ltd	431	1,24				
HKD	4	JD.com Inc	82	0,24				
	12	JD.com Inc ADR	514	1,48				
HKD	48	Meituan 'B', 144A	831	2,40				
HKD	116	Minth Group Ltd	302	0,87				
CNH	204	Ping An Bank Co Ltd	404	1,16				
HKD	124	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	844	2,43				
HKD	121	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	354	1,02				
CNH	36	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	379	1,09				
HKD	53	Tencent Holdings Ltd	2 343	6,75				
HKD	56	Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	388	1,12				
CNH	27	Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	166	0,48				
HKD	258	Xinyi Solar Holdings Ltd	276	0,80				
			9 949	28,67				
Hong Kong — 2,94 % (28 février 2022 : 2,35 %)				ABRÉVIATIONS :				
HKD	96	AIA Group Ltd	1 020	2,94	ADR	– Certificat américain de dépôt (American Depositary Receipt).		
Inde — 17,02 % (28 février 2022 : 17,91 %)				BRL	– Réal brésilien			
INR	13	Asian Paints Ltd	430	1,24	CNH	– Renminbi chinois		
INR	47	HDFC Bank Ltd	915	2,64	GBP	– Livre britannique		
INR	127	ICICI Bank Ltd	1 313	3,78	HKD	– Dollar de Hong Kong		
INR	27	Kotak Mahindra Bank Ltd	574	1,65	IDR	– Rupiah indonésienne		
INR	5	Maruti Suzuki India Ltd	499	1,44	INR	– Roupie indienne		
INR	35	Reliance Industries Ltd	967	2,79	KRW	– Won sud-coréen		
INR	29	Titan Co Ltd	820	2,36	MXN	– Peso mexicain		
INR	4	UltraTech Cement Ltd	389	1,12	PHP	– Peso philippin		
			5 907	17,02	SAR	– Riyal saoudien		
Indonésie — 3,54 % (28 février 2022 : 2,98 %)				TWD	– Dollar de Taïwan			
IDR	2 721	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	833	2,40		% de l'actif total		
IDR	1 552	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	396	1,14	Analyse de l'actif total			
			1 229	3,54	Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé			
Mexique — 4,57 % (28 février 2022 : 0,77 %)					Autres actifs			
MXN	81	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	686	1,98	Actif total			
MXN	128	Orbia Advance Corp SAB de CV	266	0,76				
MXN	162	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	635	1,83				
			1 587	4,57				
Pérou — 1,15 % (28 février 2022 : 1,37 %)								
	3	Credicorp Ltd	397	1,15				
Philippines — 0,43 % (28 février 2022 : 0,42 %)								
PHP	150	Robinsons Retail Holdings Inc	148	0,43				
Arabie saoudite — 1,78 % (28 février 2022 : 2,36 %)								
SAR	33	Al Rajhi Bank	617	1,78				
Singapour — 0,47 % (28 février 2022 : 0,00 %)								
	3	Sea Ltd, ADR	164	0,47				
Corée du Sud — 15,91 % (28 février 2022 : 18,76 %)								
KRW	1	LG Chem Ltd	738	2,13				
KRW	–	LG Energy Solution Ltd	112	0,32				
KRW	–	LG H&H Co Ltd	146	0,42				
KRW	2	NAVER Corp	314	0,90				
KRW	59	Samsung Electronics Co Ltd	2 709	7,81				
KRW	1	Samsung SDI Co Ltd	518	1,49				
KRW	15	SK Hynix Inc	985	2,84				
			5 522	15,91				
Taiwan — 12,47 % (28 février 2022 : 14,15 %)								
TWD	55	Delta Electronics Inc	515	1,48				
TWD	40	Globalwafers Co Ltd	663	1,91				
TWD	190	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	3 149	9,08				
			4 327	12,47				

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023

Actions (en milliers)	Valeur (en milliers) €	% de la valeur liquidative	% de l'actif total
Actions ordinaires — 99,83 % (28 février 2022 : 99,66 %)			
Danemark — 3,76 % (28 février 2022 : 4,42 %)			
DKK 65 Coloplast A/S	7 103	3,76	
France — 21,05 % (28 février 2022 : 18,59 %)			
210 Dassault Systemes SE	7 663	4,05	
16 Kering SA	8 777	4,64	
25 L'Oreal SA	9 278	4,91	
30 Pernod Ricard SA	5 913	3,13	
27 Sartorius Stedim Biotech	8 177	4,32	
	39 808	21,05	
Allemagne — 7,65 % (28 février 2022 : 11,97 %)			
258 Infineon Technologies AG	8 629	4,56	
108 Nemetschek SE	5 835	3,09	
	14 464	7,65	
Irlande — 6,83 % (28 février 2022 : 7,86 %)			
60 Kerry Group Plc	5 445	2,88	
122 Kingspan Group Plc	7 478	3,95	
	12 923	6,83	
Italie — 15,71 % (28 février 2022 : 11,91 %)			
76 Ferrari NV	18 590	9,83	
192 Moncler SpA	11 120	5,88	
	29 710	15,71	
Pays-Bas — 8,94 % (28 février 2022 : 9,59 %)			
29 ASML Holding NV	16 902	8,94	
Suède — 13,48 % (28 février 2022 : 13,96 %)			
SEK 394 Assa Abloy AB	9 099	4,81	
SEK 728 Atlas Copco AB	8 185	4,33	
SEK 784 Hexagon AB	8 218	4,34	
	25 502	13,48	
Suisse — 3,36 % (28 février 2022 : 3,91 %)			
CHF 7 Partners Group Holding AG	6 353	3,36	
Royaume-Uni — 12,44 % (28 février 2022 : 11,91 %)			
559 Allfunds Group Plc	4 607	2,44	
59 Croda International Plc	4 373	2,31	
GBP 842 Dr Martens Plc	1 521	0,80	
28 Linde Plc	9 028	4,78	
GBP 1 681 Oxford Nanopore Technologies Plc	3 993	2,11	
	23 522	12,44	
États-Unis — 6,61 % (28 février 2022 : 5,54 %)			
USD 9 Mettler-Toledo International Inc.	12 493	6,61	
Total des actions ordinaires (coût 217 476€)	188 780	99,83	
Total des actifs financiers à leur juste valeur par le biais du compte de résultat (Coût 217 476€)	188 780	99,83	
Contrats de change à terme — 0,01 % (28 février 2022 : 0,09 %)			
Plus-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	22	0,01	
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	188 802	99,84	
Contrats de change à terme — -0,01 % (28 février 2022 : -0,02 %)			
Moins-value latente sur les contrats (voir ci-dessous)	-20	-0,01	
Total des passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	-20	-0,01	
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat	188 782	99,83	
Autres éléments de l'actif hors passif	315	0,17	
Total des actifs nets	189 097€	100,00	

— Les montants désignés par « — » sont égaux à 0€, inférieurs à 1 000€, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.

ABRÉVIATIONS :

CHF	— Franc suisse
DKK	— Couronne danoise
GBP	— Livre britannique
SEK	— Couronne suédoise
USD	— Dollar américain

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^

Portefeuille d'investissements au 28 février 2023 – (suite)

Tableau des contrats de change à terme

Date d'échéance	Contrepartie	Devise d'achat (en milliers)		Devise de vente (en milliers)		Plus-value/ (moins-value) latente des contrats (en milliers)	
02 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 74	Vente	BRL 411	€	-1
02 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 2 287	Vente	BRL 12 551		20
02 mars 2023	BNY Mellon	Achat	BRL 12 962	Vente	EUR 2 340		2
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	USD 57	Vente	EUR 54		–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 2	Vente	USD 2		–
15 mars 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 1	Vente	USD 2		–
04 avril 2023	BNY Mellon	Achat	EUR 24	Vente	BRL 135		–
04 avril 2023	BNY Mellon	Achat	BRL 7 584	Vente	EUR 1 376		-19
Plus-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 281 €)						€	22
Moins-value latente des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : -69 €)							-20
Plus-value nette des contrats de change à terme (28 février 2022 (en milliers) : 212 €)						€	2

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

Franklin Responsible Income 2028 Fund^

Portefeuille d’investissements au 28 février 2023

Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) €	% de la valeur liquidative	Valeur nominale (en milliers)	Valeur (en milliers) €	% de la valeur liquidative
Obligations et bons d’entreprises — 92,33 %					
Australie - 1,34 %					
600 Macquarie Group Ltd, 0,350 %, due 03/03/2028	492	1,34			
Belgique - 2,19 %					
800 Crelan SA, 5,750 %, échéance le 26/01/2028	806	2,19			
Chine - 1,32 %					
600 Prosus NV, 1,539 %, échéance le 03/08/2028	487	1,32			
République tchèque - 1,77 %					
700 CEZ AS, 3,000 %, échéance le 05/06/2028	652	1,77			
Danemark - 1,57 %					
700 Nykredit Realkredit AS, 0,375 %, échéance le 17/01/2028	577	1,57			
Finlande - 1,55 %					
700 OP Corporate Bank plc, 0,375 %, échéance le 16/06/2028	572	1,55			
France - 16,09 %					
320 Altice France SA/France, 3,375 %, échéance le 15/01/2028	247	0,67			
800 BPCE SA, 4,375 %, échéance le 13/07/2028	792	2,15			
400 CAB SELAS, 3,375 %, échéance le 01/02/2028	324	0,88			
800 Engie SA, 1,750 %, échéance le 27/03/2028	724	1,97			
320 Iliad Holding SASU, 5,625 %, échéance le 15/10/2028	295	0,80			
300 iliad SA, 1,875 %, échéance le 11/02/2028	248	0,67			
800 La Banque Postale SA, 1,000 %, échéance le 09/02/2028 *	694	1,89			
800 Orano SA, 2,750 %, échéance le 08/03/2028	730	1,98			
600 RCI Banque SA, 4,875 %, échéance le 21/09/2028	602	1,64			
500 Rexel SA, 2,125 %, échéance le 15/12/2028	433	1,18			
400 SANEF SA, 0,950 %, échéance le 19/10/2028	336	0,91			
600 Societe Generale SA, 0,125 %, échéance le 18/02/2028	498	1,35			
	5 923	16,09			
Allemagne - 3,54 %					
700 Commerzbank AG, 4,625 %, échéance le 21/03/2028 *	694	1,89			
700 Vonovia Finance BV, 1,500 %, échéance le 14/01/2028	609	1,65			
	1 303	3,54			
Grèce - 0,68 %					
300 Eurobank SA, 2,250 %, échéance le 14/03/2028 *	252	0,68			
Irlande - 3,05 %					
800 AIB Group Plc, 2,250 %, échéance le 04/04/2028 *	724	1,96			
400 Bank of Ireland Group Plc, 4,875 %, échéance le 16/07/2028 *	400	1,09			
	1 124	3,05			
Italie - 7,49 %					
800 Atlantia SpA, 1,875 %, échéance le 12/02/2028	678	1,84			
500 Autostrade per l'Italia SpA, 1,625 %, échéance le 25/01/2028	426	1,16			
400 Autostrade per l'Italia SpA, 2,000 %, échéance le 04/12/2028	338	0,92			
350 IMA Industria Macchine Automatiche SpA, 3,750 %, échéance le 15/01/2028	306	0,83			
800 Intesa Sanpaolo SpA, 1,750 %, échéance le 20/03/2028	702	1,90			
300 Italmatch Chemicals SpA, 10,000 %, échéance le 06/02/2028	309	0,84			
	2 759	7,49			
Luxembourg - 3,14 %					
600 Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,000 %, échéance le 04/05/2028	446	1,21			
300 Kleopatra Finco Sarl, 4,250 %, échéance le 01/03/2026	254	0,69			
500 Matterhorn Telecom SA, 4,000 %, échéance le 15/11/2027	457	1,24			
	1 157	3,14			
Pays-Bas - 2,14 %					
800 ABN AMRO Bank NV, 4,000 %, échéance le 16/01/2028	787	2,14			
Portugal - 2,24 %					
800 Caixa Geral de Depositos SA, 5,750 %, échéance le 31/10/2028 *	824	2,24			
Espagne - 9,71 %					
700 Abanca Corp Bancaria SA, 5,250 %, échéance le 14/09/2028 *	694	1,88			
400 Arena Luxembourg Finance Sarl, 1,875 %, échéance le 01/02/2028	322	0,87			
700 Banco de Sabadell SA, 5,250 %, échéance le 07/02/2029 *	684	1,86			
600 Banco Santander SA, 3,875 %, échéance le 13/07/2028	590	1,60			
800 CaixaBank SA, 0,750 %, échéance le 26/05/2028 *	681	1,85			
600 Unicaja Banco SA, 7,250 %, échéance le 15/11/2027 *	606	1,65			
	3 577	9,71			
Suède - 2,67 %					
400 SBB Treasury Oyj, 0,750 %, échéance le 14/12/2028	264	0,72			
400 Svenska Handelsbanken AB, 3,750 %, échéance le 01/11/2027	399	1,08			
300 Verisure Holding AB, 9,250 %, échéance le 15/10/2027	318	0,87			
	981	2,67			
Suisse - 2,49 %					
430 Cloverie Plc for Zurich Insurance Co Ltd, 1,500 %, échéance le 15/12/2028	379	1,03			
700 Credit Suisse Group AG, 0,650 %, échéance le 14/01/2028 *	537	1,46			
	916	2,49			
Royaume-Uni — 14,60 %					
800 Barclays Plc, 0,877 %, échéance le 28/01/2028 *	690	1,87			
700 easyJet FinCo BV, 1,875 %, échéance le 03/03/2028	602	1,63			
600 National Grid Plc, 0,163 %, échéance le 20/01/2028	497	1,35			
800 Nationwide Building Society, 0,250 %, échéance le 14/09/2028	645	1,75			
410 NatWest Markets Plc, 1,375 %, échéance le 02/03/2027	367	1,00			
600 NatWest Markets Plc, 4,250 %, échéance le 13/01/2028	596	1,62			
700 Sage Group Plc/The, 3,820 %, échéance le 15/02/2028	690	1,87			
400 Santander UK Group Holdings Plc, 3,530 %, échéance le 25/08/2028 *	380	1,03			
800 Thames Water Utilities Finance Plc, 0,875 %, échéance le 31/01/2028	680	1,85			
280 Victoria Plc, 3,625 %, échéance le 24/08/2026	230	0,63			
	5 377	14,60			
États-Unis — 14,75 %					
500 Apple Inc, 2,000 %, échéance le 17/09/2027	470	1,28			
600 Avantor Funding Inc, 3,875 %, échéance le 15/07/2028	551	1,49			
640 Berry Global Inc, 1,500 %, échéance le 15/01/2027	570	1,55			
450 DXC Capital Funding DAC, 0,450 %, échéance le 15/09/2027	374	1,01			
650 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000 %, échéance le 22/03/2028	587	1,59			
600 International Business Machines Corp, 0,300 %, échéance le 11/02/2028	506	1,38			
500 IQVIA Inc, 2,250 %, arrivant à échéance le 15/01/2028	430	1,17			
700 JPMorgan Chase & Co, 1,638 %, échéance le 18/05/2028 *	629	1,71			
800 Morgan Stanley, 4,813 %, échéance le 25/10/2028 *	810	2,20			
540 PVH Corp, 3,125 %, échéance le 15/12/2027	504	1,37			
	5 431	14,75			
Total des obligations et bons d’entreprises (coût 34 720€)				33 997	92,33
Obligations et bons d’État— 2,07 %					
Roumanie - 2,07 %					
900 Romanian Government International Bond, 2,125 %, échéance le 07/03/2028	762	2,07			
Total des obligations et bons d’État (Coût 777€)				762	2,07
Total des actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat				34 759	94,40
Total des actifs et passifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat				34 759	94,40
Autres éléments de l'actif hors passif				2 064	5,60
Total des actifs nets				36 823€	100,00
— Les montants désignés par « – » sont égaux à 0€, inférieurs à 1 000€, inférieurs à 1 000 actions ou inférieurs à 0,01 %.					
* Titre à taux variable. Le taux d’intérêt indiqué reflète le taux en vigueur au 28 février 2023.					
Analyse de l'actif total					
% de l'actif total					
Valeurs mobilières admises à la cote officielle ou négociées sur un marché réglementé				92,29	
Autres actifs				7,71	
Actif total				100,00	

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

[Cette page est intentionnellement laissée vierge]

État de la situation financière

	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	
	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022
(en milliers)								
ACTIFS COURANTS :								
Trésorerie et équivalents de trésorerie (Note 8)	\$ 1	\$ 1	\$ –	\$ 16	\$ 34 310	\$ 20 859	€ 4 251	€ 1 027
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions (Note 8)	–	–	2 060	4 462	7 065	18 123	2 191	2 338
Actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (Note 2) :								
Investissements	844 196	939 444	140 166	234 866	1 183 129	1 477 772	125 838	146 614
Investissements nantis	–	–	–	–	–	280	–	–
Options	–	–	64	58	556	383	4	–
Contrats de swap	–	–	2 534	2 494	8 276	11 755	–	72
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	–	–	–	–	540	3 409	72	59
Plus-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	303	726	2 474	5 952	476	567
Montants à recevoir pour les investissements vendus (Note 2)	–	–	1 429	2 086	17 093	14 432	–	3
Montants à recevoir pour les actions participatives rachetables vendues	–	–	53	153	429	948	–	–
Intérêts et autres revenus à recevoir	2 036	313	1 107	1 348	8 995	8 588	1 280	1 156
Dividendes à recevoir	–	–	8	3	10	8	31	28
Commissions de gestion à recevoir	–	–	–	–	–	–	–	–
Autres actifs	–	–	–	–	–	–	–	1
Total des actifs courants	846 233	939 758	147 724	246 212	1 262 877	1 562 509	134 143	151 865
PASSIFS COURANTS :								
Découvert de trésorerie (Note 8)	–	–	620	659	849	1 199	–	–
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions (Note 8)	–	–	2 826	2 642	445	2 114	9	508
Passifs financiers à leur juste valeur après affectation au compte de résultat (Note 2) :								
Options	–	–	70	229	615	1 476	4	3
Contrats de swap	–	–	46	421	1 867	3 508	–	743
Options sur swaps	–	–	–	–	–	258	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	–	–	–	50	2 578	7 304	338	569
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	180	1 522	3 625	8 964	1 065	590
Montants à payer au titre des investissements acquis (Note 2)	9 879	19 972	11 726	5 654	101 191	44 980	187	1
Distributions aux Détenteurs d'actions de participation rachetables	2 054	6	132	55	148	48	1	–
Commissions de gestion à payer (Note 4)	363	55	71	141	487	668	3	2
Commissions de performance à payer (Note 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissions de l'Agent administratif et du Dépositaire à payer (Note 4)	24	22	16	17	73	78	14	10
Commissions d'agent de services aux actionnaires à payer (Note 4)	–	–	1	16	20	31	–	1
Montants à payer pour les actions de participation rachetables rachetées	–	–	1	1 814	1 904	3 508	–	–
Charges à payer et autres passifs	298	379	116	86	375	283	55	52
Passifs (excluant l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables)	12 618	20 434	15 805	13 306	114 177	74 419	1 676	2 479
Total de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables	\$ 833 615	\$ 919 324	\$ 131 919	\$ 232 906	\$1 148 700	\$1 488 090	€ 132 467	€ 149 386

	FTGF Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset US Short- Term Government Fund ^A		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund ^A		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund ^A	
	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022
(en milliers)								
ACTIFS COURANTS :								
Trésorerie et équivalents de trésorerie (Note 8)	\$ 3 850	\$ 5 997	\$ 14	\$ 14	\$ 17	\$ 17	\$ 45	\$ 776
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions (Note 8)	162	168	–	–	–	–	–	993
Actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (Note 2) :								
Investissements	52 716	75 783	–	–	–	–	–	57 903
Investissements nantis	–	–	–	–	–	–	–	–
Options	–	–	–	–	–	–	–	–
Contrats de swap	–	–	–	–	–	–	–	26
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	60	193	–	–	–	–	–	353
Plus-value latente sur les contrats à terme standardisés	38	51	–	–	–	–	–	315
Montants à recevoir pour les investissements vendus (Note 2)	554	466	–	–	–	–	–	1
Montants à recevoir pour les actions participatives rachetables vendues	4	37	–	–	–	–	–	–
Intérêts et autres revenus à recevoir	739	846	–	–	–	–	–	214
Dividendes à recevoir	–	5	–	–	–	–	–	–
Commissions de gestion à recevoir	–	–	–	–	–	–	–	–
Autres actifs	–	–	–	–	–	–	–	1
Total des actifs courants	58 123	83 546	14	14	17	17	45	60 582
PASSIFS COURANTS :								
Découvert de trésorerie (Note 8)	140	–	–	–	–	–	–	–
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions (Note 8)	38	51	–	–	–	–	–	181
Passifs financiers à leur juste valeur après affectation au compte de résultat (Note 2) :								
Options	–	–	–	–	–	–	–	2
Contrats de swap	–	–	–	–	–	–	–	286
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	271	139	–	–	–	–	–	298
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	–	–	–	–	–	236
Montants à payer au titre des investissements acquis (Note 2)	4	158	–	–	–	–	–	–
Distributions aux Détenteurs d'actions de participation rachetables	89	29	–	–	–	–	–	–
Commissions de gestion à payer (Note 4)	41	72	–	–	–	–	–	9
Commissions de performance à payer (Note 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissions de l'Agent administratif et du Dépositaire à payer (Note 4)	11	9	–	5	–	2	3	7
Commissions d'agent de services aux actionnaires à payer (Note 4)	4	8	–	–	–	–	–	1
Montants à payer pour les actions de participation rachetables rachetées	–	1 011	–	–	–	–	–	–
Charges à payer et autres passifs	94	91	14	9	17	15	42	37
Passifs (excluant l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables)	692	1 568	14	14	17	17	45	1 057
Total de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables	\$ 57 431	\$ 81 978	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 59 525

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [†]		FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		FTGF Western Asset US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund ^{Δδ}		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund ^{Δβ}	
Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022
\$ 1 425	\$ 2 087	\$ 20 391	\$ 14 249	\$ 63	\$ 5	\$ 60	\$ 3 396	\$ 35	\$ 459
–	5	882	3 447	1 126	1 156	–	318	–	88
–	50 718	202 891	283 356	123 407	255 876	–	37 277	–	27 090
–	–	–	89	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	9	–	9
–	–	–	–	102	112	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	1	775	4 595	1	–	–	155	–	–
–	–	74	104	–	47	–	–	–	1
–	167	4 780	1 435	608	4 839	–	–	–	–
–	170	28	23	8	347	–	–	–	–
–	707	2 851	2 987	1 920	3 416	–	460	–	347
–	–	15	–	5	2	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
1	–	–	–	–	–	2	–	–	–
1 426	53 855	232 687	310 285	127 240	265 800	62	41 615	35	27 994
–	–	559	–	155	578	–	–	–	–
–	–	27	330	–	190	–	127	–	–
–	–	–	–	–	–	–	6	–	–
–	–	–	657	116	19	–	8	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	29	4 011	2 265	35	41	–	174	–	39
–	–	29	1 281	31	72	–	89	–	27
–	214	266	42	1 250	341	–	–	–	–
12	16	94	28	172	59	–	3	–	–
14	49	91	114	67	119	–	18	–	1
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
9	24	20	20	14	18	3	19	3	6
2	5	6	7	7	9	–	1	–	–
1 366	488	45	2 408	74	5 179	11	10	–	44
23	38	184	164	79	75	48	42	32	29
1 426	863	5 332	7 316	2 000	6 700	62	497	35	146
\$ –	\$ 52 992	\$ 227 355	\$ 302 969	\$ 125 240	\$ 259 100	\$ –	\$ 41 118	\$ –	\$ 27 848
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund ^Δ		FTGF Western Asset Global Credit Fund ^Δ		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund ^{Δβ}	
Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022
\$ 998	\$ 3 674	\$ 3 559	\$ 3 114	\$ 4 735	\$ 3 512	\$ 743	\$ 418	€ 31	€ 4 275
1 540	2 793	2 733	1 944	1 544	4 353	1 074	1 374	–	223
433 473	492 770	532 162	445 353	146 874	199 783	43 765	74 454	–	32 770
–	–	–	–	152	314	–	–	–	–
–	–	–	–	19	–	–	–	–	–
–	7 755	213	–	–	142	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
162	378	3 707	4 176	1 011	1 797	343	827	–	8
–	–	4 839	2 194	338	837	202	437	–	–
771	120	2 646	5 009	3 576	3 851	1	3	–	–
41	122	2 043	392	1	2	1	4	–	–
4 375	6 174	2 855	2 276	1 086	1 218	491	800	–	431
20	2	127	4	15	41	6	9	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	1	–	–	–	–	–	–	–
441 380	513 788	554 885	464 462	159 351	215 850	46 626	78 326	31	37 707
522	–	484	161	–	5	–	9	–	–
6	–	1	1 642	17	777	3	339	–	–
–	–	–	–	4	8	–	–	–	–
–	–	–	–	–	1 508	76	393	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
1 130	594	3 219	4 645	2 097	1 907	90	116	–	66
373	1 113	61	181	1 043	1 170	34	44	–	–
770	120	25 758	5 838	9 282	3 922	306	3	–	140
15	7	2	–	–	–	–	–	–	–
200	241	153	137	17	32	2	2	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
32	30	36	26	15	15	9	9	3	5
13	19	11	10	–	–	–	–	–	–
299	1 467	1 106	7 487	72	3 467	–	5	–	–
313	403	84	86	101	91	56	53	28	48
3 673	3 994	30 915	20 213	12 648	12 902	576	973	31	259
\$ 437 707	\$ 509 794	\$ 523 970	\$ 444 249	\$ 146 703	\$ 202 948	\$ 46 050	\$ 77 353	€ –	€ 37 448

État de la situation financière – (suite)

	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund [^]		FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]		Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund [^]	
(en milliers)	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022
ACTIFS COURANTS :								
Trésorerie et équivalents de trésorerie (Note 8)	\$ 63 691	\$ 104 039	\$ 30	\$ 30	\$ 3 203	\$ 9 344	\$ –	\$ –
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions (Note 8)	250 586	717 419	–	–	3 915	4 542	–	–
Actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (Note 2) :								
Investissements	1 913 653	3 826 412	–	–	267 865	358 203	–	–
Investissements nantis	1 590	–	–	–	–	–	–	–
Options	6 090	28 173	–	–	566	382	–	–
Contrats de swap	155 867	227 706	–	–	1 033	207	–	–
Options sur swaps	–	7	–	–	–	–	–	–
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	21 504	112 006	–	–	536	5 345	–	–
Plus-value latente sur les contrats à terme standardisés	20 467	213 705	–	–	53	774	–	–
Montants à recevoir pour les investissements vendus (Note 2)	13 260	9 667	–	–	5 180	2 208	–	–
Montants à recevoir pour les actions participatives rachetables vendues	1 024	7 091	–	–	2 133	2	–	–
Intérêts et autres revenus à recevoir	36 399	54 650	–	–	3 427	3 647	–	–
Dividendes à recevoir	487	3	–	–	8	9	–	–
Commissions de gestion à recevoir	–	–	–	–	–	–	–	–
Autres actifs	–	–	–	–	1	1 002	–	–
Total des actifs courants	2 484 618	5 300 878	30	30	287 920	385 665	–	–
PASSIFS COURANTS :								
Découvert de trésorerie (Note 8)	83 849	101 514	–	–	2	–	–	–
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions (Note 8)	76 579	266 033	–	–	119	836	–	–
Passifs financiers à leur juste valeur après affectation au compte de résultat (Note 2) :								
Options	46 352	127 700	–	–	36	177	–	–
Contrats de swap	43 002	239 384	–	–	761	572	–	–
Options sur swaps	–	528	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	43 616	98 156	–	–	2 965	7 240	–	–
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	47 194	237 864	–	–	890	2 239	–	–
Montants à payer au titre des investissements acquis (Note 2)	4 384	14 790	–	–	7 800	2 415	–	–
Distributions aux Détenteurs d'actions de participation rachetables	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissions de gestion à payer (Note 4)	2 062	4 149	–	–	24	27	–	–
Commissions de performance à payer (Note 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissions de l'Agent administratif et du Dépositaire à payer (Note 4)	151	243	–	5	22	22	–	–
Commissions d'agent de services aux actionnaires à payer (Note 4)	136	279	–	–	–	–	–	–
Montants à payer pour les actions de participation rachetables rachetées	3 140	23 005	–	–	82	61	–	–
Charges à payer et autres passifs	1 652	3 399	30	25	207	177	–	–
Passifs (excluant l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables)	352 117	1 117 044	30	30	12 908	13 766	–	–
Total de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables	\$ 2 132 501	\$ 4 183 834	\$ –	\$ –	\$ 275 012	\$ 371 899	\$ –	\$ –

	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]		FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	
(en milliers)	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022
ACTIFS COURANTS :								
Trésorerie et équivalents de trésorerie (Note 8)	\$ 136	\$ 47	\$ 223	\$ 210	\$ 1 762	\$ 13 991	\$ 5	\$ –
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions (Note 8)	194	43	–	101	2 709	14 317	8	22
Actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (Note 2) :								
Investissements	8 571	9 435	164 330	215 108	538 707	728 758	10 360	11 416
Investissements nantis	–	–	–	–	–	–	–	–
Options	–	–	–	–	–	–	–	–
Contrats de swap	–	–	–	–	–	–	–	97
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	92	270	3 132	4 267	13 024	21 946	10	50
Plus-value latente sur les contrats à terme standardisés	59	21	–	–	2 190	1 272	2	–
Montants à recevoir pour les investissements vendus (Note 2)	155	–	490	230	1 798	–	248	–
Montants à recevoir pour les actions participatives rachetables vendues	–	–	117	163	1 797	3	1	–
Intérêts et autres revenus à recevoir	104	94	1 781	1 992	5 523	4 812	175	179
Dividendes à recevoir	1	2	345	754	233	319	2	1
Commissions de gestion à recevoir	2	13	–	–	–	–	–	–
Autres actifs	8	–	–	–	–	–	–	–
Total des actifs courants	9 322	9 925	170 418	222 825	567 743	785 418	10 811	11 765
PASSIFS COURANTS :								
Découvert de trésorerie (Note 8)	–	–	4	3	7	13	–	1
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions (Note 8)	26	5	850	1 190	2 495	5 014	–	90
Passifs financiers à leur juste valeur après affectation au compte de résultat (Note 2) :								
Options	–	–	–	–	–	–	–	–
Contrats de swap	–	–	–	–	–	–	–	12
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	107	26	3 966	4 493	23 627	22 185	202	20
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	5	–	–	–	–	4 865	–	–
Montants à payer au titre des investissements acquis (Note 2)	145	–	490	230	1 798	–	163	–
Distributions aux Détenteurs d'actions de participation rachetables	–	–	–	–	–	–	1	–
Commissions de gestion à payer (Note 4)	–	–	83	124	260	150	–	2
Commissions de performance à payer (Note 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissions de l'Agent administratif et du Dépositaire à payer (Note 4)	13	5	24	16	38	42	7	5
Commissions d'agent de services aux actionnaires à payer (Note 4)	–	–	11	18	–	–	–	–
Montants à payer pour les actions de participation rachetables rachetées	–	–	2 595	638	–	–	–	–
Charges à payer et autres passifs	31	23	386	478	247	431	44	45
Passifs (excluant l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables)	327	59	8 409	7 190	28 472	32 700	417	175
Total de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables	\$ 8 995	\$ 9 866	\$ 162 009	\$ 215 635	\$ 539 271	\$ 752 718	\$ 10 394	\$ 11 590

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^		FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^		FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^		FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^		Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund^	
Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022
\$ 1 723 629	\$ 1 313 3 553	\$ 416 4 167	\$ 112 6 058	£ 1 256 297	£ 2 378 154	\$ 1 005 978	\$ 293 564	\$ 136 541	\$ 222 1 344
557 051	1 054 614	1 148 337	1 283 066	43 921	70 140	94 192	174 022	17 280	21 064
-	-	-	-	-	-	-	-	19	5
-	1 058	-	1 296	-	-	-	-	899	453
-	2 784	-	-	-	-	-	-	-	-
8	203	-	-	27	8	35	143	11	120
317	502	353	1 640	45	59	4	202	156	191
-	-	46 919	55 814	-	-	-	788	99	15
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1 998	2 369	4 402	3 603	686	982	1 007	1 417	173	126
45	3	5	1	-	3	8	2	5	-
-	-	-	-	-	-	-	-	4	7
-	1	-	2	1	-	-	-	1	-
561 771	1 066 400	1 204 599	1 351 592	46 233	73 724	97 229	177 431	19 324	23 547
-	-	878	189	-	-	-	10	-	-
-	380	54	2 408	-	-	6	280	389	-
-	-	-	-	-	-	-	-	38	81
-	592	-	-	-	-	74	-	2	68
-	1 269	-	-	-	-	-	-	-	-
1 683	3 513	-	14	7	35	404	1 739	58	189
73	2 083	731	666	29	10	103	158	120	533
-	-	83 125	200 768	229	-	1 787	-	193	661
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
77	255	13	-	-	-	4	5	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
38	56	69	60	11	7	12	13	31	17
2	2	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
350	309	222	207	45	39	64	57	52	40
2 223	8 459	85 092	204 312	321	91	2 454	2 262	883	1 589
\$ 559 548	\$ 1 057 941	\$ 1 119 507	\$ 1 147 280	£ 45 912	£ 73 633	\$ 94 775	\$ 175 169	\$ 18 441	\$ 21 958
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^		FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^		FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	
Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022
\$ 422 -	\$ 420 351	\$ 2 173 -	\$ 246 -	\$ 32 149 25 134	\$ 3 14 599	\$ - 980	\$ - 571	\$ - -	\$ - 20
204 726	242 628	-	-	1 153 805	1 522 073	45 793	51 853	8 488	10 165
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	1 309	22 750	-	154	-	80
1 448	2 854	-	-	3 510	9 078	403	79	-	-
9 346	-	-	-	-	-	69	86	-	-
-	3	-	-	838	120 110	-	-	134	-
2 543	2 266	-	-	2 452	2 047	-	-	-	-
601	866	-	-	15 517	14 572	215	335	137	149
-	-	-	-	337	10	11	-	2	-
-	-	-	7	-	-	-	-	21	-
-	-	-	-	8	7	1	-	-	-
219 086	249 388	2 173	253	1 235 059	1 705 249	47 472	53 078	8 782	10 414
3	4	-	-	1	10 850	-	325	103	-
110	610	-	-	-	2 390	-	20	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	878	-	37	-	-	12
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4 239	4 074	-	-	12 389	17 153	379	145	192	196
-	-	-	-	3 704	1 309	175	81	-	-
9 308	-	-	-	5 978	61 079	-	-	30	-
-	-	-	-	106	37	-	-	-	-
100	119	-	-	701	998	39	46	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
27	17	-	-	77	83	20	7	7	5
1	1	-	-	78	107	-	1	1	-
4	1	-	-	714	3 099	-	-	-	-
148	166	2 173	253	128	71	66	67	60	38
13 940	4 992	2 173	253	24 754	97 176	716	692	393	251
\$ 205 146	\$ 244 396	\$ -	\$ -	\$ 1 210 305	\$ 1 608 073	\$ 46 756	\$ 52 386	\$ 8 389	\$ 10 163

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État de la situation financière – (suite)

	Legg Mason Brandywine Global - US High Yield Fund [^]		FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]		FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	
	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022
(en milliers)								
ACTIFS COURANTS :								
Trésorerie et équivalents de trésorerie (Note 8)	\$ -	\$ -	\$ 1 879	\$ 1 406	\$ 1 147	\$ -	\$ -	\$ -
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions (Note 8)	-	-	664	2 861	431	-	-	-
Actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (Note 2) :								
Investissements	-	-	69 694	100 896	13 130	-	2 583	2 236
Investissements nantis	-	-	-	-	-	-	-	-
Options	-	-	-	-	-	-	-	-
Contrats de swap	-	-	-	-	33	-	-	-
Options sur swaps	-	-	-	-	-	-	-	-
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	-	-	249	3 520	86	-	-	1
Plus-value latente sur les contrats à terme standardisés	-	-	-	1 151	-	-	-	-
Montants à recevoir pour les investissements vendus (Note 2)	-	-	327	508	-	-	-	-
Montants à recevoir pour les actions participatives rachetables vendues	-	-	-	-	-	-	-	-
Intérêts et autres revenus à recevoir	-	-	948	1 093	186	-	-	-
Dividendes à recevoir	-	-	9	50	-	-	5	1
Commissions de gestion à recevoir	-	-	-	-	5	-	23	2
Autres actifs	-	-	-	-	4	-	-	-
Total des actifs courants	-	-	73 770	111 485	15 022	-	2 611	2 240
PASSIFS COURANTS :								
Découvert de trésorerie (Note 8)	-	-	1	2	-	-	-	-
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions (Note 8)	-	-	122	630	-	-	-	-
Passifs financiers à leur juste valeur après affectation au compte de résultat (Note 2) :								
Options	-	-	-	-	-	-	-	-
Contrats de swap	-	-	-	-	-	-	-	-
Options sur swaps	-	-	-	-	-	-	-	-
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	-	-	3 482	4 556	64	-	20	29
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	-	-	283	1 426	123	-	-	-
Montants à payer au titre des investissements acquis (Note 2)	-	-	327	508	-	-	-	-
Distributions aux Détenteurs d'actions de participation rachetables	-	-	-	-	-	-	-	-
Commissions de gestion à payer (Note 4)	-	-	-	5	-	-	-	-
Commissions de performance à payer (Note 4)	-	-	-	-	-	-	-	-
Commissions de l'Agent administratif et du Dépositaire à payer (Note 4)	-	-	13	12	4	-	7	5
Commissions d'agent de services aux actionnaires à payer (Note 4)	-	-	-	-	-	-	-	-
Montants à payer pour les actions de participation rachetables rachetées	-	-	-	-	-	-	-	-
Charges à payer et autres passifs	-	-	132	115	27	-	50	29
Passifs (excluant l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables)	-	-	4 360	7 254	218	-	77	63
Total de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables	\$ -	\$ -	\$ 69 410	\$ 104 231	\$ 14 804	\$ -	\$ 2 534	\$ 2 177
	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]		FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	
	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022
(en milliers)								
ACTIFS COURANTS :								
Trésorerie et équivalents de trésorerie (Note 8)	\$ 11 596	\$ 6 591	\$ 2 053	\$ 1 384	\$ 11 074	\$ 2	\$ 385	\$ 246
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions (Note 8)	-	-	-	-	-	-	-	-
Actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (Note 2) :								
Investissements	214 039	536 471	36 590	42 210	1 629 033	1 618 990	12 823	14 292
Investissements nantis	-	-	-	-	-	-	-	-
Options	-	-	-	-	-	-	-	-
Contrats de swap	-	-	-	-	-	-	-	-
Options sur swaps	-	-	-	-	-	-	-	-
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	4	113	1	20	22	145	-	-
Plus-value latente sur les contrats à terme standardisés	-	-	-	-	-	-	-	-
Montants à recevoir pour les investissements vendus (Note 2)	179	445	-	-	3 682	1 602	-	-
Montants à recevoir pour les actions participatives rachetables vendues	5	111	-	36	29 209	4 006	-	1 500
Intérêts et autres revenus à recevoir	14	-	7	6	20	-	-	-
Dividendes à recevoir	42	83	72	65	740	840	13	13
Commissions de gestion à recevoir	-	-	-	-	-	-	-	-
Autres actifs	-	-	-	-	4	1	-	-
Total des actifs courants	225 879	543 814	38 723	43 721	1 673 784	1 625 586	13 221	16 051
PASSIFS COURANTS :								
Découvert de trésorerie (Note 8)	-	397	-	-	7	8 610	-	-
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions (Note 8)	-	-	-	-	-	-	-	-
Passifs financiers à leur juste valeur après affectation au compte de résultat (Note 2) :								
Options	-	-	-	-	-	-	-	-
Contrats de swap	-	-	-	-	-	-	-	-
Options sur swaps	-	-	-	-	-	-	-	-
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	229	123	56	38	840	2 099	-	-
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	-	-	-	-	-	-	-	-
Montants à payer au titre des investissements acquis (Note 2)	179	2 179	-	207	3 682	1 602	-	-
Distributions aux Détenteurs d'actions de participation rachetables	-	-	-	-	-	-	-	-
Commissions de gestion à payer (Note 4)	200	391	33	38	704	694	6	7
Commissions de performance à payer (Note 4)	-	-	-	-	-	-	-	-
Commissions de l'Agent administratif et du Dépositaire à payer (Note 4)	43	61	11	8	130	106	9	6
Commissions d'agent de services aux actionnaires à payer (Note 4)	35	50	4	5	170	108	-	-
Montants à payer pour les actions de participation rachetables rachetées	176	2 136	44	100	28 161	12 990	-	-
Charges à payer et autres passifs	224	318	47	46	111	62	27	20
Passifs (excluant l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables)	1 086	5 655	195	442	33 805	26 271	42	33
Total de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables	\$ 224 793	\$ 538 159	\$ 38 528	\$ 43 279	\$1 639 979	\$1 599 315	\$ 13 179	\$ 16 018

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Growth Fund ^A		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund ^A		FTGF ClearBridge US Appreciation Fund		FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022
\$ 12 361	\$ 10 821	\$ 59	\$ 58	\$ 55	\$ 57	\$ 9 110	\$ 18 115	\$ 54 486	\$ 30 686
—	—	—	—	—	—	—	—	530	—
921 986	881 788	—	—	—	—	180 681	207 470	1 172 787	1 756 332
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
10	14	—	—	—	—	—	—	286	4 603
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
4 380	304	—	—	—	—	43	—	2 355	6 645
724	871	—	—	—	—	—	3	1 211	2 327
72	—	—	—	—	—	10	—	67	—
989	887	—	—	—	—	160	193	1 120	1 081
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
2	—	—	—	—	—	—	—	—	—
940 524	894 685	59	58	55	57	190 004	225 781	1 232 842	1 801 674
2 030	1	—	—	—	—	—	—	5	1
—	—	—	—	—	—	—	—	—	4 240
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
976	641	—	—	—	—	—	—	1 551	1 709
6 635	304	—	—	—	—	43	—	429	1 938
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
609	567	—	—	—	—	165	196	795	1 137
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
86	67	—	—	—	5	27	23	165	158
56	56	—	—	—	—	23	31	109	148
288	701	29	29	—	—	55	11 979	3 685	19 322
118	110	30	29	55	52	81	72	368	326
10 798	2 447	59	58	55	57	394	12 301	7 107	28 979
\$ 929 726	\$ 892 238	\$ —	\$ —	\$ —	\$ —	\$ 189 610	\$ 213 480	\$1 225 735	\$1 772 695
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund ^A		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund ^A ^E		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		FTGF Royce US Smaller Companies Fund	
Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022
€ 25 979	€ 13 373	\$ 50	\$ 75	\$ 8 169	\$ 6 456	\$ 1 330	\$ 93	\$ —	\$ 12
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
1 032 510	648 298	—	2 667	399 290	164 133	744 113	933 530	78 654	88 460
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
1 921	3 195	—	—	24	82	150	1 468	—	1
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3 932	961	—	—	3 321	3 945	1 897	13 964	144	293
2 238	8 689	—	—	1 858	1 113	711	1 026	1	35
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
1 740	1 626	—	7	2 085	725	474	323	16	10
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
3	—	—	—	14	—	—	—	1	—
1 068 323	676 142	50	2 749	414 761	176 454	747 676	950 404	78 816	88 811
2	2	—	—	6	14	643	56	142	341
—	340	—	—	—	—	—	1 170	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
1 058	438	—	30	2 229	332	1 623	1 791	2	5
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
2 286	1 204	—	—	3 872	2 075	1 944	14 230	358	99
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
826	549	—	2	377	186	624	747	83	91
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
103	53	3	5	31	14	82	68	16	12
99	69	—	—	74	42	109	130	12	15
1 022	1 968	—	—	2 062	368	915	15 803	37	249
94	95	47	47	62	29	207	200	68	64
5 490	4 718	50	84	8 713	3 060	6 147	34 195	718	876
€1 062 833	€ 671 424	\$ —	\$ 2 665	\$ 406 048	\$ 173 394	\$ 741 529	\$ 916 209	\$ 78 098	\$ 87 935

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^		Legg Mason US Equity Fund^		Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^y		FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	
	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022
(en milliers)								
ACTIFS COURANTS :								
Trésorerie et équivalents de trésorerie (Note 8)	\$	—	\$	—	€	1 256	€	304
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions (Note 8)	—	—	—	—	—	—	—	—
Actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (Note 2) :								
Investissements	4 273	4 550	—	—	—	27 834	20 883	25 897
Investissements nantis	—	—	—	—	—	—	—	—
Options	—	—	—	—	—	—	—	—
Contrats de swap	—	—	—	—	—	—	—	—
Options sur swaps	—	—	—	—	—	—	—	—
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	—	—	—	—	—	162	—	34
Plus-value latente sur les contrats à terme standardisés	—	—	—	—	—	—	—	—
Montants à recevoir pour les investissements vendus (Note 2)	—	6	—	—	—	52	—	539
Montants à recevoir pour les actions participatives rachetables vendues	—	—	—	—	—	52	3	3
Intérêts et autres revenus à recevoir	—	—	—	—	—	—	1	—
Dividendes à recevoir	8	3	—	—	3	172	62	123
Commissions de gestion à recevoir	—	5	—	—	—	—	—	—
Autres actifs	—	—	—	—	—	—	—	—
Total des actifs courants	4 281	4 564	23	23	1 259	28 576	21 351	26 665
PASSIFS COURANTS :								
Découvert de trésorerie (Note 8)	—	—	—	—	—	—	—	182
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions (Note 8)	—	—	—	—	—	—	—	—
Passifs financiers à leur juste valeur après affectation au compte de résultat (Note 2) :								
Options	—	—	—	—	—	—	—	—
Contrats de swap	—	—	—	—	—	—	—	—
Options sur swaps	—	—	—	—	—	—	—	—
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	—	—	—	—	—	23	90	139
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	—	—	—	—	—	—	—	—
Montants à payer au titre des investissements acquis (Note 2)	—	5	—	—	—	51	—	214
Distributions aux Détenteurs d'actions de participation rachetables	—	—	—	—	—	—	—	—
Commissions de gestion à payer (Note 4)	1	—	—	—	—	29	25	30
Commissions de performance à payer (Note 4)	—	—	—	—	—	—	—	—
Commissions de l'Agent administratif et du Dépositaire à payer (Note 4)	7	4	—	—	3	5	11	8
Commissions d'agent de services aux actionnaires à payer (Note 4)	—	—	—	—	—	3	2	5
Montants à payer pour les actions de participation rachetables rachetées	—	—	—	—	1 185	49	—	20
Charges à payer et autres passifs	19	21	23	23	71	79	133	184
Passifs (excluant l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables)	27	30	23	23	1 259	239	261	782
Total de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables	\$ 4 254	\$ 4 534	\$ —	\$ —	€ —	€ 28 337	\$ 21 090	\$ 25 883

	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund^		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund^		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^	
	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022
(en milliers)								
ACTIFS COURANTS :								
Trésorerie et équivalents de trésorerie (Note 8)	\$	28	\$	28	€	65	€	76
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions (Note 8)	—	—	—	—	\$	51	\$	51
Actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (Note 2) :								
Investissements	—	—	—	—	—	—	—	—
Investissements nantis	—	—	—	—	—	—	—	—
Options	—	—	—	—	—	—	—	—
Contrats de swap	—	—	—	—	—	—	—	—
Options sur swaps	—	—	—	—	—	—	—	—
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	—	—	—	—	—	—	—	—
Plus-value latente sur les contrats à terme standardisés	—	—	—	—	—	—	—	—
Montants à recevoir pour les investissements vendus (Note 2)	—	—	—	—	—	—	—	—
Montants à recevoir pour les actions participatives rachetables vendues	—	—	—	—	—	—	—	—
Intérêts et autres revenus à recevoir	—							

210

Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund [^]		Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^]		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^] _α		Legg Mason Japan Equity Fund [^]		FTGF Martin Currie Asia Long- Term Unconstrained Fund [^]	
Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022
\$ 60	\$ 60	\$ 41	\$ 56	\$ 2 569	\$ 132	¥ 114 974	¥ 97 595	\$ 12	\$ 702
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	12 372	-	-	3 598	15 463
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	7	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	1 100	-	-	-	-
-	-	-	-	-	34	-	-	14	52
-	-	-	-	-	-	-	-	4	-
60	60	41	56	2 569	13 645	114 974	97 595	3 628	16 217
-	-	-	-	-	5	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	1	-	-	-	-
-	-	-	-	-	1 033	-	-	-	-
-	-	-	-	-	12	-	-	2	12
-	-	-	-	4	6	-	-	14	11
59	59	2	1	2 516	-	-	-	-	-
1	1	39	55	49	45	114 974	97 595	74	76
60	60	41	56	2 569	1 102	114 974	97 595	90	99
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 12 543	¥ -	¥ -	\$ 3 538	\$ 16 118
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]		FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund		FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]		FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]		Franklin Responsible Income 2028 Fund [^] _π	
Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022
\$ 87	\$ 1 270	\$ 156	\$ 433	\$ 174	\$ 836	€ 780	€ 1 581	€ 1 848	€ -
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
142 529	170 458	24 963	27 613	34 547	47 639	188 780	302 551	34 759	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
41	197	1	11	-	-	22	281	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
154	19 017	-	141	-	-	4 857	86	-	-
85	2 453	-	-	104	10	1 732	26	689	-
-	-	-	-	-	-	-	-	344	-
61	46	145	197	31	56	57	36	11	-
-	-	-	-	-	-	-	-	9	-
-	-	-	-	-	-	1	-	2	-
142 957	193 441	25 265	28 395	34 856	48 541	196 229	304 561	37 662	-
-	-	-	-	-	-	3	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1 422	2 114	19	10	-	-	20	69	-	-
154	6 577	-	280	-	-	4 372	86	815	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
76	105	18	19	26	36	55	99	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
19	17	9	6	11	9	41	34	2	-
8	12	3	5	1	2	1	2	-	-
184	15 197	-	-	-	443	2 603	662	-	-
45	38	95	141	116	213	37	19	22	-
1 908	24 060	144	461	154	703	7 132	971	839	-
\$ 141 049	\$ 169 381	\$ 25 121	\$ 27 934	\$ 34 702	\$ 47 838	€ 189 097	€ 303 590	€ 36 823	€ -

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État de la situation financière – (suite)

(en milliers)	Franklin Templeton Global Funds Plc	
	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022
ACTIFS COURANTS :		
Trésorerie et équivalents de trésorerie (Note 8)	\$ 331 948	\$ 295 765
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions (Note 8)	312 657	808 667
Actifs financiers à la juste valeur après affectation au compte de résultat (Note 2) :		
Investissements	17 052 700	22 173 582
Investissements nantis	1 742	683
Options	7 318	29 019
Contrats de swap	170 266	276 166
Options sur swaps	–	2 791
Plus-value latente sur les contrats de change à terme	53 350	186 626
Plus-value latente sur les contrats à terme standardisés	32 496	230 923
Montants à recevoir pour les investissements vendus (Note 2)	135 703	269 885
Montants à recevoir pour les actions participatives rachetables vendues	48 971	35 931
Intérêts et autres revenus à recevoir	103 724	124 101
Dividendes à recevoir	10 290	8 925
Commissions de gestion à recevoir	64	34
Autres actifs	59	1 015
Total des actifs courants	18 261 288	24 444 113
PASSIFS COURANTS :		
Découvert de trésorerie (Note 8)	91 015	125 131
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions (Note 8)	84 123	294 640
Passifs financiers à leur juste valeur après affectation au compte de résultat (Note 2) :		
Options	47 119	129 683
Contrats de swap	46 859	248 273
Options sur swaps	–	2 055
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	121 367	191 714
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	59 938	266 598
Montants à payer au titre des investissements acquis (Note 2)	301 633	394 100
Distributions aux Détenteurs d'actions de participation rachetables	2 826	288
Commissions de gestion à payer (Note 4)	9 548	12 569
Commissions de performance à payer (Note 4)	–	3
Commissions de l'Agent administratif et du Dépositaire à payer (Note 4)	1 695	1 654
Commissions d'agent de services aux actionnaires à payer (Note 4)	1 005	1 208
Montants à payer pour les actions de participation rachetables rachetées	54 803	136 182
Charges à payer et autres passifs	11 327	11 337
Passifs (excluant l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables)	833 258	1 815 435
Total de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables	\$ 17 428 030	\$ 22 628 678

Les montants désignés par «–» sont égaux à 0 USD / 0 EUR / 0 GBP / 0 YEN ou inférieurs à 1 000 USD / 1 000 EUR / 1 000 GBP / 1 000 YEN.

Les montants en euro des fonds FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] et Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] ont été convertis en dollars US dans le chiffre total de Legg Mason Global Funds Plc pour l'exercice clos le 28 février 2023 au taux de clôture USD/EUR de 0,9454 (28 février 2022 : 0,8919).

Les montants en yen du fonds Legg Mason Japan Equity Fund[^] ont été convertis en dollars US dans le chiffre total de Franklin Templeton Global Funds Plc pour l'exercice financier clos le 28 février 2023 au taux de clôture USD/JPY de 136,1550 (28 février 2022 : 114,9650).

Les montants en livre sterling du fonds FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] ont été convertis en dollars US dans le chiffre total de Franklin Templeton Global Funds Plc pour l'exercice financier clos le 28 février 2023 au taux de clôture USD/GBP de 0,8314 (28 février 2022 : 0,7454).

Reportez-vous à la Note 14, Événements importants pour plus de détails sur les changements de nom du fonds.

α. À compter du 27 avril 2022, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] a cessé ses activités.

β. À compter du 21 juin 2022, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] et Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] ont cessé leurs activités.

γ. À compter du 11 juillet 2022, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] a cessé ses activités.

δ. À compter du 10 octobre 2022, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^] a cessé ses activités.

ε. À compter du 17 novembre 2022, Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^] a cessé ses activités.

λ. À compter du 1er décembre 2022, FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] a commencé ses activités.

μ. À compter du 5 décembre 2022, Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^] a cessé ses activités.

π. À compter du 23 janvier 2023, Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] a commencé ses activités.

τ. À compter du 16 février 2023, Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^] a cessé ses activités.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Au nom du Conseil d'administration

Fionnuala Doris
Administratrice
30 juin 2023

Joseph Keane
Administratrice

État de la situation financière – (suite)

	28 février 2023			28 février 2022			28 février 2021		
	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 164 832	1 477	111,57	\$ 131 265	1 197	109,62	\$ 153 935	1 404	109,61
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	526 302	526 316	1,00	640 232	640 245	1,00	624 449	624 463	1,00
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	74	1	106,43	73	1	104,91	73	1	104,90
Actions de distribution (D) en USD de catégorie B	218	218	1,00	—	—	—	300	300	1,00
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	153	1	105,01	5 317	51	103,69	5 098	49	103,68
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	134	134	1,00	140	140	1,00	235	235	1,00
Actions de distribution (D) en USD de catégorie X	141 184	141 186	1,00	141 538	141 540	1,00	97 422	97 424	1,00
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)	481	4	111,80	488	4	109,85	491	4	109,84
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A (G)	230	230	1,00	264	264	1,00	285	285	1,00
Actions de distribution (D) en USD de catégorie L (G)	7	7	1,00	7	7	1,00	42	42	1,00
FTGF Western Asset US Core Bond Fund									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 29 314	230	127,44	\$ 35 416	245	144,44	\$ 47 716	316	151,06
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	35 001	391	89,45	80 771	775	104,18	87 128	789	110,48
Actions de distribution (D) en USD de catégorie B	—	—	—	2	—	104,24	2	—	110,58
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	5 503	47	117,55	8 586	64	133,90	14 666	104	140,75
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	2 543	28	89,49	3 580	34	104,21	8 392	76	110,52
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	803	9	86,98	2 222	22	99,25	5 613	54	104,43
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	31 628	272	116,19	58 355	445	131,23	84 508	619	136,50
Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	11 329	129	87,97	14 031	137	102,43	19 500	179	108,64
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	2 156	21	101,70	2 384	21	114,69	4 213	35	119,38
Actions de distribution (D) en USD de catégorie X	266	3	87,02	298	3	101,33	341	3	107,49
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	8 681	85	101,94	19 841	173	114,85	21 197	178	119,17
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	—	—	—	2 570	22	105,86	4 329	32	110,80
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	3 593	42	86,47	3 558	37	97,13	—	—	—
Actions de capitalisation en USD de catégorie GA	1 059	8	125,95	1 232	9	142,64	1 462	10	148,76
Actions de capitalisation en USD de catégorie GE	43	—	116,84	60	—	133,11	63	—	139,67
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 103 760	730	142,14	\$ 122 223	748	163,35	\$ 199 266	1 165	171,09
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	28 475	295	96,61	47 095	412	114,18	55 980	461	121,54
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	4 183	52	80,27	7 597	79	95,64	29 227	282	103,46
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	5 786	111	77,22	6 011	89	93,32	1 749	22	101,27
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	715	8	88,75	1 452	12	104,74	9 308	70	110,74
Actions de distribution (D) en USD de catégorie B	11	—	96,41	86	1	114,12	218	2	121,48
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	16 162	126	128,45	23 167	156	148,35	36 691	235	156,16
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	7 865	81	97,30	10 764	94	114,99	14 460	118	122,39
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	13 647	130	105,09	21 829	180	121,50	40 138	314	128,02
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	524 507	4 647	112,86	675 110	5 237	128,91	448 724	3 348	134,01
Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	8 486	94	90,60	11 889	111	107,08	15 158	133	113,97
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	2 793	27	105,00	8 356	70	119,85	29 448	236	124,81
Actions de distribution (D) en USD de catégorie X	3 236	38	84,24	5 357	54	99,58	4 093	39	106,00
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	285	3	84,29	2 903	26	98,90	17 281	138	103,98
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie X (couvertes)	—	—	—	—	—	—	421	4	97,03
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	374 417	2 760	135,67	491 421	3 179	154,57	658 972	4 111	160,28
Actions de distribution (M) en USD de catégorie Premier	2 837	31	91,71	2 929	27	108,14	1 627	14	115,10
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	31 663	316	94,59	22 936	185	110,65	79 619	570	115,80
Actions de distribution (M) en USD de catégorie LM	16 273	206	78,97	22 527	242	93,11	—	—	—
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	1 375	11	117,39	1 726	12	125,79	2 000	14	120,86
Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM (couvertes)	34	—	131,13	27	—	150,84	73	—	156,34
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)	169	1	144,38	200	1	165,90	209	1	173,50
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A (G)	833	9	97,37	1 106	10	115,07	1 267	10	122,48
Actions de distribution (D) en USD de catégorie B (G)	3	—	97,38	4	—	115,09	4	—	122,50
Actions de capitalisation en USD de catégorie L (G)	202	2	133,36	234	2	154,01	246	2	161,87
Actions de distribution (D) en USD de catégorie L (G)	983	10	97,38	1 141	10	115,09	1 239	10	122,50
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund									
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	€ 35	—	93,08	€ 50	—	117,82	€ 258	2	132,74
Actions de distribution (D) en EUR de catégorie A	862	9	91,32	1 190	11	108,97	1 293	11	114,08
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	54	1	92,57	65	1	117,09	162	1	132,39
Actions de distribution (Q) en EUR de catégorie F	—	—	—	—	—	124,95	1	—	130,68
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	7 303	81	90,38	1 825	17	106,44	1 181	11	110,48
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	123 205	1 314	93,74	145 011	1 317	110,07	106 972	939	113,90
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GA	636	6	112,08	741	6	132,69	907	7	138,44
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie GA	278	3	101,67	391	3	120,65	431	3	126,21
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GE	94	1	103,97	112	1	123,83	118	1	129,98
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ —	—	—	\$ 23 402	144	162,96	\$ 7 428	46	161,04
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	—	—	—	7 876	90	87,34	3 027	34	89,16
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	—	—	—	252	3	92,27	194	2	94,22
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A	—	—	—	207	2	91,74	323	3	95,63
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	—	—	—	30	—	89,13	33	—	93,23
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	—	—	—	1 481	9	142,92	817	5	142,45
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	—	—	—	452	38	92,09	461	38	95,29
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	—	—	—	13	—	156,15	28	—	154,71
Actions de distribution (D) en USD de catégorie B	—	—	—	64	1	87,30	99	1	89,14
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	—	—	—	7 053	47	151,17	3 374	22	150,15
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	—	—	—	4 005	46	87,30	1 842	21	89,13
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	—	—	—	3 094	29	108,26	2 234	21	106,56
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	—	—	—	1	—	98,57	—	—	—
Actions de distribution (M) en USD de catégorie Premier	—	—	—	1	—	97,46	—	—	—
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	—	—	—	—	—	—	268	2	115,77
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie A	—	—	—	757	5	161,24	748	5	159,33
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A (G)	—	—	—	3 274	37	88,89	4 507	50	90,76
Actions de distribution (D) en USD de catégorie B (G)	—	—	—	5	—	88,98	5	—	90,85
Actions de capitalisation en USD de catégorie L (G)	—	—	—	890	6	149,79	884	6	148,76
Actions de distribution (D) en USD de catégorie L (G)	—	—	—	135	2	88,90	161	2	90,76
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 9 390	61	154,26	\$ 12 161	74	165,33	\$ 17 681	103	172,05
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	13 012	132	98,88	15 078	137	109,94	30 274	258	117,46
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	1 619	19	83,98	2 287	25	93,16	2 766	28	99,54
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	683	9	77,14	879	10	86,54	1 188	13	94,09
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	166	3	74,10	47	1	84,12	60	1	91,77
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	3 009	22	129,52	4 100	26	142,38	7 761	43	149,53
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie A (couvertes)	2 671	36	69,49	3 395	38	79,05	4 956	48	85,25
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A (couvertes)	201	3	58,69	252	3	67,69	337	4	73,99
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie A (couvertes)	498	5	81,90	581	5	91,73	655	5	98,21
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	49	5	75,26	110	10	84,03	119	10	90,69
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	960	1 626	0,80	1 033	1 563	0,90	989	1 353	0,97
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	—	—	—	—	—	—	34	—	161,33
Actions de distribution (D) en USD de catégorie B	262	3	98,86	531	5	109,92	506	4	117,46
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	6 279	45	138,84	6 780	45	149,55	8 648	55	156,41
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	8 448	85	98,85	10 758	98	109,90	12 439	106	117,45
Actions de distribution (M) Plus en ZAR de catégorie A (couvertes)	349	9	681,64	451	9	788,67	1 219	21	882,77
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	1 240	10	121,87	1 505	11	131,41	1 995	14	137,57
Actions de distribution (D) en USD de catégorie E	583	7	82,33	661	7	91,53	784	8	97,82
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)	92	1	96,02	125	1	106,18	268	2	112,17
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie E (couvertes)	30	—	70,87	36	—	80,64	42	—	86,96

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État de la situation financière – (suite)

	28 février 2023			28 février 2022			28 février 2021		
	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund (suite)									
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	\$ 17 061	119	143,75	\$ 20 347	133	153,16	\$ 20 252	128	158,42
Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	4 951	60	82,33	5 501	60	91,53	7 007	72	97,83
Actions de distribution (D) en USD de catégorie X	697	8	82,45	1 399	15	91,68	2 769	28	97,99
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	8	1	100,36	–	–	–	–	–	–
Actions de distribution (D) en GBP de catégorie X (couvertes)	60	1	78,21	76	1	87,81	85	1	94,05
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	34 965	201	174,28	44 980	243	185,22	53 511	280	191,11
Actions de distribution (M) en USD de catégorie Premier	368	4	102,68	12 098	106	113,85	8 814	72	121,64
Actions de capitalisation en CHF de catégorie Premier (couvertes)	54 671	522	98,72	3 442	28	111,13	1 972	15	115,93
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	1 365	10	129,55	4 740	30	141,32	5 709	32	147,15
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie Premier (couvertes)	39	1	67,15	69	1	76,38	80	1	82,36
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier (couvertes)	–	–	–	49 523	266	138,99	67 295	336	143,71
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	827	9	79,03	2 899	24	88,49	25 240	191	94,73
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	203	2	69,00	205	2	77,65	185	2	83,56
Actions de capitalisation en PLN de catégorie Premier (couvertes)	2 666	95	124,47	3 664	121	127,30	7 095	203	131,13
Actions de distribution (M) en AUD de catégorie LM (couvertes)	59 726	973	91,26	93 108	1 251	102,46	80 077	947	109,85
Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM (couvertes)	207	1	135,69	148	1	145,04	283 119	1 361	149,34
FTGF Western Asset US High Yield Fund									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 18 805	105	179,29	\$ 25 055	129	194,84	\$ 22 041	113	194,57
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	27 885	411	67,77	34 889	446	78,15	34 730	428	81,22
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	1 375	17	82,01	2 271	24	94,27	1 568	16	97,97
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	1 290	18	69,82	2 424	30	81,29	7 832	91	85,88
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie A (couvertes)	1 403	20	67,53	1 414	16	79,66	1 543	15	83,50
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	5	–	94,71	–	–	93,84	–	–	–
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	383	776	0,66	520	907	0,78	548	891	0,82
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	–	–	–	358	2	192,79	14	–	193,00
Actions de distribution (D) en USD de catégorie B	46	1	67,77	106	1	78,17	904	11	81,26
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	4 132	24	170,27	3 170	17	185,96	3 766	20	186,64
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	2 074	31	67,78	2 748	35	78,16	2 914	36	81,24
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	3 404	21	160,70	3 837	22	175,71	3 706	21	176,53
Actions de distribution (D) en USD de catégorie E	581	7	84,66	1 106	11	97,67	1 123	11	101,51
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)	347	3	94,00	413	3	105,40	319	2	106,80
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	4 327	26	164,83	7 467	42	178,39	6 330	36	177,08
Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	257	3	80,65	226	2	93,01	42	–	96,61
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)	–	–	–	–	–	–	2	–	109,71
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	35 228	205	171,58	101 736	549	185,21	67 635	369	183,40
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier (couvertes)	1	–	102,60	1	–	111,69	972	6	110,82
Actions de distribution (M) en USD de catégorie S	1	–	88,37	–	–	–	–	–	–
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie S (couvertes)	28	–	86,14	–	–	–	–	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	–	–	–	45 730	232	197,50	45 078	232	194,69
Actions de distribution (M) en USD de catégorie LM	21 415	285	75,02	23 015	267	86,21	15 196	170	89,59
Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM (couvertes)	40	–	104,43	51	–	113,46	130	1	112,05
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)	189	1	183,52	211	1	199,51	238	1	198,94
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A (G)	1 072	16	67,23	1 243	16	77,53	1 335	17	80,58
Actions de capitalisation en USD de catégorie L (G)	170	1	169,50	185	1	185,19	186	1	185,59
Actions de distribution (D) en USD de catégorie L (G)	645	10	67,22	795	10	77,52	827	10	80,57
Actions de capitalisation en USD de catégorie GF	137	1	163,56	149	1	177,45	148	1	176,59
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund^a									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ –	–	–	\$ 5 371	32	170,12	\$ 8 296	44	186,70
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	–	–	–	1 415	14	99,47	2 117	19	111,90
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	–	–	–	908	10	89,94	1 147	11	101,20
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	–	–	–	10	–	67,72	65	1	77,88
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	–	–	–	219	2	127,14	295	2	140,72
Actions de distribution (D) en EUR de catégorie A (couvertes)	–	–	–	293	4	67,99	397	4	77,14
Actions de distribution (D) en GBP de catégorie A (couvertes)	–	–	–	44	–	84,50	52	–	95,23
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	–	–	–	9	17	0,70	5	8	0,80
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	–	–	–	243	2	154,50	410	2	170,41
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	–	–	–	1 023	10	99,42	1 548	14	111,85
Actions de distribution (D) en USD de catégorie E	–	–	–	413	5	84,99	732	8	95,61
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)	–	–	–	10	–	88,88	12	–	99,00
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie E (couvertes)	–	–	–	15	–	75,92	69	1	86,16
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	–	–	–	67	–	151,93	98	1	165,41
Actions de distribution (D) en GBP de catégorie X (couvertes)	–	–	–	15	–	82,01	17	–	92,43
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	–	–	–	93	1	93,44	101	1	101,47
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	–	–	–	2 097	15	123,82	3 388	21	135,63
Actions de distribution (D) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	–	–	–	79	1	73,50	46	–	82,85
Actions de distribution (M) en USD de catégorie LM (couvertes)	–	–	–	25 470	288	88,50	–	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)	–	–	–	494	3	178,03	750	4	194,69
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A (G)	–	–	–	814	9	89,17	995	10	100,32
Actions de capitalisation en USD de catégorie L (G)	–	–	–	1 125	7	165,24	1 236	7	181,62
Actions de distribution (D) en USD de catégorie L (G)	–	–	–	891	10	89,14	993	10	100,29
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund^a									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ –	–	–	\$ 24	–	106,83	\$ 1	–	119,07
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	–	–	–	1	–	90,49	1	–	103,39
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	–	–	–	5	–	89,98	–	–	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	–	–	–	1 928	18	94,23	559	4	104,70
Actions de distribution (M) en USD de catégorie LM	–	–	–	25 890	286	90,51	39 672	384	103,43
FTGF Western Asset Global High Yield Fund									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 5 649	34	164,18	\$ 8 812	49	178,94	\$ 10 843	58	186,88
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	6 082	96	63,39	7 374	101	72,88	9 793	124	78,92
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	8 467	120	70,35	11 065	137	80,65	13 355	153	87,32
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	5 245	83	63,52	10 681	145	73,86	7 846	97	81,26
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	5 294	107	73,48	7 679	122	86,67	9 349	127	95,70
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	2 233	19	110,61	2 029	16	113,76	2 039	15	110,41
Actions de distribution (D) en EUR de catégorie A (couvertes)	120	2	63,37	65	1	74,80	637	6	81,71
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	1 724	3 810	0,61	2 177	4 140	0,71	10 208	17 351	0,78
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	–	–	–	72	–	175,72	75	–	183,97
Actions de distribution (D) en USD de catégorie B	30	–	63,26	201	3	72,72	341	4	78,75
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	920	6	155,61	1 483	9	170,46	1 663	9	178,91
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	2 429	38	63,11	2 962	41	72,56	4 827	61	78,57
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	1 123	8	142,35	1 249	8	156,17	1 086	7	164,08
Actions de distribution (D) en USD de catégorie E	165	2	77,70	207	2	89,34	224	2	96,74
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie E (couvertes)	14	–	63,06	18	–	74,28	20	–	81,17
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	2 845	19	148,37	2 036	13	161,10	396	2	167,08
Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	543	7	73,75	965	11	84,81	912	10	91,86
Actions de distribution (D) en USD de catégorie X	4 458	54	82,67	5 807	61	95,06	3 840	37	102,93
Actions de distribution (D) en GBP de catégorie X (couvertes)	3 701	46	66,23	4 406	43	77,04	3 119	27	83,60
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	–	–	–	6 086	29	212,96	14 056	64	220,31
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	2 244	19	113,78	1 770	12	126,57	1 829	11	132,11
Actions de distribution (D) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	27	–	72,01	35	–	83,77	39	–	90,91
Actions de distribution (M) en USD de catégorie S	1	–	90,17	–	–	–	–	–	–
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie S (couvertes)	29	–	87,81	–	–	–	–	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)	2 047	12	167,12	2 374	13	182,46	2 521	13	190,27
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A (G)	1 003	16	63,38	1 240	17	72,88	2 197	28	78,93
Actions de capitalisation en USD de catégorie L (G)	431	3	154,37	507	3	169,39	605	3	177,52
Actions de distribution (D) en USD de catégorie L (G)	607	10	63,40	678	9	72,89	742	9	78,93

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État de la situation financière – (suite)

	28 février 2023			28 février 2022			28 février 2021		
	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^{αμ}									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ –	–	–	\$ 3 549	23	155,66	\$ 1 881	13	149,48
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	–	–	–	4 844	36	133,96	5 428	42	128,65
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	–	–	–	28	–	108,80	59	–	104,74
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	–	–	–	93	–	99,75	–	–	–
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	–	–	–	843	6	130,28	511	4	125,73
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	–	–	–	29	–	100,15	–	–	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	–	–	–	7 094	63	100,66	–	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	–	–	–	42 980	369	116,57	40 849	369	110,79
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)	–	–	–	5	–	163,47	5	–	156,66
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A (G)	–	–	–	45	–	130,79	51	–	125,55
Actions de distribution (A) en USD de catégorie L (G)	–	–	–	15	–	120,50	14	–	116,06
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 29 246	196	149,02	\$ 39 106	241	162,46	\$ 44 824	269	166,82
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	5 574	58	96,54	6 592	61	108,04	7 638	67	113,74
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	9 535	107	89,01	12 847	129	99,50	20 694	198	104,75
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	29 850	452	66,00	45 247	604	74,94	81 474	1 015	80,31
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	13 954	283	73,37	21 798	356	84,24	33 416	480	90,52
Actions de capitalisation en CHF de catégorie A (couvertes)	286	3	87,16	330	3	98,04	840	8	101,76
Actions de distribution (M) Plus en CNH de catégorie A (couvertes)	3 528	341	71,91	5 325	405	83,16	8 143	592	89,20
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	1 927	8	221,94	2 698	11	228,02	4 757	18	217,73
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	935	9	95,84	1 734	14	107,09	2 884	22	110,91
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A	447	4	109,59	541	4	115,43	665	5	113,12
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	6 684	657	79,85	10 989	951	90,29	23 309	1 882	96,06
Actions de capitalisation en SGD de catégorie A (couvertes)	672	656	1,38	1 296	1 162	1,51	1 649	1 416	1,55
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	1 394	2 739	0,69	2 389	4 143	0,78	3 984	6 341	0,84
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A	605	1 131	0,72	940	1 545	0,82	987	1 514	0,87
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	54	–	143,57	62	–	156,90	64	–	161,52
Actions de distribution (D) en USD de catégorie B	–	–	–	19	–	107,96	112	–	113,66
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	1 433	10	138,07	1 697	11	151,27	2 210	14	156,11
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	1 111	12	96,56	1 306	12	108,06	2 241	20	113,77
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	590	5	119,08	704	5	130,59	906	7	134,91
Actions de distribution (D) en USD de catégorie E	181	2	88,75	199	2	99,32	237	2	104,56
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	2 326	17	136,58	2 699	18	148,29	11 537	76	151,67
Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	585	7	88,80	654	7	99,38	689	7	104,62
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	–	–	–	221	2	110,48	7 895	70	112,93
Actions de distribution (M) en USD de catégorie X	1 204	14	85,58	3 705	39	95,65	3 672	36	100,69
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	–	–	–	–	–	–	570	5	98,39
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	228	2	89,39	268	2	99,36	297	2	102,39
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	83 254	509	163,56	72 450	409	177,15	80 687	446	180,73
Actions de distribution (M) en USD de catégorie Premier	1 371	13	102,87	–	–	–	170	2	100,83
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	120 289	732	155,45	130 405	732	158,82	130 921	721	150,58
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	8 187	72	107,84	8 686	65	119,68	6 424	43	123,15
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie Premier	69 572	678	96,97	77 670	678	102,12	83 139	688	100,09
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie Premier	10 936	102	101,76	12 221	102	107,28	12 865	102	104,95
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie Premier	84	1	111,31	92	1	111,51	225	1	112,95
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	25 877	146	176,99	43 801	230	190,55	46 784	242	193,24
Actions de distribution (M) en USD de catégorie LM	4 430	49	89,52	–	–	–	–	–	–
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie LM (couvertes)	1 358	15	84,23	1 103	10	96,42	–	–	–
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 30 772	254	121,01	\$ 22 239	176	126,60	\$ 32 132	247	130,34
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	7 663	75	101,67	6 851	64	106,79	10 545	96	109,95
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	21 104	222	90,07	9 882	91	96,55	12 195	101	100,26
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie A (couvertes)	313	3	98,80	–	–	–	–	–	–
Actions de capitalisation en SEK de catégorie A (couvertes)	12 582	1 452	90,68	22 680	2 221	96,73	312	26	100,13
Actions de distribution (M) en SEK de catégorie A (couvertes)	–	–	90,27	1	–	96,70	1	–	100,01
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	52	1	99,51	–	–	–	335	3	110,43
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	3 828	34	113,01	8 415	71	118,83	5 301	43	122,95
Actions de distribution (M) en USD de catégorie C	3 761	37	100,53	519	5	105,71	416	4	109,37
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	3 313	31	106,39	3 238	29	111,98	3 972	34	115,98
Actions de distribution (D) en USD de catégorie E	4 856	50	96,49	4 983	49	101,56	5 448	52	105,19
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	3 410	28	121,66	7 631	60	126,78	13 216	102	130,00
Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	1 287	14	92,86	1 596	16	97,66	100	1	100,48
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	8 345	87	90,78	9 247	85	96,86	2 968	25	100,14
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	25 521	192	132,97	27 247	197	138,22	23 015	163	141,38
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	65 972	653	95,51	31 220	274	101,73	37 172	294	104,95
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie Premier (couvertes)	–	–	87,78	189	2	94,28	514	4	97,87
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier (couvertes)	565	4	124,65	–	–	130,72	54	–	133,95
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	13	–	96,15	1 278	9	101,92	2 453	17	105,05
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie S	29 107	302	96,32	10 106	100	101,50	22 076	211	104,79
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	27	–	91,66	55	1	97,58	–	–	–
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie S (couvertes)	6 422	70	86,37	3 050	29	93,27	4 128	35	97,13
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie S (couvertes)	285 334	2 604	91,09	262 829	2 023	96,86	340 795	2 442	100,19
Actions de capitalisation en AUD de catégorie S (couvertes)	9 722	155	93,22	10 991	155	97,63	–	–	–
Actions de distribution (M) Plus (e) en AUD de catégorie S (couvertes)	–	–	–	–	–	–	1 551	20	99,63
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^α									
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	\$ 1	–	91,31	\$ 1	–	102,91	\$ 1	–	107,12
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	1 721	17	103,78	2 746	24	115,64	173	1	119,24
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	25 147	178	141,02	42 779	273	156,86	119 487	741	161,26
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	20 636	201	97,14	39 201	315	110,84	44 983	324	114,96
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier (couvertes)	2	–	85,63	3	–	96,15	–	–	–
Actions de capitalisation en NZD de catégorie Premier (couvertes)	5 009	84	96,21	6 128	84	107,57	10 056	126	110,51
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	1	–	91,67	–	–	–	–	–	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	28	–	89,44	–	–	–	–	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	4 099	41	99,25	4 122	37	109,96	3 845	34	112,59
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM (couvertes)	1 857	21	83,81	2 442	23	95,23	–	–	–
Actions de capitalisation en CAD de catégorie LM (couvertes)	88 202	1 177	102,26	105 526	1 177	113,65	107 747	1 177	116,50
FTGF Western Asset Global Credit Fund^α									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 2 174	17	127,27	\$ 3 171	22	142,04	\$ 1 759	12	149,41
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	321	3	108,91	408	3	124,74	663	4	132,35
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	27	–	82,92	53	1	94,35	–	–	–
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier (couvertes)	18	–	84,38	63	1	94,58	–	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	39 438	259	152,29	69 126	411	168,26	75 669	432	174,98
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM (couvertes)	4 072	47	82,64	4 532	43	93,68	4 634	39	98,28
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^{αβ}									
Actions de distribution (D) en EUR de catégorie A	€ –	–	–	€ 48	–	96,68	€ 50	–	101,58
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)	–	–	–	6	–	97,70	–	–	–
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier (couvertes)	–	–	–	1	–	105,33	1	–	106,20
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	–	–	–	37 393	205	182,42	45 868	248	184,67
Actions de distribution (Q) en EUR de catégorie LM	–	–	–	–	–	–	8 426	82	102,24
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^α									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 388 476	3 241	119,86	\$ 788 243	5 937	132,77	\$ 1 113 975	7 721	144,28
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	124 647	1 627	76,61	200 496	2 254	88,97	306 584	3 054	100,39
Actions de distribution (S) en USD de catégorie A	28 115	311	90,26	41 551	408	101,94	69 201	610	113,39
Actions de capitalisation en AUD de catégorie A (couvertes)	1 089	18	87,62	1 348	19	98,55	3 476	42	107,62

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État de la situation financière – (suite)

	28 février 2023			28 février 2022			28 février 2021		
	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^] (suite)									
Actions de distribution (M) Plus (e) en AUD de catégorie A (couvertes)	\$ 15 473	310	74,06	\$ 25 043	395	87,37	\$ 47 368	621	99,08
Actions de capitalisation en CHF de catégorie A (couvertes)	5 462	53	96,71	17 146	142	110,87	24 026	179	121,93
Actions de capitalisation en CNH de catégorie A (couvertes)	1 006	55	126,70	1 234	55	141,25	2 098	91	149,98
Actions de distribution (M) Plus (e) en CNH de catégorie A (couvertes)	2 787	220	88,22	4 928	302	103,16	5 411	309	113,75
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	157 441	1 479	100,65	364 733	2 837	114,66	527 701	3 474	125,91
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A	5 211	55	90,13	7 824	73	96,24	11 415	95	99,74
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A (couvertes)	5 789	77	71,44	8 555	89	85,34	15 400	131	97,33
Actions de distribution (S) en EUR de catégorie A (couvertes)	6 023	71	80,16	7 304	70	93,13	13 660	108	104,74
Classe de capitalisation en GBP de catégorie A	385	2	143,47	508	3	142,50	679	3	149,10
Actions de capitalisation en GBP de catégorie A (couvertes)	5 757	45	107,22	22 692	141	120,28	80 106	438	131,16
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie A (couvertes)	10 137	120	70,14	14 437	130	82,55	24 353	187	93,46
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	69	7	75,21	80	7	86,91	821	65	98,41
Actions de distribution (M) Plus (e) en HKD de catégorie A	2	–	74,98	4	–	86,74	–	–	–
Actions de capitalisation en SEK de catégorie A (couvertes)	1 390	158	92,28	3 282	297	104,81	65 000	4 774	114,96
Actions de capitalisation en SGD de catégorie A (couvertes)	9 979	11 868	1,13	23 139	24 857	1,26	23 348	22 675	1,37
Actions de distribution (M) Plus (e) en SGD de catégorie A (couvertes)	25 125	45 526	0,74	39 579	61 771	0,87	64 576	87 738	0,98
Actions de distribution (M) Plus (e) en SGD de catégorie A	29	50	0,79	34	50	0,92	–	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	91	1	107,65	126	1	119,54	564	4	130,23
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	34 826	325	107,20	49 624	416	119,34	77 546	595	130,34
Actions de distribution (S) en USD de catégorie C	4 194	47	89,36	5 973	59	100,90	8 547	76	112,24
Actions de distribution (M) Plus (e) en JPY de catégorie A	154	2	9 123,43	179	2	8 945,99	202	2	9 360,01
Actions de capitalisation en NOK de catégorie A (couvertes)	6 043	740	84,75	7 423	687	95,32	3 335	278	103,89
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	15 021	142	105,64	20 437	174	117,72	35 437	275	128,70
Actions de distribution (S) en USD de catégorie E	1 410	16	89,13	2 115	21	100,63	2 926	26	111,93
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)	2 721	29	89,78	4 390	38	102,88	9 964	73	113,66
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	51 472	449	114,61	126 827	1 003	126,44	179 479	1 311	136,86
Actions de distribution (S) en USD de catégorie F	6 629	73	91,43	11 450	111	103,26	11 942	104	114,87
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	87 446	719	121,62	189 669	1 415	134,04	266 393	1 838	144,94
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie X	16 104	198	81,40	37 367	397	94,07	55 862	529	105,61
Actions de distribution (S) en USD de catégorie X	11 462	127	89,96	20 429	201	101,60	26 356	233	113,02
Classe de capitalisation en CHF de catégorie X (couvertes)	9 965	94	100,30	28 117	225	114,39	38 488	280	125,16
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	2 037	13	146,02	5 023	30	151,60	18 964	103	152,32
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	48 362	434	105,36	155 230	1 158	119,51	239 226	1 518	130,58
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie X (couvertes)	9 389	117	75,95	11 901	120	88,55	16 549	137	99,76
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie X (couvertes)	2 413	30	76,88	6 919	68	90,25	8 524	70	101,14
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X	964	5	149,67	1 576	8	147,89	4 753	22	154,01
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)	38 851	286	113,11	78 246	462	126,27	123 193	646	136,98
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie X (couvertes)	1 878	21	75,17	6 852	58	88,04	9 661	70	99,15
Classe de capitalisation en SGD de catégorie X (couvertes)	4 358	4 958	1,19	5 057	5 222	1,31	5 456	5 119	1,42
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	242 867	1 908	127,29	318 448	2 274	140,05	687 346	4 546	151,21
Actions de distribution (S) en USD de catégorie Premier	23 154	258	89,75	55 952	552	101,36	100 741	893	112,76
Actions de capitalisation en AUD de catégorie Premier (couvertes)	850	14	92,81	2 277	30	103,71	4 895	57	112,53
Actions de distribution (S) en AUD de catégorie Premier (couvertes)	2 742	47	87,39	44 269	608	100,20	56 082	650	112,06
Actions de capitalisation en BRL de catégorie Premier (couvertes)	38 397	1 288	156,04	132 555	4 300	158,82	171 166	5 814	165,00
Actions de capitalisation en CHF de catégorie Premier (couvertes)	4 384	43	96,00	17 535	147	109,37	23 377	178	119,50
Actions de distribution (S) en CHF de catégorie Premier (couvertes)	1 151	14	76,70	2 440	25	89,64	2 231	20	101,00
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	22 074	137	151,92	32 676	185	157,68	40 171	210	158,22
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	361 662	3 293	103,82	627 086	4 760	117,49	792 826	5 126	128,18
Actions de distribution (S) en EUR de catégorie Premier (couvertes)	37 969	455	78,94	24 197	235	91,74	116 650	937	103,20
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier (couvertes)	6 545	51	106,58	86 494	543	118,83	276 937	1 544	128,72
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	19 336	218	73,65	145 729	1 261	86,13	366 571	2 716	96,89
Actions de capitalisation en JPY de catégorie Premier (couvertes)	52 479	733	9 751,61	76 911	797	11 091,23	96 121	851	12 036,16
Actions de distribution (S) en JPY de catégorie Premier (couvertes)	–	–	–	7 912	100	9 096,56	9 547	100	10 176,83
Actions de capitalisation en PLN de catégorie Premier (couvertes)	1 116	52	96,27	1 546	63	102,28	4 054	137	110,55
Actions de capitalisation en SEK de catégorie Premier (couvertes)	25	3	96,83	50	4	109,26	211	15	119,05
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	11	–	132,05	12 078	83	144,73	15 089	97	155,64
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	147 182	1 229	113,27	177 135	1 238	127,65	238 793	1 427	138,74
Actions de distribution (S) en AUD de catégorie LM (couvertes)	19 202	342	83,45	70 133	1 008	95,77	99 146	1 203	107,10
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	1 173	8	131,56	1 323	9	135,18	1 561	10	134,29
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 45	–	105,94	\$ 125	1	115,42	\$ 25	–	117,40
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	42	1	78,10	48	1	90,27	–	–	96,28
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	24	–	92,46	28	–	103,30	32	–	106,04
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	1	–	105,15	1	–	114,76	1	–	116,81
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	–	–	–	56	–	119,42	57	–	120,73
Actions de distribution (M) en CHF de catégorie X (couvertes)	40	1	70,41	48	1	82,74	51	1	88,00
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	–	–	–	3 644	31	105,47	6 928	53	107,41
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	193	2	79,35	597	5	91,91	739	5	97,54
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	1 443	16	91,70	1 777	18	98,92	1 837	18	99,62
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	19 433	199	92,33	21 698	190	102,11	22 329	178	103,76
Actions de capitalisation en GBP de catégorie S (couvertes)	31 373	274	95,04	35 151	253	103,53	30 991	213	104,46
Actions de capitalisation en AUD de catégorie LM (couvertes)	–	–	–	101 230	1 230	113,36	93 024	1 060	114,07
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM (couvertes)	30 300	307	93,33	40 071	347	102,86	34 648	276	104,10
Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM (couvertes)	150 891	1 072	117,01	146 379	860	126,95	89 195	5 014	127,59
Actions de capitalisation en CAD de catégorie LM (couvertes)	17 807	262	92,76	–	–	–	–	–	–
Actions de distribution (A) en CHF de catégorie S	19 240	200	90,61	21 046	200	96,50	–	–	–
Actions de distribution (A) en CHF de catégorie S (couvertes)	4 180	40	98,43	–	–	–	–	–	–
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]									
Actions de capitalisation en EUR de catégorie D (couvertes)	\$ 958	10	91,07	\$ 645	6	98,36	\$ 956	8	98,05
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie D (couvertes)	348	5	73,01	423	5	83,76	470	5	86,54
Actions de capitalisation en USD de catégorie D	12 154	119	101,95	14 316	133	107,68	23 854	224	106,44
Actions de distribution (M) en USD de catégorie D	1 461	18	80,39	1 638	18	90,09	24 978	271	92,27
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie D	219	3	74,86	247	3	84,29	9 749	110	88,49
Actions de capitalisation en CHF de catégorie M (couvertes)	299	3	91,94	1 415	13	99,34	1 956	18	98,68
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie M (couvertes)	–	–	–	697	6	86,63	743	6	88,90
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	–	–	–	419	4	110,41	445	4	108,97
Actions de capitalisation en USD de catégorie M	–	–	–	643	7	98,42	1 412	15	96,69
Actions de distribution (M) en USD de catégorie M	747	9	80,06	787	9	89,71	1 669	18	91,89
Actions de capitalisation en EUR de catégorie M (couvertes)	50	1	95,01	1 052	9	102,04	61	1	101,10
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	78 484	606	129,48	263 425	1 941	135,74	279 362	2 098	133,17
Actions de distribution (Q) en USD de catégorie Premier	8 643	105	82,24	10 212	112	91,28	12 555	134	93,74
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	4 182	35	113,55	153 236	1 121	121,86	234 526	1 612	120,58
Actions de distribution (Q) en EUR de catégorie Premier (couvertes)	523	7	74,31	16 884	179	84,35	26 899	255	87,43
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	85	1	74,62	12 070	106	84,77	11 514	94	87,60
Actions de capitalisation en JPY de catégorie Premier (couvertes)	41 500	500	11 303,04	53 024	500	12 194,36	56 345	500	12 014,65
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	409 895	3 023	135,60	526 808	3 728	141,30	417 668	3 031	137,79
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]									
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	\$ 9	–	74,87	\$ 10	–	86,27	\$ 11	–	91,69
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	57 381	585	98,09	–	–	–	1 822	18	103,98
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	–	–	–	717	6	100,06	3 460	28	103,96
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	1 062 117	10 625	99,96	1 146 553	10 359	110,68	818 123	7 199	113,64
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]									
Actions de capitalisation en GBP de catégorie A	£ 1	–	97,14	£ 1	–	111,82	£ 1	–	117,41
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	1	–	–	1	–	–	–	–	–
Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM	–	–	–	73 631	637	115,68	76 684	637	120,47
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie LM	45 910	504	91,11	–	–	–	–	–	–

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État de la situation financière – (suite)

	28 février 2023			28 février 2022			28 février 2021		
	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 102	1	108,03	\$ 644	5	122,84	\$ 9 524	75	127,66
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	16 144	164	98,52	19 025	171	111,27	15 160	132	114,85
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	1	–	–	870	7	111,34	1 377	10	115,94
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	–	–	90,61	–	–	–	–	–	–
Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM (couvertes)	–	–	–	154 630	951	121,21	165 535	951	124,94
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie LM (couvertes)	78 528	704	92,75	–	–	–	–	–	–
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund[^]									
Actions de distribution (Q) en USD de catégorie LM	\$ 18 441	250	73,76	\$ 21 958	244	90,04	\$ 22 193	226	98,11
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 9	–	85,86	\$ 10	–	95,97	\$ –	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	9	–	86,26	10	–	96,01	–	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	2 138	25	86,50	2 401	25	96,05	–	–	–
Actions de capitalisation en BRL de catégorie Premier (couvertes)	2 540	140	94,89	2 664	142	96,96	–	–	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	39	–	84,26	47	–	95,97	–	–	–
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier (couvertes)	38	–	85,61	47	–	96,05	–	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	4 183	48	86,60	4 640	48	96,06	–	–	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	39	–	84,36	47	–	95,98	–	–	–
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 9 739	79	122,52	\$ 12 568	87	144,07	\$ 19 033	122	155,92
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	521	7	75,50	1 099	12	91,71	1 610	16	100,20
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	–	–	–	–	–	–	293	3	99,20
Actions de distribution (S) en USD de catégorie A	17 976	192	93,73	22 007	196	112,29	25 630	209	122,72
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	381	10	56,40	526	10	69,92	766	13	78,08
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	717	10	68,79	1 075	11	83,44	645	6	91,29
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes) (IH)	14 676	107	130,10	25 053	152	146,74	42 849	232	153,27
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A (couvertes)	305	5	58,95	583	7	72,27	874	9	80,04
Actions de distribution (S) en EUR de catégorie A	41	–	78,82	49	–	89,08	55	1	90,48
Actions de distribution (S) en EUR de catégorie A (couvertes) (IH)	5 444	60	86,44	7 052	63	99,31	10 173	80	104,76
Classe de capitalisation en GBP de catégorie A	87	1	91,89	102	1	96,89	110	1	100,97
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie A (couvertes)	204	3	62,54	254	2	77,41	395	3	84,89
Actions de distribution (S) en GBP de catégorie A (couvertes) (IH)	3 053	27	95,78	4 647	32	108,33	6 577	42	113,52
Classe de capitalisation en SGD de catégorie A	60	97	0,84	68	93	0,99	131	165	1,06
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	7	–	111,01	23	–	130,86	51	–	141,97
Actions de distribution (S) en USD de catégorie B	63	1	93,69	107	1	112,23	203	2	122,66
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	285	3	106,92	450	4	126,35	1 083	8	137,44
Actions de distribution (S) en USD de catégorie C	833	9	93,31	1 099	10	111,77	2 046	17	122,16
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	666	8	81,55	6	–	96,47	1 301	12	105,04
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)	–	–	–	–	–	–	22	–	93,60
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes) (IH)	492	5	92,19	737	6	104,63	1 480	11	109,94
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	182	2	87,39	1 023	10	102,33	1 047	9	110,31
Actions de distribution (S) en USD de catégorie F	79	1	69,16	202	2	82,84	159	2	90,55
Actions de distribution (S) en GBP de catégorie R (couvertes) (IH)	24	–	79,11	38	–	89,48	123	1	93,71
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	2 545	29	87,70	3 321	32	102,61	3 376	31	110,50
Actions de distribution (S) en USD de catégorie X	35	1	69,49	234	3	83,25	321	4	91,00
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	97	1	75,27	104	1	90,83	422	4	98,90
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes) (IH)	315	3	88,76	1 203	11	99,63	1 445	12	103,54
Actions de distribution (S) en EUR de catégorie X (couvertes) (IH)	8	–	75,89	528	5	87,56	1 065	10	92,37
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X	17 560	131	111,55	26 213	167	117,12	29 863	176	121,47
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)	5 057	55	76,86	18 737	152	91,79	26 554	192	99,19
Actions de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes) (IH)	162	1	94,07	250	2	104,00	449	3	107,37
Actions de distribution (S) en GBP de catégorie X (couvertes)	6 551	88	62,22	11 372	111	76,08	21 758	187	83,45
Actions de distribution (S) en GBP de catégorie X (couvertes) (IH)	4 031	41	80,78	6 464	53	91,37	15 679	118	95,74
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	21 695	213	102,03	26 070	219	119,20	46 937	366	128,17
Actions de distribution (S) en USD de catégorie Premier	110	2	71,71	922	11	85,89	1 119	12	93,89
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	2 927	21	132,08	4 125	25	145,57	5 368	31	145,47
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	1 864	24	73,25	81	1	88,25	39 291	339	95,96
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes) (IH)	4 278	36	111,56	11 130	79	125,02	37 310	238	129,75
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier (couvertes)	3	–	78,48	4	–	93,51	–	–	–
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	99	1	62,01	270	3	76,76	573	5	84,17
Actions de distribution (S) en GBP de catégorie Premier (couvertes) (IH)	672	6	87,04	1 663	13	98,46	2 457	17	103,16
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	3 149	36	87,64	3 162	31	101,78	4 363	40	108,78
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM (couvertes) (IH)	35 016	322	108,78	20 395	173	118,09	12 901	107	120,78
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 847	7	114,61	\$ 938	8	119,84	\$ 959	8	123,34
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	142	2	91,28	149	2	96,69	224	2	100,65
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	230	2	90,77	386	4	97,53	424	3	101,30
Actions de capitalisation en SEK de catégorie A (couvertes)	–	–	–	–	–	94,46	–	–	96,72
Classe de capitalisation en SGD de catégorie A	1	1	0,97	–	–	–	–	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	69	1	99,28	124	1	104,34	129	1	107,92
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	71	1	98,39	172	2	103,51	179	2	107,17
Actions de distribution (A) en USD de catégorie E	23	–	92,36	24	–	97,84	324	3	101,84
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	519	5	105,96	807	7	110,36	827	7	113,12
Actions de distribution (A) en USD de catégorie F	–	–	–	–	–	–	34	–	99,33
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	168	2	97,77	189	2	101,78	66	1	104,28
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)	2 468	21	98,87	3 499	25	104,13	3 088	21	106,90
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie X (couvertes)	403	4	82,44	154	1	89,35	279	2	93,36
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	226 102	2 052	110,21	85 918	750	114,56	67 943	580	117,19
Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier	160	2	90,05	169	2	95,36	158	2	99,26
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	103 945	947	103,83	77 402	623	110,83	89 753	650	114,42
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie Premier (couvertes)	26 284	337	73,84	29 738	330	80,37	38 828	381	84,42
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	9 234	96	80,03	11 162	96	86,74	12 113	96	90,60
Actions de capitalisation en SEK de catégorie Premier (couvertes)	–	–	–	–	–	–	176	15	98,11
Actions de capitalisation en SGD de catégorie Premier (couvertes)	–	–	–	–	–	–	134 176	151 908	1,18
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	5 111	44	117,09	5 265	44	120,62	10 675	87	122,30
Actions de capitalisation en AUD de catégorie LM (couvertes)	163 494	1 698	143,13	536 622	4 944	149,45	368 319	3 149	152,00
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 260	2	114,70	\$ 207	2	121,94	\$ 21	–	126,05
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	91	1	81,94	103	1	92,91	112	1	101,27
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	1	–	142,10	1	–	150,00	564	4	153,88
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier (couvertes) (IH)	67	–	140,14	102	1	146,92	108	1	148,84
Actions de capitalisation en CAD de catégorie S (couvertes) (IH)	9 975	100	136,39	11 177	100	141,96	11 254	100	143,52
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 3 169	31	102,90	\$ 3 382	28	122,37	\$ 3 277	25	131,11
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	583	7	87,66	702	7	106,98	686	6	116,22
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	1	–	73,48	1	–	90,11	1	–	97,56
Classe de capitalisation en SGD de catégorie A	23	36	0,87	51	67	1,04	155	188	1,10
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	129	1	93,75	1 096	10	112,05	1 354	11	120,64
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	281	3	91,73	347	3	109,74	633	5	118,29
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	2 342	26	90,10	3 090	29	106,72	3 833	34	113,88
Actions de distribution (M) en USD de catégorie F	231	3	75,15	280	3	91,69	1 198	12	99,61
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	261	3	94,17	308	3	111,42	329	3	118,78
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie X (couvertes)	135	2	66,38	382	3	82,76	79	1	90,21
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie X (couvertes) (IH)	970	9	88,36	1 209	9	101,85	824	6	106,09
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	175 727	1 610	109,17	207 613	1 610	128,99	338 663	2 467	137,30

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État de la situation financière – (suite)

	28 février 2023			28 février 2022			28 février 2021		
	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund (suite)									
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier (couvertes) (IH)	\$ -	-	-	\$ -	-	-	\$ 897	7	124,58
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie Premier (couvertes) (IH)	1 835	18	84,39	2 282	17	97,27	3 143	22	101,31
Actions de capitalisation en NZD de catégorie Premier (couvertes) (IH)	5 577	62	145,48	6 513	59	161,81	6 794	57	164,79
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	3 990	35	108,20	5 010	37	119,82	5 719	40	117,77
Actions de capitalisation en NZD de catégorie LM (couvertes) (IH)	9 892	93	171,35	12 130	95	189,36	218 136	1 575	191,70
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 184 162	1 434	128,45	\$ 227 926	1 582	144,04	\$ 81 165	548	148,11
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	1 913	22	86,14	2 423	24	99,14	1 351	13	103,79
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	15 995	192	83,26	28 700	297	96,74	13 849	136	102,16
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	36 853	469	78,56	67 038	726	92,32	1 071	11	99,70
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	103 737	1 260	82,33	163 878	1 695	96,70	63 441	613	103,50
Actions de capitalisation en AUD de catégorie A (couvertes)	2 736	48	84,05	3 500	50	95,72	-	-	-
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	2 007	38	78,18	4 268	63	93,28	-	-	-
Actions de distribution (M) Plus en CNH de catégorie A (couvertes)	871	78	77,28	1 169	80	92,59	-	-	-
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	2	-	99,13	1	-	104,69	1	-	100,09
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	32 034	315	96,30	49 951	401	111,20	19 226	138	115,37
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A (couvertes)	27 469	314	82,68	33 645	306	98,11	22 787	180	105,03
Actions de distribution (M) Plus en EUR de catégorie A (couvertes)	2 230	27	76,87	3 108	30	93,01	-	-	-
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A (couvertes)	33 044	443	70,47	38 905	407	85,23	34 495	311	92,06
Actions de distribution (M) Plus en GBP de catégorie A (couvertes)	2 189	23	78,20	3 289	26	93,28	-	-	-
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie A (couvertes)	6 204	68	75,97	8 329	69	90,60	4 651	34	97,19
Classe de capitalisation en HKD de catégorie A	5 777	53	85,70	766	63	95,68	-	-	-
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	9 913	978	79,53	17 554	1 474	93,06	-	-	-
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	37 208	58 904	0,85	49 398	66 538	1,01	17 338	21 270	1,09
Actions de distribution (M) Plus (e) en SGD de catégorie A (couvertes)	24 225	41 619	0,78	3 914	5 723	0,93	223	299	0,99
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A	5 130	8 666	0,80	8 763	12 594	0,94	149	198	1,01
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	22 302	250	89,35	39 688	394	100,69	2 104	20	104,06
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	9 667	118	81,77	1 454	15	95,00	447	4	100,31
Actions de capitalisation en CZK de catégorie A (couvertes)	28	1	979,39	-	-	-	-	-	-
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	30 426	314	96,75	35 222	323	109,15	14 474	128	112,91
Actions de distribution (D) en USD de catégorie E	611	7	81,55	567	6	94,73	64	1	100,01
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)	4 425	45	93,02	5 373	44	108,08	1 809	13	112,81
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	25 037	275	90,98	40 863	402	101,56	3 755	36	103,97
Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	5 074	56	90,91	6 875	65	105,62	1 807	16	111,52
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	9 584	104	92,12	14 895	145	102,71	313	3	105,03
Actions de distribution (D) en USD de catégorie X	387	4	90,97	147	1	106,01	141	1	111,95
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie X	17 624	204	86,27	25 931	257	100,74	8 793	82	107,23
Classe de capitalisation en CHF de catégorie X (couvertes)	88	1	82,57	1 173	11	95,30	-	-	-
Actions de distribution (A) en CHF de catégorie X (couvertes)	396	5	80,59	3 019	29	95,94	68	1	99,46
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	972	9	99,36	1 281	11	104,50	1 012	8	99,34
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	15 314	173	83,73	36 681	340	96,16	81	1	99,21
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie X (couvertes)	16 053	205	74,16	22 675	227	89,18	22 878	198	95,80
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie X (couvertes)	5 206	54	80,09	9 746	76	94,97	3 347	24	101,32
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	51 346	563	91,22	82 954	817	101,55	2 094	20	103,69
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie Premier	19 197	217	88,30	21 157	205	102,96	3 130	29	109,42
Actions de capitalisation en BRL de catégorie Premier (couvertes)	2 211	121	96,03	2 265	118	98,52	-	-	-
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	91 195	801	107,70	141 515	1 022	123,47	15 687	102	127,20
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie Premier (couvertes)	41 888	526	75,35	42 876	423	90,45	6 553	56	97,01
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	6 824	70	80,81	2 311	18	95,62	373	3	101,87
Actions de capitalisation en SEK de catégorie Premier (couvertes)	2 027	196	107,98	3 339	256	123,61	18 380	1 222	127,05
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	90 056	952	94,56	188 113	1 790	105,08	27 021	252	107,09
Actions de distribution (Q) Plus en USD de catégorie S	22	-	81,54	262	3	94,61	-	-	-
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	49 405	469	99,63	70 922	555	114,04	20 156	142	117,25
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie S (couvertes)	5 144	57	85,09	6 325	55	101,98	6 314	48	109,17
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie S (couvertes)	284	3	83,61	1 909	14	98,90	1 920	13	105,14
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	11 406	115	99,33	-	-	-	-	-	-
Actions de distribution (M) en USD de catégorie LM	6 126	75	82,22	7 573	79	95,27	-	-	-
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie LM (couvertes)	115 356	1 372	79,49	44 361	418	94,65	-	-	-
Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM (couvertes)	25 939	238	90,69	30 076	220	101,96	30 817	213	103,78
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 12 219	109	111,73	\$ 12 217	108	113,34	\$ 14 059	125	112,29
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	-	-	-	-	-	-	3	-	100,53
Actions de distribution (M) en USD de catégorie X	1	-	94,36	1	-	98,28	-	-	-
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	30 650	259	118,21	36 297	305	119,13	24 883	212	117,27
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	3 886	30	130,32	3 871	30	129,83	11 098	88	126,33
Actions de capitalisation en BRL de catégorie S (couvertes)	-	-	-	-	-	-	1 977	103	107,73
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]									
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	\$ 75	1	75,72	\$ 86	1	87,94	\$ 12	-	97,50
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie S (couvertes) (IH)	8 314	100	78,60	10 077	100	89,87	11 762	100	97,48
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 27	-	82,04	\$ 10	-	92,02	\$ 10	-	100,31
Actions de capitalisation en SGD de catégorie A (couvertes)	72	120	0,81	3 880	5 726	0,92	5 272	7 003	1,00
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	-	-	-	-	-	-	10	-	102,35
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie X (couvertes)	4	-	61,32	6	-	73,57	20	-	84,13
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	-	-	-	-	-	-	14 917	145	102,76
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	-	-	-	-	-	-	11	-	96,41
Actions de capitalisation en AUD de catégorie LM (couvertes)	69 307	1 223	84,23	100 335	1 460	94,63	371 056	4 740	101,74
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]λ									
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	\$ 98	1	97,52	\$ -	-	-	\$ -	-	-
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	14 581	148	98,69	-	-	-	-	-	-
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie S (couvertes)	101	1	96,98	-	-	-	-	-	-
Actions de capitalisation en GBP de catégorie S (couvertes)	24	-	97,01	-	-	-	-	-	-
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 650	3	191,94	\$ 141	1	196,64	\$ 21	-	171,02
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	581	3	205,43	589	3	208,48	508	3	179,61
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	3	-	108,28	3	-	98,53	-	-	-
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	1 300	7	180,30	1 444	7	188,84	1 350	7	164,09
FTGF ClearBridge Value Fund									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 123 192	764	161,25	\$ 121 303	732	165,63	\$ 11 396	78	147,02
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	32 769	107	306,36	34 995	111	314,69	25 305	91	279,33
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	10 721	53	192,77	8 899	43	186,70	766	4	154,30
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	2 900	26	105,31	-	-	-	-	-	-
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A (couvertes)	163	1	148,17	82	-	158,13	35	-	142,06
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie A	22	-	239,81	23	-	220,87	20	-	189,53
Classe de capitalisation en SGD de catégorie A	4 485	4 483	1,35	4 372	4 254	1,39	2 399	2 627	1,22
Actions de capitalisation en SGD de catégorie A (couvertes)	1 709	903	2,55	2 375	1 214	2,65	398	225	2,36
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	11 911	73	162,44	9 512	57	167,70	693	5	149,60
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	2 870	10	276,49	2 695	9	285,43	1 548	6	254,63
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	4 195	41	102,58	2 907	27	106,16	-	-	-
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	25 113	78	321,62	24 053	73	328,39	2 411	8	289,75
Actions de distribution (A) en USD de catégorie F	385	2	177,83	2 818	16	181,76	304	2	160,78
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	110	1	104,72	-	-	-	-	-	-
Actions de distribution (A) en USD de catégorie X	1 839	8	222,54	15 344	67	227,42	25 887	129	201,13
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	4 337	32	126,47	5 094	37	121,64	540	4	99,74

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État de la situation financière – (suite)

	28 février 2023			28 février 2022			28 février 2021		
	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :
FTGF ClearBridge Value Fund (suite)									
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	\$ 546 618	1 871	292,19	\$ 506 317	1 704	297,07	\$ 398 734	1 528	261,00
Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier	2 347	12	198,95	482	2	203,29	52	–	179,63
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	87 612	327	253,64	105 810	388	243,25	38 597	161	198,65
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	57 089	544	99,13	31 343	267	104,79	–	–	–
Actions de distribution (A) en USD de catégorie LM	9 339	91	103,12	13 814	132	104,99	–	–	–
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 33 113	119	278,54	\$ 38 354	126	303,63	\$ 31 487	116	271,85
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	9 060	33	278,34	12 540	41	303,41	12 287	45	271,66
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	1 469	4	385,75	862	2	396,80	927	2	330,04
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	20	–	251,30	55	–	275,31	227	1	247,74
Actions de distribution (A) en USD de catégorie B	–	–	–	549	2	281,93	676	3	253,69
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	13 742	55	251,27	16 457	60	275,27	15 828	64	247,70
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	17 444	68	257,27	20 120	71	281,84	19 398	76	253,62
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	18 769	64	291,41	22 561	70	320,04	19 773	68	288,70
Actions de distribution (A) en USD de catégorie E	1 067	4	291,51	1 177	4	320,22	1 062	4	288,87
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	20 872	80	261,94	26 406	93	283,88	24 575	97	252,65
Actions de distribution (A) en USD de catégorie F	4 100	12	347,83	4 282	11	376,97	3 588	11	335,67
Actions de distribution (A) en USD de catégorie X	1 480	7	224,94	1 684	7	243,72	1 913	9	217,01
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	12	–	296,11	286	1	302,61	252	1	250,22
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	7 267	20	361,23	10 891	28	390,01	5 971	17	345,82
Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier	2 119	5	421,23	3 421	8	455,60	3 359	8	405,51
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	20 884	46	428,10	12 422	25	435,74	32 007	74	358,89
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	24 655	124	198,89	25 866	121	213,40	16 734	89	188,04
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	2 115	9	213,81	2 519	10	216,39	2 988	14	177,19
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)	3 734	13	292,72	4 429	14	318,04	4 259	15	283,76
Actions de capitalisation (Q) en USD de catégorie B	4	–	269,86	–	–	294,80	4	–	264,48
Actions de capitalisation en USD de catégorie L (G)	2 579	10	270,45	2 964	10	295,32	3 315	13	264,81
Actions de capitalisation en USD de catégorie GA	4 167	14	293,53	4 570	14	319,45	4 253	15	285,51
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GA	368	1	398,98	401	1	409,60	381	1	340,21
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie GA	453	1	397,87	530	1	408,46	628	2	339,19
Actions de capitalisation en USD de catégorie GE	108	–	268,85	119	–	294,80	107	–	265,46
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GE	9	–	365,13	10	–	377,75	9	–	316,10
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 208 487	571	364,91	\$ 275 982	640	431,31	\$ 270 968	669	404,79
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	30 903	85	365,08	40 436	94	431,51	44 968	111	404,97
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	59 073	101	554,31	91 461	132	618,12	101 712	156	539,07
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	6 519	34	183,21	7 277	29	225,03	10 652	41	213,55
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	66	–	332,11	182	–	394,51	286	1	372,10
Actions de distribution (A) en USD de catégorie B	39	–	337,19	158	–	400,54	153	–	377,79
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	21 984	66	332,22	27 505	70	394,65	29 420	79	372,23
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	9 309	28	337,25	14 390	36	400,61	14 406	38	377,86
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	9 229	47	196,70	13 185	56	234,24	13 376	60	221,49
Actions de distribution (A) en USD de catégorie E	51	–	190,76	195	1	227,17	543	3	214,81
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	129 606	649	199,57	152 031	648	234,47	127 217	582	218,74
Actions de distribution (A) en USD de catégorie F	14 933	75	199,15	25 793	110	233,98	23 530	108	218,27
Actions de capitalisation en USD de catégorie U	197 273	1 306	151,03	283 702	1 606	176,60	279 870	1 707	163,97
Actions de distribution (Q) en USD de catégorie U	–	–	–	–	–	–	1	–	100,36
Actions de capitalisation en EUR de catégorie U	15 490	83	175,64	89 392	411	193,77	78 474	389	167,22
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	36 363	163	223,43	39 088	149	262,44	37 103	152	244,77
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	1 169	7	165,08	1 009	5	182,92	2 519	13	158,78
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	1 803	10	166,19	6 550	29	203,10	22 281	96	191,59
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X	7 294	24	249,48	8 173	23	262,72	11 471	35	235,79
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	191 353	810	236,21	269 653	975	276,47	343 437	1 337	256,95
Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier	6 124	55	111,46	7 854	60	130,46	6 075	50	121,25
Actions de capitalisation en BRL de catégorie Premier (couvertes)	22 607	704	168,22	52 354	1 465	184,08	40 126	1 361	165,25
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	71 935	323	210,40	122 774	471	232,38	151 313	625	200,76
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	21 337	109	185,58	24 290	96	225,88	24 183	94	212,30
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie Premier	3 771	31	113,87	3 905	28	125,70	3 028	23	108,63
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	59 348	195	253,36	87 385	245	265,81	76 820	232	237,99
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	80 119	365	219,73	103 953	407	255,58	73 392	311	236,06
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	514	2	236,23	581	2	259,13	715	3	222,40
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)	7 893	21	382,67	9 838	22	450,72	9 623	23	421,52
Actions de capitalisation en USD de catégorie L (G)	9 700	27	353,51	11 883	28	418,46	11 773	30	393,31
Actions de capitalisation en USD de catégorie GA	1 426	3	452,77	1 696	3	534,19	1 599	3	500,44
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GA	17	–	546,16	20	–	607,83	18	–	529,17
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 59 419	295	201,50	\$ 82 146	347	236,91	\$ 112 488	409	274,96
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	16 442	82	201,63	20 870	88	237,06	26 846	98	275,13
Actions de capitalisation en AUD de catégorie A (couvertes)	4 700	47	148,15	5 832	45	179,96	15 024	92	211,12
Actions de capitalisation en CHF de catégorie A (couvertes)	48	–	101,44	60	–	124,19	72	–	146,13
Actions de capitalisation en CNH de catégorie A (couvertes)	984	51	135,16	1 338	52	161,19	649	23	183,04
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	6 874	21	307,57	9 335	24	341,16	13 920	31	367,91
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	581	4	136,82	671	4	167,18	1 685	7	196,27
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A (couvertes)	11	–	98,97	15	–	120,90	19	–	141,97
Classe de capitalisation en GBP de catégorie A	138	1	158,44	476	2	167,01	876	3	186,61
Classe de capitalisation en HKD de catégorie A	201	13	121,73	276	15	142,49	319	15	164,15
Actions de capitalisation en SEK de catégorie A (couvertes)	18	1	141,68	22	1	173,54	33	1	204,05
Actions de capitalisation en SGD de catégorie A (couvertes)	1 373	1 130	1,64	2 297	1 598	1,95	3 193	1 878	2,27
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	–	–	–	267	1	229,61	834	3	267,82
Actions de distribution (A) en USD de catégorie B	82	–	186,21	558	3	220,02	1 297	5	256,63
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	6 110	31	194,26	9 131	40	229,54	11 861	44	267,74
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	8 523	46	186,21	12 112	55	220,03	16 444	64	256,64
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	5 324	28	192,28	11 574	51	227,78	13 783	52	266,35
Actions de distribution (A) en USD de catégorie E	1 046	5	192,32	1 239	5	227,82	1 448	5	266,39
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E	8	–	77,29	10	–	86,39	–	–	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)	95	1	114,66	157	1	141,17	254	1	167,02
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	8 708	38	226,80	11 191	42	265,05	15 332	50	305,78
Actions de distribution (A) en USD de catégorie F	1 498	7	226,96	2 748	10	265,24	2 523	8	306,00
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	3 219	20	162,82	5 160	27	190,19	8 992	41	219,30
Actions de distribution (A) en USD de catégorie X	544	3	180,97	877	4	211,39	1 284	5	243,75
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X	855	5	176,54	1 090	5	194,53	1 245	5	208,45
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	55	–	114,99	78	–	139,60	202	1	162,89
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X	10 255	39	216,32	18 219	60	226,58	34 880	100	251,61
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	20 680	76	272,04	238 793	754	316,67	362 817	997	363,87
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie Premier	2 505	8	301,00	3 121	8	330,46	4 163	10	352,84
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie Premier	–	–	–	12	–	311,48	14	–	332,81
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	215	1	119,13	303	2	124,41	190	1	137,65
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier (couvertes)	350	2	123,31	672	3	147,39	1 187	5	170,27
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie Premier	42 019	130	269,21	68 221	181	281,04	100 113	231	311,15
Actions de capitalisation en PLN de catégorie Premier (couvertes)	–	–	–	1 142	33	146,83	1 336	30	169,20
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	602	4	158,07	727	4	172,45	932	4	182,94
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)	14 718	69	212,32	18 973	76	248,75	23 544	82	287,69
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie B	6	–	196,19	7	–	231,00	8	–	268,49
Actions de capitalisation en USD de catégorie L (G)	6 310	32	196,13	8 113	35	230,95	10 510	39	268,44
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GA	125	–	324,64	147	–	359,23	173	–	386,56
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie GA	59	–	323,42	70	–	357,88	81	–	385,09
Actions de capitalisation en USD de catégorie GE	59	–	245,41	69	–	290,04	81	–	338,37
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GE	34	–	296,85	40	–	330,96	46	–	358,81

État de la situation financière – (suite)

	28 février 2023			28 février 2022			28 février 2021		
	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 13 397	97	138,55	\$ 13 299	87	152,81	\$ 11 278	85	132,81
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	86	1	107,55	95	1	119,93	82	1	105,63
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	2 262	28	80,14	2 042	22	92,06	2 309	28	83,55
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	113	1	97,14	128	1	110,21	115	1	98,95
Actions de distribution (Q) en USD de catégorie A	1 092	10	106,31	1 216	10	118,47	1 116	11	104,39
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	859	18	1 166	1 166	19	85,71	1 266	21	78,42
Actions de distribution (M) Plus en CNH de catégorie A (couvertes)	60	5	72,55	124	8	93,35	95	7	84,96
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	141	1	129,46	150	1	134,68	125	1	108,79
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	502	5	104,45	1 262	9	119,24	1 150	9	104,85
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A (couvertes)	294	4	76,94	366	4	90,31	358	4	82,05
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	151	15	80,92	790	67	92,60	697	65	83,45
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	599	1 052	0,77	483	735	0,89	156	257	0,81
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	896	7	131,30	972	7	145,53	724	6	127,12
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	106	1	107,11	246	2	119,46	219	2	105,27
Actions de distribution (Q) en USD de catégorie C	73	1	98,62	81	1	109,98	72	1	96,92
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	17 713	134	131,88	20 648	143	144,58	18 703	150	124,91
Actions de capitalisation en EUR de catégorie F	55	–	136,03	61	–	140,68	52	–	112,95
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie F	79	1	111,26	88	1	116,98	78	1	95,69
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie X	–	–	–	–	–	–	34	–	103,38
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie X (couvertes)	50	1	93,55	62	1	109,21	60	1	98,61
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^A									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 47 722	328	145,55	\$ 48 817	304	160,43	\$ 5 832	40	146,35
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	10 477	46	228,19	10 463	42	251,52	1 827	8	229,43
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	4 993	49	96,27	–	–	–	–	–	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	21 414	104	194,79	49 413	198	223,06	11 129	45	205,65
Classe de capitalisation en SEK de catégorie A	56 766	4 360	136,29	66 724	4 656	135,75	65 440	5 012	110,24
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	5 947	40	148,03	6 403	39	162,19	2 693	18	147,06
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	12 869	104	123,82	20 266	149	135,66	8 802	72	123,01
Actions de distribution (A) en USD de catégorie X	857	4	238,35	1 622	6	261,15	745	3	236,80
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	708	6	110,40	927	7	114,04	–	–	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	2 811	13	203,85	1 823	7	231,69	2 081	8	212,45
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X	478 725	1 405	283,28	237 295	635	278,51	28 773	85	243,38
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)	2 318	15	126,11	2 436	13	141,45	4 373	24	128,91
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	94 620	707	133,80	167 377	1 146	146,09	63 369	480	132,00
Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier	33 164	138	240,49	35 826	136	262,86	4 771	20	238,06
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	1	–	101,11	–	–	–	–	–	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	5 531	25	209,43	2 203	8	237,15	63	–	216,57
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	11 173	30	306,82	4 987	12	300,59	686	2	261,26
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	532 065	3 089	172,25	601 256	3 203	187,69	197 075	1 164	169,25
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S	52 170	354	139,45	56 873	354	143,34	25 552	176	120,17
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	1 699	13	123,63	7 774	50	139,69	391	3	127,30
Actions de capitalisation en GBP de catégorie S	145 409	807	149,85	161 607	823	146,43	137 242	774	127,22
Actions de capitalisation en GBP de catégorie S (couvertes)	72 678	458	132,01	78 117	395	147,25	79 258	426	133,44
Actions de distribution (Q) en GBP de catégorie S	10 539	59	147,32	15 238	79	144,37	5 122	29	126,04
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	35 323	304	109,96	21 868	173	112,61	–	–	–
FTGF ClearBridge Global Growth Fund^A									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 686	5	137,15	\$ 754	5	150,84	\$ 768	5	153,62
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	12 493	87	143,70	15 264	98	156,48	10 321	65	157,77
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^A									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	€ 22 713	1 980	12,13	€ 30 452	2 723	12,54	€ 653	71	11,16
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (couvertes)	54 425	3 812	15,10	49 791	3 885	14,37	33 140	3 397	11,77
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A (couvertes)	44 093	4 340	10,75	47 028	4 911	10,74	42 617	5 678	9,06
Actions de distribution (Q) en USD de catégorie A	2 915	226	13,62	3 039	242	14,09	2 622	252	12,54
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	2 473	382	10,18	5 707	853	10,33	1 380	248	8,74
Actions de distribution (M) Plus en CNH de catégorie A (couvertes)	23 313	16 311	10,51	7 660	5 083	10,67	3 391	2 946	9,00
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	145 537	10 186	14,29	73 628	5 290	13,92	63 844	5 563	11,48
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes) (PH)	6 339	554	11,43	5 029	436	11,54	1 500	150	9,98
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A	418	45	9,36	–	–	–	–	–	–
Actions de distribution (M) Plus en EUR de catégorie A	3 899	315	12,36	2 624	210	12,47	2 565	244	10,52
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	4 235	5 789	1,04	4 158	6 018	1,05	1 432	2 599	0,89
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	3 347	304	11,64	3 683	342	12,08	234	26	10,80
Actions de capitalisation en USD de catégorie C (couvertes)	1 366	101	14,27	646	53	13,66	719	77	11,25
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	6 399	499	13,56	8 126	646	14,10	3 205	307	12,61
Actions de capitalisation en USD de catégorie E (couvertes)	2 326	210	11,74	904	90	11,26	–	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	4 659	397	12,43	1 537	135	12,77	1 008	108	11,27
Actions de capitalisation en USD de catégorie F (couvertes)	9 258	646	15,15	1 840	144	14,34	1 447	149	11,68
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	1 495	130	12,17	67	6	12,46	490	54	10,96
Actions de distribution (A) en USD de catégorie X	501	43	12,22	447	40	12,62	350	38	11,10
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	57 566	3 942	14,60	26 937	1 910	14,10	30 951	2 686	11,52
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes) (PH)	10 121	869	11,65	2 536	218	11,65	49	5	9,74
Actions de distribution (Q) en GBP de catégorie X	2 493	176	12,45	1 489	108	11,53	407	36	9,85
Actions de distribution (Q) en GBP de catégorie X (couvertes)	410	34	10,52	810	67	10,15	–	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	74 451	4 958	15,88	11 876	820	16,23	4 064	344	14,25
Actions de capitalisation en BRL de catégorie Premier (couvertes)	2 798	775	20,00	5 511	1 828	17,42	3 264	1 628	13,56
Actions de distribution (Q) Plus (e) en CAD de catégorie Premier (PH) (couvertes)	46 777	5 861	11,52	51 721	6 384	11,51	40 525	6 247	9,96
Actions de distribution (Q) Plus (e) en CAD de catégorie Premier	–	–	–	6 322	811	11,08	10 003	1 547	9,93
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	432 296	18 330	23,58	207 952	9 151	22,73	237 729	12 828	18,53
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes) (PH)	4 026	325	12,40	7 393	596	12,40	7 045	664	10,61
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	405	21	16,65	6 622	363	15,25	7 247	487	12,89
Actions de distribution (A) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes) (PH)	14 897	618	21,18	21 555	844	21,34	66 461	3 156	18,24
Actions de distribution (Q) en GBP de catégorie Premier	76 882	4 746	14,25	74 334	4 710	13,19	31 325	2 408	11,27
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM (couvertes)	–	–	–	–	–	–	5 346	625	10,33
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^A									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ –	–	–	\$ 224	3	87,06	\$ 220	3	85,51
Actions de distribution (Q) en USD de catégorie A	–	–	–	174	2	83,85	171	2	82,87
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	–	–	–	679	7	81,36	719	7	80,01
Actions de distribution (Q) en GBP de catégorie X	–	–	–	730	7	79,04	709	7	75,08
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	–	–	–	858	9	82,16	906	9	80,64
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 27 166	280	96,98	\$ 17 858	169	105,90	\$ –	–	–
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	61 518	674	91,28	28 785	274	104,96	–	–	–
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	61 812	670	92,22	74 314	707	105,12	–	–	–
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	8 133	139	86,78	5 538	75	102,34	–	–	–
Actions de distribution (M) Plus en CNH de catégorie A (couvertes)	1 325	104	88,26	315	19	103,79	–	–	–
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A	67	1	85,09	–	–	–	–	–	–
Actions de distribution (M) Plus en EUR de catégorie A (couvertes)	8 022	89	85,54	3 929	34	101,92	–	–	–
Actions de distribution (M) Plus en GBP de catégorie A (couvertes)	5 016	48	86,10	136	1	101,30	–	–	–
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	1 385	117	92,80	1 827	135	106,10	–	–	–
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	63 459	96 802	0,88	27 834	36 826	1,02	–	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie U	4 556	48	94,25	–	–	–	–	–	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie U	8 777	86	96,85	–	–	–	–	–	–
Actions de distribution (Q) Plus (e) en EUR de catégorie U	67	1	97,29	–	–	–	–	–	–
Actions de capitalisation en GBP de catégorie U	3 127	27	96,41	–	–	–	–	–	–
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie X	17 277	185	93,47	322	3	105,76	–	–	–
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie X (couvertes)	376	4	84,08	–	–	–	–	–	–
Actions de distribution (Q) Plus (e) en EUR de catégorie X (couvertes)	2 323	24	90,22	645	5	105,94	–	–	–

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État de la situation financière – (suite)

	28 février 2023			28 février 2022			28 février 2021		
	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund (suite)									
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie X (couvertes)	\$ 651	6	87,29	\$ 160	1	100,27	\$ –	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	2 352	27	86,03	4 720	46	102,52	–	–	–
Actions de distribution (M) en USD de catégorie Premier	59 725	657	90,93	4 994	48	103,28	–	–	–
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie Premier (couvertes)	32 976	343	90,86	155	1	105,08	–	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	28 020	281	99,82	263	2	107,42	–	–	–
Actions de distribution USD catégorie S (M) Plus	7 918	86	92,31	1 599	15	104,48	–	–	–
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 136 340	481	283,21	\$ 179 306	607	295,45	\$ 195 259	685	284,92
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	30 404	35	860,08	35 534	40	897,28	140 142	162	865,30
Actions de capitalisation en AUD de catégorie A (couvertes)	5 856	41	213,77	7 110	43	230,14	12 929	75	225,06
Actions de capitalisation en CNH de catégorie A (couvertes)	2 411	88	190,89	2 416	76	201,78	4 099	140	190,47
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	32 297	87	350,21	46 391	120	344,60	25 796	69	309,18
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	14 136	64	208,42	14 213	56	225,70	24 268	91	220,36
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A (couvertes)	172	1	158,47	385	2	171,75	49	–	168,13
Actions de capitalisation en GBP de catégorie A (couvertes)	460	2	172,42	1 070	4	184,68	696	3	179,40
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie A	727	2	371,81	778	2	347,78	966	2	323,02
Actions de capitalisation en SEK de catégorie A (couvertes)	80	4	204,46	88	4	222,22	703	27	217,39
Classe de capitalisation en SGD de catégorie A	10 567	5 109	2,79	11 147	5 166	2,93	14 111	6 772	2,78
Actions de capitalisation en SGD de catégorie A (couvertes)	26 220	13 193	2,68	26 201	12 563	2,83	35 065	17 096	2,73
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	119	–	292,49	127	–	306,67	171	1	297,23
Actions de distribution (A) en USD de catégorie B	21	–	782,27	22	–	820,22	8	–	795,02
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	11 432	39	293,00	13 207	43	307,21	5 457	18	297,74
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	5 195	7	777,17	5 656	7	814,85	5 845	7	789,75
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	9 939	38	261,78	11 386	41	275,16	10 042	38	267,35
Actions de distribution (A) en USD de catégorie E	502	2	261,74	528	2	275,11	503	2	267,30
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E	1 582	4	355,11	1 274	3	351,98	484	1	318,29
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)	1 111	6	166,43	1 109	5	181,52	691	3	178,54
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	15 873	52	307,98	26 949	84	319,38	22 736	74	306,15
Actions de distribution (A) en USD de catégorie F	267	1	308,31	244	1	319,72	1 035	3	306,48
Actions de capitalisation en USD de catégorie R	1	–	110,12	–	–	113,60	7	–	108,92
Actions de capitalisation en EUR de catégorie R	302	1	274,66	307	1	268,95	682	2	239,43
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	47 508	174	273,10	33 276	118	282,78	74 290	274	270,67
Actions de distribution (A) en USD de catégorie X	1 177	6	189,35	1 492	8	196,06	1 171	6	187,66
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	5 887	32	176,23	13 906	72	172,19	24 787	134	153,27
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	11 488	59	185,38	22 708	102	199,32	20 713	89	193,11
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X	39 715	90	368,64	42 807	93	342,20	44 009	100	315,55
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie X	3 082	8	337,47	4 309	10	313,21	3 573	9	288,84
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	220 211	611	360,19	257 090	692	371,66	365 342	1 031	354,49
Actions de capitalisation en BRL de catégorie Premier (couvertes)	6 630	203	170,82	17 351	541	165,25	4 889	179	152,66
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	46 669	90	492,39	63 706	119	479,41	17 922	35	425,24
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	5 193	24	200,98	960	4	215,21	28 744	115	207,71
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	44 274	105	350,66	67 856	156	324,40	198 528	478	298,40
Actions de capitalisation en PLN de catégorie Premier (couvertes)	3 681	114	144,10	5 300	152	146,12	3 158	85	139,89
FTGF Royce US Smaller Companies Fund									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 31 063	134	231,96	\$ 35 531	154	231,37	\$ 38 798	166	233,20
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	9 540	24	392,74	11 155	28	391,87	10 678	27	394,99
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	2 035	5	382,78	1 975	5	360,17	2 555	6	337,84
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	98	1	159,80	174	1	165,50	1 279	6	168,85
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A	124	–	271,21	111	–	255,46	130	–	239,35
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie A	54	–	385,69	123	–	345,13	124	–	334,96
Actions de capitalisation en SEK de catégorie A (couvertes)	2	–	161,28	1	–	167,25	10	1	170,83
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	2 964	13	225,03	3 094	14	225,58	3 233	14	228,51
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	2 765	8	355,62	2 999	8	356,61	3 486	10	361,25
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	721	3	241,07	750	3	242,35	779	3	246,11
Actions de distribution (A) en USD de catégorie E	7	–	141,84	8	–	142,67	5	–	144,88
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E	9	–	158,95	8	–	150,73	31	–	142,25
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	11 194	39	287,56	10 813	38	285,20	7 263	25	285,75
Actions de distribution (A) en USD de catégorie F	532	2	307,61	543	2	305,10	298	1	305,68
Actions de capitalisation en USD de catégorie R	109	1	168,67	212	1	167,46	286	2	167,95
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	53	–	208,08	333	2	206,08	300	1	206,22
Actions de distribution (A) en USD de catégorie X	1	–	95,46	–	–	94,37	–	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	600	2	315,65	966	3	311,50	2 212	7	310,55
Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier	12 361	56	219,68	14 320	66	216,79	14 478	67	216,83
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie Premier	1 473	4	292,99	1 769	5	259,24	1 763	5	249,62
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	702	3	225,37	854	4	208,25	1 058	5	191,48
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)	941	4	260,24	1 022	4	258,11	1 031	4	258,61
Actions de capitalisation en USD de catégorie L (G)	750	3	240,27	1 174	5	239,50	1 299	5	241,16
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 8	–	83,66	\$ 9	–	90,44	\$ –	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	9	–	84,44	9	–	90,61	–	–	–
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X	14	–	98,60	–	–	–	–	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	4 223	50	84,81	4 516	50	90,69	–	–	–
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^y									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	€ –	–	–	€ 608	7	100,59	€ 589	7	96,37
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (couvertes)	–	–	–	1 157	9	144,30	1 105	10	127,44
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	–	–	–	762	5	183,06	848	6	178,41
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A (couvertes)	–	–	–	4 140	48	97,65	3 462	46	90,33
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	–	–	–	1 402	23	92,61	1 638	30	85,96
Actions de distribution (M) Plus en CNH de catégorie A (couvertes)	–	–	–	158	11	102,33	41	3	94,91
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	–	–	–	333	2	195,74	300	2	174,14
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A	–	–	–	84	1	166,20	88	1	150,48
Actions de distribution (M) Plus en EUR de catégorie A	–	–	–	430	4	97,95	263	3	96,68
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	–	–	–	224	390	0,87	105	208	0,81
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	–	–	–	14	–	93,06	110	1	89,46
Actions de distribution (A) en USD de catégorie B	–	–	–	56	–	180,51	50	–	175,95
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	–	–	–	144	2	94,91	130	2	91,38
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	–	–	–	1 236	8	180,39	1 172	8	175,82
Actions de capitalisation en USD de catégorie E (couvertes)	–	–	–	123	1	102,25	–	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	–	–	–	290	3	124,53	1 700	17	118,52
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	–	–	–	1	–	104,43	–	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	–	–	–	–	–	–	1 201	15	99,89
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	–	–	–	53	–	144,35	47	–	127,12
Actions de capitalisation en PLN de catégorie Premier (couvertes)	–	–	–	480	18	127,46	192	8	111,34
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	–	–	–	–	–	–	3 967	38	126,84
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	–	–	–	2 034	15	137,11	2 251	19	119,96
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)	–	–	–	958	10	104,34	882	11	99,58
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie B	–	–	–	1	–	96,33	2	–	92,36
Actions de capitalisation en USD de catégorie L (G)	–	–	–	95	1	96,85	128	2	92,95
Actions de capitalisation en USD de catégorie GA	–	–	–	870	5	178,58	836	6	170,54
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GA	–	–	–	12 539	62	201,63	12 130	68	178,93
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie GA	–	–	–	101	1	158,26	92	1	143,16
Actions de capitalisation en USD de catégorie GE	–	–	–	44	–	163,28	39	–	157,10

État de la situation financière – (suite)

	28 février 2023			28 février 2022			28 février 2021		
	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 1 708	12	143,40	\$ 2 058	13	156,45	\$ 2 643	17	151,45
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	2 930	13	229,91	3 344	13	258,01	3 494	14	254,57
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	3 235	38	84,93	3 851	40	97,45	6 019	61	98,58
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	2 539	45	83,03	2 093	30	97,46	3 221	42	99,18
Actions de distribution (M) Plus en CNH de catégorie A (couvertes)	173	16	74,97	223	16	87,97	220	16	89,12
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	134	1	137,11	249	2	141,19	73	—	127,23
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	1 518	139	85,63	2 075	166	97,83	2 429	192	98,24
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A (couvertes)	32	48	0,91	33	42	1,05	78	97	1,07
Actions de distribution (A) en USD de catégorie B	13	—	223,94	43	—	251,36	42	—	248,16
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	100	1	98,15	109	1	107,62	100	1	104,71
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	1 236	6	222,72	1 632	7	250,00	1 711	7	246,82
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	14	—	133,58	16	—	147,17	78	1	143,65
Actions de distribution (A) en USD de catégorie E	10	—	94,16	11	—	105,87	11	—	104,55
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	298	2	128,31	29	—	139,46	28	—	134,31
Actions de capitalisation en PLN de catégorie Premier (couvertes)	35	1	138,86	2 281	66	145,76	3 041	82	139,65
Actions de capitalisation en USD de catégorie GA	6 520	45	143,98	7 183	46	157,32	7 174	47	152,29
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GA	124	1	173,18	135	1	178,49	149	1	160,59
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie GA	2	—	143,83	2	—	152,37	23	—	139,53
Actions de capitalisation en USD de catégorie GE	469	4	131,10	516	4	144,31	503	4	140,75
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GE	—	—	—	—	—	—	—	—	151,55
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund[^]									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ —	—	—	\$ —	—	—	\$ 141	2	81,33
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	—	—	—	—	—	—	69	1	84,68
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	—	—	—	—	—	—	1	—	119,52
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie A	—	—	—	—	—	—	40	—	105,28
Actions de distribution (A) en USD de catégorie B	—	—	—	—	—	—	9	—	82,73
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	—	—	—	—	—	—	9	—	84,77
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	—	—	—	—	—	—	91	1	82,69
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	—	—	—	—	—	—	32	—	95,64
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	—	—	—	—	—	—	14 347	90	132,45
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^{^u}									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ —	—	—	\$ 2 462	12	198,91	\$ 2 204	12	178,06
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	—	—	—	352	3	104,25	738	8	98,07
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	—	—	—	457	6	98,09	693	10	92,91
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	—	—	—	173	13	104,77	1 174	93	97,94
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	—	—	—	53	68	1,06	33	44	0,99
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	—	—	—	1	—	104,34	—	—	—
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	—	—	—	2 811	25	110,91	1 872	19	98,27
Actions de capitalisation en USD de catégorie GA	—	—	—	3 958	20	202,76	3 683	20	181,40
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GA	—	—	—	1 589	5	259,07	1 656	6	215,40
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie GA	—	—	—	342	1	220,29	321	1	186,39
Actions de capitalisation en USD de catégorie GE	—	—	—	49	—	187,12	44	—	168,67
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GE	—	—	—	296	1	238,91	267	1	200,13
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^]									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 88	1	115,41	\$ 22	—	133,46	\$ 2	—	159,99
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie M	1 692	85	16,64	2 262	98	17,20	2 890	105	19,71
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1	—	120,20	1	—	138,19	1	—	164,53
Actions de distribution (A) en USD de catégorie M	320	26	12,52	367	25	14,43	57 186	3 332	17,16
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie M	62	4	15,35	72	4	16,69	286	13	18,44
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	1 362	15	89,46	13 357	131	102,18	19 627	162	121,06
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	13	—	102,96	37	—	105,44	88	1	120,25
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^]									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (PF)	€ —	—	—	€ —	—	—	€ 1	—	97,46
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (PF) (couvertes)	—	—	—	—	—	—	1	—	100,77
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A (PF) (couvertes)	—	—	—	—	—	—	6 106	538	13,70
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (PF)	—	—	—	—	—	—	2 601	28	91,77
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A (PF)	—	—	—	—	—	—	2 836	238	11,92
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie A (PF) (couvertes)	—	—	—	—	—	—	4	—	12,54
Actions de capitalisation en USD de catégorie F (PF)	—	—	—	—	—	—	1	—	99,51
Actions de capitalisation en USD de catégorie F (PF) (couvertes)	—	—	—	—	—	—	1	—	102,68
Actions de distribution (A) en USD de catégorie M (PF) (couvertes)	—	—	—	—	—	—	2 236	195	13,84
Actions de capitalisation en EUR de catégorie M (PF)	—	—	—	—	—	—	3 504	37	93,51
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie M (PF)	—	—	—	—	—	—	7 263	582	12,47
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie M (PF) (couvertes)	—	—	—	—	—	—	1 284	85	13,06
Actions de distribution (A) en NOK de catégorie M (PF) (couvertes)	—	—	—	—	—	—	21	2	94,45
Actions de distribution (A) en SEK de catégorie M (PF) (couvertes)	—	—	—	—	—	—	928	102	92,98
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier (PF) (couvertes)	—	—	—	—	—	—	11 374	135	101,29
Actions de capitalisation en BRL de catégorie Premier (PF) (couvertes)	—	—	—	—	—	—	2 182	152	97,18
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 4 707	29	163,21	\$ 6 471	34	190,12	\$ 1 557	8	202,89
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	6 205	34	170,77	3 973	19	187,53	2 320	10	186,03
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	13 539	165	77,46	22 933	217	94,30	—	—	—
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	181	3	69,49	212	3	81,36	—	—	—
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	2 560	24	107,70	4 240	34	126,41	1 896	14	135,92
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	215	3	70,28	249	3	81,38	—	—	—
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	91	1	79,83	105	1	92,29	—	—	—
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	1 92	1	179,33	104	—	195,54	81	—	192,44
Actions de capitalisation en GBP de catégorie X	1 283	6	187,66	1 631	6	194,52	1 685	6	198,38
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)	2 167	12	152,41	1 876	8	181,95	851	3	193,82
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	14 049	80	175,37	37 745	187	202,05	14 752	69	213,26
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier (couvertes)	433	3	106,02	568	3	126,13	749	4	133,90
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	5 827	63	92,64	7 523	71	106,36	33 171	296	111,88
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	73 491	869	79,99	58 847	547	95,95	—	—	—
Actions de capitalisation en GBP de catégorie S	16 109	67	198,75	22 904	83	204,70	47 287	164	207,39
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund									
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	\$ 5 748	66	87,21	\$ 6 166	63	98,23	\$ 5 757	60	96,60
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A	454	7	97,11	487	7	101,33	455	6	93,44
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A	457	5	91,10	490	5	96,80	458	4	88,46
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A	45	70	0,86	54	75	0,98	67	95	0,94
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie D (couvertes)	375	6	96,94	684	8	111,38	379	5	109,14
Actions de distribution (M) Plus en CNH de catégorie D (couvertes)	1	—	98,76	1	—	113,18	1	—	110,34
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie D	1	—	102,55	1	—	114,51	1	—	110,55
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie D (couvertes)	307	414	1,00	1 016	1 221	1,13	1 015	1 230	1,10
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie D	1 014	10	101,21	856	8	113,52	505	5	110,45
Actions de capitalisation en USD de catégorie D	5 511	48	115,20	5 888	48	123,07	5 734	50	114,42
Classe de capitalisation en AUD de catégorie X	312	4	128,43	350	4	126,73	233	3	111,09
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	5 801	46	126,36	6 077	45	134,52	5 601	45	124,63
Actions de capitalisation en GBP de catégorie S	487	3	146,47	515	3	138,89	474	3	123,09
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie S	487	4	106,24	4	—	105,80	474	3	98,77
Actions de capitalisation en AUD de catégorie LM	4 121	47	130,72	4 834	52	127,51	5 422	64	110,28
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	\$ 4 789	54	88,85	\$ 7 343	68	108,56	\$ 4 928	37	133,66
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	352	4	98,83	402	3	121,66	477	3	150,92
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	14 837	132	112,56	11 843	87	136,70	2 510	15	167,30

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État de la situation financière – (suite)

	28 février 2023			28 février 2022			28 février 2021		
	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :	Total VL (en milliers)	Nbre d'Actions (en milliers)	VL/Action :
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^] (suite)									
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	\$ 2	–	96,38	\$ 656	6	116,89	\$ 801	6	142,84
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	3 812	39	98,17	6 709	57	118,63	7 740	54	144,46
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	347	3	119,33	2 252	16	143,91	3 225	18	174,89
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S	10 563	94	105,77	18 633	138	120,24	22 120	135	135,80
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]									
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (couvertes)	€ 26	–	80,63	€ 39	1	86,53	€ –	–	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	1 770	13	136,40	7 094	47	151,56	869	6	148,44
Actions de capitalisation en USD de catégorie E (couvertes)	26	–	79,81	38	1	86,29	–	–	–
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	528	4	140,86	1 877	12	155,36	661	4	151,02
Actions de capitalisation en BRL de catégorie Premier (couvertes)	1 342	76	97,67	3 184	191	96,48	–	–	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	850	6	143,00	26 577	169	157,16	17 885	117	152,24
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	1	–	108,31	–	–	–	87 876	1 077	98,43
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S	76 234	609	125,11	145 601	1 063	136,96	4 080	31	132,14
Actions de capitalisation en GBP de catégorie S	108 320	1 267	75,17	119 180	1 273	78,23	–	–	–
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]π									
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	€ 98	1	98,13	€ –	–	–	€ –	–	–
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A	5 022	51	98,18	–	–	–	–	–	–
Actions de distribution (A) Plus en EUR de catégorie A	98	1	98,13	–	–	–	–	–	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie D	98	1	98,08	–	–	–	–	–	–
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie D	98	1	98,08	–	–	–	–	–	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie K	98	1	98,11	–	–	–	–	–	–
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie K	98	1	98,11	–	–	–	–	–	–
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	9 474	97	98,17	–	–	–	–	–	–
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie X	21 739	221	98,22	–	–	–	–	–	–

Les montants désignés par «–» sont égaux à 0 USD / 0 EUR / 0 GBP / 0 YEN ou inférieurs à 1 000 USD / 1 000 EUR / 1 000 GBP / 1 000 YEN.

La Valeur liquidative par action représente celle des Actions de participation rachetables libellées dans la devise respective de chaque classe d'actions concernée.

Reportez-vous à la Note 14, Événements importants pour plus de détails sur les changements de nom du fonds.

À compter du 27 avril 2022, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] a cessé ses activités.

α. À compter du 21 juin 2022, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] et Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] ont cessé leurs activités.

γ. À compter du 11 juillet 2022, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] a cessé ses activités.

δ. À compter du 10 octobre 2022, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund a cessé ses activités.

ε. À compter du 17 novembre 2022, Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^] a cessé ses activités.

λ. À compter du 1er décembre 2022, FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] a commencé ses activités.

μ. À compter du 5 décembre 2022, Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^] a cessé ses activités.

π. À compter du 23 janvier 2023, Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] a commencé ses activités.

τ. À compter du 16 février 2023, Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^] a cessé ses activités.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État du résultat global

	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	
	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
REVENU DES INVESTISSEMENTS :								
Revenu brut des dividendes et intérêts obligataires (Note 2)	\$ 19 590	\$ 736	\$ 5 896	\$ 6 898	\$ 49 800	\$ 44 481	€ 2 399	€ 1 475
Intérêt (Note 2)	–	–	–	–	6	–	1	–
Égalisation (Note 2)	–	–	–	–	(1)	(3)	–	–
Autres revenus	–	–	–	–	–	–	–	–
Bénéfice/(perte) net(te) sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le résultat (Note 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers détenus à des fins de transaction	–	–	(23 862)	(3 097)	(121 262)	(9 356)	(6 318)	204
Plus-value/(Moins-value) nette latente sur les instruments financiers détenus à des fins de transaction	–	–	(6 884)	(11 691)	(109 818)	(91 080)	(18 592)	(6 334)
Revenu/(perte) total(e) des placements	19 590	736	(24 850)	(7 890)	(181 275)	(55 958)	(22 510)	(4 655)
CHARGES :								
Commissions de gestion (Note 4)	4 894	5 262	1 200	2 110	7 092	9 504	35	33
Commissions de performance (Note 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissions de l'agent administratif et du dépositaire (Note 4)	223	236	129	168	944	939	103	77
Commissions de services aux actionnaires (Note 4)	–	–	149	232	309	539	2	2
Frais juridiques	3	21	5	3	38	21	3	1
Frais d'audit (Note 4)	17	20	35	41	35	41	24	24
Frais d'impression	54	45	15	25	87	137	9	9
Frais sur dividendes	–	–	–	–	–	–	–	–
Intérêts débiteurs	–	–	–	–	12	22	7	26
Honoraires et dépenses des administrateurs (Note 4)	7	5	1	2	10	9	1	1
Ajustement des charges à payer et autres passifs	–	–	–	–	–	–	–	–
Autres charges	85	92	148	54	520	268	29	24
Total des charges	5 283	5 681	1 682	2 635	9 047	11 480	213	197
Dérogations et remboursements de frais/défalcation (Note 4)	(645)	(5 036)	(51)	–	(15)	–	–	–
Total des charges nettes	4 638	645	1 631	2 635	9 032	11 480	213	197
Profit/(perte) net(te) avant coûts financiers	14 952	91	(26 481)	(10 525)	(190 307)	(67 438)	(22 723)	(4 852)
COÛTS FINANCIERS :								
Distributions aux détenteurs d'actions participatives rachetables (Note 5)	(11 932)	(76)	(1 859)	(1 567)	(2 917)	(2 649)	(8)	(1)
Profit/(perte) pour l'exercice	3 020	15	(28 340)	(12 092)	(193 224)	(70 087)	(22 731)	(4 853)
Retenue d'impôt sur les dividendes et autres taxes	–	–	4	–	(236)	(113)	2	(10)
Hausse/(Baisse) de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables provenant des activités	\$ 3 020	\$ 15	\$ (28 336)	\$ (12 092)	\$ (193 460)	\$ (70 200)	€ (22 729)	€ (4 863)

	FTGF Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund ^Δ		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund ^Δ		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund ^Δ _μ	
	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
REVENU DES INVESTISSEMENTS :								
Revenu brut des dividendes et intérêts obligataires (Note 2)	\$ 4 211	\$ 4 886	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1 736	\$ 2 111
Intérêt (Note 2)	1	–	–	–	–	–	–	–
Égalisation (Note 2)	–	(2)	–	–	–	–	–	(7)
Autres revenus	–	–	–	–	–	1	–	–
Bénéfice/(perte) net(te) sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le résultat (Note 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers détenus à des fins de transaction	(4 968)	2 674	–	–	–	–	(3 715)	2 482
Plus-value/(Moins-value) nette latente sur les instruments financiers détenus à des fins de transaction	(6 290)	(10 546)	–	–	–	–	(1 106)	(1 994)
Revenu/(perte) total(e) des placements	(7 046)	(2 988)	–	–	–	1	(3 085)	2 592
CHARGES :								
Commissions de gestion (Note 4)	604	1 062	–	–	–	–	76	82
Commissions de performance (Note 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissions de l'agent administratif et du dépositaire (Note 4)	52	64	–	–	–	–	18	37
Commissions de services aux actionnaires (Note 4)	80	110	–	–	–	–	10	12
Frais juridiques	1	1	–	–	–	–	1	1
Frais d'audit (Note 4)	22	17	–	–	–	–	13	25
Frais d'impression	6	9	–	–	–	–	4	4
Frais sur dividendes	–	–	–	–	–	–	–	–
Intérêts débiteurs	1	–	–	–	–	–	–	–
Honoraires et dépenses des administrateurs (Note 4)	–	1	–	–	–	–	–	–
Ajustement des charges à payer et autres passifs	–	–	–	–	–	1	–	–
Autres charges	43	26	–	–	–	–	35	16
Total des charges	809	1 290	–	–	–	1	157	177
Dérogations et remboursements de frais/défalcation (Note 4)	(21)	–	–	–	–	–	(32)	(1)
Total des charges nettes	788	1 290	–	–	–	1	125	176
Profit/(perte) net(te) avant coûts financiers	(7 834)	(4 278)	–	–	–	–	(3 210)	2 416
COÛTS FINANCIERS :								
Distributions aux détenteurs d'actions participatives rachetables (Note 5)	(2 507)	(2 633)	–	–	–	–	(153)	–
Profit/(perte) pour l'exercice	(10 341)	(6 911)	–	–	–	–	(3 363)	2 416
Retenue d'impôt sur les dividendes et autres taxes	(40)	(11)	–	–	–	–	2	–
Hausse/(Baisse) de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables provenant des activités	\$ (10 381)	\$ (6 922)	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (3 361)	\$ 2 416

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund ^{ατ}		FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		FTGF Western Asset US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund ^{αδ}		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund ^{αβ}	
Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
\$ 2 290	\$ 2 171	\$ 12 184	\$ 17 245	\$ 12 690	\$ 13 541	\$ 1 115	\$ 1 703	\$ 357	\$ 1 685
–	–	3	1	–	1	–	–	–	–
–	–	(1)	11	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
(5 513)	729	(18 028)	16 567	(26 636)	2 039	(9 246)	(608)	(5 081)	667
1 341	(2 290)	(29 851)	(43 376)	(8 685)	(13 880)	4 275	(5 119)	2 932	(5 238)
(1 882)	610	(35 693)	(9 552)	(22 631)	1 701	(3 856)	(4 024)	(1 792)	(2 886)
418	557	1 174	1 839	1 053	1 637	121	290	2	12
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
34	35	175	260	132	157	20	31	7	28
46	55	79	124	103	142	8	20	–	–
1	1	7	6	6	3	–	–	–	1
11	27	35	41	22	17	12	20	10	17
4	4	19	37	14	21	3	3	1	4
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	3	8	3	2	–	–	–	–
–	–	1	4	1	1	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
27	15	80	83	72	47	25	14	10	12
541	694	1 573	2 402	1 406	2 027	189	378	30	74
(24)	(11)	(1)	–	(10)	–	(14)	(8)	(17)	–
517	683	1 572	2 402	1 396	2 027	175	370	13	74
(2 399)	(73)	(37 265)	(11 954)	(24 027)	(326)	(4 031)	(4 394)	(1 805)	(2 960)
(533)	(499)	(4 900)	(6 202)	(3 795)	(2 869)	(826)	(928)	(319)	(1 525)
(2 932)	(572)	(42 165)	(18 156)	(27 822)	(3 195)	(4 857)	(5 322)	(2 124)	(4 485)
(1)	(3)	(183)	(241)	(77)	(42)	1	(12)	10	1
\$ (2 933)	\$ (575)	\$ (42 348)	\$ (18 397)	\$ (27 899)	\$ (3 237)	\$ (4 856)	\$ (5 334)	\$ (2 114)	\$ (4 484)
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund ^α		FTGF Western Asset Global Credit Fund ^α		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund ^{αβ}	
Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
\$ 18 250	\$ 22 129	\$ 6 684	\$ 5 461	\$ 4 665	\$ 4 977	\$ 1 973	\$ 2 115	€ 404	€ 1 862
4	4	2	–	1	–	–	–	–	–
(6)	(17)	13	(2)	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
(11 414)	(4 563)	(14 415)	9 501	(18 099)	3 105	(4 202)	2 483	(3 794)	473
(45 874)	(26 651)	(41 738)	(41 227)	(13 755)	(16 541)	(6 019)	(7 913)	992	(2 404)
(39 040)	(9 098)	(49 454)	(26 267)	(27 188)	(8 459)	(8 248)	(3 315)	(2 398)	(69)
3 084	4 099	1 557	1 925	239	515	23	41	–	1
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
321	342	290	298	118	151	49	55	8	33
187	301	107	130	3	1	4	6	–	–
12	8	12	6	4	4	1	1	–	1
35	41	23	27	23	27	23	27	12	24
30	45	27	45	13	20	5	8	2	4
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
1	1	6	8	2	2	1	2	14	28
4	3	3	3	1	2	1	1	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
122	113	77	86	60	46	21	22	2	15
3 796	4 953	2 102	2 528	463	768	128	163	38	106
–	(1)	–	(2)	–	–	–	–	(11)	–
3 796	4 952	2 102	2 526	463	768	128	163	27	106
(42 836)	(14 050)	(51 556)	(28 793)	(27 651)	(9 227)	(8 376)	(3 478)	(2 425)	(175)
(6 139)	(8 841)	(3 697)	(3 167)	–	–	–	–	(1)	(223)
(48 975)	(22 891)	(55 253)	(31 960)	(27 651)	(9 227)	(8 376)	(3 478)	(2 426)	(398)
(449)	(577)	(4)	13	(34)	(41)	(3)	(7)	–	–
\$ (49 424)	\$ (23 468)	\$ (55 257)	\$ (31 947)	\$ (27 685)	\$ (9 268)	\$ (8 379)	\$ (3 485)	€ (2 426)	€ (398)

État du résultat global – (suite)

	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund [^]		FTGF Western Asset Multi- Asset Credit Fund [^]		Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund [^]	
	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
REVENU DES INVESTISSEMENTS :								
Revenu brut des dividendes et intérêts obligataires (Note 2)	\$ 119 538	\$ 268 078	\$ –	\$ –	\$ 17 639	\$ 39 782	\$ –	\$ –
Intérêt (Note 2)	193	19	–	–	1	–	–	–
Égalisation (Note 2)	366	(398)	–	–	14	–	–	–
Autres revenus	–	–	–	–	–	–	–	–
Bénéfice/(perte) net(te) sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le résultat (Note 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers détenus à des fins de transaction	(808 592)	445 215	–	–	(67 965)	21 382	–	–
Plus-value/(Moins-value) nette latente sur les instruments financiers détenus à des fins de transaction	213 028	(1 088 186)	–	–	(7 496)	(75 250)	–	–
Revenu/(perte) total(e) des placements	(475 467)	(375 272)	–	–	(57 807)	(14 086)	–	–
CHARGES :								
Commissions de gestion (Note 4)	30 787	68 651	–	–	310	289	–	–
Commissions de performance (Note 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissions de l'agent administratif et du dépositaire (Note 4)	1 815	3 462	–	–	205	496	–	–
Commissions de services aux actionnaires (Note 4)	2 121	4 466	–	–	–	–	–	–
Frais juridiques	90	91	–	–	14	10	–	–
Frais d'audit (Note 4)	35	41	–	–	24	26	–	–
Frais d'impression	213	557	–	–	38	74	–	–
Frais sur dividendes	–	–	–	–	–	–	–	–
Intérêts débiteurs	112	178	–	–	4	8	–	–
Honoraires et dépenses des administrateurs (Note 4)	23	38	–	–	2	5	–	–
Ajustement des charges à payer et autres passifs	–	–	–	–	–	–	–	–
Autres charges	536	1 126	–	–	92	125	–	–
Total des charges	35 732	78 610	–	–	689	1 033	–	–
Dérogations et remboursements de frais/défalcation (Note 4)	–	–	–	–	(1)	(1)	–	–
Total des charges nettes	35 732	78 610	–	–	688	1 032	–	–
Profit/(perte) net(te) avant coûts financiers	(511 199)	(453 882)	–	–	(58 495)	(15 118)	–	–
COÛTS FINANCIERS :								
Distributions aux détenteurs d'actions participatives rachetables (Note 5)	(18 470)	(42 036)	–	–	(309)	(37)	–	–
Profit/(perte) pour l'exercice	(529 669)	(495 918)	–	–	(58 804)	(15 155)	–	–
Retenue d'impôt sur les dividendes et autres taxes	(5 966)	(7 309)	–	–	(110)	(277)	–	–
Hausse/(Baisse) de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables provenant des activités	\$ (535 635)	\$ (503 227)	\$ –	\$ –	\$ (58 914)	\$ (15 432)	\$ –	\$ –

	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]		FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	
	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
REVENU DES INVESTISSEMENTS :								
Revenu brut des dividendes et intérêts obligataires (Note 2)	\$ 245	\$ 30	\$ 8 345	\$ 6 749	\$ 25 709	\$ 21 764	\$ 794	\$ 657
Intérêt (Note 2)	–	–	1	–	2	–	–	–
Égalisation (Note 2)	–	–	(39)	(30)	–	–	–	–
Autres revenus	–	–	–	–	–	–	–	–
Bénéfice/(perte) net(te) sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le résultat (Note 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers détenus à des fins de transaction	447	58	(33 243)	(9 380)	(104 216)	(24 577)	(2 007)	262
Plus-value/(Moins-value) nette latente sur les instruments financiers détenus à des fins de transaction	(1 476)	(213)	(8 855)	(18 546)	(9 919)	(38 509)	40	(940)
Revenu/(perte) total(e) des placements	(784)	(125)	(33 791)	(21 207)	(88 424)	(41 322)	(1 173)	(21)
CHARGES :								
Commissions de gestion (Note 4)	28	4	1 242	2 051	2 452	2 725	47	56
Commissions de performance (Note 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissions de l'agent administratif et du dépositaire (Note 4)	19	5	143	171	427	433	13	13
Commissions de services aux actionnaires (Note 4)	–	–	177	274	8	8	–	1
Frais juridiques	5	–	4	4	15	11	–	–
Frais d'audit (Note 4)	16	18	35	34	23	27	23	27
Frais d'impression	1	–	1	21	41	63	2	1
Frais sur dividendes	–	–	–	–	–	–	–	–
Intérêts débiteurs	–	–	3	–	25	–	–	–
Honoraires et dépenses des administrateurs (Note 4)	–	–	1	3	5	4	–	–
Ajustement des charges à payer et autres passifs	–	–	–	–	–	–	–	–
Autres charges	22	6	20	58	112	122	13	11
Total des charges	91	33	1 626	2 616	3 108	3 393	98	109
Dérogations et remboursements de frais/défalcation (Note 4)	(50)	(27)	–	–	–	–	(36)	(34)
Total des charges nettes	41	6	1 626	2 616	3 108	3 393	62	75
Profit/(perte) net(te) avant coûts financiers	(825)	(131)	(35 417)	(23 823)	(91 532)	(44 715)	(1 235)	(96)
COÛTS FINANCIERS :								
Distributions aux détenteurs d'actions participatives rachetables (Note 5)	–	–	(1 003)	(1 004)	(877)	(780)	(6)	(6)
Profit/(perte) pour l'exercice	(825)	(131)	(36 420)	(24 827)	(92 409)	(45 495)	(1 241)	(102)
Retenue d'impôt sur les dividendes et autres taxes	–	–	372	(294)	(520)	(1 043)	(2)	1
Hausse/(Baisse) de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables provenant des activités	\$ (825)	\$ (131)	\$ (36 048)	\$ (25 121)	\$ (92 929)	\$ (46 538)	\$ (1 243)	\$ (101)

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]		FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]		FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]		FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]		Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	
Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
\$ 37 779 1 — —	\$ 44 016 — — —	\$ 32 881 — — —	\$ 22 930 — — —	£ 1 738 2 — —	£ 1 757 — — —	\$ 5 142 1 — —	\$ 5 649 — — —	\$ 629 — — —	\$ 600 — 1 —
(25 905)	(20 031)	(47 722)	(20 177)	(6 233)	233	(41 235)	208	(3 160)	(524)
(63 132)	(20 131)	(96 912)	(31 759)	(6 171)	(4 951)	(4 223)	(17 331)	(792)	(1 412)
(51 257)	3 854	(111 753)	(29 006)	(10 664)	(2 961)	(40 315)	(11 474)	(3 323)	(1 335)
1 351 — 475 28 35 35 57 — 2 6 — 130	4 001 — 681 50 16 53 104 — — 6 — 179	97 — 780 — 29 23 61 — 1 8 — 144	7 — 610 — 14 27 89 — — 5 — 156	— — 46 — 2 15 4 — — 1 — 15	— — 50 — 1 15 6 — 2 — — 15	61 — 95 1 4 23 10 — 1 — — 33	65 — 116 1 3 27 17 — — 1 — — 35	— — 19 — 1 23 1 — — — — 32	— — 19 — — 42 2 — — — — 22
2 119 — 2 119	5 090 — 5 090	1 143 — 1 143	908 — 908	83 — 83	89 — 89	229 — 229	265 — 265	76 (76) —	85 (85) —
(53 376)	(1 236)	(112 896)	(29 914)	(10 747)	(3 050)	(40 544)	(11 739)	(3 323)	(1 335)
(945)	(2 540)	—	—	(757)	—	(2 031)	—	(686)	(614)
(54 321)	(3 776)	(112 896)	(29 914)	(11 504)	(3 050)	(42 575)	(11 739)	(4 009)	(1 949)
—	—	—	—	1	(3)	(53)	(25)	(2)	(5)
\$ (54 321)	\$ (3 776)	\$ (112 896)	\$ (29 914)	£ (11 503)	£ (3 053)	\$ (42 628)	\$ (11 764)	\$ (4 011)	\$ (1 954)
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund [^]		FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]		FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	
Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
\$ 8 940 — — —	\$ 8 885 — — —	\$ — — — 1 930	\$ — — — 33	\$ 55 299 9 18 —	\$ 37 405 — 216 —	\$ 2 445 1 — —	\$ 2 123 — — —	\$ 613 — — —	\$ 579 — — —
(30 719)	(12 083)	—	1 878	(176 578)	(49 978)	(1 815)	1 644	(1 880)	(431)
(13 662)	(8 859)	—	(1 972)	(69 518)	(69 045)	(433)	(2 028)	128	(1 126)
(35 441)	(12 057)	1 930	(61)	(190 770)	(81 402)	198	1 739	(1 139)	(978)
1 293 — 162 8 6 22 15 — 3 1 — 26	1 870 — 190 12 4 17 27 — 2 3 — 62	— — — — — — — — — — 1 930 —	— — — — — — — — — — 33 —	9 957 — 917 1 089 43 49 80 — 14 13 — 312	9 953 — 725 1 084 10 27 87 — 1 4 — 196	592 — 52 18 1 23 4 — 1 — — 26	575 — 37 20 1 27 5 — — — 18	34 — 11 — — 34 2 — — — 30	44 — 12 — — 28 1 — — — 13
1 536 — 1 536	2 187 — 2 187	1 930 — 1 930	33 — 33	12 474 — 12 474	12 087 — 12 087	717 (33) 684	683 (11) 672	111 (65) 46	98 (37) 61
(36 977)	(14 244)	—	(94)	(203 244)	(93 489)	(486)	1 067	(1 185)	(1 039)
(121)	(98)	—	—	(24 709)	(17 678)	—	—	(588)	(653)
(37 098)	(14 342)	—	(94)	(227 953)	(111 167)	(486)	1 067	(1 773)	(1 692)
(162)	(232)	—	94	(847)	(471)	17	(28)	(2)	—
\$ (37 260)	\$ (14 574)	\$ —	\$ —	\$ (228 800)	\$ (111 638)	\$ (469)	\$ 1 039	\$ (1 775)	\$ (1 692)

État du résultat global – (suite)

	Legg Mason Brandywine Global - US High Yield Fund [^]		FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]		FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	
	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
REVENU DES INVESTISSEMENTS :								
Revenu brut des dividendes et intérêts obligataires (Note 2)	\$ -	\$ -	\$ 4 421	\$ 13 030	\$ 226	\$ -	\$ 52	\$ 39
Intérêt (Note 2)	-	-	-	-	-	-	-	-
Égalisation (Note 2)	-	-	-	-	-	-	-	-
Autres revenus	-	-	-	-	-	-	-	-
Bénéfice/(perte) net(te) sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le résultat (Note 2)	-	-	-	-	-	-	-	-
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers détenus à des fins de transaction	-	-	(19 601)	(17 320)	(254)	-	79	253
Plus-value/(Moins-value) nette latente sur les instruments financiers détenus à des fins de transaction	-	-	(1 726)	(20 177)	(139)	-	(213)	(90)
Revenu/(perte) total(e) des placements	-	-	(16 906)	(24 467)	(167)	-	(82)	202
CHARGES :								
Commissions de gestion (Note 4)	-	-	3	39	17	-	12	10
Commissions de performance (Note 4)	-	-	-	-	-	-	-	-
Commissions de l'agent administratif et du dépositaire (Note 4)	-	-	59	148	6	-	7	7
Commissions de services aux actionnaires (Note 4)	-	-	-	2	-	-	1	-
Frais juridiques	-	-	2	6	-	-	-	-
Frais d'audit (Note 4)	-	-	23	27	16	-	34	27
Frais d'impression	-	-	8	27	-	-	-	-
Frais sur dividendes	-	-	-	-	-	-	-	-
Intérêts débiteurs	-	-	-	1	-	-	-	-
Honoraires et dépenses des administrateurs (Note 4)	-	-	1	2	-	-	-	-
Ajustement des charges à payer et autres passifs	-	-	-	-	-	-	-	-
Autres charges	-	-	38	57	15	-	20	9
Total des charges	-	-	134	309	54	-	74	53
Dérogations et remboursements de frais/défalcation (Note 4)	-	-	(24)	(20)	(32)	-	(58)	(40)
Total des charges nettes	-	-	110	289	22	-	16	13
Profit/(perte) net(te) avant coûts financiers	-	-	(17 016)	(24 756)	(189)	-	(98)	189
COÛTS FINANCIERS :								
Distributions aux détenteurs d'actions participatives rachetables (Note 5)	-	-	-	-	(2)	-	-	-
Profit/(perte) pour l'exercice	-	-	(17 016)	(24 756)	(191)	-	(98)	189
Retenue d'impôt sur les dividendes et autres taxes	-	-	(186)	(315)	(9)	-	(14)	(11)
Hausse/(Baisse) de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables provenant des activités	\$ -	\$ -	\$ (17 202)	\$ (25 071)	\$ (200)	\$ -	\$ (112)	\$ 178

	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]		FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	
	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
REVENU DES INVESTISSEMENTS :								
Revenu brut des dividendes et intérêts obligataires (Note 2)	\$ 4 300	\$ 5 224	\$ 1 556	\$ 1 764	\$ 19 216	\$ 14 546	\$ 181	\$ 135
Intérêt (Note 2)	-	-	-	-	-	-	-	-
Égalisation (Note 2)	(12)	(1)	-	-	(2)	31	-	-
Autres revenus	-	-	-	-	-	-	-	-
Bénéfice/(perte) net(te) sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le résultat (Note 2)	-	-	-	-	-	-	-	-
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers détenus à des fins de transaction	38 275	51 437	(49)	1 547	(40 931)	45 824	(164)	1 119
Plus-value/(Moins-value) nette latente sur les instruments financiers détenus à des fins de transaction	(119 909)	(133 605)	(4 889)	3 473	(118 836)	12 537	(1 038)	(1 289)
Revenu/(perte) total(e) des placements	(77 346)	(76 945)	(3 382)	6 784	(140 553)	72 938	(1 021)	(35)
CHARGES :								
Commissions de gestion (Note 4)	3 723	6 381	464	491	8 276	6 820	89	92
Commissions de performance (Note 4)	-	-	-	-	-	-	-	-
Commissions de l'agent administratif et du dépositaire (Note 4)	280	435	37	34	1 111	791	15	14
Commissions de services aux actionnaires (Note 4)	502	837	76	78	1 780	944	2	3
Frais juridiques	9	11	1	1	43	16	-	-
Frais d'audit (Note 4)	35	41	23	27	30	26	11	13
Frais d'impression	-	45	3	4	81	103	1	1
Frais sur dividendes	-	-	-	-	-	-	-	-
Intérêts débiteurs	-	2	-	-	10	13	-	-
Honoraires et dépenses des administrateurs (Note 4)	3	4	-	-	13	5	-	-
Ajustement des charges à payer et autres passifs	-	-	-	-	-	-	-	-
Autres charges	58	103	35	18	250	181	19	14
Total des charges	4 610	7 859	639	653	11 594	8 899	137	137
Dérogations et remboursements de frais/défalcation (Note 4)	-	-	(40)	(20)	(89)	(97)	(26)	(22)
Total des charges nettes	4 610	7 859	599	633	11 505	8 802	111	115
Profit/(perte) net(te) avant coûts financiers	(81 956)	(84 804)	(3 981)	6 151	(152 058)	64 136	(1 132)	(150)
COÛTS FINANCIERS :								
Distributions aux détenteurs d'actions participatives rachetables (Note 5)	-	(70)	(226)	(254)	(86)	(57)	-	-
Profit/(perte) pour l'exercice	(81 956)	(84 874)	(4 207)	5 897	(152 144)	64 079	(1 132)	(150)
Retenue d'impôt sur les dividendes et autres taxes	(851)	(1 006)	(370)	(400)	(5 143)	(4 049)	(30)	(24)
Hausse/(Baisse) de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables provenant des activités	\$ (82 807)	\$ (85 880)	\$ (4 577)	\$ 5 497	\$ (157 287)	\$ 60 030	\$ (1 162)	\$ (174)

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

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	
Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
\$ 18 832	\$ 13 308	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 3 244	\$ 2 887	\$ 10 386	\$ 11 465
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(37)	(16)	-	-	-	-	(1)	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
27 825	57 129	-	-	-	-	10 875	32 551	119 361	207 591
(53 148)	16 803	-	-	-	-	(27 103)	(9 208)	(379 934)	(56 563)
(6 528)	87 224	-	-	-	-	(12 985)	26 230	(250 187)	162 493
7 465	6 023	-	-	-	-	2 177	2 550	10 827	16 022
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
655	462	-	-	-	-	146	143	998	1 229
689	640	-	-	-	-	359	414	1 464	2 089
23	10	-	-	-	-	5	3	42	26
17	15	-	-	-	-	23	27	35	42
46	64	-	-	-	-	13	19	100	172
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	1	-	-	-	-	-	-	1	1
6	3	-	-	-	-	1	1	10	11
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
169	113	-	-	-	-	104	42	315	332
9 070	7 331	-	-	-	-	2 828	3 199	13 792	19 924
-	-	-	-	-	-	(15)	-	-	-
9 070	7 331	-	-	-	-	2 813	3 199	13 792	19 924
(15 598)	79 893	-	-	-	-	(15 798)	23 031	(263 979)	142 569
(136)	(148)	-	-	-	-	(6)	(16)	-	-
(15 734)	79 745	-	-	-	-	(15 804)	23 015	(263 979)	142 569
(5 023)	(3 486)	-	-	-	-	(921)	(814)	(2 801)	(3 192)
\$ (20 757)	\$ 76 259	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ (16 725)	\$ 22 201	\$ (266 780)	\$ 139 377
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^E		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		FTGF Royce US Smaller Companies Fund	
Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
€ 24 238	€ 16 832	\$ 73	\$ 97	\$ 16 804	\$ 3 805	\$ 9 694	\$ 11 052	\$ 1 009	\$ 932
15	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(147)	(339)	-	-	(18)	(5)	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
97 667	57 894	(446)	(91)	(20 310)	4 597	(26 757)	324 314	3 014	19 637
(99 004)	76 407	12	(25)	(33 358)	1 715	(23 159)	(253 086)	(2 696)	(19 173)
22 769	150 794	(361)	(19)	(36 882)	10 112	(40 222)	82 280	1 327	1 396
10 180	6 668	19	31	4 260	1 206	7 773	12 523	1 052	1 337
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
739	422	3	5	255	55	538	717	64	68
1 277	773	3	4	885	283	1 310	2 173	174	233
25	6	-	-	7	1	20	20	3	1
24	24	10	5	16	18	35	41	23	27
45	52	-	-	11	3	56	118	6	9
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
164	122	-	-	1	-	-	-	-	-
7	3	-	-	2	-	5	6	-	1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
140	108	30	6	79	29	178	212	43	27
12 601	8 178	65	51	5 516	1 595	9 915	15 810	1 365	1 703
-	-	(40)	(16)	-	(8)	-	-	(11)	-
12 601	8 178	25	35	5 516	1 587	9 915	15 810	1 354	1 703
10 168	142 616	(386)	(54)	(42 398)	8 525	(50 137)	66 470	(27)	(307)
(6 157)	(3 289)	(16)	(10)	(14 505)	(3 291)	-	-	-	(53)
4 011	139 327	(402)	(64)	(56 903)	5 234	(50 137)	66 470	(27)	(360)
(4 301)	(2 933)	-	(9)	(2 061)	(590)	(1 694)	(2 924)	(238)	(225)
€ (290)	€ 136 394	\$ (402)	\$ (73)	\$ (58 964)	\$ 4 644	\$ (51 831)	\$ 63 546	\$ (265)	\$ (585)

État du résultat global – (suite)

	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]		Legg Mason US Equity Fund [^]		Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^] _γ		FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	
	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
REVENU DES INVESTISSEMENTS :								
Revenu brut des dividendes et intérêts obligataires (Note 2)	\$ 71	\$ 14	\$ –	\$ –	€ 793	€ 1 338	\$ 1 344	\$ 1 598
Intérêt (Note 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Égalisation (Note 2)	–	–	–	–	–	(2)	(11)	(9)
Autres revenus	–	–	–	–	–	–	–	–
Bénéfice/(perte) net(te) sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le résultat (Note 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers détenus à des fins de transaction	(330)	17	–	–	(726)	856	(825)	(483)
Plus-value/(Moins-value) nette latente sur les instruments financiers détenus à des fins de transaction	14	(483)	–	–	(522)	2 872	(2 521)	126
Revenu/(perte) total(e) des placements	(245)	(452)	–	–	(455)	5 064	(2 013)	1 232
CHARGES :								
Commissions de gestion (Note 4)	31	9	–	–	125	382	321	409
Commissions de performance (Note 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissions de l'agent administratif et du dépositaire (Note 4)	8	4	–	–	8	22	22	25
Commissions de services aux actionnaires (Note 4)	–	–	–	–	12	40	50	65
Frais juridiques	2	–	–	–	–	–	–	1
Frais d'audit (Note 4)	10	12	–	–	12	9	17	15
Frais d'impression	–	–	–	–	–	1	3	2
Frais sur dividendes	–	–	–	–	–	–	–	–
Intérêts débiteurs	–	–	–	–	2	2	–	–
Honoraires et dépenses des administrateurs (Note 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ajustement des charges à payer et autres passifs	–	–	–	–	–	–	–	–
Autres charges	14	9	–	–	–	6	36	14
Total des charges	65	34	–	–	159	462	449	531
Dérégations et remboursements de frais/défalcaton (Note 4)	(28)	(23)	–	–	(9)	(3)	(31)	(16)
Total des charges nettes	37	11	–	–	150	459	418	515
Profit/(perte) net(te) avant coûts financiers	(282)	(463)	–	–	(605)	4 605	(2 431)	717
COÛTS FINANCIERS :								
Distributions aux détenteurs d'actions participatives rachetables (Note 5)	–	–	–	–	(120)	(337)	(523)	(577)
Profit/(perte) pour l'exercice	(282)	(463)	–	–	(725)	4 268	(2 954)	140
Retenue d'impôt sur les dividendes et autres taxes	(12)	(3)	–	–	(206)	(272)	(137)	(154)
Hausse/(Baisse) de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables provenant des activités	\$ (294)	\$ (466)	\$ –	\$ –	€ (931)	€ 3 996	\$ (3 091)	\$ (14)

	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund [^]		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund [^]	
	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
REVENU DES INVESTISSEMENTS :								
Revenu brut des dividendes et intérêts obligataires (Note 2)	\$ –	\$ –	€ –	€ 220	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Intérêt (Note 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Égalisation (Note 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Autres revenus	–	–	–	4	–	–	–	–
Bénéfice/(perte) net(te) sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le résultat (Note 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers détenus à des fins de transaction	–	–	–	4 781	–	–	–	–
Plus-value/(Moins-value) nette latente sur les instruments financiers détenus à des fins de transaction	–	–	–	(2 150)	–	–	–	–
Revenu/(perte) total(e) des placements	–	–	–	2 855	–	–	–	–
CHARGES :								
Commissions de gestion (Note 4)	–	–	–	140	–	–	–	–
Commissions de performance (Note 4)	–	–	–	3	–	–	–	–
Commissions de l'agent administratif et du dépositaire (Note 4)	–	–	–	10	–	–	–	–
Commissions de services aux actionnaires (Note 4)	–	–	–	21	–	–	–	–
Frais juridiques	–	–	–	–	–	–	–	–
Frais d'audit (Note 4)	–	–	–	12	–	–	–	–
Frais d'impression	–	–	–	1	–	–	–	–
Frais sur dividendes	–	–	–	88	–	–	–	–
Intérêts débiteurs	–	–	–	32	–	–	–	–
Honoraires et dépenses des administrateurs (Note 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ajustement des charges à payer et autres passifs	–	–	–	4	–	–	–	–
Autres charges	–	–	–	9	–	–	–	–
Total des charges	–	–	–	320	–	–	–	–
Dérégations et remboursements de frais/défalcaton (Note 4)	–	–	–	(29)	–	–	–	–
Total des charges nettes	–	–	–	291	–	–	–	–
Profit/(perte) net(te) avant coûts financiers	–	–	–	2 564	–	–	–	–
COÛTS FINANCIERS :								
Distributions aux détenteurs d'actions participatives rachetables (Note 5)	–	–	–	–	–	–	–	–
Profit/(perte) pour l'exercice	–	–	–	2 564	–	–	–	–
Retenue d'impôt sur les dividendes et autres taxes	–	–	–	(97)	–	–	–	–
Hausse/(Baisse) de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables provenant des activités	\$ –	\$ –	€ –	€ 2 467	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

[illegible]

État du résultat global – (suite)

	Franklin Templeton Global Funds Plc	
	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
REVENU DES INVESTISSEMENTS :		
Revenu brut des dividendes et intérêts obligataires (Note 2)	\$ 587 213	\$ 703 005
Intérêt (Note 2)	245	25
Égalisation (Note 2)	129	(935)
Autres revenus	1 930	40
Bénéfice/(perte) net(te) sur les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le résultat (Note 2)		
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers détenus à des fins de transaction	(1 491 020)	1 182 053
Plus-value/(Moins-value) nette latente sur les instruments financiers détenus à des fins de transaction	(1 248 346)	(2 121 229)
Revenu/(perte) total(e) des placements	(2 149 849)	(237 041)
CHARGES :		
Commissions de gestion (Note 4)	129 714	185 330
Commissions de performance (Note 4)	–	4
Commissions de l'agent administratif et du dépositaire (Note 4)	13 176	15 040
Commissions de services aux actionnaires (Note 4)	13 404	16 748
Frais juridiques	541	354
Frais d'audit (Note 4)	1 266	1 418
Frais d'impression	1 234	2 154
Frais sur dividendes	–	103
Intérêts débiteurs	410	527
Honoraires et dépenses des administrateurs (Note 4)	143	140
Ajustement des charges à payer et autres passifs	1 930	40
Autres charges	4 664	4 522
Total des charges	166 482	226 380
Dérogations et remboursements de frais/défalcation (Note 4)	(1 695)	(5 749)
Total des charges nettes	164 787	220 631
Profit/(perte) net(te) avant coûts financiers	(2 314 636)	(457 672)
COÛTS FINANCIERS :		
Distributions aux détenteurs d'actions participatives rachetables (Note 5)	(112 586)	(104 949)
Profit/(perte) pour l'exercice	(2 427 222)	(562 621)
Retenue d'impôt sur les dividendes et autres taxes	(33 107)	(32 275)
Hausse/(Baisse) de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables provenant des activités	\$ (2 460 329)	\$ (594 896)

Les montants désignés par «—» sont égaux à 0 USD / 0 EUR / 0 GBP / 0 YEN ou inférieurs à 1 000 USD / 1 000 EUR / 1 000 GBP / 1 000 YEN.

Les gains et pertes proviennent uniquement des activités poursuivies, à l'exception des fonds Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^], Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] et Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^], dont les activités ont été abandonnées. Aucune plus-value ou moins-value n'a été enregistrée hormis celles déjà traitées dans l'État du résultat global.

Les montants en euro des fonds FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] et Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] ont été convertis en dollars US dans le chiffre total de Legg Mason Global Funds Plc pour l'exercice clos le 28 février 2023 au taux moyen USD/EUR de 0,9590 (28 février 2022 : 0,8551).

Les montants en livre sterling du fonds FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] ont été convertis en dollars US dans le chiffre total de Franklin Templeton Global Funds Plc pour l'exercice financier clos le 28 février 2023 au taux moyen USD/GBP de 0,8252 (28 février 2022 : 0,7289).

Reportez-vous à la Note 14, Événements importants pour plus de détails sur les changements de nom du fonds.

α. À compter du 27 avril 2022, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] a cessé ses activités.

β. À compter du 21 juin 2022, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] et Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] ont cessé leurs activités.

γ. À compter du 11 juillet 2022, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] a cessé ses activités.

δ. À compter du 10 octobre 2022, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund a cessé ses activités.

ε. À compter du 17 novembre 2022, Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^] a cessé ses activités.

λ. À compter du 1er décembre 2022, FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] a commencé ses activités.

μ. À compter du 5 décembre 2022, Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^] a cessé ses activités.

π. À compter du 23 janvier 2023, Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] a commencé ses activités.

τ. À compter du 16 février 2023, Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^] a cessé ses activités.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

[Cette page est intentionnellement
laissée vierge]

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables

(en milliers)	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	
	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
Hausse/(Baisse) de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables provenant des activités	\$ 3 020	\$ 15	\$ (28 336)	\$ (12 092)	\$ (193 460)	\$ (70 200)	€ (22 729)	€ (4 863)
TRANSACTIONS SUR ACTIONS PARTICIPATIVES RACHETABLES								
Produit net des ventes d'actions	1 682 979	1 451 140	38 164	60 505	631 688	808 697	8 626	44 520
Produit net des distributions réinvesties	9 839	75	941	1 215	943	1 763	4	–
Coût des actions rachetées	(1 781 547)	(1 414 236)	(111 756)	(115 852)	(778 561)	(899 588)	(2 820)	(1 594)
Augmentation/(Baisse) de l'Actif net des transactions sur Actions participatives rachetables	(88 729)	36 979	(72 651)	(54 132)	(145 930)	(89 128)	5 810	42 926
Augmentation/(Baisse) des actifs nets imputables aux détenteurs d'actions participatives rachetables	(85 709)	36 994	(100 987)	(66 224)	(339 390)	(159 328)	(16 919)	38 063
ACTIF NET IMPUTABLE AUX DÉTENTEURS D'ACTIONS PARTICIPATIVES RACHETABLES								
Début de l'exercice	919 324	882 330	232 906	299 130	1 488 090	1 647 418	149 386	111 323
Écart de conversion	–	–	–	–	–	–	–	–
Fin de l'exercice	\$ 833 615	\$ 919 324	\$ 131 919	\$ 232 906	\$ 1 148 700	\$ 1 488 090	€ 132 467	€ 149 386

(en milliers)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund [^]		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund [^]		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund ^{^,H}	
	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
Hausse/(Baisse) de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables provenant des activités	\$ (10 381)	\$ (6 922)	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (3 361)	\$ 2 416
TRANSACTIONS SUR ACTIONS PARTICIPATIVES RACHETABLES								
Produit net des ventes d'actions	7 829	43 436	–	–	–	–	6 133	11 051
Produit net des distributions réinvesties	235	582	–	–	–	–	45	–
Coût des actions rachetées	(22 230)	(57 680)	–	–	–	–	(62 342)	(2 740)
Augmentation/(Baisse) de l'Actif net des transactions sur Actions participatives rachetables	(14 166)	(13 662)	–	–	–	–	(56 164)	8 311
Augmentation/(Baisse) des actifs nets imputables aux détenteurs d'actions participatives rachetables	(24 547)	(20 584)	–	–	–	–	(59 525)	10 727
ACTIF NET IMPUTABLE AUX DÉTENTEURS D'ACTIONS PARTICIPATIVES RACHETABLES								
Début de l'exercice	81 978	102 562	–	–	–	–	59 525	48 798
Écart de conversion	–	–	–	–	–	–	–	–
Fin de l'exercice	\$ 57 431	\$ 81 978	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 59 525

(en milliers)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund [^]		FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]		Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund [^]	
	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
Hausse/(Baisse) de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables provenant des activités	\$ (535 635)	\$ (503 227)	\$ –	\$ –	\$ (58 914)	\$ (15 432)	\$ –	\$ –
TRANSACTIONS SUR ACTIONS PARTICIPATIVES RACHETABLES								
Produit net des ventes d'actions	594 445	959 500	–	–	97 245	91 804	–	–
Produit net des distributions réinvesties	572	962	–	–	–	–	–	–
Coût des actions rachetées	(2 110 715)	(2 919 481)	–	–	(135 218)	(786 331)	–	–
Augmentation/(Baisse) de l'Actif net des transactions sur Actions participatives rachetables	(1 515 698)	(1 959 019)	–	–	(37 973)	(694 527)	–	–
Augmentation/(Baisse) des actifs nets imputables aux détenteurs d'actions participatives rachetables	(2 051 333)	(2 462 246)	–	–	(96 887)	(709 959)	–	–
ACTIF NET IMPUTABLE AUX DÉTENTEURS D'ACTIONS PARTICIPATIVES RACHETABLES								
Début de l'exercice	4 183 834	6 646 080	–	–	371 899	1 081 858	–	–
Écart de conversion	–	–	–	–	–	–	–	–
Fin de l'exercice	\$ 2 132 501	\$ 4 183 834	\$ –	\$ –	\$ 275 012	\$ 371 899	\$ –	\$ –

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund ^{ατ}		FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		FTGF Western Asset US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund ^{αδ}		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund ^{αβ}	
Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
\$ (2 933)	\$ (575)	\$ (42 348)	\$ (18 397)	\$ (27 899)	\$ (3 237)	\$ (4 856)	\$ (5 334)	\$ (2 114)	\$ (4 484)
5 974	61 237	116 601	157 618	80 773	180 706	9 398	29 799	1	6 972
336	549	524	1 017	2 460	2 300	790	961	319	1 525
(56 369)	(34 652)	(150 391)	(493 200)	(189 194)	(139 796)	(46 450)	(7 077)	(26 054)	(16 398)
(50 059)	27 134	(33 266)	(334 565)	(105 961)	43 210	(36 262)	23 683	(25 734)	(7 901)
(52 992)	26 559	(75 614)	(352 962)	(133 860)	39 973	(41 118)	18 349	(27 848)	(12 385)
52 992	26 433	302 969	655 931	259 100	219 127	41 118	22 769	27 848	40 233
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
\$ –	\$ 52 992	\$ 227 355	\$ 302 969	\$ 125 240	\$ 259 100	\$ –	\$ 41 118	\$ –	\$ 27 848
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund ^α		FTGF Western Asset Global Credit Fund ^α		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund ^{αβ}	
Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
\$ (49 424)	\$ (23 468)	\$ (55 257)	\$ (31 947)	\$ (27 685)	\$ (9 268)	\$ (8 379)	\$ (3 485)	€ (2 426)	€ (398)
59 409	52 803	309 635	169 168	20 632	42 911	669	3 979	4	14
101	221	18	4	–	–	–	–	–	77
(82 173)	(146 671)	(174 675)	(211 675)	(49 192)	(116 987)	(23 593)	(5 866)	(35 026)	(16 590)
(22 663)	(93 647)	134 978	(42 503)	(28 560)	(74 076)	(22 924)	(1 887)	(35 022)	(16 499)
(72 087)	(117 115)	79 721	(74 450)	(56 245)	(83 344)	(31 303)	(5 372)	(37 448)	(16 897)
509 794	626 909	444 249	518 699	202 948	286 292	77 353	82 725	37 448	54 345
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
\$ 437 707	\$ 509 794	\$ 523 970	\$ 444 249	\$ 146 703	\$ 202 948	\$ 46 050	\$ 77 353	€ –	€ 37 448
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund ^α		FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund ^α		FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund ^α		FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund ^α		Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund ^α	
Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
\$ (54 321)	\$ (3 776)	\$ (112 896)	\$ (29 914)	£ (11 503)	£ (3 053)	\$ (42 628)	\$ (11 764)	\$ (4 011)	\$ (1 954)
10 281	245 803	87 515	358 299	69 541	1	134 961	4 849	330	1 116
–	–	–	–	396	–	–	–	655	606
(454 353)	(289 248)	(2 392)	(4 521)	(86 155)	–	(172 727)	(9 512)	(491)	(3)
(444 072)	(43 445)	85 123	353 778	(16 218)	1	(37 766)	(4 663)	494	1 719
(498 393)	(47 221)	(27 773)	323 864	(27 721)	(3 052)	(80 394)	(16 427)	(3 517)	(235)
1 057 941	1 105 162	1 147 280	823 416	73 633	76 685	175 169	191 596	21 958	22 193
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
\$ 559 548	\$ 1 057 941	\$ 1 119 507	\$ 1 147 280	£ 45 912	£ 73 633	\$ 94 775	\$ 175 169	\$ 18 441	\$ 21 958

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

(en milliers)	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]		FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	
	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
Hausse/(Baisse) de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables provenant des activités	\$ (825)	\$ (131)	\$ (36 048)	\$ (25 121)	\$ (92 929)	\$ (46 538)	\$ (1 243)	\$ (101)
TRANSACTIONS SUR ACTIONS PARTICIPATIVES RACHETABLES								
Produit net des ventes d'actions	–	9 997	60 682	52 734	236 790	222 057	67	269
Produit net des distributions réinvesties	–	–	270	175	5	5	1	2
Coût des actions rachetées	(46)	–	(78 530)	(180 060)	(357 313)	(151 480)	(21)	(639)
Augmentation/(Baisse) de l'Actif net des transactions sur Actions participatives rachetables	(46)	9 997	(17 578)	(127 151)	(120 518)	70 582	47	(368)
Augmentation/(Baisse) des actifs nets imputables aux détenteurs d'actions participatives rachetables	(871)	9 866	(53 626)	(152 272)	(213 447)	24 044	(1 196)	(469)
ACTIF NET IMPUTABLE AUX DÉTENTEURS D'ACTIONS PARTICIPATIVES RACHETABLES								
Début de l'exercice	9 866	–	215 635	367 907	752 718	728 674	11 590	12 059
Écart de conversion	–	–	–	–	–	–	–	–
Fin de l'exercice	\$ 8 995	\$ 9 866	\$ 162 009	\$ 215 635	\$ 539 271	\$ 752 718	\$ 10 394	\$ 11 590

(en milliers)	Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund [^]		FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]		FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	
	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
Hausse/(Baisse) de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables provenant des activités	\$ –	\$ –	\$ (17 202)	\$ (25 071)	\$ (200)	\$ –	\$ (112)	\$ 178
TRANSACTIONS SUR ACTIONS PARTICIPATIVES RACHETABLES								
Produit net des ventes d'actions	–	–	112	6 935	15 028	–	480	144
Produit net des distributions réinvesties	–	–	–	–	1	–	–	–
Coût des actions rachetées	–	–	(17 731)	(268 929)	(25)	–	(11)	(24)
Augmentation/(Baisse) de l'Actif net des transactions sur Actions participatives rachetables	–	–	(17 619)	(261 994)	15 004	–	469	120
Augmentation/(Baisse) des actifs nets imputables aux détenteurs d'actions participatives rachetables	–	–	(34 821)	(287 065)	14 804	–	357	298
ACTIF NET IMPUTABLE AUX DÉTENTEURS D'ACTIONS PARTICIPATIVES RACHETABLES								
Début de l'exercice	–	–	104 231	391 296	–	–	2 177	1 879
Écart de conversion	–	–	–	–	–	–	–	–
Fin de l'exercice	\$ –	\$ –	\$ 69 410	\$ 104 231	\$ 14 804	\$ –	\$ 2 534	\$ 2 177

(en milliers)	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]		FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	
	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
Hausse/(Baisse) de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables provenant des activités	\$ (82 807)	\$ (85 880)	\$ (4 577)	\$ 5 497	\$ (157 287)	\$ 60 030	\$ (1 162)	\$ (174)
TRANSACTIONS SUR ACTIONS PARTICIPATIVES RACHETABLES								
Produit net des ventes d'actions	21 160	66 573	5 178	3 664	954 316	1 547 220	211	5 676
Produit net des distributions réinvesties	–	–	4	4	–	–	–	–
Coût des actions rachetées	(251 719)	(233 232)	(5 356)	(4 575)	(756 365)	(653 159)	(1 888)	(573)
Augmentation/(Baisse) de l'Actif net des transactions sur Actions participatives rachetables	(230 559)	(166 659)	(174)	(907)	197 951	894 061	(1 677)	5 103
Augmentation/(Baisse) des actifs nets imputables aux détenteurs d'actions participatives rachetables	(313 366)	(252 539)	(4 751)	4 590	40 664	954 091	(2 839)	4 929
ACTIF NET IMPUTABLE AUX DÉTENTEURS D'ACTIONS PARTICIPATIVES RACHETABLES								
Début de l'exercice	538 159	790 698	43 279	38 689	1 599 315	645 224	16 018	11 089
Écart de conversion	–	–	–	–	–	–	–	–
Fin de l'exercice	\$ 224 793	\$ 538 159	\$ 38 528	\$ 43 279	\$1 639 979	\$1 599 315	\$ 13 179	\$ 16 018

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund [^]		FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]		FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	
Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
\$ (37 260)	\$ (14 574)	\$ –	\$ –	\$ (228 800)	\$ (111 638)	\$ (469)	\$ 1 039	\$ (1 775)	\$ (1 692)
8 297	25 025	–	–	382 317	1 541 388	1 851	15 766	–	80
9	10	–	–	353	572	–	–	1	1
(10 296)	(351 786)	–	–	(551 638)	(275 534)	(7 012)	(16 439)	–	–
(1 990)	(326 751)	–	–	(168 968)	1 266 426	(5 161)	(673)	1	81
(39 250)	(341 325)	–	–	(397 768)	1 154 788	(5 630)	366	(1 774)	(1 611)
244 396	585 721	–	–	1 608 073	453 285	52 386	52 020	10 163	11 774
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
\$ 205 146	\$ 244 396	\$ –	\$ –	\$ 1 210 305	\$ 1 608 073	\$ 46 756	\$ 52 386	\$ 8 389	\$ 10 163
FTGF ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Growth Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund [^]		FTGF ClearBridge US Appreciation Fund		FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
\$ (20 757)	\$ 76 259	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (16 725)	\$ 22 201	\$ (266 780)	\$ 139 377
283 185	538 051	–	–	–	–	27 366	68 093	375 752	690 529
4	8	–	–	–	–	–	2	–	–
(224 944)	(231 165)	–	–	–	–	(34 511)	(82 824)	(655 932)	(868 263)
58 245	306 894	–	–	–	–	(7 145)	(14 729)	(280 180)	(177 734)
37 488	383 153	–	–	–	–	(23 870)	7 472	(546 960)	(38 357)
892 238	509 085	–	–	–	–	213 480	206 008	1 772 695	1 811 052
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
\$ 929 726	\$ 892 238	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 189 610	\$ 213 480	\$ 1 225 735	\$ 1 772 695
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		FTGF Royce US Smaller Companies Fund	
Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
€ (290)	€ 136 394	\$ (402)	\$ (73)	\$ (58 964)	\$ 4 644	\$ (51 831)	\$ 63 546	\$ (265)	\$ (585)
933 315	354 457	19	12	446 097	181 429	238 901	1 135 484	7 259	43 190
24	7	3	1	1 541	127	–	–	–	–
(541 640)	(424 447)	(2 285)	–	(156 020)	(12 806)	(361 750)	(1 571 691)	(16 831)	(45 766)
391 699	(69 983)	(2 263)	13	291 618	168 750	(122 849)	(436 207)	(9 572)	(2 576)
391 409	66 411	(2 665)	(60)	232 654	173 394	(174 680)	(372 661)	(9 837)	(3 161)
671 424	605 013	2 665	2 725	173 394	–	916 209	1 288 870	87 935	91 096
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
€ 1 062 833	€ 671 424	\$ –	\$ 2 665	\$ 406 048	\$ 173 394	\$ 741 529	\$ 916 209	\$ 78 098	\$ 87 935

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]		Legg Mason US Equity Fund [^]		Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^] _γ		FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	
	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
(en milliers)								
Hausse/(Baisse) de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables provenant des activités	\$ (294)	\$ (466)	\$ –	\$ –	€ (931)	€ 3 996	\$ (3 091)	\$ (14)
TRANSACTIONS SUR ACTIONS PARTICIPATIVES RACHETABLES								
Produit net des ventes d'actions	14	5 000	–	–	305	6 191	2 902	3 002
Produit net des distributions réinvesties	–	–	–	–	–	–	88	62
Coût des actions rachetées	–	–	–	–	(27 711)	(15 218)	(4 692)	(8 204)
Augmentation/(Baisse) de l'Actif net des transactions sur Actions participatives rachetables	14	5 000	–	–	(27 406)	(9 027)	(1 702)	(5 140)
Augmentation/(Baisse) des actifs nets imputables aux détenteurs d'actions participatives rachetables	(280)	4 534	–	–	(28 337)	(5 031)	(4 793)	(5 154)
ACTIF NET IMPUTABLE AUX DÉTENTEURS D'ACTIONS PARTICIPATIVES RACHETABLES								
Début de l'exercice	4 534	–	–	–	28 337	33 368	25 883	31 037
Écart de conversion	–	–	–	–	–	–	–	–
Fin de l'exercice	\$ 4 254	\$ 4 534	\$ –	\$ –	€ –	€ 28 337	\$ 21 090	\$ 25 883

	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund [^]		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund [^]	
	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
(en milliers)								
Hausse/(Baisse) de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables provenant des activités	\$ –	\$ –	€ –	€ 2 467	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
TRANSACTIONS SUR ACTIONS PARTICIPATIVES RACHETABLES								
Produit net des ventes d'actions	–	–	–	4 064	–	–	–	–
Produit net des distributions réinvesties	–	–	–	–	–	–	–	–
Coût des actions rachetées	–	–	–	(46 874)	–	–	–	–
Augmentation/(Baisse) de l'Actif net des transactions sur Actions participatives rachetables	–	–	–	(42 810)	–	–	–	–
Augmentation/(Baisse) des actifs nets imputables aux détenteurs d'actions participatives rachetables	–	–	–	(40 343)	–	–	–	–
ACTIF NET IMPUTABLE AUX DÉTENTEURS D'ACTIONS PARTICIPATIVES RACHETABLES								
Début de l'exercice	–	–	–	40 343	–	–	–	–
Écart de conversion	–	–	–	–	–	–	–	–
Fin de l'exercice	\$ –	\$ –	€ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –

	Franklin Templeton Global Funds Plc	
	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
(en milliers)		
Hausse/(Baisse) de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables provenant des activités	\$ (2 460 329)	\$ (594 896)
TRANSACTIONS SUR ACTIONS PARTICIPATIVES RACHETABLES		
Produit net des ventes d'actions	8 183 142	12 009 674
Produit net des distributions réinvesties	20 855	13 159
Coût des actions rachetées	(10 861 926)	(13 536 166)
Augmentation/(Baisse) de l'Actif net des transactions sur Actions participatives rachetables	(2 657 929)	(1 513 333)
Augmentation/(Baisse) des actifs nets imputables aux détenteurs d'actions participatives rachetables	(5 118 258)	(2 108 229)
ACTIF NET IMPUTABLE AUX DÉTENTEURS D'ACTIONS PARTICIPATIVES RACHETABLES		
Début de l'exercice	22 628 678	24 833 772
Écart de conversion	(82 390)	(96 865)
Fin de l'exercice	\$ 17 428 030	\$ 22 628 678

Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund^				Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^				Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^α				Legg Mason Japan Equity Fund^				FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^			
Pour l'exercice clos le 28 février 2023		Pour l'exercice clos le 28 février 2022		Pour l'exercice clos le 28 février 2023		Pour l'exercice clos le 28 février 2022		Pour l'exercice clos le 28 février 2023		Pour l'exercice clos le 28 février 2022		Pour l'exercice clos le 28 février 2023		Pour l'exercice clos le 28 février 2022		Pour l'exercice clos le 28 février 2023		Pour l'exercice clos le 28 février 2022	
\$	-	\$	-	\$	-	\$	(51)	\$	166	\$	1 336	¥	-	¥	-	\$	(980)	\$	(9 988)
		-				-		-		2 084				-		2 028		7 493	
		-				1		-		-				-		2		3	
		-				(14 689)		(12 709)		(3 562)				-		(13 630)		(61 470)	
		-				(14 688)		(12 709)		(1 478)				-		(11 600)		(53 974)	
		-				(14 739)		(12 543)		(142)				-		(12 580)		(63 962)	
		-				14 739		12 543		12 685				-		16 118		80 080	
		-				-		-		-				-		-		-	
\$	-	\$	-	\$	-	\$	-	\$	-	\$	12 543	¥	-	¥	-	\$	3 538	\$	16 118
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^				FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund				FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^				FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^				Franklin Responsible Income 2028 Fund^π			
Pour l'exercice clos le 28 février 2023		Pour l'exercice clos le 28 février 2022		Pour l'exercice clos le 28 février 2023		Pour l'exercice clos le 28 février 2022		Pour l'exercice clos le 28 février 2023		Pour l'exercice clos le 28 février 2022		Pour l'exercice clos le 28 février 2023		Pour l'exercice clos le 28 février 2022		Pour l'exercice clos le 28 février 2023		Pour l'exercice clos le 28 février 2022	
\$	(35 561)	\$	(21 672)	\$	(2 167)	\$	1 562	\$	(8 563)	\$	(9 415)	€	(28 951)	€	(21 118)	€	(644)	€	-
65 616		179 010		853		1 646		14 408		26 119		29 019		355 457		37 528		-	
-		-		285		308		-		-		-		-		-		-	
(58 387)		(92 306)		(1 784)		(2 158)		(18 981)		(10 667)		(114 561)		(142 120)		(61)		-	
7 229		86 704		(646)		(204)		(4 573)		15 452		(85 542)		213 337		37 467		-	
(28 332)		65 032		(2 813)		1 358		(13 136)		6 037		(114 493)		192 219		36 823		-	
169 381		104 349		27 934		26 576		47 838		41 801		303 590		111 371		-		-	
-		-		-		-		-		-		-		-		-		-	
\$	141 049	\$	169 381	\$	25 121	\$	27 934	\$	34 702	\$	47 838	€	189 097	€	303 590	€	36 823	€	-

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

Les montants désignés par «—» sont égaux à 0 USD / 0 EUR / 0 GBP / 0 YEN ou inférieurs à 1 000 USD / 1 000 EUR / 1 000 GBP / 1 000 YEN.

Tous les montants en euro, à l'exception de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables des fonds FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] et Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] ont été convertis en dollars US dans le chiffre total de Legg Mason Global Funds Plc pour l'exercice clos le 28 février 2023, au taux moyen USD/EUR de 0,9590 (28 février 2022 : 0,8551).

L'actif net au début de l'exercice attribuable aux détenteurs d'actions de participation rachetables des fonds FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] et FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] a été converti en dollars US dans le chiffre total au taux de clôture USD/EUR du 28 février 2022 de 0,8919 (28 février 2021 : 0,8288).

À l'exception des actifs nets du début de l'exercice attribuables aux détenteurs d'actions de participation rachetables, les montants en livre sterling du compartiment FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] ont été convertis en dollars US dans le chiffre total de Franklin Templeton Global Funds Plc pour l'exercice clos le 28 février 2023 au taux moyen USD/GBP de 0,8252 (28 février 2022 : 0,7289).

L'actif net du début de l'exercice imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables du compartiment FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] a été converti en dollars US dans le chiffre total au taux de clôture USD/GBP du 28 février 2022 de 0,7454 (28 février 2021 : 0,7178).

Reportez-vous à la Note 14, Événements importants pour plus de détails sur les changements de nom du fonds.

- α À compter du 27 avril 2022, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] a cessé ses activités.
- β À compter du 21 juin 2022, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] et Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] ont cessé leurs activités.
- γ À compter du 11 juillet 2022, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] a cessé ses activités.
- δ À compter du 10 octobre 2022, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^] a cessé ses activités.
- ε À compter du 17 novembre 2022, Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^] a cessé ses activités.
- λ À compter du 1er décembre 2022, FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] a commencé ses activités.
- μ À compter du 5 décembre 2022, Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^] a cessé ses activités.
- π À compter du 23 janvier 2023, Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] a commencé ses activités.
- τ À compter du 16 février 2023, Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^] a cessé ses activités.
- [^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	2 520	1 239
Rachat(s)	(2 240)	(1 446)
Hausse/(baisse) nette	280	(207)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A		
Vente(s)	888 333	727 110
Rachat(s)	(1 002 262)	(711 328)
(Baisse)/hausse nette	(113 929)	15 782
Actions de capitalisation en USD de catégorie B		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	–	(1)
Hausse nette	–	–
Actions de distribution (D) en USD de catégorie B		
Vente(s)	218	–
Rachat(s)	–	(300)
Hausse/(baisse) nette	218	(300)
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	–	5
Rachat(s)	(50)	(3)
(Baisse)/hausse nette	(50)	2
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C		
Vente(s)	1	104
Rachat(s)	(7)	(199)
Baisse nette	(6)	(95)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie X		
Vente(s)	541 654	620 936
Rachat(s)	(542 008)	(576 820)
(Baisse)/hausse nette	(354)	44 116
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie A		
Vente(s)	–	2
Rachat(s)	–	(2)
Hausse nette	–	–
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A (G)		
Vente(s)	73	83
Rachat(s)	(107)	(104)
Baisse nette	(34)	(21)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie L (G)		
Rachat(s)	–	(35)
Baisse nette	–	(35)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	63	102
Rachat(s)	(78)	(173)
Baisse nette	(15)	(71)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A		
Vente(s)	172	178
Rachat(s)	(556)	(192)
Baisse nette	(384)	(14)
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	18	42
Rachat(s)	(35)	(82)
Baisse nette	(17)	(40)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C		
Vente(s)	3	18
Rachat(s)	(9)	(60)
Baisse nette	(6)	(42)
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Vente(s)	5	1
Rachat(s)	(18)	(33)
Baisse nette	(13)	(32)
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	156	203
Rachat(s)	(329)	(377)
Baisse nette	(173)	(174)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie F		
Vente(s)	40	104
Rachat(s)	(48)	(146)
Baisse nette	(8)	(42)
Actions de capitalisation en USD de catégorie X		
Vente(s)	2	21
Rachat(s)	(2)	(35)
Baisse nette	–	(14)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie X		
Vente(s)	1	2
Rachat(s)	(1)	(2)
Hausse nette	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	16	4
Rachat(s)	(104)	(9)
Baisse nette	(88)	(5)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	1	24
Rachat(s)	(23)	(34)
Baisse nette	(22)	(10)
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM		
Vente(s)	5	39
Rachat(s)	–	(2)
Hausse nette	5	37
Actions de capitalisation en USD de catégorie GA		
Vente(s)	–	3
Rachat(s)	(1)	(4)
Baisse nette	(1)	(1)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	276	488
Rachat(s)	(294)	(905)
Baisse nette	(18)	(417)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A		
Vente(s)	138	151
Rachat(s)	(255)	(200)
Baisse nette	(117)	(49)
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A		
Vente(s)	10	17
Rachat(s)	(37)	(220)
Baisse nette	(27)	(203)
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	59	89
Rachat(s)	(37)	(22)
Hausse nette	22	67
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	9	8
Rachat(s)	(13)	(66)
Baisse nette	(4)	(58)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie B		
Rachat(s)	(1)	(1)
Baisse nette	(1)	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	24	28
Rachat(s)	(54)	(107)
Baisse nette	(30)	(79)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C		
Vente(s)	6	7
Rachat(s)	(19)	(31)
Baisse nette	(13)	(24)
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Vente(s)	39	78
Rachat(s)	(89)	(212)
Baisse nette	(50)	(134)
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	2 966	3 782
Rachat(s)	(3 556)	(1 893)
(Baisse)/hausse nette	(590)	1 889
Actions de distribution (D) en USD de catégorie F		
Vente(s)	28	85
Rachat(s)	(45)	(107)
Baisse nette	(17)	(22)
Actions de capitalisation en USD de catégorie X		
Vente(s)	11	85
Rachat(s)	(54)	(251)
Baisse nette	(43)	(166)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie X		
Vente(s)	8	57
Rachat(s)	(24)	(42)
(Baisse)/hausse nette	(16)	15

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund – (suite)		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	4	13
Rachat(s)	(27)	(125)
Baisse nette	(23)	(112)
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie X (couvertes)		
Rachat(s)	–	(4)
Baisse nette	–	(4)
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	1 800	1 083
Rachat(s)	(2 219)	(2 015)
Baisse nette	(419)	(932)
Actions de distribution (M) en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	5	13
Rachat(s)	(1)	–
Hausse nette	4	13
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	277	186
Rachat(s)	(146)	(571)
Hausse/(baisse) nette	131	(385)
Actions de distribution (M) en USD de catégorie LM		
Vente(s)	42	263
Rachat(s)	(78)	(21)
(Baisse)/hausse nette	(36)	242
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM		
Rachat(s)	(1)	(2)
Baisse nette	(1)	(2)
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	–	(1)
Hausse nette	–	–
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A (G)		
Vente(s)	–	2
Rachat(s)	(1)	(2)
Baisse nette	(1)	–
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A		
Rachat(s)	–	(2)
Baisse nette	–	(2)
Actions de distribution (D) en EUR de catégorie A		
Vente(s)	–	3
Rachat(s)	(2)	(3)
Baisse nette	(2)	–
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	–	(1)
Hausse nette	–	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier		
Vente(s)	88	31
Rachat(s)	(24)	(25)
Hausse nette	64	6
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM		
Vente(s)	–	381
Rachat(s)	(3)	(3)
(Baisse)/hausse nette	(3)	378
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GA		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund^{At}		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	9	254
Rachat(s)	(153)	(156)
(Baisse)/hausse nette	(144)	98
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A		
Vente(s)	9	84
Rachat(s)	(99)	(28)
(Baisse)/hausse nette	(90)	56
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(2)	(2)
Baisse nette	(2)	(1)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(3)	–
(Baisse)/hausse nette	(3)	1
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	1	5
Rachat(s)	(10)	(1)
(Baisse)/hausse nette	(9)	4
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A		
Vente(s)	7	1
Rachat(s)	(45)	(1)
Baisse nette	(38)	–
Actions de distribution (D) en USD de catégorie B		
Rachat(s)	(1)	–
Baisse nette	(1)	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	10	46
Rachat(s)	(57)	(21)
(Baisse)/hausse nette	(47)	25
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C		
Vente(s)	2	38
Rachat(s)	(48)	(13)
(Baisse)/hausse nette	(46)	25
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	–	33
Rachat(s)	(29)	(25)
(Baisse)/hausse nette	(29)	8
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	23	14
Rachat(s)	(23)	(16)
Baisse nette	–	(2)
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)		
Vente(s)	–	2
Rachat(s)	(5)	(2)
Baisse nette	(5)	–
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A (G)		
Vente(s)	1	2
Rachat(s)	(38)	(15)
Baisse nette	(37)	(13)
Actions de capitalisation en USD de catégorie L (G)		
Rachat(s)	(6)	–
Baisse nette	(6)	–
Actions de distribution (D) en USD de catégorie L (G)		
Rachat(s)	(2)	–
Baisse nette	(2)	–
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	25	79
Rachat(s)	(38)	(108)
Baisse nette	(13)	(29)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A		
Vente(s)	12	27
Rachat(s)	(17)	(148)
Baisse nette	(5)	(121)
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A		
Vente(s)	1	7
Rachat(s)	(2)	(10)
Baisse nette	(1)	(3)
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A		
Vente(s)	16	8
Rachat(s)	(22)	(11)
Baisse nette	(6)	(3)
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	3	–
Rachat(s)	(1)	–
Hausse nette	2	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	8	7
Rachat(s)	(12)	(24)
Baisse nette	(4)	(17)
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A (couvertes)		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – (suite)		
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	8	3
Rachat(s)	(10)	(13)
Baisse nette	(2)	(10)
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	1	1
Rachat(s)	(1)	(1)
Hausse nette	–	–
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A		
Rachat(s)	(5)	–
Baisse nette	(5)	–
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	116	823
Rachat(s)	(53)	(613)
Hausse nette	63	210
Actions de distribution (D) en USD de catégorie B		
Vente(s)	–	2
Rachat(s)	(2)	(1)
(Baisse)/hausse nette	(2)	1
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	11	16
Rachat(s)	(11)	(26)
Baisse nette	–	(10)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C		
Vente(s)	14	21
Rachat(s)	(27)	(29)
Baisse nette	(13)	(8)
Actions de distribution (M) Plus en ZAR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	7	732
Rachat(s)	(7)	(744)
Baisse nette	–	(12)
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Vente(s)	3	1
Rachat(s)	(4)	(4)
Baisse nette	(1)	(3)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie E		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	–	(2)
Baisse nette	–	(1)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	31	47
Rachat(s)	(45)	(42)
(Baisse)/hausse nette	(14)	5
Actions de distribution (D) en USD de catégorie F		
Vente(s)	–	3
Rachat(s)	–	(15)
Baisse nette	–	(12)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie X		
Vente(s)	–	2
Rachat(s)	(7)	(15)
Baisse nette	(7)	(13)
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	256	87
Rachat(s)	(298)	(124)
Baisse nette	(42)	(37)
Actions de distribution (M) en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	27	342
Rachat(s)	(129)	(308)
(Baisse)/hausse nette	(102)	34
Actions de capitalisation en CHF de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	522	13
Rachat(s)	(28)	–
Hausse nette	494	13
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	1	30
Rachat(s)	(21)	(32)
Baisse nette	(20)	(2)
Parts de Capitalisation en GBP de Classe Premier (couvertes)		
Rachat(s)	(266)	(70)
Baisse nette	(266)	(70)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	–	(1)
Hausse nette	–	–
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(15)	(168)
Baisse nette	(15)	(167)
Actions de capitalisation en PLN de Classe Premier (couvertes)		
Vente(s)	1	1
Rachat(s)	(27)	(83)
Baisse nette	(26)	(82)
Actions de distribution (M) en AUD de catégorie LM (couvertes)		
Vente(s)	72	387
Rachat(s)	(350)	(83)
(Baisse)/hausse nette	(278)	304
Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM (couvertes)		
Vente(s)	1	–
Rachat(s)	(1)	(1 360)
Baisse nette	–	(1 360)
FTGF Western Asset US High Yield Fund		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	32	235
Rachat(s)	(56)	(219)
(Baisse)/hausse nette	(24)	16
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A		
Vente(s)	108	280
Rachat(s)	(143)	(262)
(Baisse)/hausse nette	(35)	18
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A		
Vente(s)	2	69
Rachat(s)	(14)	(130)
Baisse nette	(12)	(61)
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A		
Vente(s)	5	15
Rachat(s)	(12)	(7)
(Baisse)/hausse nette	(7)	8
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	4	1
Hausse nette	4	1
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A		
Vente(s)	2	1
Rachat(s)	(2)	(1)
Hausse nette	–	–
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	22	629
Rachat(s)	(153)	(613)
(Baisse)/hausse nette	(131)	16
Actions de capitalisation en USD de catégorie B		
Vente(s)	–	2
Rachat(s)	(2)	–
(Baisse)/hausse nette	(2)	2
Actions de distribution (D) en USD de catégorie B		
Vente(s)	–	2
Rachat(s)	–	(12)
Baisse nette	–	(10)
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	9	4
Rachat(s)	(2)	(7)
Hausse/(baisse) nette	7	(3)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C		
Vente(s)	3	8
Rachat(s)	(7)	(9)
Baisse nette	(4)	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Vente(s)	7	4
Rachat(s)	(8)	(3)
(Baisse)/hausse nette	(1)	1
Actions de distribution (D) en USD de catégorie E		
Vente(s)	1	2
Rachat(s)	(5)	(2)
Baisse nette	(4)	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)		
Vente(s)	–	1
Hausse nette	–	1

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
FTGF Western Asset US High Yield Fund – (suite)		
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	18	47
Rachat(s)	(34)	(41)
(Baisse)/hausse nette	(16)	6
Actions de distribution (D) en USD de catégorie F		
Vente(s)	2	2
Rachat(s)	(1)	–
Hausse nette	1	2
Actions de capitalisation en USD de catégorie X		
Vente(s)	–	9
Rachat(s)	–	(9)
Hausse nette	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	405	469
Rachat(s)	(749)	(289)
(Baisse)/hausse nette	(344)	180
Parts de Capitalisation en GBP de Classe Premier (couvertes)		
Rachat(s)	–	(6)
Baisse nette	–	(6)
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM		
Rachat(s)	(232)	–
Baisse nette	(232)	–
Actions de distribution (M) en USD de catégorie LM		
Vente(s)	18	255
Rachat(s)	–	(158)
Hausse nette	18	97
Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM (couvertes)		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	–	(1)
Hausse nette	–	–
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A (G)		
Vente(s)	1	1
Rachat(s)	(1)	(2)
Baisse nette	–	(1)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie L (G)		
Vente(s)	1	1
Rachat(s)	(1)	(1)
Hausse nette	–	–
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^]δ		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	–	10
Rachat(s)	(32)	(22)
Baisse nette	(32)	(12)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A		
Vente(s)	–	2
Rachat(s)	(14)	(7)
Baisse nette	(14)	(5)
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A		
Vente(s)	19	–
Rachat(s)	(19)	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A		
Vente(s)	–	6
Rachat(s)	(10)	(7)
Baisse nette	(10)	(1)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(2)	(1)
Baisse nette	(2)	–
Actions de distribution (D) en EUR de catégorie A (couvertes)		
Rachat(s)	(4)	–
Baisse nette	(4)	–
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	112	10
Rachat(s)	(129)	(1)
(Baisse)/hausse nette	(17)	9
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Rachat(s)	(2)	–
Baisse nette	(2)	–

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C		
Rachat(s)	(10)	(4)
Baisse nette	(10)	(4)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie E		
Rachat(s)	(5)	(3)
Baisse nette	(5)	(3)
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie E (couvertes)		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Rachat(s)	(1)	–
Baisse nette	(1)	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	–	5
Rachat(s)	(15)	(11)
Baisse nette	(15)	(6)
Actions de distribution (D) en GBP de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(1)	–
(Baisse)/hausse nette	(1)	1
Actions de distribution (M) en USD de catégorie LM (couvertes)		
Vente(s)	105	288
Rachat(s)	(393)	–
(Baisse)/hausse nette	(288)	288
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie A		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(3)	(2)
Baisse nette	(3)	(1)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A (G)		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(9)	(2)
Baisse nette	(9)	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie L (G)		
Rachat(s)	(7)	–
Baisse nette	(7)	–
Actions de distribution (D) en USD de catégorie L (G)		
Rachat(s)	(10)	–
Baisse nette	(10)	–
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^]β		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	–	(1)
Hausse nette	–	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	–	38
Rachat(s)	(18)	(24)
(Baisse)/hausse nette	(18)	14
Actions de distribution (M) en USD de catégorie LM		
Vente(s)	4	57
Rachat(s)	(290)	(155)
Baisse nette	(286)	(98)
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	10	32
Rachat(s)	(25)	(41)
Baisse nette	(15)	(9)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A		
Vente(s)	17	24
Rachat(s)	(22)	(47)
Baisse nette	(5)	(23)
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A		
Vente(s)	11	116
Rachat(s)	(73)	(68)
(Baisse)/hausse nette	(62)	48
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A		
Vente(s)	58	32
Rachat(s)	(75)	(48)
Baisse nette	(17)	(16)

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – (suite)		
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	55	29
Rachat(s)	(70)	(34)
Baisse nette	(15)	(5)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A		
Vente(s)	5	17
Rachat(s)	(2)	(16)
Hausse nette	3	1
Actions de distribution (D) en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	1	–
Rachat(s)	–	(5)
Hausse/(baisse) nette	1	(5)
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	525	2 905
Rachat(s)	(855)	(16 116)
Baisse nette	(330)	(13 211)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie B		
Vente(s)	–	3
Rachat(s)	(3)	(4)
Baisse nette	(3)	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	1	2
Rachat(s)	(4)	(2)
Baisse nette	(3)	–
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C		
Vente(s)	–	5
Rachat(s)	(3)	(25)
Baisse nette	(3)	(20)
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Vente(s)	1	4
Rachat(s)	(1)	(3)
Hausse nette	–	1
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	13	13
Rachat(s)	(7)	(2)
Hausse nette	6	11
Actions de distribution (D) en USD de catégorie F		
Vente(s)	2	39
Rachat(s)	(6)	(38)
(Baisse)/hausse nette	(4)	1
Actions de distribution (D) en USD de catégorie X		
Vente(s)	5	32
Rachat(s)	(12)	(8)
(Baisse)/hausse nette	(7)	24
Actions de distribution (D) en GBP de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	10	19
Rachat(s)	(7)	(3)
Hausse nette	3	16
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	–	56
Rachat(s)	(29)	(91)
Baisse nette	(29)	(35)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	8	3
Rachat(s)	(1)	(2)
Hausse nette	7	1
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie A		
Vente(s)	–	3
Rachat(s)	(1)	(3)
Baisse nette	(1)	–
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A (G)		
Vente(s)	1	2
Rachat(s)	(2)	(13)
Baisse nette	(1)	(11)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie L (G)		
Vente(s)	1	1
Rachat(s)	–	(1)
Hausse nette	1	–
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^µ		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	18	14
Rachat(s)	(41)	(4)
(Baisse)/hausse nette	(23)	10

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A		
Vente(s)	7	22
Rachat(s)	(43)	(28)
Baisse nette	(36)	(6)
Actions de capitalisation en USD de catégorie B		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	1	2
Rachat(s)	(2)	(1)
(Baisse)/hausse nette	(1)	1
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C		
Vente(s)	–	2
Rachat(s)	(6)	–
(Baisse)/hausse nette	(6)	2
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	11	–
Rachat(s)	(11)	–
Hausse nette	–	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	12	72
Rachat(s)	(75)	(9)
(Baisse)/hausse nette	(63)	63
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM		
Rachat(s)	(369)	–
Baisse nette	(369)	–

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	57	117
Rachat(s)	(102)	(145)
Baisse nette	(45)	(28)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A		
Vente(s)	6	12
Rachat(s)	(9)	(18)
Baisse nette	(3)	(6)
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A		
Vente(s)	89	150
Rachat(s)	(241)	(561)
Baisse nette	(152)	(411)
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A		
Vente(s)	28	13
Rachat(s)	(50)	(82)
Baisse nette	(22)	(69)
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	127	34
Rachat(s)	(200)	(158)
Baisse nette	(73)	(124)
Actions de capitalisation en CHF de catégorie A (couvertes)		
Rachat(s)	–	(5)
Baisse nette	–	(5)
Actions de distribution (M) Plus en CNH de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	53	53
Rachat(s)	(117)	(240)
Baisse nette	(64)	(187)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	5	6
Rachat(s)	(10)	(14)
Baisse nette	(5)	(8)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A		
Vente(s)	2	5
Rachat(s)	(5)	(12)
Baisse nette	(3)	(7)
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A		
Vente(s)	64	145
Rachat(s)	(358)	(1 076)
Baisse nette	(294)	(931)
Classe de Capitalisation en SGD de Classe A (couvertes)		
Vente(s)	34	94
Rachat(s)	(540)	(348)
Baisse nette	(506)	(254)

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – (suite)		
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	254	3 739
Rachat(s)	(1 658)	(5 937)
Baisse nette	(1 404)	(2 198)
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A		
Vente(s)	603	4 131
Rachat(s)	(1 017)	(4 100)
(Baisse)/hausse nette	(414)	31
Actions de distribution (D) en USD de catégorie B		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Rachat(s)	(1)	(3)
Baisse nette	(1)	(3)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	–	(9)
Baisse nette	–	(8)
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Vente(s)	1	1
Rachat(s)	(1)	(3)
Baisse nette	–	(2)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie E		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	–	(1)
Hausse nette	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	6	9
Rachat(s)	(7)	(67)
Baisse nette	(1)	(58)
Actions de capitalisation en USD de catégorie X		
Vente(s)	–	2
Rachat(s)	(2)	(70)
Baisse nette	(2)	(68)
Actions de distribution (M) en USD de catégorie X		
Vente(s)	1	3
Rachat(s)	(26)	–
(Baisse)/hausse nette	(25)	3
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	–	(1)
Hausse nette	–	–
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X		
Rachat(s)	–	(5)
Baisse nette	–	(5)
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	156	73
Rachat(s)	(56)	(110)
Hausse/(baisse) nette	100	(37)
Actions de distribution (M) en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	39	40
Rachat(s)	(26)	(42)
Hausse/(baisse) nette	13	(2)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	51	52
Rachat(s)	(44)	(30)
Hausse nette	7	22
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier		
Vente(s)	–	168
Rachat(s)	–	(157)
Hausse nette	–	11
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie Premier		
Vente(s)	–	218
Rachat(s)	–	(228)
Baisse nette	–	(10)
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie Premier		
Vente(s)	–	102
Rachat(s)	–	(102)
Hausse nette	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM		
Rachat(s)	(84)	(12)
Baisse nette	(84)	(12)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Actions de distribution (M) en USD de catégorie LM		
Vente(s)	59	–
Rachat(s)	(10)	–
Hausse nette	49	–
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie LM (couvertes)		
Vente(s)	15	10
Rachat(s)	(10)	–
Hausse nette	5	10
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	225	108
Rachat(s)	(147)	(179)
Hausse/(baisse) nette	78	(71)
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A		
Vente(s)	30	65
Rachat(s)	(19)	(97)
Hausse/(baisse) nette	11	(32)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	197	62
Rachat(s)	(66)	(72)
Hausse/(baisse) nette	131	(10)
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	3	–
Hausse nette	3	–
Actions de capitalisation en SEK de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	1 454	2 641
Rachat(s)	(2 223)	(446)
(Baisse)/hausse nette	(769)	2 195
Actions de capitalisation en USD de catégorie B		
Vente(s)	1	–
Rachat(s)	–	(3)
Hausse/(baisse) nette	1	(3)
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	12	42
Rachat(s)	(49)	(14)
(Baisse)/hausse nette	(37)	28
Actions de distribution (M) en USD de catégorie C		
Vente(s)	37	2
Rachat(s)	(5)	(1)
Hausse nette	32	1
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Vente(s)	19	16
Rachat(s)	(17)	(21)
Hausse/(baisse) nette	2	(5)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie E		
Vente(s)	1	–
Rachat(s)	–	(3)
Hausse/(baisse) nette	1	(3)
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	12	47
Rachat(s)	(44)	(89)
Baisse nette	(32)	(42)
Actions de distribution (D) en USD de catégorie F		
Vente(s)	1	16
Rachat(s)	(3)	(1)
(Baisse)/hausse nette	(2)	15
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	48	88
Rachat(s)	(46)	(28)
Hausse nette	2	60
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	334	223
Rachat(s)	(339)	(189)
(Baisse)/hausse nette	(5)	34
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	666	170
Rachat(s)	(287)	(190)
Hausse/(baisse) nette	379	(20)
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	2	–
Rachat(s)	(4)	(2)
Baisse nette	(2)	(2)

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – (suite)		
Parts de Capitalisation en GBP de Classe Premier (couvertes)		
Vente(s)	4	–
Hausse nette	4	–
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	1	1
Rachat(s)	(10)	(9)
Baisse nette	(9)	(8)
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie S		
Vente(s)	272	10
Rachat(s)	(70)	(121)
Hausse/(baisse) nette	202	(111)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(1)	–
(Baisse)/hausse nette	(1)	1
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie S (couvertes)		
Vente(s)	49	4
Rachat(s)	(8)	(10)
Hausse/(baisse) nette	41	(6)
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie S (couvertes)		
Vente(s)	1 035	337
Rachat(s)	(454)	(756)
Hausse/(baisse) nette	581	(419)
Classe de Capitalisation en AUD de Classe LM (couvertes)		
Vente(s)	–	155
Hausse nette	–	155
Actions de distribution (M) Plus (e) en AUD de catégorie S (couvertes)		
Rachat(s)	–	(20)
Baisse nette	–	(20)
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^		
Actions de capitalisation en USD de catégorie X		
Vente(s)	–	24
Rachat(s)	(7)	(1)
(Baisse)/hausse nette	(7)	23
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	84	176
Rachat(s)	(179)	(644)
Baisse nette	(95)	(468)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	124	53
Rachat(s)	(238)	(62)
Baisse nette	(114)	(9)
Actions de capitalisation en NZD de catégorie Premier (couvertes)		
Rachat(s)	–	(42)
Baisse nette	–	(42)
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM		
Vente(s)	6	13
Rachat(s)	(2)	(10)
Hausse nette	4	3
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM (couvertes)		
Vente(s)	25	24
Rachat(s)	(27)	(1)
(Baisse)/hausse nette	(2)	23
FTGF Western Asset Global Credit Fund^		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	1	15
Rachat(s)	(6)	(5)
(Baisse)/hausse nette	(5)	10
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	2	1
Rachat(s)	(2)	(2)
Baisse nette	–	(1)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(1)	–
(Baisse)/hausse nette	(1)	1
Parts de Capitalisation en GBP de Classe Premier (couvertes)		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(1)	–
(Baisse)/hausse nette	(1)	1
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM		
Vente(s)	–	2
Rachat(s)	(152)	(23)
Baisse nette	(152)	(21)

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM (couvertes)		
Vente(s)	6	9
Rachat(s)	(2)	(5)
Hausse nette	4	4
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^β		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM		
Rachat(s)	(205)	(43)
Baisse nette	(205)	(43)
Actions de distribution (Q) en EUR de catégorie LM		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	–	(83)
Baisse nette	–	(82)
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	422	2 007
Rachat(s)	(3 118)	(3 791)
Baisse nette	(2 696)	(1 784)
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A		
Vente(s)	432	879
Rachat(s)	(1 059)	(1 679)
Baisse nette	(627)	(800)
Actions de distribution (S) en USD de catégorie A		
Vente(s)	43	196
Rachat(s)	(140)	(398)
Baisse nette	(97)	(202)
Actions de capitalisation en AUD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	1	2
Rachat(s)	(2)	(25)
Baisse nette	(1)	(23)
Actions de distribution (M) Plus (e) en AUD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	18	41
Rachat(s)	(103)	(267)
Baisse nette	(85)	(226)
Actions de capitalisation en CHF de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	7	19
Rachat(s)	(96)	(56)
Baisse nette	(89)	(37)
Actions de capitalisation en CNH de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	7	22
Rachat(s)	(7)	(58)
Baisse nette	–	(36)
Actions de distribution (M) Plus (e) en CNH de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	–	71
Rachat(s)	(82)	(78)
Baisse nette	(82)	(7)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	779	1 392
Rachat(s)	(2 137)	(2 029)
Baisse nette	(1 358)	(637)
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A		
Vente(s)	6	23
Rachat(s)	(24)	(45)
Baisse nette	(18)	(22)
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	6	26
Rachat(s)	(18)	(68)
Baisse nette	(12)	(42)
Actions de distribution (S) en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	10	23
Rachat(s)	(9)	(61)
Hausse/(baisse) nette	1	(38)
Actions de capitalisation en GBP de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	2	42
Rachat(s)	(98)	(339)
Baisse nette	(96)	(297)
Classe de capitalisation en GBP de catégorie A		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(1)	(1)
Baisse nette	(1)	–
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	5	25
Rachat(s)	(15)	(82)
Baisse nette	(10)	(57)

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – (suite)		
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A		
Vente(s)	–	39
Rachat(s)	–	(97)
Baisse nette	–	(58)
Actions de Capitalisation en SEK de Classe A (couvertes)		
Vente(s)	33	166
Rachat(s)	(172)	(4 643)
Baisse nette	(139)	(4 477)
Classe de Capitalisation en SGD de Classe A (couvertes)		
Vente(s)	–	27 402
Rachat(s)	(12 989)	(25 220)
(Baisse)/hausse nette	(12 989)	2 182
Actions de distribution (M) Plus (e) en SGD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	2 598	13 149
Rachat(s)	(18 843)	(39 116)
Baisse nette	(16 245)	(25 967)
Actions de distribution (M) Plus (e) en SGD de catégorie A		
Vente(s)	–	50
Hausse nette	–	50
Actions de capitalisation en USD de catégorie B		
Rachat(s)	–	(3)
Baisse nette	–	(3)
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	36	164
Rachat(s)	(127)	(343)
Baisse nette	(91)	(179)
Actions de distribution (S) en USD de catégorie C		
Vente(s)	1	6
Rachat(s)	(13)	(23)
Baisse nette	(12)	(17)
Actions de distribution (M) Plus (e) en JPY de catégorie A		
Vente(s)	2	–
Rachat(s)	(2)	–
Hausse nette	–	–
Actions de capitalisation en NOK de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	379	594
Rachat(s)	(326)	(185)
Hausse nette	53	409
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Vente(s)	18	57
Rachat(s)	(50)	(158)
Baisse nette	(32)	(101)
Actions de distribution (S) en USD de catégorie E		
Vente(s)	2	4
Rachat(s)	(7)	(9)
Baisse nette	(5)	(5)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)		
Vente(s)	1	3
Rachat(s)	(10)	(38)
Baisse nette	(9)	(35)
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	157	476
Rachat(s)	(711)	(784)
Baisse nette	(554)	(308)
Actions de distribution (S) en USD de catégorie F		
Vente(s)	5	78
Rachat(s)	(43)	(71)
(Baisse)/hausse nette	(38)	7
Actions de capitalisation en USD de catégorie X		
Vente(s)	113	469
Rachat(s)	(809)	(892)
Baisse nette	(696)	(423)
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie X		
Vente(s)	24	163
Rachat(s)	(223)	(295)
Baisse nette	(199)	(132)
Actions de distribution (S) en USD de catégorie X		
Vente(s)	9	67
Rachat(s)	(83)	(99)
Baisse nette	(74)	(32)
Actions de Capitalisation en CHF de Classe X (couvertes)		
Vente(s)	49	52
Rachat(s)	(180)	(107)
Baisse nette	(131)	(55)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	1 583	374
Rachat(s)	(2 307)	(734)
Baisse nette	(724)	(360)
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X		
Vente(s)	1	9
Rachat(s)	(18)	(82)
Baisse nette	(17)	(73)
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	39	148
Rachat(s)	(42)	(165)
Baisse nette	(3)	(17)
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	–	8
Rachat(s)	(38)	(10)
Baisse nette	(38)	(2)
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	56	135
Rachat(s)	(232)	(319)
Baisse nette	(176)	(184)
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X		
Vente(s)	–	3
Rachat(s)	(3)	(17)
Baisse nette	(3)	(14)
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	3	27
Rachat(s)	(40)	(39)
Baisse nette	(37)	(12)
Classe de capitalisation en SGD de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	1 105	1 560
Rachat(s)	(1 369)	(1 457)
(Baisse)/hausse nette	(264)	103
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	984	745
Rachat(s)	(1 350)	(3 017)
Baisse nette	(366)	(2 272)
Actions de distribution (S) en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	10	333
Rachat(s)	(304)	(674)
Baisse nette	(294)	(341)
Actions de capitalisation en AUD de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	1	–
Rachat(s)	(17)	(27)
Baisse nette	(16)	(27)
Actions de distribution (S) en AUD de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	13	111
Rachat(s)	(574)	(153)
Baisse nette	(561)	(42)
Classe de Capitalisation en BRL de Classe Premier (couvertes)		
Vente(s)	92	213
Rachat(s)	(3 104)	(1 727)
Baisse nette	(3 012)	(1 514)
Actions de capitalisation en CHF de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	8	49
Rachat(s)	(112)	(80)
Baisse nette	(104)	(31)
Actions de distribution (S) en CHF de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	9	25
Rachat(s)	(20)	(20)
(Baisse)/hausse nette	(11)	5
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	1 114	3 637
Rachat(s)	(2 581)	(4 003)
Baisse nette	(1 467)	(366)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier		
Vente(s)	12	89
Rachat(s)	(60)	(114)
Baisse nette	(48)	(25)
Actions de distribution (S) en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	318	124
Rachat(s)	(98)	(826)
Hausse/(baisse) nette	220	(702)
Parts de Capitalisation en GBP de Classe Premier (couvertes)		
Vente(s)	21	147
Rachat(s)	(513)	(1 148)
Baisse nette	(492)	(1 001)

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – (suite)		
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	71	556
Rachat(s)	(1 114)	(2 011)
Baisse nette	(1 043)	(1 455)
Actions de capitalisation en JPY de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	101	38
Rachat(s)	(165)	(92)
Baisse nette	(64)	(54)
Actions de distribution (S) en JPY de catégorie Premier (couvertes)		
Rachat(s)	(100)	–
Baisse nette	(100)	–
Actions de capitalisation en PLN de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	24	–
Rachat(s)	(35)	(74)
Baisse nette	(11)	(74)
Actions de capitalisation en SEK de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(1)	(12)
Baisse nette	(1)	(11)
Actions de capitalisation en USD de catégorie S		
Rachat(s)	(83)	(14)
Baisse nette	(83)	(14)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)		
Vente(s)	–	1 215
Rachat(s)	(9)	(1 404)
Baisse nette	(9)	(189)
Actions de distribution (S) en AUD de catégorie LM (couvertes)		
Vente(s)	72	237
Rachat(s)	(738)	(432)
Baisse nette	(666)	(195)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM		
Vente(s)	1	1
Rachat(s)	(2)	(2)
Baisse nette	(1)	(1)
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(1)	–
(Baisse)/hausse nette	(1)	1
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A		
Vente(s)	–	1
Hausse nette	–	1
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	19	59
Rachat(s)	(50)	(81)
Baisse nette	(31)	(22)
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes)		
Rachat(s)	(3)	–
Baisse nette	(3)	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie S		
Vente(s)	1	7
Rachat(s)	(3)	(7)
Baisse nette	(2)	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)		
Vente(s)	40	99
Rachat(s)	(31)	(87)
Hausse nette	9	12
Actions de capitalisation en GBP de catégorie S (couvertes)		
Vente(s)	50	58
Rachat(s)	(29)	(18)
Hausse nette	21	40
Classe de Capitalisation en AUD de Classe LM (couvertes)		
Vente(s)	–	227
Rachat(s)	(1 230)	(57)
(Baisse)/hausse nette	(1 230)	170
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM (couvertes)		
Vente(s)	25	340
Rachat(s)	(65)	(269)
(Baisse)/hausse nette	(40)	71
Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM (couvertes)		
Vente(s)	418	99
Rachat(s)	(206)	(4 253)
Hausse/(baisse) nette	212	(4 154)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Actions de capitalisation en CAD de catégorie LM (couvertes)		
Vente(s)	271	–
Rachat(s)	(9)	–
Hausse nette	262	–
Actions de distribution (A) en CHF de catégorie S (couvertes)		
Vente(s)	40	–
Hausse nette	40	–
Actions de distribution (A) en CHF de catégorie S		
Vente(s)	–	200
Hausse nette	–	200
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie D (couvertes)		
Vente(s)	14	6
Rachat(s)	(10)	(8)
Hausse/(baisse) nette	4	(2)
Actions de capitalisation en USD de catégorie D		
Vente(s)	3	–
Rachat(s)	(17)	(91)
Baisse nette	(14)	(91)
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie D		
Rachat(s)	–	(107)
Baisse nette	–	(107)
Actions de distribution (M) en USD de catégorie D		
Vente(s)	2	3
Rachat(s)	(2)	(256)
Baisse nette	–	(253)
Actions de capitalisation en CHF de catégorie M (couvertes)		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(10)	(6)
Baisse nette	(10)	(5)
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie M (couvertes)		
Rachat(s)	(6)	–
Baisse nette	(6)	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Rachat(s)	(4)	–
Baisse nette	(4)	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie M		
Rachat(s)	(7)	(8)
Baisse nette	(7)	(8)
Actions de distribution (M) en USD de catégorie M		
Vente(s)	1	1
Rachat(s)	(1)	(10)
Baisse nette	–	(9)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie M (couvertes)		
Vente(s)	–	8
Rachat(s)	(8)	–
(Baisse)/hausse nette	(8)	8
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	82	299
Rachat(s)	(1 417)	(456)
Baisse nette	(1 335)	(157)
Actions de distribution (Q) en USD de catégorie Premier		
Rachat(s)	(7)	(22)
Baisse nette	(7)	(22)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	8	750
Rachat(s)	(1 094)	(1 241)
Baisse nette	(1 086)	(491)
Actions de distribution (Q) en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	3	34
Rachat(s)	(175)	(110)
Baisse nette	(172)	(76)
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	–	17
Rachat(s)	(105)	(5)
(Baisse)/hausse nette	(105)	12
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM		
Vente(s)	–	708
Rachat(s)	(705)	(11)
(Baisse)/hausse nette	(705)	697

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	585	–
Rachat(s)	–	(18)
Hausse/(baisse) nette	585	(18)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	19	7
Rachat(s)	(25)	(29)
Baisse nette	(6)	(22)
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM		
Vente(s)	266	3 160
Hausse nette	266	3 160
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM		
Rachat(s)	(637)	–
Baisse nette	(637)	–
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie LM		
Vente(s)	700	–
Rachat(s)	(196)	–
Hausse nette	504	–
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	–	2
Rachat(s)	(4)	(72)
Baisse nette	(4)	(70)
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	7	197
Rachat(s)	(14)	(158)
(Baisse)/hausse nette	(7)	39
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	31	7
Rachat(s)	(38)	(10)
Baisse nette	(7)	(3)
Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM (couvertes)		
Rachat(s)	(951)	–
Baisse nette	(951)	–
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie LM (couvertes)		
Vente(s)	1 075	–
Rachat(s)	(371)	–
Hausse nette	704	–
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund^		
Actions de distribution (Q) en USD de catégorie LM		
Vente(s)	12	18
Rachat(s)	(6)	–
Hausse nette	6	18
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	–	25
Hausse nette	–	25
Classe de Capitalisation en BRL de Classe Premier (couvertes)		
Vente(s)	–	142
Rachat(s)	(2)	–
(Baisse)/hausse nette	(2)	142
Actions de capitalisation en USD de catégorie S		
Vente(s)	–	48
Hausse nette	–	48
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	8	38
Rachat(s)	(16)	(73)
Baisse nette	(8)	(35)
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A		
Rachat(s)	–	(3)
Baisse nette	–	(3)
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A		
Vente(s)	12	3
Rachat(s)	(17)	(7)
Baisse nette	(5)	(4)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Actions de distribution (S) en USD de catégorie A		
Vente(s)	35	32
Rachat(s)	(39)	(45)
Baisse nette	(4)	(13)
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)		
Rachat(s)	–	(3)
Baisse nette	–	(3)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes) (IH)		
Vente(s)	9	22
Rachat(s)	(54)	(102)
Baisse nette	(45)	(80)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	5	7
Rachat(s)	(6)	(2)
(Baisse)/hausse nette	(1)	5
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A (couvertes)		
Rachat(s)	(2)	(2)
Baisse nette	(2)	(2)
Actions de distribution (S) en EUR de catégorie A (couvertes) (IH)		
Vente(s)	2	2
Rachat(s)	(5)	(19)
Baisse nette	(3)	(17)
Actions de distribution (S) en EUR de catégorie A		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	1	2
Rachat(s)	–	(3)
Hausse/(baisse) nette	1	(1)
Actions de distribution (S) en GBP de catégorie A (couvertes) (IH)		
Vente(s)	5	8
Rachat(s)	(10)	(18)
Baisse nette	(5)	(10)
Classe de capitalisation en SGD de catégorie A		
Vente(s)	5	3 290
Rachat(s)	(1)	(3 362)
Hausse/(baisse) nette	4	(72)
Actions de distribution (S) en USD de catégorie B		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	–	5
Rachat(s)	(1)	(9)
Baisse nette	(1)	(4)
Actions de distribution (S) en USD de catégorie C		
Vente(s)	–	2
Rachat(s)	(1)	(9)
Baisse nette	(1)	(7)
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Vente(s)	3	2
Rachat(s)	(1)	(8)
Hausse/(baisse) nette	2	(6)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes) (IH)		
Rachat(s)	(1)	(5)
Baisse nette	(1)	(5)
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	2	2
Rachat(s)	(10)	(1)
(Baisse)/hausse nette	(8)	1
Actions de distribution (S) en USD de catégorie F		
Vente(s)	–	2
Rachat(s)	(1)	(2)
Baisse nette	(1)	–
Actions de distribution (S) en GBP de catégorie R (couvertes) (IH)		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie X		
Vente(s)	59	6
Rachat(s)	(62)	(5)
(Baisse)/hausse nette	(3)	1
Actions de distribution (S) en USD de catégorie X		
Vente(s)	–	3
Rachat(s)	(2)	(4)
Baisse nette	(2)	(1)

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – (suite)		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes) (IH)		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(8)	(2)
Baisse nette	(8)	(1)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	1	–
Rachat(s)	(1)	(3)
Baisse nette	–	(3)
Actions de distribution (S) en EUR de catégorie X (couvertes) (IH)		
Rachat(s)	(5)	(5)
Baisse nette	(5)	(5)
Actions de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes) (IH)		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(1)	(2)
Baisse nette	(1)	(1)
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	33	91
Rachat(s)	(130)	(131)
Baisse nette	(97)	(40)
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X		
Vente(s)	142	71
Rachat(s)	(178)	(80)
Baisse nette	(36)	(9)
Actions de distribution (S) en GBP de catégorie X (couvertes) (IH)		
Vente(s)	9	22
Rachat(s)	(21)	(87)
Baisse nette	(12)	(65)
Actions de distribution (S) en GBP de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	15	32
Rachat(s)	(38)	(108)
Baisse nette	(23)	(76)
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	–	7
Rachat(s)	(6)	(154)
Baisse nette	(6)	(147)
Actions de distribution (S) en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	1	–
Rachat(s)	(10)	(1)
Baisse nette	(9)	(1)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes) (IH)		
Vente(s)	20	9
Rachat(s)	(63)	(168)
Baisse nette	(43)	(159)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	43	–
Rachat(s)	(20)	(338)
Hausse/(baisse) nette	23	(338)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier		
Vente(s)	2	1
Rachat(s)	(6)	(7)
Baisse nette	(4)	(6)
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie Premier (couvertes)		
Rachat(s)	(2)	(2)
Baisse nette	(2)	(2)
Actions de distribution (S) en GBP de catégorie Premier (couvertes) (IH)		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(7)	(5)
Baisse nette	(7)	(4)
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM (couvertes) (IH)		
Vente(s)	187	107
Rachat(s)	(38)	(41)
Hausse nette	149	66
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM		
Vente(s)	5	11
Rachat(s)	–	(20)
Hausse/(baisse) nette	5	(9)
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	2	1
Rachat(s)	(3)	(1)
Baisse nette	(1)	–

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A		
Vente(s)	–	2
Rachat(s)	–	(2)
Hausse nette	–	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	1	1
Rachat(s)	(3)	–
(Baisse)/hausse nette	(2)	1
Actions de capitalisation en SGD de catégorie A		
Vente(s)	11 942	176
Rachat(s)	(11 941)	(176)
Hausse nette	1	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(1)	(1)
Baisse nette	(1)	–
Actions de distribution (A) en USD de catégorie E		
Rachat(s)	–	(3)
Baisse nette	–	(3)
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Rachat(s)	(2)	–
Baisse nette	(2)	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie X		
Vente(s)	–	1
Hausse nette	–	1
Actions de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	–	4
Rachat(s)	(4)	–
(Baisse)/hausse nette	(4)	4
Actions de Distribution (M) en GBP de Classe X (couvertes)		
Vente(s)	4	1
Rachat(s)	(1)	(2)
Hausse/(baisse) nette	3	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	1 645	184
Rachat(s)	(343)	(14)
Hausse nette	1 302	170
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	592	20
Rachat(s)	(268)	(47)
Hausse/(baisse) nette	324	(27)
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	7	6
Rachat(s)	–	(57)
Hausse/(baisse) nette	7	(51)
Actions de capitalisation en SEK de catégorie Premier (couvertes)		
Rachat(s)	–	(15)
Baisse nette	–	(15)
Actions de capitalisation en SGD de catégorie Premier (couvertes)		
Rachat(s)	–	(151 908)
Baisse nette	–	(151 908)
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM		
Rachat(s)	–	(43)
Baisse nette	–	(43)
Actions de capitalisation en AUD de catégorie LM (couvertes)		
Vente(s)	–	1 795
Rachat(s)	(3 246)	–
(Baisse)/hausse nette	(3 246)	1 795
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	–	2
Hausse nette	–	2
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Rachat(s)	–	(4)
Baisse nette	–	(4)
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier (couvertes) (IH)		
Rachat(s)	(1)	–
Baisse nette	(1)	–
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	11	18
Rachat(s)	(8)	(15)
Hausse nette	3	3

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund – (suite)		
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A		
Vente(s)	1	2
Rachat(s)	(1)	(1)
Hausse nette	–	1
Actions de capitalisation en SGD de catégorie A		
Vente(s)	10	11 856
Rachat(s)	(41)	(11 977)
Baisse nette	(31)	(121)
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(9)	(2)
Baisse nette	(9)	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Rachat(s)	–	(2)
Baisse nette	–	(2)
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	–	18
Rachat(s)	(3)	(23)
Baisse nette	(3)	(5)
Actions de distribution (M) en USD de catégorie F		
Rachat(s)	–	(9)
Baisse nette	–	(9)
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie X (couvertes) (IH)		
Vente(s)	–	10
Rachat(s)	–	(7)
Hausse nette	–	3
Actions de Distribution (M) en GBP de Classe X (couvertes)		
Vente(s)	2	3
Rachat(s)	(3)	(1)
(Baisse)/hausse nette	(1)	2
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier (couvertes) (IH)		
Rachat(s)	–	(7)
Baisse nette	–	(7)
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	56	83
Rachat(s)	(56)	(940)
Baisse nette	–	(857)
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie Premier (couvertes) (IH)		
Vente(s)	1	–
Rachat(s)	–	(5)
Hausse/(baisse) nette	1	(5)
Actions de capitalisation en NZD de catégorie Premier (couvertes) (IH)		
Vente(s)	3	2
Hausse nette	3	2
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM		
Vente(s)	1	2
Rachat(s)	(3)	(5)
Baisse nette	(2)	(3)
Actions de capitalisation en NZD de catégorie LM (couvertes) (IH)		
Vente(s)	4	99
Rachat(s)	(6)	(1 579)
Baisse nette	(2)	(1 480)
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	418	1 529
Rachat(s)	(566)	(495)
(Baisse)/hausse nette	(148)	1 034
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A		
Vente(s)	9	14
Rachat(s)	(11)	(3)
(Baisse)/hausse nette	(2)	11
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A		
Vente(s)	58	208
Rachat(s)	(163)	(47)
(Baisse)/hausse nette	(105)	161
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A		
Vente(s)	133	1 486
Rachat(s)	(568)	(404)
(Baisse)/hausse nette	(435)	1 082
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A		
Vente(s)	232	773
Rachat(s)	(489)	(58)
(Baisse)/hausse nette	(257)	715

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Actions de capitalisation en AUD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	–	51
Rachat(s)	(2)	(1)
(Baisse)/hausse nette	(2)	50
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	4	63
Rachat(s)	(29)	–
(Baisse)/hausse nette	(25)	63
Actions de Distribution (M) Plus en CNH de Classe A (couvertes)		
Vente(s)	21	80
Rachat(s)	(23)	–
(Baisse)/hausse nette	(2)	80
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	115	322
Rachat(s)	(201)	(59)
(Baisse)/hausse nette	(86)	263
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	67	176
Rachat(s)	(59)	(50)
Hausse nette	8	126
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	125	229
Rachat(s)	(89)	(133)
Hausse nette	36	96
Actions de distribution (M) Plus en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	3	32
Rachat(s)	(6)	(2)
(Baisse)/hausse nette	(3)	30
Actions de Distribution (M) Plus (e) en GBP de Classe A (couvertes)		
Vente(s)	13	49
Rachat(s)	(14)	(14)
(Baisse)/hausse nette	(1)	35
Actions de Distribution (M) Plus en GBP de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	11	28
Rachat(s)	(14)	(2)
(Baisse)/hausse nette	(3)	26
Actions de Capitalisation en HKD de Classe A		
Vente(s)	4	64
Rachat(s)	(14)	(1)
(Baisse)/hausse nette	(10)	63
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A		
Vente(s)	21	1 610
Rachat(s)	(517)	(136)
(Baisse)/hausse nette	(496)	1 474
Actions de distribution (M) Plus (e) en SGD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	50 704	5 682
Rachat(s)	(14 808)	(258)
Hausse nette	35 896	5 424
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	45 172	59 557
Rachat(s)	(52 806)	(14 289)
(Baisse)/hausse nette	(7 634)	45 268
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A		
Vente(s)	10 980	12 877
Rachat(s)	(14 908)	(481)
(Baisse)/hausse nette	(3 928)	12 396
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	121	401
Rachat(s)	(265)	(27)
(Baisse)/hausse nette	(144)	374
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C		
Vente(s)	107	13
Rachat(s)	(4)	(2)
Hausse nette	103	11
Actions de capitalisation en CZK de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	1	–
Hausse nette	1	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Vente(s)	69	239
Rachat(s)	(78)	(44)
(Baisse)/hausse nette	(9)	195
Actions de distribution (D) en USD de catégorie E		
Vente(s)	4	8
Rachat(s)	(3)	(3)
Hausse nette	1	5

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – (suite)		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)		
Vente(s)	10	40
Rachat(s)	(9)	(9)
Hausse nette	1	31
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	78	422
Rachat(s)	(205)	(56)
(Baisse)/hausse nette	(127)	366
Actions de distribution (D) en USD de catégorie F		
Vente(s)	12	61
Rachat(s)	(21)	(12)
(Baisse)/hausse nette	(9)	49
Actions de capitalisation en USD de catégorie X		
Vente(s)	19	160
Rachat(s)	(60)	(18)
(Baisse)/hausse nette	(41)	142
Actions de distribution (D) en USD de catégorie X		
Vente(s)	4	1
Rachat(s)	(1)	(1)
Hausse nette	3	–
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie X		
Vente(s)	43	324
Rachat(s)	(96)	(149)
(Baisse)/hausse nette	(53)	175
Actions de Capitalisation en CHF de Classe X (couvertes)		
Vente(s)	1	11
Rachat(s)	(11)	–
(Baisse)/hausse nette	(10)	11
Actions de distribution (A) en CHF de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	–	30
Rachat(s)	(24)	(2)
(Baisse)/hausse nette	(24)	28
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	59	416
Rachat(s)	(226)	(77)
(Baisse)/hausse nette	(167)	339
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X		
Vente(s)	–	4
Rachat(s)	(2)	(1)
(Baisse)/hausse nette	(2)	3
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	11	121
Rachat(s)	(33)	(92)
(Baisse)/hausse nette	(22)	29
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	13	68
Rachat(s)	(35)	(16)
(Baisse)/hausse nette	(22)	52
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	121	910
Rachat(s)	(375)	(113)
(Baisse)/hausse nette	(254)	797
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	91	233
Rachat(s)	(79)	(57)
Hausse nette	12	176
Classe de Capitalisation en BRL de Classe Premier (couvertes)		
Vente(s)	4	135
Rachat(s)	(1)	(17)
Hausse nette	3	118
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	495	1 312
Rachat(s)	(716)	(392)
(Baisse)/hausse nette	(221)	920
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	310	400
Rachat(s)	(207)	(33)
Hausse nette	103	367
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	67	20
Rachat(s)	(15)	(5)
Hausse nette	52	15
Actions de capitalisation en SEK de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	1	650
Rachat(s)	(61)	(1 616)
Baisse nette	(60)	(966)

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Actions de capitalisation en USD de catégorie S		
Vente(s)	193	1 990
Rachat(s)	(1 031)	(452)
(Baisse)/hausse nette	(838)	1 538
Actions de distribution (Q) Plus (e) en USD de catégorie S		
Vente(s)	–	3
Hausse nette	–	3
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)		
Vente(s)	178	492
Rachat(s)	(264)	(79)
(Baisse)/hausse nette	(86)	413
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie S (couvertes)		
Vente(s)	5	72
Rachat(s)	(3)	(65)
Hausse nette	2	7
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie S (couvertes)		
Vente(s)	2	15
Rachat(s)	(13)	(14)
(Baisse)/hausse nette	(11)	1
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM		
Vente(s)	215	–
Rachat(s)	(100)	–
Hausse nette	115	–
Actions de distribution (M) en USD de catégorie LM		
Vente(s)	15	87
Rachat(s)	(19)	(8)
(Baisse)/hausse nette	(4)	79
Actions de Distribution (M) Plus (e) en EUR de Classe LM (couvertes)		
Vente(s)	1 038	418
Rachat(s)	(84)	–
Hausse nette	954	418
Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM (couvertes)		
Vente(s)	169	16
Rachat(s)	(151)	(9)
Hausse nette	18	7
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	1	2
Rachat(s)	–	(19)
Hausse/(baisse) nette	1	(17)
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	17	136
Rachat(s)	(63)	(43)
(Baisse)/hausse nette	(46)	93
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM		
Rachat(s)	–	(58)
Baisse nette	–	(58)
Actions de capitalisation en BRL de catégorie S (couvertes)		
Vente(s)	–	22
Rachat(s)	–	(125)
Baisse nette	–	(103)
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]		
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A		
Vente(s)	–	1
Hausse nette	–	1
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]		
Classe de Capitalisation en SGD de Classe A (couvertes)		
Vente(s)	104	9 442
Rachat(s)	(5 710)	(10 719)
Baisse nette	(5 606)	(1 277)
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Rachat(s)	–	(145)
Baisse nette	–	(145)
Actions de capitalisation en AUD de catégorie LM (couvertes)		
Vente(s)	–	1 584
Rachat(s)	(237)	(4 864)
Baisse nette	(237)	(3 280)
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]		
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A		
Vente(s)	1	–
Hausse nette	1	–

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] – (suite)		
Actions de capitalisation en USD de catégorie S		
Vente(s)	148	–
Hausse nette	148	–
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie S (couvertes)		
Vente(s)	1	–
Hausse nette	1	–
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	2	1
Hausse nette	2	1
FTGF ClearBridge Value Fund		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	402	920
Rachat(s)	(370)	(266)
Hausse nette	32	654
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A		
Vente(s)	19	63
Rachat(s)	(23)	(43)
(Baisse)/hausse nette	(4)	20
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	55	1
Rachat(s)	(29)	(1)
Hausse nette	26	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A		
Vente(s)	54	67
Rachat(s)	(44)	(28)
Hausse nette	10	39
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	1	–
Hausse nette	1	–
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie A		
Vente(s)	–	3
Rachat(s)	–	(3)
Hausse nette	–	–
Actions de capitalisation en SGD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	262	1 920
Rachat(s)	(573)	(931)
(Baisse)/hausse nette	(311)	989
Actions de capitalisation en SGD de catégorie A		
Vente(s)	1 549	3 159
Rachat(s)	(1 320)	(1 532)
Hausse nette	229	1 627
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	43	101
Rachat(s)	(27)	(49)
Hausse nette	16	52
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C		
Vente(s)	3	5
Rachat(s)	(2)	(2)
Hausse nette	1	3
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Vente(s)	32	37
Rachat(s)	(18)	(10)
Hausse nette	14	27
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	40	93
Rachat(s)	(35)	(28)
Hausse nette	5	65
Actions de distribution (A) en USD de catégorie F		
Vente(s)	–	15
Rachat(s)	(14)	(1)
(Baisse)/hausse nette	(14)	14
Actions de capitalisation en USD de catégorie X		
Vente(s)	5	–
Rachat(s)	(4)	–
Hausse nette	1	–
Actions de distribution (A) en USD de catégorie X		
Vente(s)	19	246
Rachat(s)	(78)	(308)
Baisse nette	(59)	(62)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X		
Vente(s)	89	36
Rachat(s)	(94)	(3)
(Baisse)/hausse nette	(5)	33
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	370	444
Rachat(s)	(203)	(268)
Hausse nette	167	176
Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	11	2
Rachat(s)	(1)	–
Hausse nette	10	2
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	508	283
Rachat(s)	(231)	(16)
Hausse nette	277	267
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier		
Vente(s)	124	399
Rachat(s)	(185)	(172)
(Baisse)/hausse nette	(61)	227
Actions de distribution (A) en USD de catégorie LM		
Vente(s)	7	140
Rachat(s)	(48)	(8)
(Baisse)/hausse nette	(41)	132
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	19	37
Rachat(s)	(26)	(27)
(Baisse)/hausse nette	(7)	10
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A		
Vente(s)	3	8
Rachat(s)	(11)	(12)
Baisse nette	(8)	(4)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A		
Vente(s)	2	1
Rachat(s)	–	(1)
Hausse nette	2	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie B		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie B		
Rachat(s)	(2)	(1)
Baisse nette	(2)	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	3	7
Rachat(s)	(8)	(11)
Baisse nette	(5)	(4)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C		
Vente(s)	3	4
Rachat(s)	(6)	(9)
Baisse nette	(3)	(5)
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Vente(s)	5	16
Rachat(s)	(11)	(14)
(Baisse)/hausse nette	(6)	2
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	15	43
Rachat(s)	(28)	(47)
Baisse nette	(13)	(4)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie F		
Vente(s)	3	5
Rachat(s)	(2)	(5)
Hausse nette	1	–
Actions de distribution (A) en USD de catégorie X		
Rachat(s)	–	(2)
Baisse nette	–	(2)
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X		
Rachat(s)	(1)	–
Baisse nette	(1)	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	18	73
Rachat(s)	(26)	(62)
(Baisse)/hausse nette	(8)	11

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund – (suite)		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier		
Rachat(s)	(3)	–
Baisse nette	(3)	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier		
Vente(s)	23	2
Rachat(s)	(2)	(51)
Hausse/(baisse) nette	21	(49)
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM		
Vente(s)	11	46
Rachat(s)	(8)	(14)
Hausse nette	3	32
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM		
Vente(s)	1	–
Rachat(s)	(2)	(4)
Baisse nette	(1)	(4)
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)		
Vente(s)	3	1
Rachat(s)	(4)	(2)
Baisse nette	(1)	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie L (G)		
Rachat(s)	–	(3)
Baisse nette	–	(3)
Actions de capitalisation en USD de catégorie GA		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie GA		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	104	246
Rachat(s)	(173)	(275)
Baisse nette	(69)	(29)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A		
Vente(s)	23	52
Rachat(s)	(32)	(69)
Baisse nette	(9)	(17)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	33	69
Rachat(s)	(28)	(81)
Hausse/(baisse) nette	5	(12)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A		
Vente(s)	24	33
Rachat(s)	(55)	(57)
Baisse nette	(31)	(24)
Actions de capitalisation en USD de catégorie B		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	5	49
Rachat(s)	(9)	(58)
Baisse nette	(4)	(9)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C		
Vente(s)	1	5
Rachat(s)	(9)	(7)
Baisse nette	(8)	(2)
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Vente(s)	9	22
Rachat(s)	(18)	(26)
Baisse nette	(9)	(4)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie E		
Rachat(s)	(1)	(2)
Baisse nette	(1)	(2)
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	210	319
Rachat(s)	(209)	(253)
Hausse nette	1	66
Actions de distribution (A) en USD de catégorie F		
Vente(s)	5	39
Rachat(s)	(40)	(37)
(Baisse)/hausse nette	(35)	2

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Actions de capitalisation en USD de catégorie U		
Vente(s)	442	509
Rachat(s)	(742)	(610)
Baisse nette	(300)	(101)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie U		
Vente(s)	22	187
Rachat(s)	(350)	(165)
(Baisse)/hausse nette	(328)	22
Actions de capitalisation en USD de catégorie X		
Vente(s)	54	60
Rachat(s)	(40)	(63)
Hausse/(baisse) nette	14	(3)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	8	26
Rachat(s)	(27)	(93)
Baisse nette	(19)	(67)
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X		
Vente(s)	4	6
Rachat(s)	(2)	(14)
Hausse/(baisse) nette	2	(8)
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X		
Vente(s)	15	12
Rachat(s)	(14)	(24)
Hausse/(baisse) nette	1	(12)
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	645	449
Rachat(s)	(810)	(811)
Baisse nette	(165)	(362)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	13	24
Rachat(s)	(18)	(14)
(Baisse)/hausse nette	(5)	10
Classe de Capitalisation en BRL de Classe Premier (couvertes)		
Vente(s)	–	728
Rachat(s)	(761)	(624)
(Baisse)/hausse nette	(761)	104
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	107	46
Rachat(s)	(94)	(44)
Hausse nette	13	2
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier		
Vente(s)	29	167
Rachat(s)	(177)	(321)
Baisse nette	(148)	(154)
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie Premier		
Vente(s)	5	10
Rachat(s)	(2)	(5)
Hausse nette	3	5
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier		
Vente(s)	58	98
Rachat(s)	(108)	(85)
(Baisse)/hausse nette	(50)	13
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM		
Vente(s)	430	172
Rachat(s)	(472)	(76)
(Baisse)/hausse nette	(42)	96
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)		
Vente(s)	1	2
Rachat(s)	(2)	(3)
Baisse nette	(1)	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie L (G)		
Rachat(s)	(1)	(2)
Baisse nette	(1)	(2)
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	51	67
Rachat(s)	(103)	(129)
Baisse nette	(52)	(62)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A		
Vente(s)	6	28
Rachat(s)	(12)	(38)
Baisse nette	(6)	(10)

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund – (suite)		
Actions de capitalisation en AUD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	35	14
Rachat(s)	(33)	(61)
Hausse/(baisse) nette	2	(47)
Actions de capitalisation en CNH de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	43	99
Rachat(s)	(44)	(70)
(Baisse)/hausse nette	(1)	29
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	1	1
Rachat(s)	(1)	(4)
Baisse nette	–	(3)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A		
Vente(s)	2	3
Rachat(s)	(5)	(10)
Baisse nette	(3)	(7)
Classe de capitalisation en GBP de catégorie A		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(1)	(2)
Baisse nette	(1)	(1)
Actions de Capitalisation en HKD de Classe A		
Rachat(s)	(2)	–
Baisse nette	(2)	–
Actions de capitalisation en SEK de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	1	1
Rachat(s)	(1)	(1)
Hausse nette	–	–
Actions de capitalisation en SGD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	83	924
Rachat(s)	(551)	(1 204)
Baisse nette	(468)	(280)
Actions de capitalisation en USD de catégorie B		
Rachat(s)	(1)	(2)
Baisse nette	(1)	(2)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie B		
Rachat(s)	(3)	(2)
Baisse nette	(3)	(2)
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	1	4
Rachat(s)	(10)	(8)
Baisse nette	(9)	(4)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C		
Vente(s)	1	12
Rachat(s)	(10)	(21)
Baisse nette	(9)	(9)
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Vente(s)	2	8
Rachat(s)	(25)	(9)
Baisse nette	(23)	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	6	4
Rachat(s)	(10)	(12)
Baisse nette	(4)	(8)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie F		
Vente(s)	1	8
Rachat(s)	(4)	(6)
(Baisse)/hausse nette	(3)	2
Actions de capitalisation en USD de catégorie X		
Vente(s)	8	8
Rachat(s)	(15)	(22)
Baisse nette	(7)	(14)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie X		
Vente(s)	–	2
Rachat(s)	(1)	(3)
Baisse nette	(1)	(1)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X		
Vente(s)	4	–
Rachat(s)	(4)	–
Hausse nette	–	–

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X		
Vente(s)	3	15
Rachat(s)	(24)	(55)
Baisse nette	(21)	(40)
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	40	115
Rachat(s)	(718)	(358)
Baisse nette	(678)	(243)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier		
Vente(s)	1	1
Rachat(s)	(1)	(3)
Baisse nette	–	(2)
Parts de Capitalisation en GBP de Classe Premier (couvertes)		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(1)	(3)
Baisse nette	(1)	(2)
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(1)	–
(Baisse)/hausse nette	(1)	1
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie Premier		
Vente(s)	5	7
Rachat(s)	(56)	(57)
Baisse nette	(51)	(50)
Actions de capitalisation en PLN de Classe Premier (couvertes)		
Vente(s)	–	7
Rachat(s)	(33)	(4)
(Baisse)/hausse nette	(33)	3
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie A		
Vente(s)	6	4
Rachat(s)	(13)	(10)
Baisse nette	(7)	(6)
Actions de capitalisation en USD de catégorie L (G)		
Rachat(s)	(3)	(4)
Baisse nette	(3)	(4)
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	21	9
Rachat(s)	(11)	(7)
Hausse nette	10	2
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A		
Vente(s)	15	11
Rachat(s)	(9)	(17)
Hausse/(baisse) nette	6	(6)
Actions de distribution (Q) en USD de catégorie A		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	15	3
Rachat(s)	(16)	(5)
Baisse nette	(1)	(2)
Actions de Distribution (M) Plus en CNH de Classe A (couvertes)		
Vente(s)	1	1
Rachat(s)	(4)	–
(Baisse)/hausse nette	(3)	1
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	1	9
Rachat(s)	(5)	(9)
Baisse nette	(4)	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	–	(1)
Hausse nette	–	–
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	3	–
Rachat(s)	(3)	–
Hausse nette	–	–
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A		
Vente(s)	3	45
Rachat(s)	(55)	(43)
(Baisse)/hausse nette	(52)	2
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	1 444	537
Rachat(s)	(1 127)	(59)
Hausse nette	317	478

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – (suite)		
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	1	1
Rachat(s)	(1)	–
Hausse nette	–	1
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C		
Rachat(s)	(1)	–
Baisse nette	(1)	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	6	8
Rachat(s)	(15)	(15)
Baisse nette	(9)	(7)
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	96	296
Rachat(s)	(72)	(32)
Hausse nette	24	264
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A		
Vente(s)	27	52
Rachat(s)	(23)	(18)
Hausse nette	4	34
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	66	201
Rachat(s)	(160)	(48)
(Baisse)/hausse nette	(94)	153
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A		
Vente(s)	50	–
Rachat(s)	(1)	–
Hausse nette	49	–
Classe de capitalisation en SEK de catégorie A		
Vente(s)	120	5 052
Rachat(s)	(416)	(5 408)
Baisse nette	(296)	(356)
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	16	21
Rachat(s)	(15)	–
Hausse nette	1	21
Actions de capitalisation en USD de catégorie X		
Vente(s)	55	301
Rachat(s)	(100)	(224)
(Baisse)/hausse nette	(45)	77
Actions de distribution (A) en USD de catégorie X		
Vente(s)	2	5
Rachat(s)	(4)	(2)
(Baisse)/hausse nette	(2)	3
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	17	11
Rachat(s)	(11)	(12)
Hausse/(baisse) nette	6	(1)
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X		
Vente(s)	–	24
Rachat(s)	(1)	(17)
(Baisse)/hausse nette	(1)	7
Actions de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	14	28
Rachat(s)	(12)	(39)
Hausse/(baisse) nette	2	(11)
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X		
Vente(s)	1 317	688
Rachat(s)	(547)	(138)
Hausse nette	770	550
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	342	1 449
Rachat(s)	(781)	(783)
(Baisse)/hausse nette	(439)	666
Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	8	116
Rachat(s)	(6)	–
Hausse nette	2	116
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	31	9
Rachat(s)	(14)	(1)
Hausse nette	17	8

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier		
Vente(s)	73	14
Rachat(s)	(55)	(4)
Hausse nette	18	10
Actions de capitalisation en USD de catégorie S		
Vente(s)	2 151	4 695
Rachat(s)	(2 265)	(2 656)
(Baisse)/hausse nette	(114)	2 039
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)		
Vente(s)	6	50
Rachat(s)	(43)	(3)
(Baisse)/hausse nette	(37)	47
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S		
Vente(s)	–	178
Hausse nette	–	178
Actions de capitalisation en GBP de catégorie S (couvertes)		
Vente(s)	118	232
Rachat(s)	(55)	(263)
Hausse/(baisse) nette	63	(31)
Actions de capitalisation en GBP de catégorie S		
Vente(s)	339	580
Rachat(s)	(355)	(531)
(Baisse)/hausse nette	(16)	49
Actions de distribution (Q) en GBP de catégorie S		
Vente(s)	24	63
Rachat(s)	(44)	(13)
(Baisse)/hausse nette	(20)	50
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM		
Vente(s)	138	177
Rachat(s)	(7)	(4)
Hausse nette	131	173
FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	16	36
Rachat(s)	(27)	(3)
(Baisse)/hausse nette	(11)	33
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	9 720	5 237
Rachat(s)	(9 793)	(4 749)
(Baisse)/hausse nette	(73)	488
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	3 013	2 970
Rachat(s)	(3 756)	(318)
(Baisse)/hausse nette	(743)	2 652
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	4 500	3 390
Rachat(s)	(5 071)	(4 157)
Baisse nette	(571)	(767)
Actions de distribution (Q) en USD de catégorie A		
Vente(s)	95	165
Rachat(s)	(111)	(175)
Baisse nette	(16)	(10)
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	711	965
Rachat(s)	(1 182)	(360)
(Baisse)/hausse nette	(471)	605
Actions de Distribution (M) Plus en CNH de Classe A (couvertes)		
Vente(s)	16 667	4 818
Rachat(s)	(5 439)	(2 681)
Hausse nette	11 228	2 137
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes) (PH)		
Vente(s)	406	341
Rachat(s)	(288)	(55)
Hausse nette	118	286
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A		
Vente(s)	7 976	3 000
Rachat(s)	(3 080)	(3 273)
Hausse/(baisse) nette	4 896	(273)
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A		
Vente(s)	45	–
Hausse nette	45	–

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – (suite)		
Actions de distribution (M) Plus en EUR de catégorie A		
Vente(s)	290	162
Rachat(s)	(185)	(196)
Hausse/(baisse) nette	105	(34)
Actions de Distribution (M) Plus en SGD de Classe A (couvertes)		
Vente(s)	8 620	10 608
Rachat(s)	(8 849)	(7 189)
(Baisse)/hausse nette	(229)	3 419
Actions de capitalisation en USD de catégorie C (couvertes)		
Vente(s)	64	61
Rachat(s)	(16)	(85)
Hausse/(baisse) nette	48	(24)
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	57	384
Rachat(s)	(95)	(68)
(Baisse)/hausse nette	(38)	316
Actions de capitalisation en USD de catégorie E (couvertes)		
Vente(s)	213	129
Rachat(s)	(93)	(39)
Hausse nette	120	90
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Vente(s)	228	478
Rachat(s)	(375)	(139)
(Baisse)/hausse nette	(147)	339
Actions de capitalisation en USD de catégorie F (couvertes)		
Vente(s)	556	140
Rachat(s)	(54)	(145)
Hausse/(baisse) nette	502	(5)
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	448	32
Rachat(s)	(186)	(5)
Hausse nette	262	27
Actions de capitalisation en USD de catégorie X		
Vente(s)	128	–
Rachat(s)	(4)	(48)
Hausse/(baisse) nette	124	(48)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie X		
Vente(s)	8	3
Rachat(s)	(5)	(1)
Hausse nette	3	2
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes) (PH)		
Vente(s)	969	239
Rachat(s)	(318)	(26)
Hausse nette	651	213
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X		
Vente(s)	3 299	1 582
Rachat(s)	(1 267)	(2 358)
Hausse/(baisse) nette	2 032	(776)
Actions de distribution (Q) en GBP de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	42	67
Rachat(s)	(75)	–
(Baisse)/hausse nette	(33)	67
Actions de distribution (Q) en GBP de catégorie X		
Vente(s)	89	98
Rachat(s)	(21)	(26)
Hausse nette	68	72
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	9 228	573
Rachat(s)	(5 090)	(97)
Hausse nette	4 138	476
Classe de Capitalisation en BRL de Classe Premier (couvertes)		
Vente(s)	567	543
Rachat(s)	(1 620)	(343)
(Baisse)/hausse nette	(1 053)	200
Actions de distribution (Q) Plus (e) en CAD de catégorie Premier (PH) (couvertes)		
Vente(s)	133	137
Rachat(s)	(656)	–
(Baisse)/hausse nette	(523)	137
Actions de distribution (Q) Plus (e) en CAD de catégorie Premier		
Vente(s)	14	26
Rachat(s)	(825)	(762)
Baisse nette	(811)	(736)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes) (PH)		
Vente(s)	26	10
Rachat(s)	(297)	(78)
Baisse nette	(271)	(68)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier		
Vente(s)	12 764	8 130
Rachat(s)	(3 585)	(11 807)
Hausse/(baisse) nette	9 179	(3 677)
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier		
Vente(s)	13	6
Rachat(s)	(355)	(130)
Baisse nette	(342)	(124)
Actions de distribution (A) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes) (PH)		
Vente(s)	360	94
Rachat(s)	(586)	(2 406)
Baisse nette	(226)	(2 312)
Actions de distribution (Q) en GBP de catégorie Premier		
Vente(s)	2 346	4 282
Rachat(s)	(2 310)	(1 980)
Hausse nette	36	2 302
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM (couvertes)		
Vente(s)	–	29
Rachat(s)	–	(654)
Baisse nette	–	(625)
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^e		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Rachat(s)	(3)	–
Baisse nette	(3)	–
Actions de distribution (Q) en USD de catégorie A		
Rachat(s)	(2)	–
Baisse nette	(2)	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)		
Rachat(s)	(7)	–
Baisse nette	(7)	–
Actions de distribution (Q) en GBP de catégorie X		
Rachat(s)	(7)	–
Baisse nette	(7)	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Rachat(s)	(9)	–
Baisse nette	(9)	–
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	203	173
Rachat(s)	(92)	(4)
Hausse nette	111	169
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A		
Vente(s)	187	759
Rachat(s)	(224)	(52)
(Baisse)/hausse nette	(37)	707
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A		
Vente(s)	543	306
Rachat(s)	(143)	(32)
Hausse nette	400	274
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	100	83
Rachat(s)	(36)	(8)
Hausse nette	64	75
Actions de Distribution (M) Plus en CNH de Classe A (couvertes)		
Vente(s)	97	19
Rachat(s)	(12)	–
Hausse nette	85	19
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A		
Vente(s)	1	–
Hausse nette	1	–
Actions de distribution (M) Plus en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	64	34
Rachat(s)	(9)	–
Hausse nette	55	34
Actions de Distribution (M) Plus en GBP de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	50	1
Rachat(s)	(3)	–
Hausse nette	47	1

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – (suite)		
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A		
Vente(s)	63	135
Rachat(s)	(81)	–
(Baisse)/hausse nette	(18)	135
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	98 637	45 506
Rachat(s)	(38 661)	(8 680)
Hausse nette	59 976	36 826
Actions de capitalisation en USD de catégorie U		
Vente(s)	48	–
Hausse nette	48	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie U		
Vente(s)	86	–
Hausse nette	86	–
Actions de distribution (Q) Plus (e) en EUR de catégorie U		
Vente(s)	1	–
Hausse nette	1	–
Actions de capitalisation en GBP de catégorie U		
Vente(s)	27	–
Hausse nette	27	–
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie X		
Vente(s)	577	16
Rachat(s)	(395)	(13)
Hausse nette	182	3
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	5	–
Rachat(s)	(1)	–
Hausse nette	4	–
Actions de distribution (Q) Plus (e) en EUR de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	23	15
Rachat(s)	(4)	(10)
Hausse nette	19	5
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	9	1
Rachat(s)	(4)	–
Hausse nette	5	1
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	97	46
Rachat(s)	(116)	–
(Baisse)/hausse nette	(19)	46
Actions de distribution (M) en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	1 047	48
Rachat(s)	(438)	–
Hausse nette	609	48
Actions de Distribution (M) en EUR de Classe Premier (couvertes)		
Vente(s)	367	2
Rachat(s)	(25)	(1)
Hausse nette	342	1
Actions de capitalisation en USD de catégorie S		
Vente(s)	322	2
Rachat(s)	(43)	–
Hausse nette	279	2
Actions de distribution USD catégorie S (M) Plus		
Vente(s)	101	15
Rachat(s)	(30)	–
Hausse nette	71	15
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	118	811
Rachat(s)	(244)	(889)
Baisse nette	(126)	(78)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A		
Vente(s)	5	28
Rachat(s)	(10)	(150)
Baisse nette	(5)	(122)
Actions de capitalisation en AUD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	34	132
Rachat(s)	(36)	(164)
Baisse nette	(2)	(32)
Actions de capitalisation en CNH de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	54	452
Rachat(s)	(42)	(516)
Hausse/(baisse) nette	12	(64)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	61	170
Rachat(s)	(53)	(205)
Hausse/(baisse) nette	8	(35)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A		
Vente(s)	41	262
Rachat(s)	(74)	(211)
(Baisse)/hausse nette	(33)	51
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	5	6
Rachat(s)	(6)	(4)
(Baisse)/hausse nette	(1)	2
Actions de capitalisation en GBP de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	–	2
Rachat(s)	(2)	(1)
(Baisse)/hausse nette	(2)	1
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie A		
Vente(s)	–	3
Rachat(s)	–	(3)
Hausse nette	–	–
Actions de capitalisation en SEK de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	15	51
Rachat(s)	(15)	(74)
Baisse nette	–	(23)
Classe de Capitalisation en SGD de Classe A (couvertes)		
Vente(s)	3 936	12 298
Rachat(s)	(3 306)	(16 831)
Hausse/(baisse) nette	630	(4 533)
Classe de capitalisation en SGD de catégorie A		
Vente(s)	857	5 184
Rachat(s)	(914)	(6 790)
Baisse nette	(57)	(1 606)
Actions de capitalisation en USD de catégorie B		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	9	33
Rachat(s)	(13)	(8)
(Baisse)/hausse nette	(4)	25
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C		
Vente(s)	1	1
Rachat(s)	(1)	(1)
Hausse nette	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Vente(s)	13	33
Rachat(s)	(16)	(30)
(Baisse)/hausse nette	(3)	3
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)		
Vente(s)	2	10
Rachat(s)	(1)	(8)
Hausse nette	1	2
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E		
Vente(s)	3	7
Rachat(s)	(2)	(5)
Hausse nette	1	2
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	5	69
Rachat(s)	(37)	(59)
(Baisse)/hausse nette	(32)	10
Actions de distribution (A) en USD de catégorie F		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	–	(3)
Baisse nette	–	(2)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie R		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	–	(2)
Baisse nette	–	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie X		
Vente(s)	149	352
Rachat(s)	(93)	(508)
Hausse/(baisse) nette	56	(156)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie X		
Vente(s)	–	2
Rachat(s)	(2)	–
(Baisse)/hausse nette	(2)	2

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund – (suite)		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	87	293
Rachat(s)	(130)	(280)
(Baisse)/hausse nette	(43)	13
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X		
Vente(s)	14	170
Rachat(s)	(54)	(232)
Baisse nette	(40)	(62)
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X		
Vente(s)	34	110
Rachat(s)	(37)	(117)
Baisse nette	(3)	(7)
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie X		
Vente(s)	3	16
Rachat(s)	(5)	(15)
(Baisse)/hausse nette	(2)	1
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	172	666
Rachat(s)	(253)	(1 005)
Baisse nette	(81)	(339)
Classe de Capitalisation en BRL de Classe Premier (couvertes)		
Vente(s)	–	467
Rachat(s)	(338)	(105)
(Baisse)/hausse nette	(338)	362
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	27	17
Rachat(s)	(7)	(128)
Hausse/(baisse) nette	20	(111)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier		
Vente(s)	68	133
Rachat(s)	(97)	(49)
(Baisse)/hausse nette	(29)	84
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier		
Vente(s)	22	106
Rachat(s)	(73)	(428)
Baisse nette	(51)	(322)
Actions de capitalisation en PLN de Classe Premier (couvertes)		
Vente(s)	10	100
Rachat(s)	(48)	(33)
(Baisse)/hausse nette	(38)	67
FTGF Royce US Smaller Companies Fund		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	13	94
Rachat(s)	(33)	(106)
Baisse nette	(20)	(12)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A		
Vente(s)	3	17
Rachat(s)	(7)	(16)
(Baisse)/hausse nette	(4)	1
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	1	5
Rachat(s)	(1)	(10)
Baisse nette	–	(5)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A		
Vente(s)	2	13
Rachat(s)	(2)	(14)
Baisse nette	–	(1)
Actions de Capitalisation en SEK de Classe A (couvertes)		
Vente(s)	5	7
Rachat(s)	(5)	(8)
Baisse nette	–	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	1	3
Rachat(s)	(2)	(3)
Baisse nette	(1)	–
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C		
Vente(s)	–	3
Rachat(s)	–	(5)
Baisse nette	–	(2)
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Vente(s)	–	5
Rachat(s)	–	(5)
Hausse nette	–	–

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	7	24
Rachat(s)	(6)	(11)
Hausse nette	1	13
Actions de distribution (A) en USD de catégorie F		
Vente(s)	–	2
Rachat(s)	–	(1)
Hausse nette	–	1
Actions de capitalisation en USD de catégorie R		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie X		
Vente(s)	–	18
Rachat(s)	(2)	(17)
(Baisse)/hausse nette	(2)	1
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(1)	(5)
Baisse nette	(1)	(4)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	4	8
Rachat(s)	(14)	(9)
Baisse nette	(10)	(1)
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie Premier		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(1)	(1)
Baisse nette	(1)	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM		
Rachat(s)	(1)	(1)
Baisse nette	(1)	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)		
Vente(s)	1	–
Rachat(s)	(1)	–
Hausse nette	–	–
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie L		
Rachat(s)	(2)	–
Baisse nette	(2)	–
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	–	50
Hausse nette	–	50

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^{^γ}		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	1	2
Rachat(s)	(10)	(3)
Baisse nette	(9)	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	–	3
Rachat(s)	(7)	(3)
Baisse nette	(7)	–
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(5)	(2)
Baisse nette	(5)	(1)
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	–	22
Rachat(s)	(48)	(20)
(Baisse)/hausse nette	(48)	2
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	–	3
Rachat(s)	(23)	(10)
Baisse nette	(23)	(7)
Actions de Distribution (M) Plus en CNH de Classe A (couvertes)		
Vente(s)	–	9
Rachat(s)	(11)	(1)
(Baisse)/hausse nette	(11)	8
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(2)	(1)
Baisse nette	(2)	–
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A		
Rachat(s)	(1)	–
Baisse nette	(1)	–

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^γ – (suite)		
Actions de distribution (M) Plus en EUR de catégorie A		
Vente(s)	–	2
Rachat(s)	(4)	(1)
(Baisse)/hausse nette	(4)	1
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	41	3 874
Rachat(s)	(431)	(3 692)
(Baisse)/hausse nette	(390)	182
Actions de capitalisation en USD de catégorie B		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Rachat(s)	(2)	–
Baisse nette	(2)	–
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C		
Rachat(s)	(8)	–
Baisse nette	(8)	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie E (couvertes)		
Vente(s)	–	2
Rachat(s)	(1)	(1)
(Baisse)/hausse nette	(1)	1
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	–	3
Rachat(s)	(3)	(17)
Baisse nette	(3)	(14)
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Rachat(s)	–	(15)
Baisse nette	–	(15)
Actions de capitalisation en PLN de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	–	12
Rachat(s)	(18)	(2)
(Baisse)/hausse nette	(18)	10
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	–	(39)
Baisse nette	–	(38)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM		
Rachat(s)	(15)	(4)
Baisse nette	(15)	(4)
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)		
Rachat(s)	(10)	(1)
Baisse nette	(10)	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie L (G)		
Rachat(s)	(1)	(1)
Baisse nette	(1)	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie GA		
Rachat(s)	(5)	(1)
Baisse nette	(5)	(1)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GA		
Vente(s)	–	6
Rachat(s)	(62)	(12)
Baisse nette	(62)	(6)
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie GA		
Rachat(s)	(1)	–
Baisse nette	(1)	–
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	5	3
Rachat(s)	(6)	(7)
Baisse nette	(1)	(4)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A		
Vente(s)	2	4
Rachat(s)	(2)	(5)
Baisse nette	–	(1)
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A		
Vente(s)	4	7
Rachat(s)	(6)	(28)
Baisse nette	(2)	(21)
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	54	2
Rachat(s)	(39)	(14)
Hausse/(baisse) nette	15	(12)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Actions de Distribution (M) Plus en CNH de Classe A (couvertes)		
Vente(s)	16	–
Rachat(s)	(16)	–
Hausse nette	–	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A		
Vente(s)	2	3
Rachat(s)	(3)	(1)
(Baisse)/hausse nette	(1)	2
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A		
Vente(s)	2	93
Rachat(s)	(29)	(119)
Baisse nette	(27)	(26)
Actions de Distribution (M) Plus en SGD de Classe A (couvertes)		
Vente(s)	21	10
Rachat(s)	(15)	(65)
Hausse/(baisse) nette	6	(55)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C		
Vente(s)	1	1
Rachat(s)	(2)	(1)
Baisse nette	(1)	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	2	–
Hausse nette	2	–
Actions de capitalisation en PLN de catégorie Premier (couvertes)		
Vente(s)	1	–
Rachat(s)	(66)	(16)
Baisse nette	(65)	(16)
Actions de capitalisation en USD de catégorie GA		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(1)	(2)
Baisse nette	(1)	(1)
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^α		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Rachat(s)	–	(2)
Baisse nette	–	(2)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier		
Rachat(s)	–	(90)
Baisse nette	–	(90)
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^α		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Rachat(s)	(12)	–
Baisse nette	(12)	–
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A		
Rachat(s)	(3)	(5)
Baisse nette	(3)	(5)
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)		
Rachat(s)	(6)	(4)
Baisse nette	(6)	(4)
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A		
Rachat(s)	(13)	(80)
Baisse nette	(13)	(80)
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	1	522
Rachat(s)	(69)	(498)
(Baisse)/hausse nette	(68)	24
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	–	15
Rachat(s)	(25)	(9)
(Baisse)/hausse nette	(25)	6
Actions de capitalisation en USD de catégorie GA		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(20)	(1)
Baisse nette	(20)	–

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^α – (suite)		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GA		
Rachat(s)	(5)	(1)
Baisse nette	(5)	(1)
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie GA		
Rachat(s)	(1)	–
Baisse nette	(1)	–
Classe de Capitalisation en EUR de Classe GE		
Rachat(s)	(1)	–
Baisse nette	(1)	–
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^α		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	4	–
Rachat(s)	(3)	–
Hausse nette	1	–
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie M		
Vente(s)	3	21
Rachat(s)	(16)	(28)
Baisse nette	(13)	(7)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie M		
Vente(s)	1	–
Rachat(s)	–	(3 307)
Hausse/(baisse) nette	1	(3 307)
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie M		
Rachat(s)	–	(9)
Baisse nette	–	(9)
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	15	179
Rachat(s)	(131)	(210)
Baisse nette	(116)	(31)
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier		
Rachat(s)	–	(1)
Baisse nette	–	(1)
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^α		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A (PF) (couvertes)		
Vente(s)	–	50
Rachat(s)	–	(588)
Baisse nette	–	(538)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (PF)		
Rachat(s)	–	(28)
Baisse nette	–	(28)
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A (PF)		
Rachat(s)	–	(238)
Baisse nette	–	(238)
Actions de distribution (A) en USD de catégorie M (PF) (couvertes)		
Rachat(s)	–	(195)
Baisse nette	–	(195)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie M (PF)		
Rachat(s)	–	(37)
Baisse nette	–	(37)
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie M (PF)		
Vente(s)	–	7
Rachat(s)	–	(589)
Baisse nette	–	(582)
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie M (PF) (couvertes)		
Rachat(s)	–	(85)
Baisse nette	–	(85)
Actions de distribution (A) en NOK de catégorie M (PF) (couvertes)		
Rachat(s)	–	(2)
Baisse nette	–	(2)
Actions de distribution (A) en SEK de catégorie M (PF) (couvertes)		
Rachat(s)	–	(102)
Baisse nette	–	(102)
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier (PF) (couvertes)		
Vente(s)	–	38
Rachat(s)	–	(173)
Baisse nette	–	(135)
Actions de capitalisation en BRL de catégorie Premier (PF) (couvertes)		
Vente(s)	–	3
Rachat(s)	–	(155)
Baisse nette	–	(152)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^α		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	8	31
Rachat(s)	(13)	(5)
(Baisse)/hausse nette	(5)	26
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	–	434
Rachat(s)	(52)	(217)
(Baisse)/hausse nette	(52)	217
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A		
Vente(s)	26	16
Rachat(s)	(11)	(7)
Hausse nette	15	9
Actions de capitalisation en USD de catégorie C		
Vente(s)	–	5
Rachat(s)	–	(2)
Hausse nette	–	3
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Vente(s)	1	34
Rachat(s)	(11)	(14)
(Baisse)/hausse nette	(10)	20
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	–	3
Hausse nette	–	3
Actions de capitalisation en USD de catégorie X		
Vente(s)	1	1
Rachat(s)	(1)	–
Hausse nette	–	1
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X		
Vente(s)	1	–
Hausse nette	1	–
Classe de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)		
Vente(s)	6	6
Rachat(s)	(2)	(1)
Hausse nette	4	5
Actions de capitalisation en GBP de catégorie X		
Vente(s)	1	2
Rachat(s)	(1)	(2)
Hausse nette	–	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	54	129
Rachat(s)	(161)	(11)
(Baisse)/hausse nette	(107)	118
Parts de Capitalisation en GBP de Classe Premier (couvertes)		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	–	(2)
Baisse nette	–	(1)
Actions de capitalisation en USD de catégorie S		
Vente(s)	–	78
Rachat(s)	(8)	(303)
Baisse nette	(8)	(225)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)		
Vente(s)	616	815
Rachat(s)	(294)	(268)
Hausse nette	322	547
Actions de capitalisation en GBP de catégorie S		
Vente(s)	2	5
Rachat(s)	(18)	(86)
Baisse nette	(16)	(81)
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund		
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A		
Vente(s)	3	3
Hausse nette	3	3
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A		
Vente(s)	–	1
Hausse nette	–	1
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A		
Vente(s)	–	1
Hausse nette	–	1
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A		
Vente(s)	48	147
Rachat(s)	(53)	(167)
Baisse nette	(5)	(20)

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

État des variations de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables – (suite)

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – (suite)		
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie D (couvertes)		
Vente(s)	–	3
Rachat(s)	(2)	–
(Baisse)/hausse nette	(2)	3
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie D (couvertes)		
Vente(s)	–	89
Rachat(s)	(807)	(98)
Baisse nette	(807)	(9)
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie D		
Vente(s)	2	8
Rachat(s)	–	(5)
Hausse nette	2	3
Actions de capitalisation en USD de catégorie D		
Rachat(s)	–	(2)
Baisse nette	–	(2)
Actions de Capitalisation en AUD de Classe X		
Vente(s)	1	2
Rachat(s)	(1)	(1)
Hausse nette	–	1
Actions de capitalisation en USD de catégorie X		
Vente(s)	3	–
Rachat(s)	(2)	–
Hausse nette	1	–
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie S		
Vente(s)	–	1
Hausse nette	–	1
Actions de capitalisation en AUD de catégorie LM		
Rachat(s)	(5)	(12)
Baisse nette	(5)	(12)
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A		
Vente(s)	21	44
Rachat(s)	(35)	(13)
(Baisse)/hausse nette	(14)	31
Actions de capitalisation en USD de catégorie E		
Vente(s)	2	2
Rachat(s)	(1)	(2)
Hausse nette	1	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie F		
Vente(s)	81	94
Rachat(s)	(36)	(22)
Hausse nette	45	72
Actions de capitalisation en USD de catégorie X		
Rachat(s)	(6)	–
Baisse nette	(6)	–
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier		
Vente(s)	26	22
Rachat(s)	(44)	(19)
(Baisse)/hausse nette	(18)	3
Actions de capitalisation en USD de catégorie S		
Vente(s)	1	15
Rachat(s)	(14)	(17)
Baisse nette	(13)	(2)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S		
Vente(s)	1	138
Rachat(s)	(45)	(135)
(Baisse)/hausse nette	(44)	3
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]		
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (couvertes)		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(1)	–
(Baisse)/hausse nette	(1)	1
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A		
Vente(s)	10	49
Rachat(s)	(44)	(8)
(Baisse)/hausse nette	(34)	41
Actions de capitalisation en USD de catégorie E (couvertes)		
Vente(s)	–	1
Rachat(s)	(1)	–
(Baisse)/hausse nette	(1)	1
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X		
Vente(s)	3	8
Rachat(s)	(11)	–
(Baisse)/hausse nette	(8)	8

Les notes complémentaires font partie intégrante des états financiers

	Pour l'exercice clos le	
	28 février 2023 Actions (en milliers)	28 février 2022 Actions (en milliers)
Classe de Capitalisation en BRL de Classe Premier (couvertes)		
Vente(s)	–	216
Rachat(s)	(115)	(25)
(Baisse)/hausse nette	(115)	191
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier		
Vente(s)	7	88
Rachat(s)	(170)	(36)
(Baisse)/hausse nette	(163)	52
Actions de capitalisation en USD de catégorie S		
Vente(s)	5	–
Rachat(s)	(5)	(1 077)
Baisse nette	–	(1 077)
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S		
Vente(s)	113	1 249
Rachat(s)	(567)	(217)
(Baisse)/hausse nette	(454)	1 032
Actions de capitalisation en GBP de catégorie S		
Vente(s)	136	1 273
Rachat(s)	(142)	–
(Baisse)/hausse nette	(6)	1 273
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A		
Vente(s)	1	–
Hausse nette	1	–
Actions de distribution (A) Plus en EUR de catégorie A		
Vente(s)	1	–
Hausse nette	1	–
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A		
Vente(s)	52	–
Rachat(s)	(1)	–
Hausse nette	51	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie D		
Vente(s)	1	–
Hausse nette	1	–
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie D		
Vente(s)	1	–
Hausse nette	1	–
Actions de capitalisation en EUR de catégorie K		
Vente(s)	1	–
Hausse nette	1	–
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie K		
Vente(s)	1	–
Hausse nette	1	–
Classe de capitalisation en EUR de catégorie X		
Vente(s)	97	–
Hausse nette	97	–
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie X		
Vente(s)	221	–
Hausse nette	221	–

– Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 ou inférieurs à 1 000. Seules les classes d'actions ayant fait l'objet de transactions pendant l'exercice financier sont indiquées.

Reportez-vous à la Note 14, Événements importants pour plus de détails sur les changements de nom du fonds.

α À compter du 27 avril 2022, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] a cessé ses activités.

β À compter du 21 juin 2022, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] et Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] ont cessé leurs activités.

γ À compter du 11 juillet 2022, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] a cessé ses activités.

δ À compter du 10 octobre 2022, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^] a cessé ses activités.

ε À compter du 17 novembre 2022, Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^] a cessé ses activités.

λ À compter du 1^{er} décembre 2022, FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] a commencé ses activités.

μ À compter du 5 décembre 2022, Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^] a cessé ses activités.

π À compter du 23 janvier 2023, Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] a commencé ses activités.

τ À compter du 16 février 2023, Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^] a cessé ses activités.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers

1. Généralités

Franklin Templeton Global Funds plc (la " Société ", anciennement Legg Mason Global Funds plc, renommée le 21 février 2023, afin de refléter le nom du gestionnaire de la Société, Franklin Templeton International Services S.à r.l. Legg Mason Global Funds plc, se réfère à la Note 14, Evénements importants, pour plus de détails sur les changements de nom des fonds) est une société d'investissement à capital variable constituée en vertu de la législation irlandaise en tant que société anonyme conformément à la Loi sur les sociétés de 2014, aux Communautés Européennes (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities), aux Réglementations de 2011 (tels que modifiés) (les " Réglementations sur les OPCVM ") et Réglementations sur les OPCVM de la Banque centrale. Elle a été constituée le 13 janvier 1998 sous le numéro d'immatriculation 278601.

Son objectif, tel qu'il est établi dans ses documents constitutifs, est le placement collectif en valeurs mobilières et autres actifs financiers liquides des capitaux levés auprès du public, et son fonctionnement est soumis au principe de la répartition des risques. La Société est divisée en compartiments. Les documents constitutifs de la Société prévoient que la Société peut offrir des catégories d'actions distinctes, chacune représentant des intérêts dans un compartiment (le " Fonds " ou les " Fonds " collectivement) comprenant un portefeuille d'investissements distinct. Un portefeuille d'actifs distinct ne dit pas être maintenu pour une catégorie. Les fonds mis en place par la société sont présentés dans la section " Informations générales " du présent rapport. Les objectifs et les politiques d'investissement de tous les fonds actifs sont indiqués dans le rapport des administrateurs (révisé).

2. Principales méthodes comptables

Les principales méthodes comptables et techniques d'estimation adoptées par la société pour la préparation des états financiers sont exposées ci-dessous :

Déclaration de conformité

Les états financiers pour l'exercice financier clos le 28 février 2023 ont été établis conformément aux normes comptables généralement acceptées en Irlande, en ce compris la Financial Reporting Standard (« FRS ») 102 : la « Norme de présentation de l'information financière en vigueur au Royaume-Uni et en République d'Irlande » (« FRS 102 ») et la législation irlandaise incluant le Companies Act de 2014, la Réglementation sur les OPCVM et les Réglementations OPCVM de la Banque centrale. Ces politiques sont cohérentes avec celles appliquées dans les états financiers de l'exercice clos le 28 février 2022.

Base d'élaboration

Les états financiers ont été établis selon le principe de la continuité de l'exploitation, conformément à la convention du coût historique, compte tenu de la réévaluation des éléments d'actif et de passif financiers détenus à leur juste valeur par le biais du compte de résultat. Les états financiers des Fonds Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund[^], Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund[^], Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^], Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund[^], Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund[^], Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund[^], FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^], Legg Mason Brandywine Global - US High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^], Legg Mason ClearBridge Growth Fund[^], Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund[^], Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^], Legg Mason US Equity Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund, Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund[^], Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund[^], Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason Japan Equity Fund[^], Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund[^], Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund[^], Legg Mason Martin Currie Greater China Fund[^] et FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] Mason Western Asset Global Inflation M ont été établis sur la base du principe de non-continuité de l'exploitation, car ces compartiments ont été fermés pendant les années en cours et précédentes ou après la date de l'état de la situation financière.

Le format et certaines formulations des états financiers ont été adaptés à ceux contenus dans la Loi sur les sociétés de 2014, de telle sorte que, de l'avis du Conseil d'administration, ils correspondent plus précisément à la nature de l'activité de fonds de placement de la Société.

La Société recourt à l'exemption prévue pour les fonds communs de placement à capital variable conformément à la Section 7 « Statement of Cash Flows » (Tableau des flux de trésorerie) de la norme FRS 102 et ne présente pas de tableau de flux de trésorerie étant donné que pratiquement tous les investissements de la Société sont très liquides et sont comptabilisés à la juste valeur et que la Société fournit un état de l'évolution de l'actif net imputable aux détenteurs d'actions participatives rachetables.

(a) Investissements à la juste valeur

La Société a groupé tous les instruments financiers, y compris ses investissements en titres de créance et titres de capital, ainsi que les instruments dérivés qui y sont rattachés, en tant qu'éléments d'actif et de passif financiers détenus à leur juste valeur par le biais du compte de résultat. Ces actifs et passifs financiers sont répertoriés comme détenus en vue d'être négociés à leur juste valeur par le biais du compte de résultat. Les actifs et passifs financiers détenus à des fins de transaction sont acquis ou contractés principalement aux fins de vendre ou de racheter lesdits actifs à court terme. Les dérivés sont également classés comme détenus à des fins de transaction, car la société ne classe aucun dérivé comme couverture dans une relation de couverture.

Les actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat sont initialement constatés à leur juste valeur. Les frais de transaction sont portés dans les charges de l'état de résultat global. Après l'imputation initiale, tous les actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat sont évalués à la juste valeur. Les plus et les moins-values induites par les variations de la juste valeur des actifs ou passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat sont présentées dans l'état du résultat global pour l'exercice au cours duquel elles apparaissent.

La valeur de marché des instruments financiers négociés sur les marchés actifs (tels que les titres et produits dérivés négociés sur un marché ouvert au public) est basée sur les cours de marché cotés à la date de l'état de la situation financière. Les instruments financiers (y compris les obligations) détenus par les compartiments, qui sont cotés ou négociés sur des marchés réglementés, sont valorisés sur la base du dernier cours moyen disponible le jour de négociation. La juste valeur des organismes de placement collectif est basée sur la valeur liquidative négociée du fonds concerné à la date de l'état de la situation financière, telle que fournie par l'administrateur du fonds.

La société peut de temps à autre investir dans des instruments financiers qui ne sont pas négociés sur un marché actif (par exemple dans des produits dérivés négociés de gré à gré). La juste valeur est déterminée à l'aide de techniques d'évaluation. L'entreprise utilise diverses méthodes et formule des hypothèses fondées sur les conditions du marché existant à chaque date du bilan. Les techniques d'évaluation utilisées comprennent l'utilisation de transactions comparables récentes dans des conditions de concurrence normale, l'analyse des flux de trésorerie actualisés et d'autres techniques d'évaluation couramment utilisées par les acteurs du marché. Les valeurs attribuées à ces instruments sont basées sur les meilleures informations disponibles et, en raison de l'incertitude de l'évaluation, ces valeurs peuvent différer de manière significative des valeurs qui auraient été réalisées s'il existait un marché pour ces instruments et les différences pourraient être importantes. La conclusion de ces accords implique, à des degrés divers, des éléments de risque de crédit, de risque juridique, de risque de marché et de risque lié à la documentation qui dépassent les montants comptabilisés dans l'état du résultat global. Ces risques impliquent la possibilité qu'il n'y ait pas de marché liquide pour ces accords, que les contreparties aux accords manquent à leurs obligations d'exécution ou soient en désaccord sur la signification des termes contractuels des accords, ou qu'il y ait des changements défavorables dans les taux d'intérêt ou le prix de l'indice ou du titre sous-jacent à ces transactions. Les prix utilisés à la fin de l'exercice, qui proviennent d'un seul courtier ou sont basés sur des techniques d'évaluation, constituent la meilleure estimation de la juste valeur à la date de clôture de l'exercice. Toutefois, il existe un certain degré d'incertitude quant à ces prix. Il n'est pas toujours possible de clôturer les positions à la valeur de marché indiquée avec la contrepartie donnée.

(b) Comptabilisation/sortie de bilan

Les achats et ventes d'investissements effectués de la manière habituelle sont pris en compte à la date de transaction (la date à laquelle la Société s'engage à acheter ou à vendre l'actif) plus un jour. Les investissements sont initialement constatés à leur juste valeur et les coûts de transaction des actifs financiers comptabilisés à la juste valeur après affectation au compte de résultat sont imputés lorsqu'ils sont engagés. Les investissements seront sortis du bilan lorsque les droits de recevoir des flux de trésorerie en provenance des investissements auront expiré, ou que la Société aura transféré de manière substantielle tous les risques et les avantages inhérents à la propriété.

(c) Tarification par courtier unique

Les prix utilisés à la fin de l'exercice, qui proviennent d'un seul courtier, constituent la meilleure estimation de la juste valeur à la date de clôture de l'exercice. Toutefois, il existe un certain degré d'incertitude quant à ces prix. Il n'est pas toujours possible de clôturer les positions à la valeur indiquée avec la contrepartie donnée. Les valeurs des titres de chaque Fonds dont le prix a été déterminé à l'aide de sources provenant d'un seul courtier au 28 février 2023 et au 28 février 2022 sont indiquées dans la note 12.1 (d).

(d) Comptabilisation des investissements

Les opérations sur titres sont comptabilisées à la date de transaction plus une. Les investissements sont initialement comptabilisés à leur juste valeur et les coûts de transaction pour tous les titres « évalués à la juste valeur par le biais du compte de résultat » sont imputés lorsqu'ils sont engagés. Les gains ou pertes sur la vente de titres sont calculés en utilisant la méthode du premier entré, premier sorti (First-in-First-Out, « FIFO »).

(e) Revenus d'investissements

Les intérêts créditeurs et débiteurs sont constatés dans l'état du résultat global pour l'ensemble des instruments de créance en utilisant la méthode du taux d'intérêt effectif. Les gestionnaires de portefeuille suivent de près les revenus d'intérêts à recevoir pour identifier tous les arriérés d'intérêts. Les comptes ont été vérifiés afin d'identifier tous les arriérés d'intérêts et, au 28 février 2023 et au 28 février 2022, tous les montants étaient considérés comme étant récupérables.

Les dividendes sont reportés à l'état du résultat global à la date de cotation « ex-dividende » des titres concernés. Les revenus des dividendes sont indiqués bruts de tout précompte fiscal non récupérable, lequel est reporté séparément dans l'état du résultat global.

(f) Compensation des instruments financiers

Les actifs et les passifs financiers sont compensés et le montant net est enregistré dans l'état de la situation financière lorsqu'existe sur le plan légal un droit exécutoire de compensation des montants comptabilisés et qu'on désire régler sur une base nette, ou réaliser l'actif et de dénouer le passif simultanément. Il n'y avait pas d'instrument financier de compensation en portefeuille au 28 février 2023 ni au 28 février 2022.

(g) Estimations comptables et hypothèses importantes

La direction fait des estimations et émet des hypothèses quant à l'avenir. Les estimations comptables en résultant sont, par définition, rarement identiques aux résultats réels correspondants. Les estimations et hypothèses qui comportent un risque important susceptible d'exiger un ajustement significatif des valeurs comptables des actifs et passifs au cours du prochain exercice financier sont présentées ci-après.

Juste valeur des instruments financiers dérivés

La société peut, de temps à autre, détenir des instruments financiers qui ne sont pas cotés sur des marchés actifs, tels que des produits dérivés négociés de gré à gré. Les justes valeurs de ces instruments sont déterminées à l'aide des techniques d'évaluation décrites dans la note 2(a). Lorsque des techniques d'évaluation (par exemple, des modèles) sont utilisées pour déterminer les justes valeurs, elles sont validées et périodiquement revues et comparées au prix fourni par un prestataire de services d'évaluation indépendant, le cas échéant.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

2. Principales règles et méthodes comptables – (suite)

(g) Estimations comptables et hypothèses importantes – (suite)

Les modèles utilisent des données observables, dans la mesure du possible. Toutefois, des domaines tels que le risque de crédit (propre et de contrepartie), les volatilités et les corrélations nécessitent que la direction procède à des estimations. Des changements dans les hypothèses relatives à ces facteurs pourraient affecter la juste valeur déclarée des instruments financiers.

Les valeurs attribuées à ces instruments sont basées sur les meilleures informations disponibles et, en raison de l'incertitude de l'évaluation, ces valeurs peuvent différer de manière significative des valeurs qui auraient été réalisées s'il existait un marché pour ces instruments et les différences pourraient être importantes. La conclusion de ces accords implique, à des degrés divers, des éléments de risque de crédit, de risque juridique, de risque de marché et de risque lié à la documentation qui dépassent les montants comptabilisés dans l'état du résultat global. Ces risques impliquent la possibilité qu'il n'y ait pas de marché liquide pour ces accords, que les contreparties aux accords manquent à leurs obligations d'exécution ou soient en désaccord sur la signification des termes contractuels des accords, ou qu'il y ait des changements défavorables dans les taux d'intérêt ou le prix de l'indice ou du titre sous-jacent à ces transactions.

(h) Prêt de titres

Certains fonds peuvent prêter des titres à des courtiers, à des négociants et à d'autres organismes financiers pour obtenir des revenus supplémentaires. Chaque prêt de titres est garanti par des actifs en garantie d'un montant égal ou supérieur à la valeur de marché actuelle des titres prêtés. Il existe un risque de retard dans la réception des garanties ou dans la récupération des titres prêtés, voire de perte des droits sur les garanties en cas de défaillance financière de l'emprunteur.

Au 28 février 2023 et au 28 février 2022, aucun Fonds n'était engagé dans le prêt de titres.

(i) Péréquation

Un compte de péréquation est maintenu de manière à ce que le montant des distributions soit le même pour toutes les actions nonobstant les différentes dates d'émission. Les revenus et les charges d'égalisation sont comptabilisés dans l'état du résultat global.

Égalisation des revenus

Une somme égale à la partie du prix d'émission d'une action qui correspond aux revenus (le cas échéant) accumulés, mais non distribués à la date d'émission ; il est considéré comme un paiement d'égalisation remboursé par les actionnaires dans le versement du premier dividende auquel l'actionnaire avait droit pour la période comptable correspondant à celle au cours de laquelle les actions sont émises.

Charges d'égalisation

Une somme égale à la partie du prix d'émission d'une action qui correspond aux charges (le cas échéant) accumulées, mais non distribuées à la date d'émission ; elle est considérée comme un montant d'égalisation reçu et remboursé aux actionnaires dans le versement du premier dividende auquel l'actionnaire avait droit pour la période comptable correspondant à celle au cours de laquelle les actions sont émises.

(j) Charges

Les charges sont comptabilisées sur la base du fait générateur. Certains frais sont spécifiques à chaque catégorie d'actions et leur sont directement imputés. Les frais généraux d'un fonds sont imputés entre les différentes catégories d'actions sur la base de la valeur liquidative relative.

(k) Frais de transaction

Les coûts de transaction sont des coûts supplémentaires qui sont directement attribuables à l'acquisition, l'émission ou la cession d'un actif ou d'un passif financier. Un coût additionnel est un coût qui n'aurait pas été encouru si l'entité n'avait pas acquis, émis ou cédé l'instrument financier. Lors de la comptabilisation initiale d'un actif ou d'un passif financier, une entité doit l'évaluer à sa juste valeur, majorée des coûts de transaction des instruments directement comptabilisés dans l'état du résultat global.

Les coûts de transaction facturés par le Dépositaire lors du règlement des achats et ventes d'investissements sont compris dans les commissions de la Société d'administration et du Dépositaire figurant à l'état du résultat global de chaque Compartiment.

Les coûts de transaction sur les achats et ventes d'actions et de titres d'organismes de placement collectif, de contrats à terme et d'options sont indiqués à la Note 4 de chaque Fonds.

Les coûts de transaction afférents à l'achat et la vente d'obligations et d'autres instruments dérivés sont inclus dans le prix d'achat et de vente de l'investissement. Ils ne peuvent être regroupés de manière pratique et fiable, étant donné qu'ils sont intégrés dans le coût de l'investissement et ne peuvent pas être vérifiés et identifiés séparément.

(l) Conversion en devises étrangères

- Devise fonctionnelle et de présentation : Les éléments figurant dans les états financiers de la Société sont mesurés dans la devise de l'environnement économique principal où elle opère (la « devise fonctionnelle »). Il s'agit de dollars américains (USD) pour tous les fonds, à l'exception des fonds FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] et Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] dont la devise fonctionnelle est l'euro, FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] dont la devise fonctionnelle est la livre sterling, et Legg Mason Japan Equity Fund[^] dont la devise fonctionnelle est le yen japonais. La Société a adopté la devise fonctionnelle de chaque Compartiment comme devise de présentation des présents états financiers. Les états financiers de la Société sont présentés en dollars US.
- Les achats et les ventes de titres, ainsi que les produits et les charges sont convertis au taux de change en vigueur aux dates auxquelles ces opérations ont été enregistrées. Les actifs et passifs sont convertis au taux de change en vigueur à la clôture de l'exercice. Les différences entre les montants des produits et des charges enregistrés et perçus ou payés sont comptabilisées en tant que gains/pertes de change dans l'état du résultat global sous le poste gain/(perte) net(te) sur les actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat.

(m) Contrats de change à terme et au comptant

Un contrat de change à terme (« contrat de change à terme ») est un engagement consistant à acheter ou à vendre une devise étrangère à une date future et à un taux négocié. Les contrats de change à terme visent à gérer les risques de change et à tactiquement déplacer le risque de change du portefeuille. Les contrats de change à terme sont généralement souscrits en tant qu'instrument de couverture pour l'achat ou la vente d'un titre libellé dans une devise étrangère. Le Compartiment réalisera une plus-value ou moins-value lors de la clôture ou du règlement de la transaction à terme. Les plus-values ou moins-values latentes sur contrats de change à terme sont consignées dans l'état de la situation financière et dans l'état du résultat global. Les plus-values ou moins-values réalisées sont reportées avec toutes les autres plus-values et moins-values de change dans l'état du résultat global. Les risques relatifs aux contrats à terme comprennent l'incapacité potentielle de la contrepartie à respecter les conditions du contrat, ainsi que les fluctuations imprévues de la valeur d'une devise étrangère par rapport à la devise de référence du Compartiment. Les contrats de change à terme sont mesurés à leur juste valeur sur la base d'une source de prix indépendante par référence au cours auquel un nouveau contrat à terme de même taille et de même échéance pourrait être souscrit. Pour chaque Compartiment concerné, les plus-values ou moins-values sur les contrats de change au comptant ouverts sont incluses dans les disponibilités bancaires de l'état de la situation financière.

(n) Contrats à terme

Les dépôts de garantie initiaux sont effectués lors de la conclusion de contrats à terme et sont généralement effectués en espèces. Les contrats à terme sont évalués à leur juste valeur sur la base de leur prix de règlement quotidien. Les variations de la valeur des contrats à terme ouverts sont comptabilisées en tant que plus-values ou moins-values non réalisées sur les contrats à terme jusqu'à ce que les contrats soient résiliés, date à laquelle les plus-values et moins-values réalisées sont comptabilisées en tant que plus-values ou moins-values réalisées et incluses dans les plus-values/(moins-values) nettes sur les actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat dans l'état du résultat global. La plus-value ou la moins-value latente sur les contrats à terme est présentée dans l'état de la situation financière. Les plus-values et moins-values réalisées qui n'ont pas encore été livrées figurent dans les comptes sur marge et la trésorerie affectée dans l'état de la situation financière.

(o) Contrats d'option

La prime sur les options de vente achetées exercées est déduite du produit de la vente du titre sous-jacent ou de la devise étrangère pour déterminer la plus-value ou la moins-value réalisée. La prime sur les options d'achat exercées est ajoutée au coût des titres ou des devises achetés. Les primes payées pour l'achat d'options qui expirent sans avoir été exercées sont traitées comme des pertes réalisées. La plus-value ou moins-value sur les positions d'options ouvertes est calculée et enregistrée comme la juste valeur de l'option moins la prime payée sur cette option. Les plus-values ou moins-values latentes sur les positions d'options ouvertes sont comptabilisées comme des actifs ou des passifs dans l'état de la situation financière.

La prime sur les options d'achat vendues exercées est ajoutée au produit de la vente du titre sous-jacent ou de la devise étrangère pour déterminer la plus-value ou la moins-value réalisée. La prime sur les options de vente vendues exercées est déduite du coût des titres ou des devises achetés. Les primes reçues pour les options vendues, qui expirent sans avoir été exercées, sont traitées comme des plus-values réalisées.

(p) Instruments de swap

Les instruments de swap sont comptabilisés à leur juste valeur à la date de conclusion du contrat dérivé et sont ensuite réévalués à leur juste valeur. Les justes valeurs sont obtenues à partir des prix cotés sur des marchés actifs, y compris les transactions récentes sur le marché, et des techniques d'évaluation, y compris les modèles d'actualisation des flux de trésorerie et les modèles d'évaluation des options, le cas échéant. Tous les produits dérivés sont comptabilisés comme des actifs lorsque leur juste valeur est positive et comme des passifs lorsque leur juste valeur est négative. Les variations de la juste valeur des instruments de swap et les intérêts payés et perçus sur les instruments de swap sont comptabilisés dans l'état du résultat global sous la rubrique gain/(perte) net(te) sur les actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat.

Swap sur défaillance de crédit

Chaque fonds à revenu fixe (Fixed Income Fund tel que défini à la page 15), à l'exception du FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, peut conclure des contrats de swap sur défaillance de crédit, à condition que (i) le contrat de swap sur défaillance de crédit fasse l'objet d'une évaluation quotidienne par les fonds et d'une vérification indépendante au moins une fois par semaine, et que (ii) les risques liés au swap sur défaillance fassent l'objet d'une évaluation indépendante sur une base semestrielle et que le rapport soit soumis aux administrateurs pour examen. Un fonds peut être soit l'acheteur, soit le vendeur dans une transaction de swap de défaut de crédit. L'« acheteur » d'un contrat de défaut de crédit est tenu de verser à la contrepartie un flux périodique de paiements pendant la durée du contrat, à condition qu'aucun cas de défaut ne soit survenu sur une obligation de référence sous-jacente. Si un Fonds est acheteur et qu'aucun cas de défaillance ne se produit, le Fonds perdra son investissement et ne récupérera rien. En revanche, si le Fonds est un acheteur et qu'un cas de défaut se

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

2. Principales règles et méthodes comptables – (suite)

(p) Instruments de swap - (suite)

produit, le Fonds (l'acheteur) recevra la valeur notionnelle totale de l'obligation de référence qui peut avoir peu ou pas de valeur. Inversement, si le Fonds est vendeur et qu'un cas de défaut survient, le Fonds (le vendeur) doit payer à la contrepartie la valeur notionnelle totale, ou "valeur nominale", de l'obligation de référence en échange de l'obligation de référence. En tant que vendeur, un Fonds reçoit un taux de revenu fixe pendant toute la durée du contrat, qui est généralement comprise entre six mois et trois ans, à condition qu'il n'y ait pas de cas de défaut.

Les fonds achètent des contrats de swap de défaut de crédit afin de se couvrir contre le risque de baisse du prix du capital, ou de défaut, des titres de créance qu'ils détiennent. Les Fonds vendent des contrats de swap sur défaillance afin de s'exposer à la hausse du prix du capital, et le risque de défaillance est transféré de l'acheteur de contrats de défaillance au Fonds en tant que vendeur du contrat de swap sur défaillance. Cela implique le risque que le swap expire sans valeur et le risque de crédit que le vendeur ne parvienne pas à s'acquitter de ses obligations de paiement envers les Fonds en cas de défaillance. Les fonds ne peuvent conclure de telles transactions qu'avec des contreparties notées A- ou plus.

Swap de taux d'intérêt

Un swap de taux d'intérêt ou un swap de devises implique l'échange par un Fonds avec une autre partie de leurs engagements respectifs à payer ou à recevoir des flux de trésorerie, par exemple un échange de paiements à taux variable contre des paiements à taux fixe en devises de base ou en devises étrangères. L'achat d'un plafond donne à l'acheteur le droit, dans la mesure où un indice spécifié dépasse une valeur prédéterminée, de recevoir des paiements sur un montant de capital notionnel de la part de la partie qui vend le plafond. L'achat d'un floor permet à l'acheteur, dans la mesure où un indice spécifié tombe en dessous d'une valeur prédéterminée, de recevoir des paiements sur un montant nominal de référence de la part de la partie qui vend le floor. Un collar combine les éléments de l'achat d'un plafond et de la vente d'un floor. Les "spreads locks" sont des contrats qui garantissent la possibilité de conclure un swap de taux d'intérêt à un taux prédéterminé supérieur à un taux de référence.

Swaps d'actions

Les swaps d'actions sont des accords entre un Fonds et des tiers, qui permettent aux Fonds d'acquérir une exposition à l'évolution du prix de titres spécifiques sans avoir à acheter ces titres. Les variations de la valeur des contrats sont enregistrées en tant que plus-values ou moins-values latentes et les Fonds comptabilisent une plus-value ou une moins-value réalisée lorsque le contrat est clôturé.

Swaps de rendement total

Certains fonds peuvent investir dans des swaps de rendement total afin de réduire leur exposition à long terme au risque de marché et au risque de crédit. Les swaps de rendement total sont des contrats dans lesquels un Fonds paie ou reçoit une série de flux de trésorerie basés sur le rendement total d'un actif spécifié en échange du paiement ou de la réception, respectivement, d'un taux d'intérêt fixe ou variable basé sur ce même actif spécifié. Les swaps de rendement total sont évalués à leur juste valeur par un fournisseur de prix indépendant. Si le prix n'est pas disponible, ils sont évalués à leur juste valeur par le Franklin Templeton Global Valuation Committee (le "comité d'évaluation"). Ces positions sont rapprochées du prix de la contrepartie sur une base mensuelle.

Swaps de devises croisés

Les swaps de devises impliquent l'échange de deux devises différentes avec un accord pour inverser l'échange à une date ultérieure à des taux de change spécifiés. Le change de devises à la date d'entrée en vigueur du contrat s'effectue au taux de change au comptant en vigueur. Le ré-échange à l'échéance peut se faire au même taux de change, à un taux spécifié ou au taux au comptant du moment. Les paiements d'intérêts, le cas échéant, sont effectués entre les parties sur la base des taux d'intérêt disponibles dans les deux monnaies au début du contrat.

Swaps d'inflation

Les swaps d'inflation impliquent l'échange d'un taux fixe sur un montant nominal et d'un taux variable lié à un indice d'inflation. La partie qui paie le taux flottant paie le taux ajusté à l'inflation multiplié par le montant principal notionnel.

Swaps d'indice

Un swap d'indice est un contrat de couverture dans lequel une partie échange un flux de trésorerie prédéterminé avec une contrepartie à une date donnée. Une dette, des actions ou un autre indice de prix est utilisé comme échange convenu d'un côté de ce swap. Un swap indexé au jour le jour applique un indice de taux au jour le jour tel que les fonds fédéraux ou le taux interbancaire offert à Londres (LIBOR). Le swap indexé au jour le jour désigne un swap de taux d'intérêt impliquant l'échange du taux au jour le jour contre un taux d'intérêt fixe.

(q) Contrats différentiels

Un contrat différentiel est un accord entre deux parties pour échanger la différence entre le prix d'ouverture et le prix de clôture d'un contrat. Dans le cadre d'un contrat long différentiel, la contrepartie s'engage à payer au Fonds le montant, le cas échéant, de l'augmentation de la valeur du montant notionnel du contrat s'il avait été investi dans le ou les titres sous-jacents, plus les dividendes qui auraient été perçus sur ces actions. Dans un contrat différentiel à découvert, la contrepartie accepte de payer au Fonds le montant, le cas échéant, par lequel le montant notionnel du contrat aurait diminué en valeur s'il avait été investi dans le(s) titre(s) sous-jacent(s). Le Fonds doit également payer à la contrepartie la valeur des dividendes qui auraient été perçus sur ces actions.

(r) Titres négociés sur la base d'une « détermination future »

Les fonds peuvent négocier des titres sur la base d'une "détermination future" ("TBA"). Dans une transaction TBA, un Fonds s'engage à acheter ou à vendre des titres pour lesquels des informations spécifiques ne sont pas encore connues au moment de la transaction. Les titres achetés sur une base TBA ne sont pas réglés tant qu'ils n'ont pas été livrés au ou par le Fonds concerné, normalement 15 à 45 jours plus tard. Ces titres sont sujets à des fluctuations de marché et leur valeur actuelle est déterminée de la même manière que pour les autres titres.

(s) Placements à court terme

Les certificats de dépôt, les dépôts à terme et les autres placements à court terme auprès d'institutions financières sont évalués à leur valeur nominale avec les intérêts courus, le cas échéant.

(t) Accords de rachat et de prise en pension

Contrat de mise en pension désigne tout contrat en vertu duquel un Fonds transfère des titres, ou tout droit lié à un titre ou à une valeur mobilière, à une contrepartie sous réserve d'un engagement de les racheter à un prix spécifié à une date future spécifiée ou à spécifier. Contrat de prise en pension désigne tout contrat en vertu duquel un Fonds reçoit des titres, ou tout droit lié à un titre ou à une valeur mobilière, d'une contrepartie qui s'engage à les revendre à un prix spécifique à une date future spécifiée ou à spécifier.

Les titres achetés dans le cadre d'accords de revente sont évalués à leur valeur nominale et ajustés pour tenir compte des fluctuations des taux de change. Les taux d'intérêt varient pour chaque accord et sont fixés au début de l'accord. La politique de la société consiste à assurer la garde des titres achetés dans le cadre d'accords de prise en pension et à évaluer les titres sur une base quotidienne afin de protéger la société au cas où les titres ne seraient pas rachetés par la contrepartie. La société obtient généralement des garanties supplémentaires si la valeur de marché des titres sous-jacents est inférieure à la valeur nominale de l'accord de prise en pension, majorée des intérêts courus. En cas de manquement à l'obligation de rachat, la société a le droit de liquider la garantie et d'affecter le produit à la satisfaction de l'obligation. En cas de défaillance ou de faillite de la contrepartie à l'accord, la réalisation et/ou la rétention de la garantie ou du produit peut faire l'objet d'une procédure judiciaire. Des contrats de prise en pension ont été utilisés au cours de l'exercice dans le cadre d'une gestion efficace du portefeuille.

(u) Fonds négocié en bourse

Les fonds peuvent investir dans des fonds négociés en bourse ("ETF"). Les ETF sont des titres qui suivent un indice, une matière première ou un panier d'actions comme un fonds indiciel, mais s'échangent comme des actions sur une bourse de valeur. Ces titres sont sujets à des fluctuations de marché et leur valeur actuelle est déterminée de la même manière que pour les autres titres.

(v) Actions d'organismes de placement collectif

La juste valeur des investissements dans des fonds d'investissement ouverts est basée sur la valeur liquidative par action non audité fournie par l'administrateur du fonds concerné.

(w) Options sur swaps

Certains fonds peuvent investir dans des options sur swaps à des fins de couverture contre les fluctuations défavorables des taux d'intérêt. Ces instruments combinent les caractéristiques de deux autres instruments financiers, à savoir une option et un swap de taux d'intérêt. Les Fonds enregistrent une plus-value(moins-value) non réalisée (juste valeur) pour le montant que l'on s'attend à recevoir ou à payer en vertu de l'accord si ce montant était résilié au moment de l'évaluation. La juste valeur est fournie quotidiennement par Markit, le fournisseur. Les plus-values(moins-values) latentes sont comptabilisées comme un actif ou un passif financier dans l'état de la situation financière.

(x) Obligations indexées sur l'inflation de la Trésorerie (TIPS)

Certains fonds peuvent investir dans des titres indexés. Les titres indexés sont des titres dont le prix est indexé sur celui d'indices de valeurs mobilières, de devises ou d'autres statistiques financières. Les titres indexés sont généralement des titres de créance ou des dépôts dont la valeur à l'échéance et/ou le taux de coupon est déterminé par référence à un instrument ou à une statistique spécifique. La performance des titres indexés fluctue (directement ou inversement, selon l'instrument) en fonction de la performance de l'indice, du titre ou de la devise. Les titres sont évalués quotidiennement par le vendeur concerné et la variation de la juste valeur est enregistrée par les Fonds comme une plus-value ou une moins-value non réalisée.

(y) Titres de créance et participations au prêt

Les titres de créance et les participations à des prêts sont des prêts à taux fixe ou variable accordés dans le cadre de négociations privées entre une société ou un autre type d'entité et une ou plusieurs institutions financières. Ces investissements devraient prendre la forme de participations ou de cessions de prêts, qui peuvent ou non être titrisés. Les titres de créance et les participations à des prêts sont classés par l'entreprise comme des actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat et sont initialement comptabilisés à la juste valeur. Les plus et les moins-values induites par les variations de la juste valeur des actifs ou passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat sont présentées dans l'état du résultat global pour l'exercice au cours duquel elles apparaissent.

Notes aux états financiers – (suite)

2. Principales règles et méthodes comptables – (suite)

(2) Société en commandite ouverte (MLP)

Certains fonds peuvent investir dans des sociétés en commandite ouvertes (MLP) en achetant des parts émises aux commanditaires de la MLP qui sont cotées en bourse sur des marchés réglementés. Les MLP sont des sociétés en commandite ou des sociétés à responsabilité limitée qui tirent généralement leurs revenus et leurs gains de l'exploration, du développement, du stockage, de la collecte, de l'exploitation minière, de la production, du traitement, du raffinage, du transport (y compris les pipelines transportant du gaz, du pétrole ou des produits dérivés) ou de la commercialisation de toute ressource minérale ou naturelle. Les MLP ont généralement deux catégories de propriétaires, le commandité et les commanditaires. Les commanditaires détiennent le reste de la société, par le biais de parts ordinaires, et ont un rôle limité dans les opérations et la gestion.

La juste valeur d'un investissement dans un MLP est déterminée de la même manière que pour les autres titres. Les variations de la juste valeur sont enregistrées comme un gain ou une perte non réalisé(e).

(aa) Intérêts créditeurs et intérêts débiteurs

Les intérêts créditeurs et intérêts débiteurs comprennent les intérêts créditeurs et les intérêts débiteurs sur la trésorerie, les équivalents de trésorerie, les dépôts à terme et les dépôts de garantie. Les intérêts créditeurs et les intérêts débiteurs sont comptabilisés dans l'état du résultat global.

(ab) Comptes sur marge et liquidités soumises à restrictions

Les « Comptes sur marge et encaisse affectée » dans l'État de la situation financière représentent les dépôts sur marge, les garanties en espèces et les gains et pertes réalisés sur les contrats à terme non encore livrés.

Les dépôts de garantie sont détenus ou mis en gage auprès de courtiers en ce qui concerne les contrats de dérivés négociés en bourse et de gré à gré. Les garanties en espèces fournies ou reçues par les Fonds pour la négociation de produits dérivés sont également identifiées dans l'état de la situation financière dans les comptes sur marge et les liquidités soumises à restrictions et ne sont pas incluses dans les composantes de la trésorerie et des équivalents de trésorerie. Les soldes de garantie en espèces sont des montants liés à la négociation de produits dérivés et sont détenus à la fin de l'exercice auprès de courtiers. Les soldes de garantie en espèces reçus dans le cadre de la négociation de produits dérivés sont détenus auprès de The Bank of New York Mellon SA/NV, succursale de Dublin, et de tout sous-dépositaire, et sont payables aux courtiers à la fin de l'exercice.

(ac) Créances sur investissements / actions participatives rachetables vendues et payables sur investissements achetés / actions participatives rachetables rachetées

Les créances pour investissements / actions participatives rachetables vendues représentent les créances pour titres / actions participatives rachetables vendues qui ont été contractées mais qui n'ont pas encore été réglées ou livrées à la date de l'État de la situation financière. Ces montants sont comptabilisés initialement à la juste valeur et sont ensuite évalués au coût amorti.

Le montant à payer pour les investissements achetés / actions participatives rachetables acquises représente le montant à payer pour les titres achetés / actions participatives rachetables acquises qui ont été contractés mais qui n'ont pas encore été réglés ou livrés à la date de l'État de la situation financière. Ces montants sont comptabilisés initialement à la juste valeur et sont ensuite évalués au coût amorti.

(ad) Distributions aux Détenteurs d'actions de participation rachetables

Les distributions aux détenteurs d'actions participatives rachetables sont comptabilisées à la date de détachement du dividende et présentées en tant que "charges financières" dans l'état du résultat global.

3. Gestion efficace de portefeuille

Sous réserve des conditions et dans les limites établies périodiquement par la Banque centrale d'Irlande (la « Banque centrale »), et sauf indication contraire dans les politiques et les objectifs d'investissement d'un compartiment, les gestionnaires d'investissement et/ou gestionnaires d'investissement par délégation peuvent employer des techniques et des instruments d'investissement, tels que des contrats à terme standardisés, des options, des contrats de change à terme ainsi que d'autres instruments dérivés à des fins de gestion efficace du portefeuille. En outre, de nouvelles techniques et de nouveaux instruments peuvent être mis au point et être utilisés à l'avenir par un compartiment. un compartiment peut recourir à ces techniques et à ces instruments sous réserve de l'autorisation préalable de la Banque centrale et de toute restriction que celle-ci pourrait imposer.

Pour les OPCVM qui appliquent des techniques et des instruments de gestion de portefeuille efficaces, des informations doivent être fournies en vertu des Réglementations de la Banque centrale sur les OPCVM. Un OPCVM est tenu d'indiquer les revenus résultant des techniques et des instruments de gestion efficace de portefeuille pour toute l'année considérée, ainsi que les frais d'exploitation et commissions directs et indirects engagés. Veuillez vous reporter au tableau ci-dessous.

Les détails des instruments financiers dérivés ouverts à la fin de l'exercice financier sont présentés dans le portefeuille d'investissements des compartiments. Toutes les plus-values et moins-values réalisées résultant de l'utilisation de contrats dérivés aux fins de gestion efficace de portefeuille sont incluses dans les plus-values/(moins-values) nettes sur les actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais des profits ou des pertes dans l'État du résultat global.

Au cours de l'année, des contrats de prise en pension ont été conclus aux fins d'une gestion efficace du portefeuille. Des informations détaillées concernant les contrats de prise en pension à la fin de l'exercice sont présentées dans le portefeuille d'investissement.

Contrats de prise en pension

Une partie des actifs de chaque compartiment peut être détenue en liquidités à titre accessoire. À des fins de gestion efficace de portefeuille, chaque compartiment peut conclure des contrats de rachat et des contrats de prise en pension.

Le tableau ci-dessous présente le revenu généré par les contrats de prise en pension au cours de l'année close le 28 février 2023 et 28 février 2022 :

Nom du Compartiment	28 février 2023 (000's)	28 février 2022 (000's)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	5 725\$	70\$

Il n'y a pas eu de frais de transaction sur les achats et les ventes de contrats de prise en pension.

Transactions de prêt de titres

Certains compartiments peuvent également avoir recours à des contrats de prêt de titres à des fins de gestion efficace du portefeuille comme décrit ci-dessus. Dans le cadre de ces transactions, le compartiment peut transférer provisoirement ses titres à un emprunteur, lequel s'engage à restituer au compartiment des titres équivalents dans un délai prédéfini. En concluant ces transactions, le compartiment espère augmenter les rendements de son portefeuille de titres en percevant une commission pour avoir mis ses titres à la disposition de l'emprunteur. Aucun contrat de prêt de titres n'était en place pour aucun des compartiments au cours de l'année close le 28 février 2023 et 28 février 2022.

4. Frais d'exploitation et autres transactions avec des parties liées

Conformément au contrat de gestion conclu entre Franklin Templeton International Services S.à r.l (le « gestionnaire » ou « FTIS ») et la Société (le « contrat de gestion »), le gestionnaire sera en droit de recevoir une commission de gestion prélevée sur les actifs du compartiment concerné en contrepartie de ses services de gestion de portefeuille et de distribution. Cette commission sera acquise au titre de chaque jour de négociation et payable mensuellement à terme échu (la « commission de gestion »). La Société sera également responsable du prompt règlement ou du remboursement au Gestionnaire des commissions, frais de transfert, frais d'inscription, impôts et autres obligations similaires, frais et débours personnels régulièrement dus ou encourus par FTIS.

Les commissions de gestion maximales facturées pour chaque catégorie d'actions à la fin de l'exercice, (commissions exprimées sous forme de pourcentage de la valeur liquidative du compartiment concerné imputable à une telle catégorie) sont les suivantes :

Nom du compartiment	Commissions de gestion maximale	Nom du compartiment	Commissions de gestion maximale
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		FTGF Western Asset US Core Bond Fund	
Catégorie A	0,800 %	Catégorie A	0,800 %
Catégorie B	1,050 %	Catégorie B	1,050 %
Catégorie C	1,300 %	Catégorie C	1,300 %
Catégorie E	1,400 %	Catégorie E	1,400 %
Catégorie X	0,600 %	Catégorie F	0,400 %
Catégorie Premier	0,300 %	Catégorie R	0,550 %
Catégorie LM	Néant	Catégorie T	0,800 %
Catégorie A (G)	0,800 %	Catégorie X	0,300 %
Catégorie L (G)	0,800 %	Catégorie Premier	0,300 %
		Catégorie S	0,200 %
		Catégorie LM	Néant
		Catégorie GA	0,820 %
		Catégorie GE	1,420 %

Notes aux états financiers – (suite)

4. Frais d'exploitation et autres transactions des parties liées – (suite)

Nom du compartiment	Commissions de gestion maximale
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	
Catégorie A	1,000 %
Catégorie B	1,250 %
Catégorie C	1,500 %
Catégorie E	1,600 %
Catégorie F	0,550 %
Catégorie R	0,600 %
Catégorie T	1,000 %
Catégorie X	0,300 %
Catégorie Premier	0,300 %
Catégorie LM	Néant
Catégorie A (G)	1,150 %
Catégorie B (G)	1,650 %
Catégorie L (G)	1,650 %
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	
Catégorie A	0,800 %
Catégorie B	1,050 %
Catégorie C	1,300 %
Catégorie E	1,400 %
Catégorie F	0,550 %
Catégorie R	0,400 %
Catégorie T	0,800 %
Catégorie X	0,300 %
Catégorie Premier	0,300 %
Catégorie S	0,200 %
Catégorie LM	Néant
Catégorie GA	0,820 %
Catégorie GE	1,420 %
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^]	
Catégorie A	0,950 %
Catégorie B	1,200 %
Catégorie C	1,450 %
Catégorie E	1,550 %
Catégorie F	0,700 %
Catégorie R	0,550 %
Catégorie X	0,450 %
Catégorie Premier	0,450 %
Catégorie S	0,300 %
Catégorie LM	Néant
Catégorie A (G)	1,200 %
Catégorie B (G)	1,700 %
Catégorie L (G)	1,700 %
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	
Catégorie A	1,100 %
Catégorie B	1,350 %
Catégorie C	1,600 %
Catégorie E	1,700 %
Catégorie F	0,650 %
Catégorie R	0,700 %
Catégorie T	1,100 %
Catégorie X	0,550 %
Catégorie Premier	0,400 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Western Asset US High Yield Fund	
Catégorie A	0,950 %
Catégorie B	1,200 %
Catégorie C	1,450 %
Catégorie E	1,550 %
Catégorie F	0,700 %
Catégorie R	0,550 %
Catégorie T	0,950 %
Catégorie X	0,450 %
Catégorie Premier	0,450 %
Catégorie S	0,300 %
Catégorie LM	Néant
Catégorie A (G)	1,150 %
Catégorie L (G)	1,650 %
Catégorie GF	0,950 %
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^]	
Catégorie A	1,500 %
Catégorie B	1,750 %
Catégorie C	2,000 %
Catégorie E	2,100 %
Catégorie F	0,800 %
Catégorie R	1,100 %
Catégorie T	1,500 %
Catégorie X	0,750 %
Catégorie Premier	0,550 %
Catégorie S	0,450 %
Catégorie LM	Néant
Catégorie A (G)	1,250 %
Catégorie B (G)	1,750 %
Catégorie L (G)	1,750 %

Nom du compartiment	Commissions de gestion maximale
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^]	
Catégorie A	1,500 %
Catégorie B	1,750 %
Catégorie C	2,000 %
Catégorie E	2,100 %
Catégorie F	0,800 %
Catégorie R	1,100 %
Catégorie T	1,500 %
Catégorie X	0,750 %
Catégorie Premier	0,550 %
Catégorie S	0,450 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	
Catégorie A	0,950 %
Catégorie B	1,250 %
Catégorie C	1,450 %
Catégorie E	1,550 %
Catégorie F	0,700 %
Catégorie R	0,850 %
Catégorie T	0,950 %
Catégorie X	0,450 %
Catégorie Premier	0,450 %
Catégorie S	0,300 %
Catégorie LM	Néant
Catégorie A (G)	1,250 %
Catégorie L (G)	1,750 %
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^]	
Catégorie A	0,900 %
Catégorie B	1,150 %
Catégorie C	1,400 %
Catégorie E	1,500 %
Catégorie F	0,600 %
Catégorie R	0,550 %
Catégorie T	0,900 %
Catégorie X	0,450 %
Catégorie Premier	0,350 %
Catégorie S	0,250 %
Catégorie LM	Néant
Catégorie A (G)	1,100 %
Catégorie L (G)	1,600 %
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	
Catégorie A	1,100 %
Catégorie B	1,350 %
Catégorie C	1,600 %
Catégorie E	1,700 %
Catégorie F	0,850 %
Catégorie R	0,700 %
Catégorie T	1,100 %
Catégorie X	0,600 %
Catégorie Premier	0,600 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	
Catégorie A	0,850 %
Catégorie B	1,100 %
Catégorie C	1,350 %
Catégorie E	1,450 %
Catégorie F	0,600 %
Catégorie R	0,450 %
Catégorie T	0,850 %
Catégorie X	0,350 %
Catégorie Premier	0,350 %
Catégorie S	0,250 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]	
Catégorie A	0,900 %
Catégorie B	1,150 %
Catégorie C	1,400 %
Catégorie E	1,500 %
Catégorie F	0,650 %
Catégorie R	0,500 %
Catégorie T	0,900 %
Catégorie X	0,400 %
Catégorie Premier	0,400 %
Catégorie S	0,300 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]	
Catégorie A	0,850 %
Catégorie B	1,100 %
Catégorie C	1,350 %
Catégorie E	1,450 %
Catégorie F	0,600 %
Catégorie R	0,650 %
Catégorie T	0,850 %
Catégorie X	0,350 %
Catégorie Premier	0,350 %
Catégorie S	0,250 %
Catégorie LM	Néant

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

4. Frais d'exploitation et autres transactions des parties liées – (suite)

Nom du compartiment	Commissions de gestion maximale
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^]	
Catégorie A	1,150 %
Catégorie B	1,400 %
Catégorie C	1,650 %
Catégorie E	1,750 %
Catégorie F	0,700 %
Catégorie R	0,750 %
Catégorie T	1,150 %
Catégorie X	0,575 %
Catégorie Premier	0,450 %
Catégorie S	0,350 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]	
Catégorie A	1,500 %
Catégorie B	1,750 %
Catégorie C	2,000 %
Catégorie E	2,100 %
Catégorie F	1,250 %
Catégorie R	1,100 %
Catégorie T	1,500 %
Catégorie X	1,000 %
Catégorie Y	1,000 %
Catégorie Premier	1,000 %
Catégorie S	0,600 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]	
Catégorie A	1,250 %
Catégorie B	1,500 %
Catégorie C	1,750 %
Catégorie E	1,850 %
Catégorie F	0,800 %
Catégorie R	0,750 %
Catégorie T	1,250 %
Catégorie X	0,625 %
Catégorie Premier	0,600 %
Catégorie S	0,400 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]	
Catégorie D	1,200 %
Catégorie F	1,200 %
Catégorie M	0,600 %
Catégorie Premier	0,600 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]	
Catégorie A	1,000 %
Catégorie B	1,250 %
Catégorie C	1,500 %
Catégorie E	1,600 %
Catégorie F	0,550 %
Catégorie R	0,600 %
Catégorie X	0,500 %
Catégorie Premier	0,300 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]	
Catégorie A	0,800 %
Catégorie R	0,500 %
Catégorie T	0,800 %
Catégorie X	0,400 %
Catégorie Premier	0,300 %
Catégorie S	0,200 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]	
Catégorie A	0,800 %
Catégorie F	0,550 %
Catégorie R	0,500 %
Catégorie T	0,800 %
Catégorie X	0,300 %
Catégorie Premier	0,300 %
Catégorie S	0,200 %
Catégorie LM	Néant
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund[^]	
Catégorie LM	Néant
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]	
Catégorie A	0,850 %
Catégorie B	1,100 %
Catégorie C	1,350 %
Catégorie E	1,450 %
Catégorie F	0,600 %
Catégorie R	0,650 %
Catégorie T	0,850 %
Catégorie X	0,350 %
Catégorie Premier	0,350 %
Catégorie S	0,250 %
Catégorie LM	Néant

Nom du compartiment	Commissions de gestion maximale
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	
Catégorie A	1,100 %
Catégorie B	1,350 %
Catégorie C	1,600 %
Catégorie E	1,700 %
Catégorie F	0,850 %
Catégorie R	0,700 %
Catégorie T	1,100 %
Catégorie X	0,600 %
Catégorie Premier	0,600 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]	
Catégorie A	1,350 %
Catégorie B	1,600 %
Catégorie C	1,850 %
Catégorie E	1,950 %
Catégorie F	1,100 %
Catégorie J	0,900 %
Catégorie R	0,950 %
Catégorie X	0,900 %
Catégorie Premier	0,900 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]	
Catégorie A	1,100 %
Catégorie F	0,750 %
Catégorie T	1,100 %
Catégorie X	0,550 %
Catégorie Premier	0,550 %
Catégorie S	0,450 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	
Catégorie A	1,150 %
Catégorie B	1,400 %
Catégorie C	1,650 %
Catégorie E	1,750 %
Catégorie F	0,900 %
Catégorie R	0,750 %
Catégorie T	1,150 %
Catégorie X	0,650 %
Catégorie Premier	0,650 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	
Catégorie A	1,100 %
Catégorie B	1,350 %
Catégorie C	1,600 %
Catégorie E	1,700 %
Catégorie F	0,800 %
Catégorie J	0,450 %
Catégorie R	0,700 %
Catégorie T	1,100 %
Catégorie X	0,450 %
Catégorie Premier	0,450 %
Catégorie S	0,350 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]	
Catégorie A	1,650 %
Catégorie B	1,900 %
Catégorie C	2,150 %
Catégorie E	2,250 %
Catégorie F	1,300 %
Catégorie J	0,750 %
Catégorie R	1,250 %
Catégorie T	1,650 %
Catégorie X	1,150 %
Catégorie Premier	1,150 %
Catégorie S	0,750 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]	
Catégorie A	1,050 %
Catégorie B	1,300 %
Catégorie C	1,550 %
Catégorie E	1,650 %
Catégorie F	0,700 %
Catégorie T	1,050 %
Catégorie X	0,525 %
Catégorie Premier	0,525 %
Catégorie S	0,400 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]	
Catégorie A	2,000 %
Catégorie T	2,000 %
Catégorie U	1,000 %
Catégorie X	1,150 %
Catégorie Premier	1,150 %
Catégorie LM	Néant

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

4. Frais d'exploitation et autres transactions des parties liées – (suite)

Nom du compartiment	Commissions de gestion maximale
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]	
Catégorie A	1,100 %
Catégorie B	1,350 %
Catégorie C	1,600 %
Catégorie E	1,700 %
Catégorie F	0,800 %
Catégorie J	0,450 %
Catégorie R	0,700 %
Catégorie T	1,100 %
Catégorie X	0,550 %
Catégorie Premier	0,550 %
Catégorie S	0,450 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]	
Catégorie A	1,200 %
Catégorie E	1,950 %
Catégorie F	0,950 %
Catégorie R	0,700 %
Catégorie T	1,200 %
Catégorie X	0,600 %
Catégorie Premier	0,600 %
Catégorie S	0,500 %
Catégorie LM	Néant
FTGF ClearBridge Value Fund	
Catégorie A	1,350 %
Catégorie B	1,850 %
Catégorie C	1,850 %
Catégorie E	2,100 %
Catégorie F	1,100 %
Catégorie R	0,850 %
Catégorie T	1,350 %
Catégorie X	0,675 %
Catégorie Premier	0,675 %
Catégorie LM	Néant
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	
Catégorie A	1,250 %
Catégorie B	1,750 %
Catégorie C	1,750 %
Catégorie E	2,000 %
Catégorie F	1,000 %
Catégorie R	0,750 %
Catégorie T	1,250 %
Catégorie X	0,625 %
Catégorie Premier	0,625 %
Catégorie LM	Néant
Catégorie A (G)	1,250 %
Catégorie B (G)	1,750 %
Catégorie L (G)	1,750 %
Catégorie GA	1,420 %
Catégorie GE	2,170 %
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
Catégorie A	1,250 %
Catégorie B	1,750 %
Catégorie C	1,750 %
Catégorie E	2,000 %
Catégorie F	1,000 %
Catégorie R	0,750 %
Catégorie T	1,250 %
Catégorie U	0,525 %
Catégorie X	0,625 %
Catégorie Premier	0,625 %
Catégorie LM	Néant
Catégorie A (G)	1,250 %
Catégorie L (G)	1,750 %
Catégorie GA	1,420 %
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	
Catégorie A	1,300 %
Catégorie B	1,800 %
Catégorie C	1,800 %
Catégorie E	2,050 %
Catégorie F	1,050 %
Catégorie R	0,800 %
Catégorie T	1,300 %
Catégorie X	0,650 %
Catégorie Premier	0,650 %
Catégorie LM	Néant
Catégorie A (G)	1,300 %
Catégorie B (G)	1,800 %
Catégorie L (G)	1,800 %
Catégorie GA	1,420 %
Catégorie GE	2,170 %

Nom du compartiment	Commissions de gestion maximale
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	
Catégorie A	1,250 %
Catégorie B	1,750 %
Catégorie C	1,750 %
Catégorie E	2,000 %
Catégorie F	1,000 %
Catégorie R	0,800 %
Catégorie T	1,250 %
Catégorie X	0,625 %
Catégorie Premier	0,625 %
Catégorie LM	Néant
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]	
Catégorie A	1,200 %
Catégorie B	1,700 %
Catégorie C	1,700 %
Catégorie E	1,950 %
Catégorie F	0,950 %
Catégorie R	0,700 %
Catégorie T	1,200 %
Catégorie X	0,600 %
Catégorie Premier	0,600 %
Catégorie S	0,400 %
Catégorie LM	Néant
FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]	
Catégorie A	1,300 %
Catégorie B	1,800 %
Catégorie C	1,800 %
Catégorie E	2,050 %
Catégorie F	1,050 %
Catégorie R	0,800 %
Catégorie T	1,300 %
Catégorie X	0,650 %
Catégorie Premier	0,650 %
Catégorie S	0,550 %
Catégorie LM	Néant
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]	
Catégorie A	1,500 %
Catégorie B	2,000 %
Catégorie C	2,000 %
Catégorie E	2,250 %
Catégorie F	1,250 %
Catégorie R	1,000 %
Catégorie T	1,500 %
Catégorie U	0,650 %
Catégorie X	0,750 %
Catégorie Premier	0,750 %
Catégorie LM	Néant
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^]	
Catégorie A	1,650 %
Catégorie B	2,150 %
Catégorie C	2,150 %
Catégorie E	2,400 %
Catégorie F	1,400 %
Catégorie R	1,150 %
Catégorie T	1,650 %
Catégorie X	1,000 %
Catégorie Premier	1,000 %
Catégorie S	0,600 %
Catégorie LM	Néant
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	
Catégorie A	1,500 %
Catégorie B	2,000 %
Catégorie C	2,000 %
Catégorie E	2,250 %
Catégorie F	1,250 %
Catégorie R	1,000 %
Catégorie T	1,500 %
Catégorie U	0,600 %
Catégorie X	0,750 %
Catégorie Premier	0,750 %
Catégorie S	0,400 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	
Catégorie A	1,500 %
Catégorie B	2,000 %
Catégorie C	2,000 %
Catégorie E	2,250 %
Catégorie F	1,250 %
Catégorie R	1,000 %
Catégorie T	1,500 %
Catégorie X	0,750 %
Catégorie Premier	0,750 %
Catégorie LM	Néant

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

4. Frais d'exploitation et autres transactions des parties liées – (suite)

Nom du compartiment	Commissions de gestion maximale
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	
Catégorie A	1,500 %
Catégorie B	2,000 %
Catégorie C	2,000 %
Catégorie E	2,250 %
Catégorie F	1,250 %
Catégorie R	1,000 %
Catégorie T	1,500 %
Catégorie X	0,750 %
Catégorie Premier	0,750 %
Catégorie LM	Néant
Catégorie A (G)	1,250 %
Catégorie L (G)	1,750 %
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]	
Catégorie A	1,500 %
Catégorie B	2,000 %
Catégorie C	2,000 %
Catégorie E	2,250 %
Catégorie F	1,250 %
Catégorie R	1,000 %
Catégorie T	1,500 %
Catégorie X	0,750 %
Catégorie Premier	0,750 %
Catégorie S	0,550 %
Catégorie LM	Néant
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^]	
Catégorie A	1,350 %
Catégorie B	1,850 %
Catégorie C	1,850 %
Catégorie E	2,100 %
Catégorie F	1,100 %
Catégorie R	0,850 %
Catégorie T	1,350 %
Catégorie X	0,675 %
Catégorie Premier	0,675 %
Catégorie S	0,500 %
Catégorie LM	Néant
Catégorie A (G)	1,350 %
Catégorie B (G)	1,850 %
Catégorie L (G)	1,850 %
Catégorie GA	1,420 %
Catégorie GE	2,170 %
Catégorie GP	0,850 %
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	
Catégorie A	1,350 %
Catégorie B	1,850 %
Catégorie C	1,850 %
Catégorie E	2,100 %
Catégorie F	1,100 %
Catégorie R	0,850 %
Catégorie T	1,350 %
Catégorie X	0,675 %
Catégorie Premier	0,675 %
Catégorie S	0,500 %
Catégorie LM	Néant
Catégorie GA	1,620 %
Catégorie GE	2,370 %
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^]	
Catégorie A	1,350 %
Catégorie B	1,850 %
Catégorie C	1,850 %
Catégorie E	2,100 %
Catégorie F	1,100 %
Catégorie R	0,850 %
Catégorie T	1,350 %
Catégorie X	0,675 %
Catégorie Premier	0,675 %
Catégorie S	0,500 %
Catégorie LM	Néant
Catégorie GA	1,420 %
Catégorie GE	2,170 %

Nom du compartiment	Commissions de gestion maximale
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^]	
Catégorie A	1,500 %
Catégorie B	2,000 %
Catégorie C	2,000 %
Catégorie E	2,250 %
Catégorie F	1,250 %
Catégorie M	1,000 %
Catégorie R	1,000 %
Catégorie T	1,500 %
Catégorie Premier	0,750 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]	
Catégorie A	1,500 %
Catégorie B	2,000 %
Catégorie C	2,000 %
Catégorie E	2,250 %
Catégorie F	1,250 %
Catégorie R	1,000 %
Catégorie T	1,500 %
Catégorie X	0,750 %
Catégorie Premier	0,750 %
Catégorie S	0,650 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	
Catégorie A	1,500 %
Catégorie B	2,000 %
Catégorie C	2,000 %
Catégorie D	1,100 %
Catégorie E	2,250 %
Catégorie F	1,250 %
Catégorie R	1,000 %
Catégorie T	1,500 %
Catégorie X	0,750 %
Catégorie Premier	0,750 %
Catégorie S	0,440 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]	
Catégorie A	1,500 %
Catégorie B	2,000 %
Catégorie C	2,000 %
Catégorie E	2,250 %
Catégorie F	1,250 %
Catégorie J	0,650 %
Catégorie R	1,000 %
Catégorie T	1,500 %
Catégorie X	0,750 %
Catégorie Premier	0,750 %
Catégorie S	0,650 %
Catégorie LM	Néant
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]	
Catégorie A	1,500 %
Catégorie B	2,000 %
Catégorie C	2,000 %
Catégorie E	2,250 %
Catégorie F	1,250 %
Catégorie R	1,000 %
Catégorie X	0,750 %
Catégorie Premier	0,750 %
Catégorie S	0,650 %
Catégorie LM	Néant
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]	
Catégorie A	0,60 %
Catégorie D	1,15 %
Catégorie K	0,60 %
Catégorie X	0,20 %

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

4. Frais d'exploitation et autres transactions des parties liées – (suite)

Dans les tableaux ci-dessus, les commissions de gestion pour chaque compartiment s'appliquent à toutes classes d'actions offertes par le compartiment énumérées dans les colonnes pertinentes. Toutes les classes d'actions ne sont pas proposées par tous les Fonds et toutes les classes d'actions n'étaient pas émises à la fin de l'exercice en cours et de l'exercice précédent. Le Prospectus et ses révisions occasionnelles indiquent les classes d'actions offertes par chaque Compartiment.

Conformément à chaque Contrat de gestion d'investissement, la Société de gestion est responsable du paiement des commissions et des frais du Gestionnaire d'investissement concerné.

Société de gestion a volontairement accepté de renoncer à une partie de ses commissions et/ou au remboursement de certaines dépenses afin que les dépenses totales ne dépassent pas certaines limites de dépenses volontairement établies pour les Compartiments. La Société de gestion peut, à son unique discrétion et à tout moment, réviser ou supprimer les exonérations et/ou remboursements de frais volontaires.

Pour les exercices financiers clos les 28 février 2023 et 28 février 2022, les frais de gestion annulés, remboursés et les autres dépenses récupérées sont les suivantes :

Nom du Compartiment	28 février 2023 en (milliers d'euros)		28 février 2022 en (milliers d'euros)	
	Commissions de gestion renoncées	Commissions de gestion remboursées et autres dépenses récupérées	Commissions de gestion renoncées	Commissions de gestion remboursées et autres dépenses récupérées
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	622\$	23\$	4 389\$	647\$
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	9\$	– \$	– \$	– \$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	3\$	– \$	– \$	– \$
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^]	3\$	– \$	1\$	– \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	– \$	1\$	– \$	– \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	2\$	2\$	– \$	– \$
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^]	– \$	10\$	1\$	– \$
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]	– \$	17\$	– \$	– \$
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]	14\$	13\$	– \$	– \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	– \$	– \$	1\$	– \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	– \$	– \$	– \$	2\$
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	– €	11€	– €	– €
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	1\$	– \$	1\$	– \$
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	– \$	76\$	– \$	85\$
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	28\$	22\$	4\$	23\$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	35\$	– \$	34\$	– \$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	22\$	3\$	6\$	2\$
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	32\$	33\$	36\$	1\$
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	– \$	24\$	– \$	20\$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	17\$	15\$	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	10\$	47\$	9\$	31\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	19\$	– \$	10\$	– \$
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	25\$	– \$	21\$	– \$
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	14\$	24\$	11\$	2\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	– \$	– \$	3\$	– \$
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	26\$	2\$	9\$	14\$
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	1€	7€	– €	– €
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	1\$	– \$	1\$	– \$
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^]	– \$	– \$	– \$	23\$
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	– \$	33\$	4\$	– \$
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	35\$	– \$	3\$	– \$
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]	– €	– €	5€	13€
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	2\$	7\$	1\$	5\$
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	36\$	– \$	9\$	– \$
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	6€	5€	3€	– €
Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	6€	14€	– €	– €

Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 USD/0 EUR ou inférieurs à 1 000 USD/1 000 EUR.

En vertu de chaque contrat de gestion d'investissement, chaque gestionnaire d'investissement est en droit de recevoir une commission de gestion d'investissements et chaque gestionnaire d'investissement sera responsable de payer les commissions et débours des gestionnaires d'investissement délégués, qui seront prélevés sur sa propre commission de gestion d'investissements (qui peut comprendre la « commission de performance »).

Aux termes du contrat de distribution principal conclu entre le gestionnaire, la Société et Franklin Distributors, LLC (le « distributeur principal »), le distributeur principal est autorisé à commercialiser, promouvoir, offrir et organiser la vente et le rachat d'actions de la Société (ci-après collectivement, les « services de distribution »). De même, Distributeur principal est autorisé à engager, à ses propres frais, un ou plusieurs distributeurs pour l'assister dans l'exercice de ses fonctions et responsabilités, à condition que les nominations de ces autres sociétés soient faites conformément aux exigences des règles de la Banque centrale. En vertu du Contrat de Distribution principal entre le Gestionnaire, la Société et le Distributeur principal, dans de telles circonstances, le Distributeur principal reste responsable vis-à-vis du Gestionnaire en ce qui concerne l'exécution de ses obligations en vertu dudit contrat. Le distributeur principal, conformément aux exigences de la Banque centrale, a nommé Legg Mason Asset Management Hong Kong Limited (« LMAMHK ») (cessation au 1er juillet 2022), Franklin Templeton Investments (Asia) Limited (« FTIA ») (à compter du 1er juillet 2022) et Templeton Asset Management Ltd. (à compter du 1er janvier 2023, anciennement Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited) en tant que distributeurs supplémentaires des Fonds. Le Gestionnaire s'est également nommé, ainsi que Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc., pour fournir certains services de distribution.

La Société sera également responsable du prompt règlement ou du remboursement à la société de gestion des commissions, frais de transfert, frais d'inscription, impôts et autres obligations similaires, frais et débours personnels régulièrement dus, ou encourus par la société de gestion.

Commission d'agent de service aux actionnaires

Conformément au Contrat de Gestion conclu entre la Société et la Société de gestion, cette dernière sera en droit de recevoir une commission d'agent de service aux actionnaires prélevée sur les actifs des Compartiments concernés en contrepartie de ses services ; cette commission sera acquise au titre de chaque jour de négociation et payable mensuellement à terme échu (la « Commission d'agent de service aux actionnaires »). Les commissions d'Agent de services aux Actionnaires sont payables mensuellement à terme échu et s'accumulent chaque jour de négociation. En vertu du contrat cadre de services aux actionnaires conclu entre le gestionnaire, la Société et Franklin Distributors, LLC (le « mandataire en charge des services aux actionnaires » ou l'« agents de services aux actionnaires principal »), le mandataire en charge des services aux actionnaires sera en droit de recevoir de la part du gestionnaire une commission de mandataire de service aux actionnaires de la part de certaines classes d'actions en échange de ses services en qualité de mandataire de services aux actionnaires.

En vertu du Contrat cadre de services aux actionnaires, le Mandataire en charge des services aux Actionnaires est autorisé, à ses propres frais et charges, à engager une ou plusieurs partie(s) aux fins de l'assister dans le cadre de ses responsabilités aux termes du contrat, sous réserve que le Mandataire en charge des services aux Actionnaires demeure responsable envers le Gestionnaire de l'exécution des obligations lui incombant en vertu dudit contrat. Conformément, l'agent principal de services aux actionnaires a nommé LMAMHK (cessation au 1er juillet 2022), FTIA (à compter du 1er juillet 2022) et Templeton Asset Management Ltd. (à compter du 1er janvier 2023, anciennement Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited) en tant d'Agents de Services aux Actionnaires supplémentaires de la Société. Le Gestionnaire a autorisé Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc. à fournir des services aux actionnaires concernant Taiwan.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

4. Frais d'exploitation et autres transactions des parties liées – (suite)

Le montant global des commissions d'Agent de services aux actionnaires payé par chaque catégorie d'actions est ou a été égal à :

- (i) 0,15 pour cent par an de la valeur liquidative des compartiments FTGF Western Asset US Core Bond Fund, FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund, FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^], FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund, FTGF Western Asset US High Yield Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^], FTGF Western Asset Global High Yield Fund, Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^], FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund, FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund, FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^], FTGF Western Asset Global Credit Fund[^], Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^], FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^], FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^], FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund, FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund, FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] et FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]; et
- (ii) 0,35 pour cent par an de la valeur liquidative des compartiments FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^], FTGF ClearBridge Value Fund, FTGF ClearBridge US Appreciation Fund, FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund, FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund, FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund, FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^], FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^], FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund, FTGF Royce US Smaller Companies Fund, FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund, FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^] et FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^].

Des commissions de services aux actionnaires sont à payer pour toutes les classes sauf les Classes d'Actions F, les Classes d'Actions J, les Classes d'Actions U, les Classes d'Actions Y, les Classes d'Actions LM, les Classes d'Actions Grandfathered et les Classes d'Actions Galleon (chacune d'entre elles étant définie au Prospectus). Celles-ci ne sont pas à payer non plus sur toutes les classes d'actions offertes par les Fonds FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund[^] and Franklin Responsible Income 2028 Fund[^].

Au cours des exercices clos les 28 février 2023 et 28 février 2022, les commissions de services aux actionnaires ayant fait l'objet d'une renonciation s'établissaient comme suit :

Nom du compartiment	Services aux actionnaires Services Frais Dispensé 28 Février 2023 en (000's)	Services aux actionnaires Services Frais Dispensé 28 Février 2022 en (000's)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	42\$	– \$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	12\$	– \$
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^]	21\$	10\$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	6\$	– \$
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^]	4\$	7\$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	21\$	– \$
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]	5\$	1\$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	1\$	– \$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	8\$	3\$
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	1\$	– \$
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	15\$	– \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	21\$	10\$
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	89\$	97\$
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	1\$	1\$
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	2\$	3\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	– \$	5\$
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	11\$	– \$
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	1€	3€
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	30\$	15\$
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	– \$	10\$
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	8\$	116\$
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]	– €	11€
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	31\$	19\$
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	5\$	2\$

Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 USD/0 EUR ou inférieures à 1 000 USD/1 000 EUR.

En outre, certaines dépenses opérationnelles, y compris, mais sans s'y limiter, les frais payables aux filiales de Franklin Templeton pour la fourniture d'un soutien à la gouvernance et de rapports au conseil, les services d'assurance au conseil et les services d'enregistrement permanent pour les juridictions où les compartiments sont offerts au public. Pour l'exercice clos le 28 février 2023, ces charges s'élevaient à 1 313 151 \$ (28 février 2022 : 1 260 797 \$)

Parties liées

Jane Trust, Jaspal Sagger et William Jackson sont administrateurs de la Société et sont également administrateurs et/ou dirigeants de certains affiliés du gestionnaire, des gestionnaires d'investissement, des distributeurs et des agents de service aux actionnaires. Joseph Carrier a été administrateur de la Société et, jusqu'à la date de cessation de son emploi chez Franklin Templeton Investments le 3 octobre 2022, il a également été administrateur et/ou dirigeant de certaines sociétés affiliées au gestionnaire, aux gestionnaires de portefeuille, aux distributeurs et aux agents de service aux actionnaires. William Jackson et Jane Trust sont également administrateurs de FTIS. Les administrateurs restants de la Société, tels qu'énumérés ci-dessus, sont tous ou ont tous été des employés de FTIS ou de l'une de ses filiales. À l'exception de ce qui est indiqué ci-dessus, aucun des administrateurs n'a ou n'a eu d'intérêt direct ou indirect dans un contrat ou un accord existant à la date des présentes qui soit significatif par rapport aux activités de la Société.

Au 28 février 2023 et 28 février 2022, les compartiments figurant dans le tableau ci-dessous détenaient des placements dans des organismes de placement collectif ayant nommé un gestionnaire, des gestionnaires d'investissement, ou des gestionnaires d'investissement délégués identiques à ceux nommés par le compartiment, ou ayant nommé une partie liée dudit gestionnaire, desdits gestionnaires d'investissement ou gestionnaires d'investissement délégués.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

4. Frais d'exploitation et autres transactions des parties liées – (suite)

Le tableau ci-dessous présente les pourcentages de participation relatifs aux organismes de placement collectif détenus par la Société :

Fonds	Organisme de placement collectif sous-jacent	28 février 2023		28 février 2022	
		%	Valeur (en milliers)	%	Valeur (en milliers)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	0,07 %	1 741\$	0,30 %	5 470\$
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	0,03 %	654€	0,05 %	808€
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	12,62 %	1 117\$	11,55 %	6 832\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – LM Class US\$ Accumulating	21,75 %	2 899\$	11,08 %	4 821\$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	0,07 %	1 661\$	0,05 %	914\$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	1,50 %	133\$	1,29 %	762\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	0,17 %	3 862\$	0,68 %	12 311\$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	0,73 %	17 040\$	0,37 %	6 636\$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class LM	3,14 %	10 921\$	2,52 %	20 460\$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – LM Class US\$ Accumulating	2,22 %	296\$	–	–
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	0,02 %	559\$	0,04 %	718\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	24,65 %	2 181\$	24,56 %	14 535\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	0,70 %	16 369\$	–	–
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	5,73 %	507\$	4,81 %	2 845\$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	0,74 %	17 212\$	2,00 %	36 257\$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	0,05 %	1 154\$	1,03 %	18 650\$
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribution)	0,06 %	1 342\$	0,01 %	213\$
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	0,00 %	30\$	0,00 %	64\$
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	1,39 %	32 545\$	2,31 %	41 913\$
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	0,05 %	1 100\$	0,08 %	1 480\$
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	0,01 %	180\$	0,01 %	140\$

Les investissements croisés effectués par les Compartiments au sein de la Société sont indiqués dans la Note 13 des états financiers.

Coûts de transaction

Les coûts de transaction sur achats et ventes d'actions et de parts d'organismes de placement collectif pour les exercices clos les 28 février 2023 et 28 février 2022 sont présentés ci-dessous :

Nom du Compartiment	28 février 2023	28 février 2022
	(000's)	(000's)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	32\$	43\$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	248\$	235\$
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	10€	11€
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^]	– \$	– \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	9\$	12\$
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^]	– \$	1\$
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]	– \$	– \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	6\$	4\$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	1\$	2\$
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]	– \$	3\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	5\$	16\$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	14\$	16\$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	14\$	22\$
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	3\$	3\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	9 768\$	7 891\$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	32\$	83\$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	23\$	29\$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	51\$	36\$
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	£1	2£
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	7\$	7\$
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	11\$	7\$
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	2\$	7\$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	90\$	23\$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	– \$	4\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	41\$	81\$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	16\$	8\$
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	4\$	14\$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	1\$	1\$
FTGF ClearBridge Value Fund	260\$	247\$
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	4\$	6\$
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	57\$	58\$
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	36\$	64\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	3\$	5\$

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

4. Frais d'exploitation et autres transactions des parties liées – (suite)

Nom du Compartiment	28 février 2023 (000's)	28 février 2022 (000's)
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	81\$	161\$
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	7\$	9\$
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	1 247€	546€
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	– \$	3\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	904\$	355\$
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	1 128\$	2 082\$
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	91\$	92\$
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	5\$	7\$
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	– €	24€
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	11\$	26\$
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	– \$	3\$
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	32\$	144\$
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	181\$	215\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	13\$	13\$
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	40\$	45\$
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	153€	467€

Les montants désignés par « - » sont égaux à 0 \$/0 €/0 £ soit inférieurs à 1 000 \$/1 000 €/1 000 £.

Commission de performance

Outre les commissions de gestion d'investissement indiquées ci-dessus, le gestionnaire peut recevoir une commission (une « commission de performance ») liée à la performance des catégories d'actions PF (catégories avec commission de performance, identifiées par l'ajout des lettres « (PF) » à leur dénomination).

Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] (cessation d'activités le 1^{er} juin 2021)

Pour le Compartiment Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], pour chaque Classe d'Actions PF, la Commission de performance a normalement été calculée pour chaque période de douze mois prenant fin le dernier jour de négociation de chaque exercice fiscal annuel (une « Période de calcul »). Pour chaque catégorie d'actions PF, la première période de calcul était la période commençant le jour ouvrable suivant immédiatement le jour de négociation au cours duquel la valeur d'actif net était calculée pour la première fois pour cette catégorie d'actions (le « premier jour de négociation ») et prenant fin le dernier jour de négociation de l'exercice au cours duquel le premier jour de négociation intervient (la « première période de calcul »).

Pour chaque Période de calcul de chaque Classe d'Actions PF, le Gestionnaire d'investissement a eu droit à une Commission de performance correspondant à 20 pour cent du montant éventuel par lequel la performance de la valeur liquidative par action au cours de cette période a dépassé le « High Water Mark » (tel que défini ci-dessous) applicable à la fin de la Période de calcul précédente. Pour les catégories d'actions de distribution et pour les besoins d'évaluation de la performance de la valeur liquidative par action au cours de la période de calcul, tout dividende versé au cours de la période devait être ajouté à la valeur liquidative. Pour chaque catégorie d'actions PF, dès lors qu'elle était exigible au titre d'une période de calcul, une commission de performance ne devait pas être affectée par les pertes subies par les compartiments ou la catégorie d'actions PF au cours de toute période de calcul ultérieure. Toute commission de performance était cumulée chaque jour de négociation et versée normalement dans un délai de 21 jours à compter de la fin de la période de calcul, après vérification par le dépositaire. Si le contrat du gestionnaire de portefeuille était résilié avant le dernier jour de négociation de tout exercice, pour chaque catégorie d'actions PF, la commission de performance au titre de la période de calcul applicable à cette date devait être calculée et versée comme si la date de résiliation correspondait à la fin de la période de calcul. Si un actionnaire demandait le rachat de ses actions de catégorie PF avant la fin d'une période de calcul, toute commission de performance cumulée sur ses actions devait avoir été bloquée et versée au gestionnaire d'investissement.

Le plus haut historique de chaque catégorie d'actions PF du Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] correspondait à la valeur suivante, en fonction de celle qui était la plus élevée : (i) le prix d'offre initial par action, (ii) la valeur liquidative par action la plus élevée immédiatement après la fin de chaque période de calcul et (iii), si la catégorie d'actions PF est lancée à l'issue d'une fusion d'une catégorie d'actions dans un autre compartiment géré par le gestionnaire d'investissement délégué, la plus haute cotation de cette catégorie d'actions à la date de la fusion, après calcul conformément aux conditions d'offre de l'autre compartiment concerné.

Le Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] n'a pas effectué de péréquation des revenus pour les actionnaires concernant les cumuls de commissions de performance.

Aucune commission de performance n'a été perçue au cours de l'exercice clos le 28 février 2023 (28 février 2022 : Les commissions de performance comptabilisées sont présentées dans l'état du résultat global).

Commissions de la Société d'administration et du Dépositaire

La Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch agit en tant que dépositaire (le « Dépositaire ») et la BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company (la « Société d'administrateur ») agit en tant qu'administrateur de tous les Fonds de la Société. Pour leurs services d'administration, de comptabilité, de services aux actionnaires, de services de fiducie et de services de garde de biens, ils perçoivent collectivement des Compartiments une commission maximale de 0,15 % de la valeur de l'actif net de chaque Compartiment.

Rémunération des Administrateurs

Les commissions et débours des administrateurs cumulés et comptabilisés dans le compte de résultat de l'état du résultat global et correspondant à l'exercice clos le 28 février 2023 se montaient à 143 000 \$ (28 février 2022 : 140 000 \$).

Aucune rémunération d'administrateur n'est due au titre de Jane Trust, Jaspal Sagger et William Jackson, qui sont des salariés du gestionnaire, du gestionnaire de portefeuille ou de leurs entités affiliées. Aucune rémunération d'administrateur n'était due au titre de Joseph Carrier jusqu'au 3 octobre 2022, date de fin de son emploi à plein temps chez Franklin Templeton Investments. M. Carrier continuera d'agir en qualité d'administrateur non exécutif de la Société et, à partir du 3 octobre 2022, sera rémunéré comme les autres administrateurs non exécutifs de la Société.

Rémunération des auditeurs

Les honoraires versés aux auditeurs, PricewaterhouseCoopers, d'un montant de 1 064 363 € (hors TVA), au titre de l'exercice, concernent le contrôle légal des états financiers de la société (28 février 2022 : 1 068 650€) (hors taxes). Le montant total des honoraires d'audit de la société, tel que détaillé dans l'état du résultat global à la page 226, comprend la TVA de 23 % et est présenté dans la devise de présentation de la société (le dollar américain).

Pour l'exercice clos le 28 février 2023, les frais remboursés aux auditeurs se sont élevés à 11 804 € (aucun débours versé aux commissaires aux comptes pour l'exercice clos le 28 février 2022).

Autres transactions avec des parties liées

Le tableau ci-dessous indique le pourcentage de participation des principaux actionnaires détenant plus de 20 % du capital social émis du Compartiment :

Fonds	% Holding 28 February 2023	% Holding 28 February 2022
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	71,16	73,47
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	21,10	–
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	–	26,73
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	92,89	97,13
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	–	22,36
FTGF Western Asset US High Yield Fund	34,32	25,50
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^]	–	66,96
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]	–	24,70
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]	–	22,32
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	29,86	31,62
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	21,21	–
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]	–	73,89
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	29,89	39,26
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	26,15	32,01
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	68,41	61,17
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	77,47	84,13
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	–	44,11
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	–	24,98
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	–	21,74
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	35,78	32,51
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	68,68	39,07
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	94,78	99,94

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

4. Frais d'exploitation et autres transactions des parties liées – (suite)

Fonds	% Holding 28 février 2023	% Holding 28 février 2022
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	100,00	100,00
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	81,03	83,85
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	95,79	94,78
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	65,31	65,44
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	23,18	23,00
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	32,53	72,28
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	23,04	–
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	96,36	96,77
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	51,35	50,15
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	21,00	20,52
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	31,26	44,84
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	27,49	24,50
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	40,60	39,63
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	26,66	24,02
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	99,01	99,02
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	91,03	79,63
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	–	20,36
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	100,00	–
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	–	94,31
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	75,02	–
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	32,03	32,50
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	45,87	28,47
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	–	20,79
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	34,53	37,18
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	54,38	48,76
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	–	23,67
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	21,50	–
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	–	97,91
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	27,65	75,35
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	21,57	–
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	40,84	38,93
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	99,79	100,00
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	–	54,02
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	41,38	38,44
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	22,30	50,58
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	21,52	–
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	60,68	35,12
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	58,97	59,03
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	23,93	21,24
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	27,69	36,19
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	26,36	–
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	26,85	–
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	20,92	–
Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	53,20	–
Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	24,34	–

Les montants désignés par « – » sont égaux à 0.

5. Distributions aux Détenteurs d'actions de participation rachetables

Classes d'actions de Distribution

La lettre entre parenthèses à la fin du nom de chaque Classe d'actions de Distribution indique une fréquence particulière des déclarations et des versements de dividendes, comme cela est précisé dans le tableau ci-après.

Désignation des Classes d'actions de Distribution	Fréquence des déclarations de dividende	Fréquence du versement de dividendes
(D)	Quotidienne	Mensuelle
(M)	Mensuelle	Mensuelle
(Q)	Trimestrielle	Trimestrielle (mars, juin, septembre, décembre)
(S)	Semestrielle	Semestrielle (mars, septembre)
(A)	Annuelle	Annuelle (mars)

Pour chaque catégorie d'actions de distribution de chaque compartiment à revenu fixe (selon ce qui est défini à la page 15), au moment de chaque déclaration de dividende : (1) la totalité ou une partie du revenu net de l'investissement, le cas échéant, sera déclarée en tant que dividende ; et (2) la totalité ou une partie des plus-values réalisées et latentes minorées des moins-values réalisées et latentes pourra être déclarée en tant que dividende, sans obligation de l'être.

Pour chaque Classe d'Actions de Distribution de chaque Compartiment en actions (Compartiment en actions tel que défini à la page 15), lors de chaque déclaration de dividende, tout, ou partie, du revenu net des placements, s'il y a lieu, sera déclaré comme dividende. Pour chaque Actionnaire de chaque Classe d'Actions de Distribution, les versements seront effectués dans la devise dans laquelle l'Actionnaire a souscrit aux actions, sauf indication contraire de la part de l'Actionnaire.

Pour chaque Classe d'Actions de Distribution de chaque Compartiment à actifs multiples (Compartiment à actifs multiples tel que défini à la page 15), lors de chaque déclaration de dividende, tout, ou partie, du revenu net des placements, s'il y a lieu, sera déclaré comme dividende. Pour chaque Actionnaire de chaque Classe d'Actions de Distribution, les versements seront effectués dans la devise dans laquelle l'Actionnaire a souscrit aux actions, sauf indication contraire de la part de l'Actionnaire.

Les Classes d'Actions de Distribution Plus peuvent déclarer et verser des distributions prélevées sur le capital. Les investisseurs dans ces catégories d'actions doivent savoir que le paiement de dividendes prélevés sur le capital équivaut à un retour ou à un retrait d'une partie de l'investissement initial de l'investisseur ou des gains en capital attribuables à cet investissement initial, et que ces distributions entraîneront une diminution immédiate correspondante de la valeur liquidative par action de la catégorie d'actions. Le paiement des distributions prélevées sur le capital entraînera par conséquent une érosion du capital et peut être obtenu en renonçant au potentiel de croissance future du capital.

Au cours de l'exercice, les compartiments suivants ont versé des distributions prélevées sur le capital pour les catégories d'actions de distribution « Plus » :

	Distributions sur du capital pour l'exercice clos le 28 février 2023 (000's)	Distributions sur du capital pour l'exercice clos le 28 février 2022 (000's)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – Classe A USD Distribution (M) Plus	51\$	313\$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – Classe A AUD Distribution (M) (Couverte) Plus	67\$	60\$
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^] – Classe A USD Distribution (M) Plus	1\$	7\$
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^] – Classe A AUD Distribution (M) (Couverte) Plus	– \$	1\$
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^] – Classe A HKD Distribution (M) Plus	2\$	9\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Classe A USD Distribution (M) Plus	9\$	25\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Classe A AUD Distribution (M) (Couverte) Plus	1\$	1\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Classe A HKD Distribution (M) Plus	1\$	2\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Classe A SGD Distribution (M) (Couverte) Plus	11\$	19\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Classe A ZAR Distribution (M) (Couverte) Plus	28\$	390\$
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Classe A USD Distribution (M) Plus	20\$	101\$

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

5. Distributions aux Détenteurs d'actions de participation rachetables – (suite)

	Distributions sur du capital pour l'exercice clos le 28 février 2023 (000's)	Distributions sur du capital pour l'exercice clos le 28 février 2022 (000's)
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Classe A HKD Distribution (M) Plus	– \$	– \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Classe A SGD Distribution (M) (Couverte) Plus	6\$	9\$
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund^ – Classe A USD Distribution (M) Plus	2\$	1\$
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund^ – Classe A SGD Distribution (M) (Couverte) Plus	– \$	– \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Classe A USD Distribution (M) Plus	101\$	164\$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Classe A AUD Distribution (M) (Couverte) Plus	91\$	138\$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Classe A SGD Distribution (M) (Couverte) Plus	28\$	65\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Classe A USD Distribution (M) Plus	552\$	1 045\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Classe A AUD Distribution (M) (Couverte) Plus	252\$	463\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Classe A CNH Distribution (M) (Couverte) Plus	112\$	276\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Classe A HKD Distribution (M) Plus	135\$	284\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Classe A SGD Distribution (M) (Couverte) Plus	29\$	58\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Classe A SGD Distribution (M) Plus	13\$	21\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Classe A HKD Distribution (M) Plus	1\$	20\$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^ – Classe D USD Distribution (M) Plus	1\$	76\$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – Classe A AUD Distribution (M) (Couverte) Plus	1\$	10\$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – Classe A AUD Distribution (M) (Couverte) Plus	– \$	1\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A USD Distribution (M) Plus	644\$	473\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A SGD Distribution (M) (Couverte) Plus	578\$	719\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A SGD Distribution (M) (Couverte) Plus	95\$	52\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A CNH Distribution (M) (Couverte) Plus	24\$	42\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A HKD Distribution (M) (Couverte) Plus	169\$	132\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A GBP Distribution (M) (Couverte) Plus	33\$	21\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A Euro Distribution (M) (Couverte) Plus	34\$	18\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A AUD Distribution (M) (Couverte) Plus	41\$	26\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Classe A USD Distribution (M) Plus	69\$	62\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Classe A AUD Distribution (M) (Couverte) Plus	29\$	31\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Classe A CNH Distribution (M) (Couverte) Plus	3\$	6\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Classe A HKD Distribution (M) Plus	14\$	19\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Classe A SGD Distribution (M) (Couverte) Plus	24\$	5\$
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Classe A USD Distribution (M) (Couverte) Plus	2 309€	1 311€
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Classe A CNH Distribution (M) (Couverte) Plus	762€	327€
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Classe A AUD Distribution (M) (Couverte) Plus	149€	93€
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Classe A Euro Distribution (M) Plus	127€	57€
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Classe A SGD Distribution (M) (Couverte) Plus	256€	86€
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Catégorie Premier USD Distribution (M) Plus	1 079\$	19\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe A USD Distribution (M) Plus	1 580\$	406\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe A AUD Distribution (M) (Couverte) Plus	228\$	73\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe A CNH Distribution (M) (Couverte) Plus	28\$	6\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe A Euro Distribution (M) (couverte) Plus	190\$	60\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe A GBP Distribution (M) (Couverte) Plus	88\$	1\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe A HKD Distribution (M) Plus	57\$	31\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe A SGD Distribution (M) (Couverte) Plus	1 531\$	446\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe S USD Distribution (M) Plus	116\$	11\$
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^ – Classe A USD Distribution (M) (Couverte) Plus	3€	94€
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^ – Classe A AUD Distribution (M) (Couverte) Plus	– €	29€
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^ – Classe A CNH Distribution (M) (Couverte) Plus	1€	5€
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^ – Classe A Euro Distribution (M) Plus	– €	5€
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^ – Classe A SGD Distribution (M) (Couverte) Plus	– €	4€
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Classe A USD Distribution (M) Plus	56\$	50\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Classe A AUD Distribution (M) (Couverte) Plus	45\$	28\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Classe A CNH Distribution (M) (Couverte) Plus	5\$	8\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Classe A HKD Distribution (M) Plus	28\$	30\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Classe A SGD Distribution (M) (Couverte) Plus	1\$	1\$
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^ – Classe A USD Distribution (M) Plus	– \$	14\$
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^ – Classe A AUD Distribution (M) (Couverte) Plus	– \$	15\$
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^ – Classe A HKD Distribution (M) Plus	– \$	8\$
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^ – Classe A SGD Distribution (M) (Couverte) Plus	– \$	2\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Classe A AUD Distribution (M) Plus	7\$	5\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Classe A SGD Distribution (M) Plus	1\$	1\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Classe D HKD Distribution (M) Plus	14\$	10\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Classe D HKD Distribution (M) Plus	– \$	– \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Classe D CNH Distribution (M) Plus (Couverte)	– \$	– \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Classe D AUD Distribution (M) Plus (Couverte)	7\$	3\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Classe D SGD Distribution (M) (Couverte) Plus	3\$	8\$

Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 USD/0 EUR ou inférieurs à 1 000 USD/1 000 EUR.

Les Classes d'Actions Distribution Plus (e) et Distribution Plus (u) offertes par certains des Compartiments peuvent prélever certains frais et dépenses sur le capital plutôt que sur le revenu. Imputer tout ou partie des frais et dépenses au capital entraînera une augmentation des revenus à distribuer ; cependant, le capital dont disposent ces Catégories d'Actions Distribution Plus (e) et Distribution Plus (u) pour l'investissement futur et la croissance du capital pourrait être diminué. Les actionnaires doivent noter qu'il existe un risque accru que lors du rachat des actions des Classes d'Actions Distribution Plus (e) et Distribution Plus (u), les actionnaires ne reçoivent pas la totalité du montant investi. Pour les investisseurs des catégories d'actions de distribution « Plus (e) » et « Plus (u) », cela peut entraîner une érosion de leur investissement en capital malgré la performance du compartiment concerné, ou des plus-values attribuables à cet investissement initial, ce qui diminuera probablement la valeur des rendements futurs. L'augmentation du dividende résultant de l'imputation de frais et de dépenses au capital équivaut en fait à un remboursement ou à un retrait du capital investi initialement par l'investisseur ou des gains en capital attribuables à cet investissement initial. Le niveau plus élevé de distribution de dividendes dans le cadre de ce mécanisme de prélèvement entraînera une diminution immédiate correspondante de la valeur liquidative des classes d'actions à la date ex-dividende. Les actionnaires doivent noter que, dans la mesure où les dépenses sont imputées au capital, une partie ou la totalité des distributions effectuées par les catégories d'actions de distribution Plus (e) et Plus (u) doivent être considérées comme une forme de remboursement du capital. L'intégralité des frais des Classes d'Actions Plus (e) de Distribution a été imputée sur le capital.

Au cours de l'exercice, les compartiments suivants ont imputés des commissions et frais sur le capital des catégories d'actions de distribution Plus (e) :

	Frais et imputés au capital pour l'exercice clôturé le 28 février 2023 (000's)	Frais et imputés au capital pour l'exercice clôturé le 28 février 2022 (000's)
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Classe A Euro Distribution (M) (Couverte) Plus (e)	3\$	4\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Actions de Distribution (M) Plus (e) en GBP de Catégorie Premier (Couvertes)	1\$	1\$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – Actions de Distribution (M) Plus (e) en USD de Classe S	44\$	42\$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – Actions de Distribution (M) Plus (e) en EUR de Classe S (couvertes)	13\$	13\$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – Actions de Distribution (M) Plus (e) en GBP de Classe S (couvertes)	834\$	953\$

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

5. Distributions aux Détenteurs d'actions de participation rachetables – (suite)

	Frais et imputés au capital pour l'exercice clôturé le 28 février 2023 (000's)	Frais et imputés au capital pour l'exercice clôturé le 28 février 2022 (000's)
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe A USD Distribution (M) Plus (e)	2 562\$	4 797\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe A AUD Distribution (M) (Couverte) Plus (e)	307\$	644\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe A CNH Distribution (M) (Couverte) Plus (e)	56\$	92\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe A GBP Distribution (M) (Couverte) Plus (e)	192\$	304\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe A JPY Distribution (M) Plus (e)	3\$	3\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe A SGD Distribution (M) (Couverte) Plus (e)	497\$	910\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe A SGD Distribution (M) Plus (e)	1\$	– \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe X GBP Distribution (M) (Couverte) Plus (e)	42\$	100\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe X USD Distribution (M) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe A Euro Distribution (M) (Couverte) Plus (e)	110\$	195\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Classe A HKD Distribution (M) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Actions de Distribution (M) Plus (e) en GBP de Catégorie Premier (couvertes)	274\$	2 586\$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] – Classe A USD Distribution (M) Plus (e)	1\$	1\$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] – Actions de Distribution (M) Plus (e) en EUR de Catégorie Premier (couvertes)	2\$	5\$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^] – Actions de Distribution (M) Plus (e) en GBP de Catégorie Premier (couvertes)	6\$	80\$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^] – Classe A USD Distribution (M) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – LM Class Euro Distribution (Q) (Couverte) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A Euro Distribution (M) (Couverte) Plus (e)	446\$	554\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A GBP Distribution (M) (Couverte) Plus (e)	88\$	105\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe X Euro Distribution (M) (Couvertes) Plus (e)	137\$	183\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe X GBP Distribution (M) (Couverte) Plus (e)	52\$	64\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe X USD Distribution (M) Plus (e)	157\$	124\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – LM Classe Euro Distribution (Q) (Couverte) Plus (e)	108\$	9\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Catégorie Premier Euro Distribution (M) (Couverte) Plus (e)	215\$	154\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Catégorie Premier GBP Distribution (M) (Couverte) Plus (e)	11\$	9\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Catégorie Premier USD Distribution (M) Plus (e)	104\$	83\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe S Euro Distribution (M) (Couverte) Plus (e)	25\$	32\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe S GBP Distribution (M) (Couverte) Plus (e)	2\$	8\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A SGD Distribution (M) (Couverte) Plus (e)	327\$	41\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Classe A USD Distribution (M) Plus (e)	1 657\$	2 012\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – S Class USD Distribution (Q) Plus (e)	1\$	– \$
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^] – Classe A USD Distribution (M) Plus (e)	1\$	– \$
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^] – Classe X GBP Distribution (M) (Couverte) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund – Classe A USD Distribution (M) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund – Classe S Euro Distribution (M) (Couverte) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Classe A USD Distribution (M) Plus (e)	2\$	2\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Classe A Euro Distribution (M) (Couverte) Plus (e)	5\$	6\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Classe A USD Distribution (M) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Classe X Euro Distribution (M) (Couverte) Plus (e)	1\$	– \$
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Actions de Distribution (A) Plus (e) en GBP de Catégorie Premier (couvertes) (PH)	133€	173€
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Actions de Distribution (Q) Plus (e) en CAD de Catégorie Premier	38€	59€
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Actions de Distribution (Q) Plus (e) en CAD de Catégorie Premier (Couvertes) (PH)	453€	400€
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe A USD Distribution (M) Plus (e)	1 433\$	802\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe A Euro Distribution (A) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe A Euro Distribution (A) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe X USD Distribution (M) Plus (e)	298\$	12\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe X Euro Distribution (Q) (Couverte) Plus (e)	18\$	11\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Classe X GBP Distribution (Q) (Couverte) Plus (e)	7\$	– \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Classe A USD Distribution (M) Plus (e)	117\$	107\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Classe A Euro Distribution (M) Plus (e)	9\$	9\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Actions de Distribution (M) Plus (e) en GBP de Classe S	3\$	2\$

Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 USD/0 EUR ou inférieurs à 1 000 USD/1 000 EUR.

Classes d'actions de Capitalisation

En ce qui concerne les Classes d'Actions de Capitalisation, il est prévu que, dans le cours normal des activités commerciales, les distributions ne soient pas déclarées et que tout revenu d'investissement net imputable à chacune des Classes d'Actions de Capitalisation soit cumulé sur une base quotidienne dans la valeur liquidative par action de chaque classe d'actions respective.

6. Capital social et Actions participatives rachetables

Capital social

La Société a été créée avec un capital social initial de 39 000 €, représenté par 39 000 actions de souscription sans valeur nominale. Toutes les actions de souscription, sauf trois, ont été rachetées par la Société. Les détenteurs de ces trois actions de souscription ont le droit d'assister et de voter à toutes les réunions de la Société, mais n'ont pas le droit de participer aux dividendes ou à l'actif net des Compartiments ou de la Société.

Actions de participation rachetables

Le capital social de la Société doit à tout moment être égal à sa valeur liquidative. Les Administrateurs ont le droit d'émettre jusqu'à cinq cent milliards d'actions sans valeur nominale de la Société à la valeur de l'actif net par action et selon les termes et conditions qu'ils jugent adaptés. Il n'existe pas de droits de préemption sur les actions émises par la Société.

Chaque action donne droit à l'Actionnaire de participer de manière égale sur la base du prorata aux dividendes, le cas échéant, et des actifs nets du Compartiment pour lequel elle a été émise, sauf pour les dividendes déclarés avant qu'il soit devenu un actionnaire.

Les produits de l'émission des actions seront enregistrés dans les comptes de la Société pour le Compartiment correspondant et seront affectés à l'acquisition pour le compte du Compartiment des actifs dans lesquels il peut investir. Les documents comptables et les comptes de chaque Compartiment seront tenus séparément.

Chaque Compartiment offre des classes d'actions différentes, tel qu'indiqué dans le Prospectus de la Société. Ces différentes classes d'actions diffèrent principalement en termes de charges de vente, commissions, ratios de frais, politique de distribution et devise de libellé. Les investisseurs sont donc en mesure de choisir la classe d'actions qui convient le mieux à leurs besoins de placement, compte tenu du montant considéré et de la période de détention anticipée au sein du portefeuille.

Chaque classe d'actions est conçue en tant que Classe d'Actions de distribution ou Classe d'Actions de capitalisation. Les Classes d'Actions de capitalisation ne distribuent pas de revenu net ni de plus-values de placement nettes réalisées ou latentes, alors que les Classes d'Actions de distribution en distribueront à certains intervalles, lesquels varieront en fonction des lettres entre parenthèses figurant à la fin du nom de la Classe d'Actions de distribution, tel qu'expliqué à la Note 5 relative aux Distributions aux détenteurs d'actions participatives rachetables ci-dessus. En outre, la Société possède des actions de souscription en circulation. Les actions de fondateur ne donnent pas à leurs détenteurs le droit de participer aux actifs d'un quelconque Compartiment.

Chaque Compartiment peut offrir des Classes d'Actions libellées dans des devises autres que la devise de référence du Compartiment. Pour chacune de ces classes d'actions, sauf si le nom de la classe d'actions comporte la mention « couvertes », le Gestionnaire et le Gestionnaire par délégation concernés n'utiliseront aucune technique pour couvrir l'exposition de la classe d'actions aux fluctuations des taux de change entre la devise de référence du Compartiment et la devise de la classe d'actions.

Les Classes d'Actions A sont disponibles pour tous les investisseurs. Les distributeurs peuvent verser des commissions ou des remises aux courtiers ou autres investisseurs qui ont conclu un contrat avec un distributeur concernant ces actions. Les Classes d'Actions B, C, D, E et K sont disponibles pour tous les investisseurs qui sont clients de courtiers nommés par un distributeur en ce qui concerne ces actions. Les distributeurs peuvent verser des commissions aux courtiers ou autres investisseurs qui ont conclu un contrat avec un distributeur en ce qui concerne ces actions. Les Classes d'Actions F sont disponibles pour les investisseurs professionnels et les investisseurs ayant un contrat d'investissement discrétionnaire avec un courtier nommé par le distributeur en ce qui concerne ces actions. Les distributeurs peuvent verser des commissions ou des remises aux courtiers ou autres investisseurs qui ont conclu un contrat avec le distributeur concernant ces actions. Les Classes d'Actions J sont destinées à la distribution japonaise, à la discrétion des Administrateurs ou des distributeurs. Les Classes d'Actions M sont disponibles pour les investisseurs professionnels et les investisseurs ayant un contrat d'investissement discrétionnaire avec un courtier ou une autre entité désignée par un distributeur en ce qui concerne ces actions.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

6. Capital social et Actions participatives rachetables – (suite)

Les Classes d'Actions R sont disponibles pour tous les investisseurs qui ont un accord fondé sur des commissions avec un intermédiaire dont ils ont reçu une recommandation individuelle dans le cadre de leur investissement dans les Compartiments. Les Classes d'Actions T sont destinées à la distribution taïwanaise, à la discrétion des Administrateurs ou des distributeurs. Les Classes d'Actions X sont disponibles pour les courtiers, les gestionnaires de portefeuille ou les plateformes qui, conformément aux exigences réglementaires ou sur la base d'accords de commissions avec leurs clients, ne sont pas autorisés à accepter et à conserver des commissions de suivi ; et les investisseurs institutionnels (pour les investisseurs de l'Union européenne, cela signifie « Contreparties éligibles » telles que définies dans la directive MIFID II) investissant pour leur propre compte. Les Classes d'Actions U, Y et S sont disponibles pour les investisseurs institutionnels à la discrétion des Administrateurs ou des distributeurs. Les Classes d'Actions BW LM sont disponibles, à la discrétion des Administrateurs ou des distributeurs, aux investisseurs qualifiés qui sont membres du groupe Franklin Templeton ou clients de ces membres. Les Classes d'Actions LM sont disponibles, à la discrétion des Administrateurs ou des distributeurs, aux investisseurs admissibles qui sont membres du groupe Franklin Templeton, aux régimes de retraite et aux régimes de nature similaire parrainés par des membres du groupe Franklin Templeton, ou aux clients de ces membres. Pour les investisseurs basés dans l'Union européenne, les Classes d'Actions BW Premier sont disponibles à la discrétion des Administrateurs ou des distributeurs aux « Contreparties éligibles » telles que définies par la directive MIFID II ; pour les investisseurs basés en dehors de l'Union européenne, les Classes d'Actions BW Premier sont disponibles aux investisseurs institutionnels à la discrétion des Administrateurs ou des distributeurs ou aux investisseurs éligibles qui sont membres du groupe Franklin Templeton ou clients de ces membres. Pour les investisseurs basés dans l'Union européenne, les Classes d'Actions Premier sont disponibles pour les « Contreparties éligibles » telles que définies par la directive MIFID II ; pour les investisseurs basés en dehors de l'Union européenne, les Classes d'Actions Premier sont disponibles pour les investisseurs institutionnels.

Pour les classes d'actions dont le nom comporte la mention « (Couvertes) » après la dénomination de la devise, il est prévu que ces classes d'actions soient couvertes contre les fluctuations des taux de change entre la devise de la classe d'actions et la devise de référence du Compartiment concerné. Certaines classes d'actions des Compartiments gérés par Brandywine Global Investment Management, LLC sont couvertes par rapport à un indice, comme indiqué par la mention « (IH) » dans le nom de la classe d'actions. Les Compartiments gérés par Brandywine Global Investment Management, LLC et le Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund géré par ClearBridge Investments (North America) Pty Limited (anciennement ClearBridge RARE Infrastructure International Pty Limited) proposent des catégories d'actions couvertes, comme l'indique l'inclusion d'un « (PH) » dans le nom de la catégorie d'actions. Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] (cessation d'activités le 1^{er} juin 2021) proposait des catégories d'actions qui pouvaient avoir versé une commission de performance, comme indiqué par la mention « (PF) » dans la dénomination.

Certains Compartiments ont également émis des Classes d'Actions Grandfathered, comme indiqué par la mention « GA », « GE », « GP » ou « (G) » dans le nom de la classe d'actions. Les Classes d'Actions Grandfathered sont proposées exclusivement aux porteurs de parts de compartiments affiliés. Les Classes d'Actions Grandfathered sont fermées à toute souscription supplémentaire, à la fois de la part d'actionnaires existants détenant déjà des actions de cette Classe et de la part de nouveaux investisseurs, lesdites Actions pouvant toutefois toujours être achetées par (1) réinvestissement de dividendes ; (2) conversion automatique d'une Classe d'Actions B (G) du Compartiment en une Classe d'Actions A (G) du même Compartiment ; et (3) échange d'Actions d'une Classe d'Actions Grandfathered portant la même lettre d'identification. Nonobstant ce qui précède, comme indiqué dans les Suppléments des Compartiments, certaines Classes d'Actions Grandfathered pour certains Compartiments peuvent être mises à disposition pour des souscriptions ultérieures par les actionnaires existants de la classe d'actions, à la seule discrétion des Administrateurs.

7. Fiscalité

En vertu de la loi et des pratiques courantes en Irlande, la Société est un organisme de placement tel que défini à la Section 739B de la Loi de consolidation fiscale de 1997 (telle que modifiée). Sur cette base, la Société n'est généralement pas soumise à l'impôt irlandais sur les revenus et les plus-values, sauf dans le cas d'événements imputables. Habituellement, un événement imputable se produit au titre de toute distribution, tout remboursement, tout rachat, toute annulation, tout transfert d'actions ou à la fin d'une « Période de référence », une « Période de référence » étant une période de huit ans commençant par l'acquisition des actions par les Actionnaires et chaque période ultérieure de huit ans débutant immédiatement après la Période de référence précédente.

La Société n'est redevable d'aucun impôt irlandais au titre d'événements imposables eu égard à ce qui suit :

- (i) un actionnaire qui n'est ni résident irlandais, ni résident ordinaire en Irlande à des fins fiscales, lors de la survenance de l'événement donnant lieu à imposition, sous réserve qu'une déclaration valable appropriée ait été effectuée, ou la Société, a été autorisé(e) par les autorités fiscales irlandaises à procéder à des paiements bruts en l'absence de déclaration appropriée ;
- (ii) certains actionnaires résidents irlandais exemptés ont fourni les déclarations légales requises signées à la Société.

En outre, toute transaction portant sur des actions détenues dans le cadre d'un système de compensation reconnu tel que désigné par ordonnance des services fiscaux irlandais (même si la transaction est qualifiée d'événement donnant lieu à imposition dans le cas contraire), ne constitue pas un événement imputable.

En l'absence de déclaration appropriée, la Société sera soumise à l'impôt irlandais au moment de l'événement imputable.

Les plus-values, dividendes et intérêts perçus peuvent être soumis à des impôts, y compris les prélèvements libératoires imposés par le pays d'origine et ces sommes peuvent ne pas être récupérables par le Compartiment ou ses actionnaires.

8. Trésorerie et équivalents de trésorerie et Comptes de marge

La trésorerie et les équivalents de trésorerie sont valorisés à leur valeur nominale majorée des intérêts courus, le cas échéant. La trésorerie, les équivalents de trésorerie et les soldes de découvert bancaire de tout Compartiment sont détenus auprès du Dépositaire. Les « Comptes sur marge et encaisse affectée » dans l'État de la situation financière représentent les dépôts sur marge, les garanties en espèces et les gains et pertes réalisés sur les contrats à terme non encore livrés. Les dépôts de marge et les garanties financières, détenues en relation avec les gré à gré et les instruments dérivés négociés en bourse au 28 février 2023, sont détenus auprès des courtiers suivants : Bank of America Merrill Lynch, BNP Paribas, BNY Mellon, Citi, Goldman Sachs, HSBC, JP Morgan, Morgan Stanley et UBS (28 février 2022 : Bank of America Merrill Lynch, Barclays, BNY Mellon, Citi, Goldman Sachs, HSBC, JP Morgan, Morgan Stanley et UBS).

9. Engagements et passifs éventuels

Il n'y avait pas d'engagements ni de passif éventuel significatifs au 28 février 2023 ni au 28 février 2022.

10. Commissions indirectes

La Société dispose de politiques visant à garantir que ses prestataires de services agissent dans le meilleur intérêt des Compartiments lorsqu'ils appliquent les décisions de négocier pour le compte de ces Compartiments dans le cadre de la gestion des portefeuilles des Compartiments. À ces fins, toutes les mesures raisonnables doivent être prises pour obtenir le meilleur résultat possible pour les Compartiments, en tenant compte du prix, des coûts, de la rapidité, de la probabilité d'exécution et de règlement, de la taille et de la nature de l'ordre, ou de toute autre considération pertinente pour l'exécution de l'ordre. Les remises en espèces provenant d'un courtier ou d'un contrepartiste en contrepartie d'opérations de courtage du Compartiment adressées audit courtier ou audit contrepartiste ne seront pas conservées par le Gestionnaire, le Gestionnaire de portefeuille par délégation ou une de leurs personnes liées. La Société ne prendra pas en charge les coûts de recherche externe entreprise par les Gestionnaires et les Gestionnaires de portefeuille par délégation. Ces coûts seront à la charge du Gestionnaire ou du Gestionnaire de portefeuille par délégation concerné. Les informations sur les politiques d'exécution relatives aux Compartiments sont mises gratuitement à la disposition des Actionnaires qui en font la demande.

Au cours des exercices clos les 28 février 2023 et 28 février 2022, Royce & Associates, LP (« Royce ») a conclu des accords de commission indirecte avec des courtiers, mais a remboursé aux compartiments concernés tous les frais de recherche engagés dans le cadre de ces accords.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

11. Taux de change

Les taux de change suivants ont été utilisés dans les présents états financiers afin d'obtenir les montants équivalents en dollar US, en euro, en livre sterling pour les Compartiments dont la devise de référence est respectivement le dollar US, l'euro, la livre sterling :

	Devise	Taux de change au 28 février 2023	Taux de change au 28 février 2022
Compartiments en USD	Peso argentin	366,3138*	208,2521
	Dollar australien	1,4861	1,3768
	Réal brésilien	5,2355	5,1517
	Livre sterling	0,8314	0,7454
	Dollar canadien	1,3645	1,2675
	Peso chilien	s.o.	799,2000
	Renminbi chinois (CNH)	6,9499	6,3168
	Renminbi chinois (CNY)	6,9394	6,3111
	Peso colombien	4 859,4300	3 937,0050
	Couronne tchèque	22,2152	22,4397
	Couronne danoise	7,0371	6,6330
	Livre égyptienne	30,6300	15,7100
	Euro	0,9454	0,8919
	Dollar de Hong Kong	7,8494	7,8146
	Forint hongrois	s.o.	331,7191
	Roupie indienne	82,6675	75,3475
	Roupie indonésienne	15 250,0000	14 367,0000
	Shekel israélien	3,6534	3,2108
	Yen japonais	136,1550	114,9650
	Ringgit malais	4,4875	4,1985
	Peso mexicain	18,2965	20,4810
	Dollar néo-zélandais	1,6173	1,4780
	Couronne norvégienne	10,3848	8,8158
	Roupie pakistanaise	261,5000	177,3500
	Nouveau sol péruvien	3,7949	s.o.
	Peso philippin	55,3500	51,2700
	Zloty polonais	4,4486	4,1980
	Rouble russe	75,0500	107,9975
	Riyal saoudien	3,7527	3,7517
	Dollar de Singapour	1,3485	1,3557
	Rand sud-africain	18,3650	15,3763
	Won sud-coréen	1 323,2500	1 202,3500
	Couronne suédoise	10,4680	9,4722
	Franc suisse	0,9419	0,9171
	Dollar de Taiwan	30,4695	28,0350
	Baht thaïlandais	35,3413	32,6750
	Livre turque	18,8850	13,8403
Compartiments en EUR		Taux de change au 28 février 2023	Taux de change au 28 février 2022
	Dollar australien	1,5719	1,5438
	Réal brésilien	5,5375	s.o.
	Livre sterling	0,8793	0,8358
	Dollar canadien	1,4432	1,4212
	Couronne tchèque	s.o.	25,1605
	Couronne danoise	7,4431	7,4373
	Yen japonais	144,0112	128,9045
	Couronne norvégienne	s.o.	9,8847
	Zloty polonais	4,7052	4,7070
	Rouble russe	s.o.	121,0922
	Rand sud-africain	19,4247	17,2406
	Couronne suédoise	11,0720	10,6207
	Franc suisse	0,9962	1,0283
Compartiments basés en GBP	Livre turque	s.o.	15,5184
	Dollar américain	1,0577	1,1213
		Taux de change au 28 février 2023	Taux de change au 28 février 2022
	Dollar australien	s.o.	1,8470
	Euro	1,1372	1,1964
	Yen japonais	163,7741	s.o.
	Dollar américain	1,2029	1,3415

* Taux quotidien actualisé, basé sur l'indice ARS Eqty Eqty Impli (UNOFFICIAL), conformément aux instructions de FTIS.

12. Exposition aux risques et gestion des risques

Suite à sa nomination en tant que société de gestion d'OPCVM de la Société, ayant la responsabilité de la gestion de la Société et de certaines activités de gestion des investissements, les fonctions d'administration et de distribution relatives à la Société telles qu'énoncées dans les Règlements sur les OPCVM, la Société de gestion a pris la décision de déléguer certaines, mais pas toutes les activités de gestion d'investissements aux Gestionnaires de portefeuille et/ou aux Gestionnaires de portefeuille délégué concernés, étant entendu que la Société de gestion reste responsable vis-à-vis des Compartiments de l'exécution de leurs obligations convenues (veuillez vous reporter aux pages Informations générales pour la liste des Gestionnaires de portefeuille et des Gestionnaires de portefeuille délégués pour chaque Compartiment, selon le cas, conformément au prospectus).

La Société, en conjonction avec la Société de gestion et les Gestionnaires de portefeuille, a déterminé que certains de ses risques importants sont le risque de marché, le risque de crédit et le risque de liquidité. En ce qui concerne l'utilisation d'instruments financiers dérivés, les risques sont le risque de contrepartie, le risque de crédit, l'augmentation des appels de marge et le risque de perte illimitée. De plus amples détails sur ces risques et d'autres types de risques sont présentés ci-dessous et dans le prospectus sous « Facteurs de risque ».

Le risque de marché inclut le risque de prix de marché, le risque de change, le risque de taux d'intérêt et l'autre risque de prix.

Le risque de marché est le risque que la juste valeur des flux de trésorerie futurs d'un instrument financier fluctue du fait de variations des cours. Le risque de marché maximum résultant de la détention d'instruments financiers, hors dérivés, est déterminé par la juste valeur des instruments financiers. Les Gestionnaires de portefeuille ou Gestionnaires de portefeuille délégué peuvent chercher à jouer sur la ventilation des actifs en portefeuille pour limiter le risque associé à certains pays, secteurs ou titres, sans perdre de vue les objectifs d'investissement des Compartiments, tels que spécifiés aux présents états financiers. Le risque est maîtrisé par les Gestionnaires de portefeuille ou Gestionnaires de portefeuille délégué concernés par le biais d'une sélection prudente de titres et autres instruments financiers conformément aux limites spécifiées et à des mandats d'investissement définis. Les politiques d'investissement de chaque fonds sont détaillées dans le rapport des administrateurs (révisé). Les détails des actifs financiers et des passifs financiers de chaque Fonds sont présentés dans l'état de la situation financière.

Le risque de change est le risque que la valeur d'un instrument financier fluctue à la suite de variations du taux de change entre la devise dans laquelle l'actif ou le passif financier est libellé et la devise fonctionnelle des Compartiments. La valeur des investissements des Compartiments libellés dans une devise autre que la devise fonctionnelle peut augmenter ou diminuer en fonction des fluctuations du taux de change relatif aux devises concernées. Il existe un risque que d'importantes fluctuations des taux de change aient des répercussions significatives sur la performance des Compartiments.

Lorsqu'un Compartiment détient des investissements dans une devise autre que la devise fonctionnelle de ce Compartiment, le Gestionnaire de portefeuille ou le Gestionnaire de portefeuille délégué concerné peut gérer le risque de change soit en couvrant les devises étrangères dans la devise fonctionnelle du Compartiment, soit en diversifiant les investissements dans plusieurs devises en utilisant un réseau de trading de devises multi-banques.

Le risque de taux d'intérêt correspond au risque de fluctuation de la valeur d'un instrument financier due aux variations des taux d'intérêt du marché. Les Fonds qui détiennent des titres de créance à taux d'intérêt fixe et des positions de découvert sont exposés au risque de taux d'intérêt lorsque la valeur de ces titres ou prêts peut fluctuer en raison d'une variation des taux d'intérêt. Les avoirs en titres à taux fixe ou variable peuvent également être sujets à un risque de taux d'intérêt, bien que ce soit dans une moindre mesure. Les actifs en numéraire détenues par l'intermédiaire du Dépositaire ont le potentiel de générer des revenus d'intérêts, dont le niveau fluctuera en fonction du niveau en vigueur des taux d'intérêt du marché.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

Les Fonds d'actions n'investissent généralement pas dans des titres porteurs d'intérêts autres que les soldes de trésorerie détenus auprès par Dépositaire. Les liquidités génèrent des revenus d'intérêts dont le niveau fluctue en fonction du niveau des taux d'intérêt du marché. Par conséquent, les fonds d'actions ne sont pas soumis à des risques importants en raison des fluctuations des taux d'intérêt du marché en vigueur sur leurs actifs et passifs financiers.

Les Fonds à revenu fixe et les Fonds multi-actifs investissent dans des actifs et des passifs financiers porteurs d'intérêts qui les exposent aux risques associés aux effets des fluctuations des taux d'intérêt du marché en vigueur sur leur situation financière et leurs flux de trésorerie. La valeur des investissements en titres porteurs d'intérêts à taux fixe peut être soumise à la volatilité des prix en raison de fluctuations des taux d'intérêt. Les fluctuations des taux d'intérêt du marché auront un impact sur le montant des intérêts reçu par un Compartiment.

Une augmentation des taux d'intérêt réduira généralement la valeur des titres de créance émis et en circulation, tandis qu'une baisse des taux d'intérêt augmentera généralement la valeur des titres de créance émis et en circulation. L'ampleur de ces fluctuations de prix est plus élevée quand l'échéance des titres en circulation est plus longue. Les variations de la valeur des titres détenus par un Compartiment lorsque les taux d'intérêt fluctuent signifient que la valeur liquidative par action peut augmenter ou diminuer en fonction de l'effet sur la valeur du portefeuille de titres de créances du Compartiment.

Le gestionnaire de chaque fonds à revenu fixe surveille l'environnement des taux d'intérêt et évalue les risques liés aux principales stratégies. Le risque de taux d'intérêt est contrôlé en surveillant les échéances et la durée par rapport aux indices de référence des fonds. Des techniques telles que la mesure de la durée des taux directeurs sont utilisées pour évaluer l'exposition des portefeuilles à la courbe.

Les détails du rendement moyen pondéré de chaque fonds à revenu fixe, les années moyennes pondérées jusqu'à l'échéance et une analyse des titres à revenu fixe et non productifs d'intérêts sont présentés dans les notes 12.1(b) et 12.1(c) ci-dessous.

Les risques liés à l'investissement dans les fonds d'actions comprennent l'évolution de la conjoncture économique, la situation du secteur et de l'entreprise et la sélection des titres. Les fonds à revenu fixe et les fonds multi-actifs sont également soumis au risque de taux d'intérêt, au risque de crédit, au risque d'échéance et au risque de marché. Les titres internationaux sont soumis aux fluctuations des taux de change, à des marchés moins liquides et à l'instabilité politique et économique selon les pays. Les marchés en développement sont sujets aux mêmes risques, mais éventuellement dans une plus grande mesure. Aux fins d'une gestion efficace du portefeuille, les fonds peuvent conclure des instruments dérivés négociés en bourse ou de gré à gré ("OTC"), y compris, mais sans s'y limiter, des contrats à terme, des swaps, des contrats à terme de gré à gré, des options et des bons de souscription, et peuvent conclure des accords de prêt d'actions.

Le Comité de gestion des investissements et de surveillance des portefeuilles (« IMPOC » ou le « Comité ») a été établi au sein de Franklin Templeton afin de superviser la délégation des responsabilités en matière de gestion des investissements pour tous les Compartiments. Le Comité est composé de membres qui, collectivement, possèdent l'expérience et les connaissances spécialisées dans des domaines tels que la gestion des investissements, y compris les actions, les titres à revenu fixe et les dérivés ; l'analyse des investissements et l'établissement de rapports ; gestion des risques ; et la conformité. Le Comité, au nom de la société de gestion, a été chargé de veiller à ce que les Compartiments soient gérés conformément aux directives et limites d'investissement des Compartiments énoncées dans le prospectus et les Règlements OPCVM, ainsi qu'aux instructions du Gestionnaire de portefeuille ou de Sous-investissement concerné. Les propres directives et limites de placement internes du gestionnaire. Le Comité se réunit en général une fois par mois pour contrôler que les Compartiments sont gérés dans le respect de ces limites et obligations réglementaires. Les Gestionnaires de portefeuille et/ou les Gestionnaires de portefeuille délégués respectifs, selon le cas, font rapport au Comité sur les questions relatives à la surveillance de certains risques importants découlant des investissements d'un Fonds dans des instruments financiers.

12.1 Risque du marché

Chaque Compartiment utilisant des instruments financiers dérivés (« IFD ») cherche à limiter le risque de marché et l'effet de levier créés par l'utilisation d'instruments dérivés en utilisant soit l'approche par les engagements, soit une technique sophistiquée de mesure du risque connue sous le nom de « valeur à risque » ("l'approche VaR"). Chaque fond utilisant FDI (autre que FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] et FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]) utilise l'approche par l'engagement... FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] and FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] utilisent l'approche VaR. Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] a utilisé l'approche VaR jusqu'à la date à laquelle il a cessé ses activités le 1er juin 2021.

Le gestionnaire utilise un processus de gestion des risques qui lui permet de mesurer, de suivre et de gérer avec précision les risques liés aux positions des FDI.

L'approche par les engagements calcule l'effet de levier en mesurant la valeur de marché des expositions sous-jacentes aux produits dérivés par rapport à la valeur liquidative du fonds concerné. La VaR est une méthodologie statistique qui cherche à prédire, à l'aide de données historiques, la perte maximale probable qu'un fonds pourrait subir, calculée à un niveau de confiance spécifique (par exemple, « unilatéral » de 99 %). FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] and FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] utilisent un modèle de VaR "absolue" dans lequel la mesure de la VaR est relative à la valeur liquidative du fonds. Un modèle VaR a certaines limites inhérentes et on ne peut s'y fier pour prédire ou garantir que l'ampleur ou la fréquence des pertes subies par un fonds sera limitée dans une certaine mesure. Comme le modèle de la VaR s'appuie sur des données historiques de marché comme l'une de ses données clés, si les conditions actuelles du marché diffèrent de celles de la période d'observation historique, l'efficacité du modèle de la VaR pour prédire la VaR d'un fonds peut être sensiblement réduite. Les investisseurs peuvent subir de graves conséquences financières dans des conditions de marché anormales.

L'efficacité du modèle VaR pourrait être compromise de la même manière si d'autres hypothèses ou composants du modèle VaR s'avéraient inadéquats ou incorrects.

Western Asset Management Company Limited et Western Asset Management Company, LLC ("Western Asset") calculent la VaR à un niveau de confiance de 99 % pour un horizon d'un jour en utilisant un échantillon approprié de données historiques. Le tableau ci-dessous indique la VaR absolue des fonds :

Fonds	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	2,48 %	2,66 %
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	1,38 %	1,02 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	0,62 %	0,51 %
Western Asset SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	1,64 %	1,65 %

Brandywine Global Investment Management, LLC ("Brandywine") calcule la VaR à un niveau de confiance de 95 % pour un horizon de 1 jour en utilisant 2 ans de données historiques. Le tableau ci-dessous indique la VaR absolue des fonds :

Fonds	Au 28 février 2023	Au 28 février 2022
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	1,06 %	0,50 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	1,11 %	0,52 %
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	0,47 %	0,53 %
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	1,68 %	1,22 %
FTGF Global Multi-Sector Impact Fund [^]	1,11 %	s.o.

Où FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] et FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] utilisent un modèle de VaR absolue, conformément aux exigences de la Banque centrale, chacune ces Compartiments sont soumis à une limite de VaR absolue de 20 % de la Valeur liquidative du Compartiment. Cependant, chacun de ces fonds peut de temps à autre connaître une variation de la valeur liquidative sur une période de détention de 20 jours supérieure à 20 % de la valeur liquidative.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

En plus d'utiliser l'approche VaR, le gestionnaire de FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] et FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] surveillent quotidiennement les niveaux de levier surveiller les changements dus aux mouvements du marché. En outre, les Gestionnaires de portefeuille et/ou Gestionnaires de portefeuille délégués respectifs de chacun de ces Compartiments effectueront des tests préalables aux transactions afin d'examiner l'impact que la transaction aurait sur l'effet de levier global du Compartiment concerné et d'étudier les niveaux de risque et de rendement de la transaction.

Les niveaux de VaR les plus bas, moyens et élevés, à un niveau de confiance de 99 % pour un horizon de 20 jours, pour les fonds Western Asset et Brandywine concernés, étaient les suivants :

Pour l'exercice clos le 28 février 2023

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

Pour l'exercice clos le 28 février 2022

Fonds	Minimum	Moyenne	Maximum
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	4,70 %	5,82 %	11,90 %
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	2,42 %	2,86 %	4,88 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	2,26 %	2,47 %	2,59 %
Western Asset SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	3,12 %	5,10 %	10,04 %
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	1,92 %	2,61 %	3,61 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund [^]	2,76 %	3,31 %	4,51 %
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	2,43 %	3,81 %	4,75 %
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	6,27 %	7,40 %	8,70 %

Conformément aux exigences de la Banque centrale, Martin Currie Investment Management Limited a calculé la VaR sur la base d'une période de détention de 10 jours ouvrables et d'un intervalle de confiance unilatéral de 95 %. Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] (a cessé ses activités le 1er juin 2021) était soumis à une limite absolue de VaR de 8,5 % de la valeur liquidative du fonds. Les niveaux de VaR les plus bas, les plus moyens et les plus élevés sont les suivants :

Pour l'exercice clos le 28 février 2022

Fonds	Minimum	Moyenne	Maximum
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]	0,00 %	4,14 %	6,16 %

β jusqu'à la date de sa cessation d'activité le 1er juin 2021.

Pour les fonds utilisant la VaR, l'effet de levier est calculé comme la somme des valeurs nominales des produits dérivés utilisés.

Les niveaux moyens de l'effet de levier utilisés étaient les suivants :

Fonds	Pour l'exercice clos le 28 février 2023	Pour l'exercice clos le 28 février 2022
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	1 555,99 %	1 175,10 %
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	132,04 %	113,25 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	34,70 %	31,96 %
Western Asset SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	415,50 %	389,53 %
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	216,30 %	277,27 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	107,40 %	98,08 %
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	98,80 %	67,54 %
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	222,50 %	267,56 %
FTGF Global Multi-Sector Impact Fund [^]	87,00 %*	s.o.
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]	s.o.	88,25 %**

* Depuis le 1er décembre 2022, date de création du FTGF Global Multi-Sector Impact Fund[^], jusqu'à l'exercice clos le 28 février 2023.

** Le chiffre concernant le fonds Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] est pour la période du 1er mars 2021 jusqu'à la date à laquelle il a cessé ses activités le 1er juin 2021.

La simulation de crise est l'examen des effets potentiels sur la situation financière d'un Fonds d'un ensemble de changements spécifiques dans les facteurs de risque, liés à des événements exceptionnels mais possibles. Western Asset adopte une approche prudente en appliquant des tests de résistance qui vont au-delà de la gamme des événements raisonnablement probables. Western Asset prévoit (bien qu'il n'y ait aucune garantie) que si le FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund est en mesure de résister à des tests de résistance qui se situent au-delà de la fourchette des événements raisonnablement probables, la valeur liquidative par action (ou toute catégorie particulière d'actions) de ce fonds restera stable en cas d'événements négatifs raisonnables sur le marché.

Un test de résistance basé sur des scénarios peut être utilisé pour répondre à l'exigence d'analyse de sensibilité de la norme FRS 102. La norme FRS 102 ne prescrit pas de mouvement spécifique en points de base ou en pourcentage pour les analyses de sensibilité. Par conséquent, aux fins du présent rapport annuel, l'impact sur le FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund d'une augmentation instantanée de 25 points de base des taux d'intérêt à court terme est indiqué :

	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund
Au 28 février 2023	(62 727 \$)
Au 28 février 2022	(206 914 \$)

(a) Risque de cours de marché

Le risque de marché de chaque compartiment est surveillé par rapport à un indice, mais n'est pas géré. Les indices au 28 février 2023 et au 28 février 2022 sont présentés ci-dessous.

Les tableaux suivants présentent l'indice de chaque Compartiment, à l'exception des Compartiments FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] et FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^], et quantifier l'impact probable sur la valeur de l'actif net de chaque fonds en fonction de l'évolution positive ou négative de l'indice, y compris le bêta sur un an pour chaque fonds. Le bêta est une mesure de la volatilité des positions d'un fonds par rapport au marché ou à l'indice. Bien que le bêta offre une mesure claire et quantifiable, il n'intègre pas de nouvelles informations et les mouvements de prix passés ne sont pas des prédicteurs précis de l'avenir.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(a) Risque de cours de marché – (suite)

Au 28 février 2023

Fonds	Index	Devise	Incidence de la fluctuation de l'indice sur la valeur liquidative (en milliers)	
			Positive de 5 %*	Négative de 5 %*
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	FTSE Bon de trésorerie 1 mois (USD)	USD	26 917	(26 917)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond	USD	8 535	(8 535)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond	USD	76 497	(76 497)
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	Indice FTSE Euro Broad Investment-Grade Bond	EUR	7 320	(7 320)
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	ICE BofA US Dollar Dépôt de 3 mois à taux offert Échéance constante	USD	533 447	(533 447)
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Bloomberg U.S. Corporate High Yield Bond Index 2 % Issuer Capped (indice plafonné des émetteurs)	USD	6 239	(6 239)
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Indice Bloomberg Global High Yield couvert en devises (USD)	USD	3 132	(3 132)
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Indice Markit iBoxx Asian Local Bond	USD	20 499	(20 499)
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund**	Indice ICE BofA U.S. Trésorerie 1-10 Ans	USD	25 905	(25 905)
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	Indice Bloomberg Global Aggregate couvert en devises (USD)	USD	9 824	(9 824)
FTGF Western Asset Global Credit Fund^	Indice Bloomberg Global Aggregate Credit couvert en devises (USD)	USD	2 680	(2 680)
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	Indice Bloomberg des titres adossés à des créances hypothécaires américaines	USD	57 923	(57 923)
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^	Dividendes bruts de l'indice ICE Bank of America Merrill Lynch Sterling Non-Gilt (GBP)	GBP	2 438	(2 438)
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^	Indice Bloomberg du crédit américain	USD	5 237	(5 237)
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^	Bloomberg Global Aggregate – Indice de société couvert en devises (USD)	USD	488	(488)
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	Indice FTSE World Government Bond	USD	11 449	(11 449)
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^	Indice Bloomberg Global High Yield	USD	500	(500)
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	Indice FTSE World Government Bond	USD	14 110	(14 110)
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	Indice ICE Bank of America Merrill Lynch Global High Yield BB-B	USD	407	(407)
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	Indice Russell 1000 Value	USD	134	(134)
FTGF ClearBridge Value Fund	Indice Russell 1000 Value	USD	49 285	(49 285)
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	Indice S&P 500	USD	7 716	(7 716)
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	Indice Russell 1000 Growth	USD	59 710	(59 710)
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	Indice Russell 3000 Growth	USD	8 695	(8 695)
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	Indice Dow Jones U.S. Select Dividend (Total)	USD	1 728	(1 728)
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^	Indice Russell 3000	USD	81 564	(81 564)
FTGF ClearBridge Global Growth Fund^	Indice MSCI AC World Net Dividends	USD	681	(681)
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^	IPC G7 OCDE + 5,5 %. IPC : Indice des prix à la consommation (inflation)	EUR	(166 313)	166 313
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	IPC G7 OCDE + 5,5 %. IPC : Indice des prix à la consommation (inflation)	USD	(99 562)	99 562
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Indice Russell 2000 Value	USD	41 755	(41 755)
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Indice Russell 2000	USD	3 868	(3 868)
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^	Indice MSCI AC World Index Small Cap Net	USD	224	(224)
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	Indice MSCI AC Asia Pacific ex Japan Net Dividends	USD	862	(862)
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	Indice MSCI AC Asia ex-Japan Net Dividends	USD	206	(206)
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	Indice MSCI AC World Net Dividends	USD	9 398	(9 398)
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	50 % MSCI AC Asia Pacific Ex Japan Equity REITS Index Net Dividends (USD)/50 % MSCI AC Asia Pacific Ex Japan/UTILITIES Index Net Dividends (USD)	USD	1 001	(1 001)
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	Indice MSCI Emerging Markets Net	USD	1 985	(1 985)
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^	Indice MSCI Europe Net	EUR	14 681	(14 681)
Franklin Responsible Income 2028 Fund^ ***	Benchmark non disponible	EUR	s.o.	s.o.

* Le résultat le plus probable est basé sur une surperformance de +5 % ou une sous-performance de -5 % par rapport à la performance réelle de l'indice de référence sur l'année en cours.

** Le fonds n'a pas d'indice de référence, c'est pourquoi un indice de substitution a été utilisé comme indicateur pour le calcul du bêta.

*** Le fonds ne dispose pas d'une performance sur un an, le coefficient bêta n'est donc pas disponible pour le fonds.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(a) Risque de cours de marché – (suite)

Au 28 février 2022

Fonds	Index	Devise	Incidence de la fluctuation de l'indice sur la valeur liquidative (en milliers)	
			Positive de 5 %*	Négative de 5 %*
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	FTSE Bon de trésorerie 1 mois (USD)	USD	13 793	(13 793)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond	USD	13 835	(13 835)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond	USD	94 029	(94 029)
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	Indice FTSE Euro Broad Investment-Grade Bond	EUR	5 630	(5 630)
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^]	Indice Bloomberg U.S. High Yield 1-5 Years Cash Pay 2 % Constrained	USD	2 599	(2 599)
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	ICE BofA US Dollar Dépôt de 3 mois à taux offert Échéance constante	USD	1 197 902	(1 197 902)
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Bloomberg U.S. Corporate High Yield Bond Index 2 % Issuer Capped (indice plafonné des émetteurs)	USD	12 765	(12 765)
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund**	Indice JP Morgan EMBI Global	USD	1 359	(1 359)
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]	Indice JP Morgan Corporate Emerging Markets Bond - Broad Composite	USD	1 622	(1 622)
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Indice Bloomberg Global High Yield couvert en devises (USD)	USD	4 327	(4 327)
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]	Bloomberg Global Inflation-Linked 1-10 ans couverts (USD)	USD	1 922	(1 922)
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Indice Markit iBoxx Asian Local Bond	USD	22 884	(22 884)
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund**	Indice ICE BofA U.S. Trésorerie 1-10 Ans	USD	14 249	(14 249)
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Indice Bloomberg Global Aggregate couvert en devises (USD)	USD	9 738	(9 738)
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	Indice Bloomberg Global Aggregate Credit couvert en devises (USD)	USD	4 215	(4 215)
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	Indice ICE BofA European Currency High Yield (ex. Financials) 2 % Constrained Currency couvert (EUR)	EUR	1 313	(1 313)
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Indice Bloomberg des titres adossés à des créances hypothécaires américaines	USD	59 527	(59 527)
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	Dividendes bruts de l'indice ICE Bank of America Merrill Lynch Sterling Non-Gilt (GBP)	GBP	3 359	(3 359)
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	Indice Bloomberg du crédit américain	USD	8 977	(8 977)
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	Indice FTSE World Government Bond	USD	8 068	(8 068)
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	Bloomberg Global High Yield Index (USD)	USD	516	(516)
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	Indice FTSE World Government Bond	USD	8 680	(8 680)
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	Indice ICE Bank of America Merrill Lynch Global High Yield BB-B	USD	495	(495)
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	Indice Russell 1000 Value	USD	119	(119)
FTGF ClearBridge Value Fund	Indice Russell 1000 Value (indice S&P 500 avant le 17 mai 2021)	USD	39 869	(39 869)
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	Indice S&P 500	USD	10 693	(10 693)
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	Indice Russell 1000 Growth	USD	81 804	(81 804)
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	Indice Russell 3000 Growth	USD	16 761	(16 761)
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	Indice Dow Jones U.S. Select Dividend (Total)	USD	1 150	(1 150)
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	Indice Russell 3000	USD	88 983	(88 983)
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	Indice MSCI AC World Net Dividends	USD	883	(883)
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	IPC G7 OCDE + 5,5 %. IPC : Indice des prix à la consommation (inflation)	EUR	(340 765)	340 765
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	Rendement total net de l'infrastructure des marchés émergents S&P	USD	73	(73)
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Indice Russell 2000 Value (indice Russell 2000 avant le 17 mai 2021)	USD	43 387	(43 387)
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Indice Russell 2000	USD	3 991	(3 991)
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	Indice MSCI Europe Net Dividends	EUR	1 280	(1 280)
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	Indice MSCI AC Asia Pacific ex Japan Net Dividends	USD	636	(636)
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	Indice MSCI AC World Net Dividends	USD	430	(430)
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	Indice MSCI AC Asia ex-Japan Net Dividends	USD	567	(567)
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	Indice MSCI AC World Net Dividends	USD	12 236	(12 236)
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	50 % MSCI AC Asia Pacific Ex Japan Equity REITS Index Net Dividends (USD)/50 % MSCI AC Asia Pacific Ex Japan/UTILITIES Index Net Dividends (USD)	USD	599	(599)
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	Indice MSCI Emerging Markets Net Dividends	USD	2 398	(2 398)

* Le résultat le plus probable est basé sur une surperformance de +5 % ou une sous-performance de -5 % par rapport à la performance réelle de l'indice de référence sur l'année en cours.

** Le fonds n'a pas d'indice de référence, c'est pourquoi un indice de substitution a été utilisé comme indicateur pour le calcul du bêta.

L'analyse de sensibilité présentée ci-dessus ne doit pas être utilisée comme une indication des performances futures.

L'analyse de sensibilité au risque de marché pour les fonds FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] et FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] a été incorporé dans le calcul du risque de marché en utilisant l'approche VaR (Note 12.1 ci-dessus).

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(b) Risque de change

Une partie des actifs financiers des Compartiments sont libellés en devises autres que le dollar US, l'euro et la livre sterling (les devises fonctionnelles des Compartiments). Par conséquent, les fluctuations des taux de change peuvent avoir un impact très négatif sur l'état de la situation financière et le rendement total.

Western Asset a une forte tendance à couvrir toutes les devises étrangères dans la monnaie fonctionnelle du portefeuille du fonds. Western Asset ne laisse généralement qu'une petite partie du portefeuille sans couverture, et ce uniquement si les perspectives suggèrent fortement que le risque de change est intéressant. Dans d'autres portefeuilles, des couvertures sont mises en place chaque fois qu'une devise risque de se déprécier d'un montant supérieur au coût de la transaction de couverture. Western Asset peut effectuer des couvertures croisées dans des devises non fonctionnelles - lorsque cela est autorisé par les directives, dans des limites strictes (généralement moins de 5 % du portefeuille), et en cherchant à refléter une exposition par rapport à l'indice de référence.

Les tableaux suivants indiquent l'exposition nette des Compartiments aux devises étrangères au 28 février 2023 et au 28 février 2022.

Les montants indiqués ci-dessous sont principalement des actifs monétaires et des passifs monétaires, à l'exception des investissements dans des titres ne portant pas intérêt, qui comprennent des actions, qui sont des actifs non monétaires. Les montants indiqués ci-dessous pour les contrats de change à terme représentent les valeurs à recevoir dans le cadre des contrats de change et incluent les transactions de couverture de change. Les montants indiqués pour les autres produits dérivés représentent la plus-value/(moins-value) non réalisée à la fin de l'exercice.

Au 28 février 2023

Devise	Investissements dans les titres à revenus fixes (en milliers)	Investissements dans les titres à revenus variables (en milliers)	Investissements dans les titres ne portant pas d'intérêts (en milliers)	Contrat à terme sur devises étrangères (en milliers)	Autres produits dérivés (en milliers)	Autres actifs/ (passifs) nets (en milliers)	Valeur liquidative totale (en milliers)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund							
Dollar américain	\$ 526 575	\$ 317 621	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (10 581)	\$ 833 615
Total	\$ 526 575	\$ 317 621	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (10 581)	\$ 833 615
FTGF Western Asset US Core Bond Fund							
Dollar américain	\$ 103 546	\$ 34 879	\$ 1 741	\$ –	\$ 2 605	\$ (10 852)	\$ 131 919
Total	\$ 103 546	\$ 34 879	\$ 1 741	\$ –	\$ 2 605	\$ (10 852)	\$ 131 919
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund							
Peso argentin	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 5	\$ 5
Dollar australien	–	–	–	14 558	(473)	1 694	15 779
Réal brésilien	6 186	–	–	–	–	424	6 610
Livre sterling	–	–	–	(1 838)	(96)	2 607	673
Dollar canadien	–	–	–	22 434	–	805	23 239
Renminbi chinois	–	–	–	(17 733)	–	–	(17 733)
Euro	–	–	–	29 230	(521)	3 090	31 799
Roupie indienne	–	–	–	1 883	–	–	1 883
Roupie indonésienne	10 217	–	–	(2 574)	–	1 225	8 868
Yen japonais	–	–	–	5 593	186	1 338	7 117
Ringgit malais	–	–	–	–	–	25	25
Peso mexicain	38 173	–	–	(967)	(1 287)	3 348	39 267
Couronne norvégienne	–	–	–	6 373	–	1	6 374
Zloty polonais	–	–	–	–	–	11	11
Rouble russe	921	–	–	–	–	–	921
Rand sud-africain	–	–	–	1 597	–	–	1 597
Dollar américain	846 500	281 132	–	(60 594)	7 390	(52 163)	1 022 265
Total	\$ 901 997	\$ 281 132	\$ –	\$ (2 038)	\$ 5 199	\$ (37 590)	\$ 1 148 700
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund							
Dollar australien	€ –	€ –	€ –	€ (224)	€ –	€ 140	€ (84)
Livre sterling	1 785	456	–	(2 816)	(12)	437	(150)
Dollar canadien	–	–	–	(429)	–	238	(191)
Euro	95 827	12 812	–	15 751	(681)	6 004	129 713
Yen japonais	–	–	–	(372)	120	256	4
Couronne norvégienne	–	–	–	1 691	–	–	1 691
Zloty polonais	1 687	–	–	(1 637)	–	83	133
Couronne suédoise	–	–	–	1 397	–	–	1 397
Dollar américain	12 088	529	654	(13 627)	(16)	326	(46)
Total	€ 111 387	€ 13 797	€ 654	€ (266)	€ (589)	€ 7 484	€ 132 467
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 61 881	\$ –	\$ –	\$ 61 881
Réal brésilien	2 045	–	–	–	–	552	2 597
Livre sterling	10 807	7 532	–	(16 789)	–	580	2 130
Dollar canadien	–	–	–	902	–	2	904
Peso colombien	–	–	–	–	–	63	63
Couronne tchèque	–	–	–	–	–	38	38
Euro	12 558	8 121	1 117	(22 728)	52	5 967	5 087
Roupie indienne	–	–	–	(1 629)	–	–	(1 629)
Roupie indonésienne	6 727	–	–	(1 410)	–	343	5 660
Yen japonais	–	–	–	4 951	–	–	4 951
Peso mexicain	7 562	–	–	(1 933)	–	156	5 785
Zloty polonais	3 319	–	–	(523)	–	117	2 913
Rouble russe	412	–	–	–	–	–	412
Dollar de Singapour	–	–	–	957	–	1	958
Rand sud-africain	2 497	–	–	617	–	643	3 757
Franc suisse	–	–	–	54 581	–	–	54 581
Dollar de Taiwan	–	–	–	(3 258)	–	–	(3 258)
Dollar américain	101 955	34 926	3 313	(78 855)	(7)	19 193	80 525
Total	\$ 147 882	\$ 50 579	\$ 4 430	\$ (3 236)	\$ 45	\$ 27 655	\$ 227 355

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(b) Risque de change – (suite)

Au 28 février 2023 – (suite)

Devise	Investissements dans les titres à revenus fixes (en milliers)	Investissements dans les titres à revenus variables (en milliers)	Investissements dans les titres ne portant pas d'intérêts (en milliers)	Contrat à terme sur devises étrangères (en milliers)	Autres produits dérivés (en milliers)	Autres actifs/ (passifs) nets (en milliers)	Valeur liquidative totale (en milliers)
FTGF Western Asset US High Yield Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2	\$ 2
Livre sterling	–	–	–	41	–	–	41
Dollar canadien	–	–	–	(6)	–	–	(6)
Euro	–	–	–	1 764	–	–	1 764
Peso mexicain	–	–	–	–	–	3	3
Dollar de Singapour	–	–	–	379	–	–	379
Dollar américain	101 664	19 440	2 303	(2 212)	(45)	1 907	123 057
Total	\$ 101 664	\$ 19 440	\$ 2 303	\$ (34)	\$ (45)	\$ 1 912	\$ 125 240
FTGF Western Asset Global High Yield Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 5 298	\$ –	\$ 3	\$ 5 301
Livre sterling	1 976	482	–	1 411	–	96	3 965
Euro	3 035	269	133	1 672	–	587	5 696
Roupie indonésienne	–	–	–	–	–	21	21
Peso mexicain	743	–	–	–	–	14	757
Rouble russe	88	–	–	–	–	83	171
Dollar de Singapour	–	–	–	1 725	–	(4)	1 721
Livre turque	–	–	–	–	–	1	1
Dollar américain	42 049	3 940	1	(10 317)	38	4 087	39 798
Total	\$ 47 891	\$ 4 691	\$ 134	\$ (211)	\$ 38	\$ 4 888	\$ 57 431
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 20 732	\$ –	\$ 13	\$ 20 745
Renminbi chinois	74 978	–	–	3 536	–	1 759	80 273
Euro	–	–	–	10 745	–	–	10 745
Dollar de Hong Kong	–	956	–	–	–	33	989
Roupie indienne	33 683	–	–	–	–	458	34 141
Roupie indonésienne	62 988	–	–	–	–	790	63 778
Ringgit malais	50 257	–	–	–	–	390	50 647
Peso philippin	21 554	–	–	–	–	145	21 699
Dollar de Singapour	38 899	5 769	–	2 090	–	531	47 289
Won sud-coréen	76 610	–	–	–	(373)	1 918	78 155
Franc suisse	–	–	–	287	–	–	287
Baht thaïlandais	23 532	–	–	–	–	151	23 683
Dollar américain	30 027	10 358	3 862	(38 358)	–	(613)	5 276
Total	\$ 412 528	\$ 17 083	\$ 3 862	\$ (968)	\$ (373)	\$ 5 575	\$ 437 707
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 9 724	\$ –	\$ –	\$ 9 724
Livre sterling	89 845	8 554	–	197 072	239	(10 044)	285 666
Euro	187 988	24 491	–	(111 391)	4 675	(4 688)	101 075
Yen japonais	–	–	–	(774)	138	607	(29)
Couronne suédoise	–	–	–	12 589	–	9	12 598
Dollar américain	176 288	27 956	17 040	(106 732)	(61)	445	114 936
Total	\$ 454 121	\$ 61 001	\$ 17 040	\$ 488	\$ 4 991	\$ (13 671)	\$ 523 970
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1 421	\$ (22)	\$ 165	\$ 1 564
Réal brésilien	1 455	749	–	–	–	42	2 246
Livre sterling	10 703	1 415	–	(14 679)	–	455	(2 106)
Dollar canadien	2 388	–	–	87 135	–	220	89 743
Renminbi chinois	–	–	–	(13 277)	–	–	(13 277)
Euro	20 719	4 775	–	(8 159)	(696)	1 654	18 293
Roupie indienne	–	–	–	(299)	–	–	(299)
Roupie indonésienne	1 740	–	–	–	–	89	1 829
Shekel israélien	–	–	–	–	–	71	71
Yen japonais	5 195	3 399	–	(6 916)	144	416	2 238
Peso mexicain	3 922	–	–	(248)	–	82	3 756
Dollar néo-zélandais	–	–	–	5 015	–	–	5 015
Couronne norvégienne	–	–	–	1 586	–	22	1 608
Zloty polonais	1 942	–	–	(1 856)	–	68	154
Rand sud-africain	2 282	–	–	–	–	147	2 429
Won sud-coréen	1 808	–	–	(1 944)	–	79	(57)
Couronne suédoise	–	–	–	1 603	–	–	1 603
Dollar américain	67 165	6 152	11 217	(50 468)	(116)	(2 057)	31 893
Total	\$ 119 319	\$ 16 490	\$ 11 217	\$ (1 086)	\$ (690)	\$ 1 453	\$ 146 703

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(b) Risque de change – (suite)

Au 28 février 2023 – (suite)

Devise	Investissements dans les titres à revenus fixes (en milliers)	Investissements dans les titres à revenus variables (en milliers)	Investissements dans les titres ne portant pas d'intérêts (en milliers)	Contrat à terme sur devises étrangères (en milliers)	Autres produits dérivés (en milliers)	Autres actifs/ (passifs) nets (en milliers)	Valeur liquidative totale (en milliers)
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]							
Livre sterling	\$ 3 796	\$ 2 542	\$ –	\$ (6 813)	\$ 15	\$ 401	\$ (59)
Euro	13 255	5 127	–	(14 963)	112	713	4 244
Yen japonais	–	–	–	307	37	81	425
Dollar américain	14 771	3 715	559	21 722	(72)	745	41 440
Total	\$ 31 822	\$ 11 384	\$ 559	\$ 253	\$ 92	\$ 1 940	\$ 46 050
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]							
Dollar australien	\$ 15 845	\$ –	\$ –	\$ 31 792	\$ –	\$ 2 589	\$ 50 226
Réal brésilien	22 887	–	–	50 630	(4 264)	2 460	71 713
Livre sterling	–	5 770	–	32 947	(157)	4 294	42 854
Dollar canadien	–	–	–	37 643	–	4 075	41 718
Renminbi chinois	–	–	–	(18 680)	–	–	(18 680)
Peso colombien	–	–	–	(20 092)	–	–	(20 092)
Livre égyptienne	689	–	–	–	–	132	821
Euro	6 524	–	2 181	745 456	(13 694)	34 499	774 966
Roupie indienne	129 539	–	–	(75 670)	–	5 720	59 589
Roupie indonésienne	174 005	–	–	(93 570)	–	4 402	84 837
Yen japonais	–	–	–	(230 491)	3 317	12 502	(214 672)
Ringgit malais	–	–	–	11 047	–	–	11 047
Peso mexicain	114 924	–	–	(114 820)	1 018	16 451	17 573
Couronne norvégienne	–	–	–	9 608	–	6	9 614
Zloty polonais	55 983	–	–	(53 060)	–	1 915	4 838
Rouble russe	5 439	–	–	(4 096)	–	–	1 343
Dollar de Singapour	–	–	–	73 031	–	1	73 032
Rand sud-africain	31 036	–	–	771	–	854	32 661
Couronne suédoise	–	–	–	1 418	–	5	1 423
Franc suisse	–	–	–	21 026	–	53	21 079
Dollar de Taiwan	–	–	–	(47 438)	–	–	(47 438)
Dollar américain	1 002 252	331 800	16 369	(379 564)	59 656	103 536	1 134 049
Total	\$ 1 559 123	\$ 337 570	\$ 18 550	\$ (22 112)	\$ 45 876	\$ 193 494	\$ 2 132 501
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]							
Peso argentin	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1	\$ 1
Dollar australien	–	–	–	5 231	(63)	170	5 338
Réal brésilien	–	–	–	338	–	202	540
Livre sterling	1 370	950	–	175 544	(74)	(1 178)	176 612
Dollar canadien	280	–	–	18 936	–	87	19 303
Renminbi chinois	–	–	–	(2 600)	–	–	(2 600)
Euro	842	3 144	507	42 835	28	2 263	49 619
Roupie indonésienne	3 019	–	–	(2 495)	–	148	672
Yen japonais	–	–	–	4 418	–	1	4 419
Peso mexicain	731	–	–	(4 362)	(756)	1 263	(3 124)
Dollar néo-zélandais	–	–	–	–	–	9	9
Couronne norvégienne	–	–	–	3 614	–	(1)	3 613
Couronne suédoise	–	–	–	–	–	2	2
Franc suisse	–	–	–	4 217	–	–	4 217
Livre turque	–	–	–	–	–	3	3
Dollar américain	173 588	81 010	2 424	(248 105)	830	6 641	16 388
Total	\$ 179 830	\$ 85 104	\$ 2 931	\$ (2 429)	\$ (35)	\$ 9 611	\$ 275 012
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]							
Livre sterling	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 85	\$ –	\$ –	\$ 85
Euro	–	–	–	6 064	–	–	6 064
Yen japonais	–	–	–	41 628	–	–	41 628
Franc suisse	–	–	–	300	–	–	300
Dollar américain	77 126	462 713	17 212	(49 752)	244	3 928	511 471
Total	\$ 77 126	\$ 462 713	\$ 17 212	\$ (1 675)	\$ 244	\$ 3 928	\$ 559 548
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]							
Dollar américain	\$ 1 042 661	\$ 104 522	\$ 1 154	\$ –	\$ (378)	\$ (28 452)	\$ 1 119 507
Total	\$ 1 042 661	\$ 104 522	\$ 1 154	\$ –	\$ (378)	\$ (28 452)	\$ 1 119 507
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]							
Livre sterling	£ 30 870	£ 10 333	£ –	£ 3 366	£ (12)	£ 1 385	£ 45 942
Euro	566	428	–	(1 152)	15	148	5
Yen japonais	–	–	–	(151)	19	120	(12)
Dollar américain	544	1 180	–	(2 043)	(6)	302	(23)
Total	£ 31 980	£ 11 941	£ –	£ 20	£ 16	£ 1 955	£ 45 912

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(b) Risque de change – (suite)

Au 28 février 2023 – (suite)

Devise	Investissements dans les titres à revenus fixes (en milliers)	Investissements dans les titres à revenus variables (en milliers)	Investissements dans les titres ne portant pas d'intérêts (en milliers)	Contrat à terme sur devises étrangères (en milliers)	Autres produits dérivés (en milliers)	Autres actifs/ (passifs) nets (en milliers)	Valeur liquidative totale (en milliers)
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]							
Réal brésilien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 276	\$ –	\$ –	\$ 276
Livre sterling	28	–	–	77 897	–	329	78 254
Euro	50	–	–	442	–	203	695
Yen japonais	–	–	–	477	–	–	477
Peso mexicain	620	–	–	180	–	164	964
Dollar américain	65 420	27 821	253	(79 641)	(173)	429	14 109
Total	\$ 66 118	\$ 27 821	\$ 253	\$ (369)	\$ (173)	\$ 1 125	\$ 94 775
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^]							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 520	\$ (16)	\$ 43	\$ 547
Réal brésilien	91	–	–	–	–	7	98
Livre sterling	–	–	–	(38)	(1)	60	21
Dollar canadien	–	–	–	742	–	11	753
Renminbi chinois	–	–	–	(662)	–	–	(662)
Euro	–	–	–	(345)	3	73	(269)
Roupie indonésienne	249	–	–	29	–	32	310
Yen japonais	–	–	–	69	–	6	75
Peso mexicain	1 214	–	–	(239)	–	80	1 055
Couronne norvégienne	–	–	–	185	–	–	185
Rouble russe	22	–	–	–	–	–	22
Dollar américain	11 478	2 884	1 342	(308)	928	(18)	16 306
Total	\$ 13 054	\$ 2 884	\$ 1 342	\$ (47)	\$ 914	\$ 294	\$ 18 441
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]							
Réal brésilien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2 532	\$ –	\$ –	\$ 2 532
Livre sterling	210	212	–	(400)	(1)	4	25
Euro	2 461	1 346	–	(4 176)	59	348	38
Dollar américain	3 145	1 167	30	2 029	(4)	33	6 400
Total	\$ 5 816	\$ 2 725	\$ 30	\$ (15)	\$ 54	\$ 385	\$ 8 995
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 186	\$ –	\$ –	\$ 186
Réal brésilien	9 738	–	–	(6 113)	–	(55)	3 570
Livre sterling	7 053	–	–	16 986	–	121	24 160
Dollar canadien	4 585	–	–	(1 219)	–	28	3 394
Renminbi chinois	–	–	–	(950)	–	–	(950)
Peso colombien	7 920	–	–	(2 571)	–	456	5 805
Couronne danoise	–	–	–	(189)	–	–	(189)
Euro	8 814	–	–	36 527	–	249	45 590
Shekel israélien	–	–	–	(194)	–	–	(194)
Yen japonais	–	–	–	25 308	–	–	25 308
Peso mexicain	24 449	–	–	(21 477)	–	468	3 440
Dollar néo-zélandais	2 062	–	–	(1 953)	–	26	135
Couronne norvégienne	6 120	–	–	(115)	–	94	6 099
Zloty polonais	7 036	–	–	(1 454)	–	456	6 038
Rouble russe	6 292	–	–	–	–	55	6 347
Dollar de Singapour	–	–	–	(271)	–	–	(271)
Rand sud-africain	9 422	–	–	(9 386)	–	20	56
Won sud-coréen	8 781	–	–	(4 666)	–	52	4 167
Couronne suédoise	–	–	–	(118)	–	–	(118)
Baht thaïlandais	–	–	–	1 431	–	–	1 431
Dollar américain	47 246	10 717	4 095	(30 596)	–	(3 457)	28 005
Total	\$ 149 518	\$ 10 717	\$ 4 095	\$ (834)	\$ –	\$ (1 487)	\$ 162 009
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 149 903	\$ –	\$ –	\$ 149 903
Réal brésilien	39 348	–	–	(13 194)	–	644	26 798
Livre sterling	–	–	–	12 300	–	1 647	13 947
Dollar canadien	–	–	–	16 353	–	–	16 353
Peso colombien	31 019	–	–	20 996	–	1 747	53 762
Euro	–	4 018	–	154 722	–	(1 776)	156 964
Yen japonais	–	–	–	–	2 086	(11)	2 075
Peso mexicain	31 005	–	–	(32 918)	–	1 169	(744)
Dollar néo-zélandais	14 430	–	–	(3 487)	–	166	11 109
Couronne norvégienne	–	–	–	48 046	–	1	48 047
Nouveau sol péruvien	19 905	–	–	(20 189)	–	66	(218)
Zloty polonais	23 077	–	–	(23 648)	–	585	14
Rand sud-africain	15 712	–	–	(15 997)	–	(2)	(287)
Franc suisse	–	–	–	(64 929)	–	–	(64 929)
Dollar américain	245 418	84 210	30 565	(238 561)	104	4 741	126 477
Total	\$ 419 914	\$ 88 228	\$ 30 565	\$ (10 603)	\$ 2 190	\$ 8 977	\$ 539 271

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(b) Risque de change – (suite)

Au 28 février 2023 – (suite)

Devise	Investissements dans les titres à revenus fixes (en milliers)	Investissements dans les titres à revenus variables (en milliers)	Investissements dans les titres ne portant pas d'intérêts (en milliers)	Contrat à terme sur devises étrangères (en milliers)	Autres produits dérivés (en milliers)	Autres actifs/ (passifs) nets (en milliers)	Valeur liquidative totale (en milliers)
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^							
Livre sterling	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 67	\$ –	\$ –	\$ 67
Dollar canadien	–	–	–	9 884	–	–	9 884
Euro	79	–	–	(7)	–	–	72
Couronne suédoise	–	–	–	(2)	–	–	(2)
Franc suisse	–	–	–	(2)	–	–	(2)
Dollar américain	9 551	334	396	(10 132)	2	224	375
Total	\$ 9 630	\$ 334	\$ 396	\$ (192)	\$ 2	\$ 224	\$ 10 394
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (255)	\$ –	\$ –	\$ (255)
Réal brésilien	11 157	–	–	(5 044)	–	174	6 287
Livre sterling	1 556	–	–	9 178	–	6	10 740
Dollar canadien	1 527	–	–	4 328	–	26	5 881
Renminbi chinois	–	–	–	(688)	–	–	(688)
Peso colombien	12 040	–	–	(3 628)	–	726	9 138
Couronne danoise	–	–	–	(51)	–	–	(51)
Euro	11 990	40	–	21 821	–	142	33 993
Shekel israélien	–	–	–	(52)	–	–	(52)
Yen japonais	–	–	–	41 040	–	–	41 040
Ringgit malais	5 778	–	–	(5 221)	–	83	640
Peso mexicain	25 446	–	–	(19 832)	–	624	6 238
Dollar néo-zélandais	1 673	–	–	13 940	–	20	15 633
Couronne norvégienne	1 518	–	–	8 288	–	24	9 830
Zloty polonais	8 284	–	–	890	–	727	9 901
Rouble russe	55	–	–	–	–	–	55
Dollar de Singapour	–	–	–	(73)	–	–	(73)
Rand sud-africain	7 572	–	–	(7 184)	–	(2)	386
Won sud-coréen	13 957	–	–	(7 291)	–	82	6 748
Couronne suédoise	–	–	–	(32)	–	–	(32)
Baht thaïlandais	–	–	–	2 331	–	1	2 332
Dollar américain	71 025	27 021	4 087	(55 256)	–	578	47 455
Total	\$ 173 578	\$ 27 061	\$ 4 087	\$ (2 791)	\$ –	\$ 3 211	\$ 205 146
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund							
Dollar australien	\$ 388	\$ –	\$ –	\$ 4 727	\$ –	\$ 2	\$ 5 117
Réal brésilien	44 532	–	–	(625)	–	719	44 626
Livre sterling	–	1 173	–	46 639	–	89	47 901
Renminbi chinois	–	–	–	868	–	–	868
Peso colombien	35 719	–	–	–	–	2 820	38 539
Couronne tchèque	–	–	–	29	–	–	29
Euro	22 650	–	–	408 937	(878)	532	431 241
Yen japonais	–	–	–	–	(2 581)	136	(2 445)
Peso mexicain	38 254	–	–	(2 826)	–	1 585	37 013
Dollar de Singapour	–	–	–	61 210	–	88	61 298
Couronne suédoise	–	–	–	2 020	–	–	2 020
Franc suisse	–	–	–	483	–	–	483
Dollar américain	741 247	184 488	85 354	(530 341)	186	62 681	543 615
Total	\$ 882 790	\$ 185 661	\$ 85 354	\$ (8 879)	\$ (3 273)	\$ 68 652	\$ 1 210 305
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^							
Réal brésilien	\$ 890	\$ –	\$ –	\$ (890)	\$ –	\$ 15	\$ 15
Livre sterling	–	–	–	(1 169)	–	–	(1 169)
Peso colombien	802	–	–	(889)	–	31	(56)
Euro	–	2 802	–	(3 578)	17	15	(744)
Yen japonais	–	–	–	–	(74)	4	(70)
Dollar américain	12 080	26 981	2 238	6 550	(86)	1 017	48 780
Total	\$ 13 772	\$ 29 783	\$ 2 238	\$ 24	\$ (143)	\$ 1 082	\$ 46 756
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^							
Livre sterling	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (9)	\$ –	\$ –	\$ (9)
Dollar canadien	–	–	–	(64)	–	–	(64)
Euro	97	–	–	8 360	–	1	8 458
Dollar américain	7 778	202	411	(8 479)	–	92	4
Total	\$ 7 875	\$ 202	\$ 411	\$ (192)	\$ –	\$ 93	\$ 8 389

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(b) Risque de change – (suite)

Au 28 février 2023 – (suite)

Devise	Investissements dans les titres à revenus fixes (en milliers)	Investissements dans les titres à revenus variables (en milliers)	Investissements dans les titres ne portant pas d'intérêts (en milliers)	Contrat à terme sur devises étrangères (en milliers)	Autres produits dérivés (en milliers)	Autres actifs/ (passifs) nets (en milliers)	Valeur liquidative totale (en milliers)
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 71 448	\$ –	\$ –	\$ 71 448
Réal brésilien	7 638	–	–	–	–	119	7 757
Livre sterling	–	–	–	7 018	–	–	7 018
Dollar canadien	–	–	–	7 370	–	–	7 370
Peso chilien	–	–	–	6 716	–	1	6 717
Peso colombien	5 023	–	–	(1 784)	–	295	3 534
Couronne tchèque	3 362	–	–	(3 361)	–	53	54
Euro	–	–	–	–	(283)	(1)	(284)
Yen japonais	–	–	–	14 477	–	–	14 477
Ringgit malais	1 810	–	–	134	–	26	1 970
Peso mexicain	13 934	–	–	–	–	287	14 221
Dollar néo-zélandais	–	–	–	4 260	–	–	4 260
Couronne norvégienne	–	–	–	3 326	–	–	3 326
Dollar de Singapour	–	–	–	73	–	–	73
Rand sud-africain	5 953	–	–	(557)	–	(2)	5 394
Won sud-coréen	4 525	–	–	(2 231)	–	26	2 320
Baht thaïlandais	–	–	–	2 413	–	–	2 413
Dollar américain	11 900	11 663	3 886	(112 535)	–	2 428	(82 658)
Total	\$ 54 145	\$ 11 663	\$ 3 886	\$ (3 233)	\$ (283)	\$ 3 232	\$ 69 410
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]							
Réal brésilien	\$ 695	\$ –	\$ –	\$ (184)	\$ –	\$ 9	\$ 520
Livre sterling	160	–	–	(108)	–	2	54
Peso colombien	437	–	–	–	–	34	471
Euro	541	184	–	(619)	(62)	8	52
Yen japonais	–	–	–	–	(47)	2	(45)
Peso mexicain	612	–	–	(178)	–	20	454
Dollar américain	7 741	2 760	–	1 111	19	1 667	13 298
Total	\$ 10 186	\$ 2 944	\$ –	\$ 22	\$ (90)	\$ 1 742	\$ 14 804
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]							
Euro	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1 338	\$ –	\$ –	\$ 1 338
Dollar américain	–	–	2 583	(1 358)	–	(29)	1 196
Total	\$ –	\$ –	\$ 2 583	\$ (20)	\$ –	\$ (29)	\$ 2 534
FTGF ClearBridge Value Fund							
Livre sterling	\$ –	\$ –	\$ 7 710	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 7 710
Dollar canadien	–	–	–	–	–	230	230
Euro	–	–	34 655	61 883	–	(580)	95 958
Yen japonais	–	–	10 195	–	–	–	10 195
Dollar de Singapour	–	–	–	1 757	–	(21)	1 736
Dollar américain	–	–	869 426	(64 606)	–	9 077	813 897
Total	\$ –	\$ –	\$ 921 986	\$ (966)	\$ –	\$ 8 706	\$ 929 726
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund							
Euro	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 42	\$ 42
Dollar américain	–	–	180 681	–	–	8 887	189 568
Total	\$ –	\$ –	\$ 180 681	\$ –	\$ –	\$ 8 929	\$ 189 610
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund							
Réal brésilien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 22 751	\$ –	\$ 477	\$ 23 228
Livre sterling	–	–	–	–	–	(55)	(55)
Euro	–	–	–	29 795	–	51	29 846
Dollar américain	–	–	1 172 787	(53 811)	–	53 740	1 172 716
Total	\$ –	\$ –	\$ 1 172 787	\$ (1 265)	\$ –	\$ 54 213	\$ 1 225 735
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 4 676	\$ –	\$ (1)	\$ 4 675
Livre sterling	–	–	–	348	–	170	518
Renminbi chinois	–	–	–	980	–	–	980
Euro	–	–	–	738	–	1	739
Dollar de Singapour	–	–	–	1 365	–	–	1 365
Couronne suédoise	–	–	–	18	–	–	18
Franc suisse	–	–	–	48	–	–	48
Dollar américain	–	–	214 039	(8 398)	–	10 809	216 450
Total	\$ –	\$ –	\$ 214 039	\$ (225)	\$ –	\$ 10 979	\$ 224 793

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(b) Risque de change – (suite)

Au 28 février 2023 – (suite)

Devise	Investissements dans les titres à revenus fixes (en milliers)	Investissements dans les titres à revenus variables (en milliers)	Investissements dans les titres ne portant pas d'intérêts (en milliers)	Contrat à terme sur devises étrangères (en milliers)	Autres produits dérivés (en milliers)	Autres actifs/ (passifs) nets (en milliers)	Valeur liquidative totale (en milliers)
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 864	\$ –	\$ –	\$ 864
Dollar canadien	–	–	114	–	–	(105)	9
Renminbi chinois	–	–	–	60	–	–	60
Euro	–	–	–	851	–	–	851
Dollar de Singapour	–	–	–	602	–	–	602
Dollar américain	557	–	35 919	(2 432)	–	2 098	36 142
Total	\$ 557	\$ –	\$ 36 033	\$ (55)	\$ –	\$ 1 993	\$ 38 528
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^							
Livre sterling	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 75 460	\$ –	\$ 546	\$ 76 006
Dollar canadien	–	–	21 126	–	–	(21 126)	–
Euro	–	–	–	31 670	–	(1 111)	30 559
Couronne suédoise	–	–	–	–	–	78	78
Dollar américain	–	–	1 607 907	(107 948)	–	33 377	1 533 336
Total	\$ –	\$ –	\$ 1 629 033	\$ (818)	\$ –	\$ 11 764	\$ 1 639 979
FTGF ClearBridge Global Growth Fund^							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ 265	\$ –	\$ –	\$ 1	\$ 266
Livre sterling	–	–	507	–	–	–	507
Dollar canadien	–	–	457	–	–	–	457
Euro	–	–	1 355	–	–	(1)	1 354
Dollar de Hong Kong	–	–	727	–	–	–	727
Yen japonais	–	–	722	–	–	–	722
Couronne suédoise	–	–	135	–	–	–	135
Franc suisse	–	–	477	–	–	–	477
Dollar américain	–	–	8 178	–	–	356	8 534
Total	\$ –	\$ –	\$ 12 823	\$ –	\$ –	\$ 356	\$ 13 179
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^							
Dollar australien	€ –	€ –	€ 53 833	€ (1 557)	€ –	€ 63	€ 52 339
Réal brésilien	–	–	18 045	1 357	–	–	19 402
Livre sterling	–	–	115 566	5 910	–	848	122 324
Dollar canadien	–	–	93 188	39 871	–	93	133 152
Renminbi chinois	–	–	–	23 823	–	(73)	23 750
Couronne danoise	–	–	–	–	–	40	40
Euro	–	–	266 281	(148 999)	–	26 462	143 744
Yen japonais	–	–	63 941	(4 896)	–	–	59 045
Dollar de Singapour	–	–	–	4 319	–	(25)	4 294
Dollar américain	–	–	421 656	81 035	–	2 052	504 743
Total	€ –	€ –	€ 1 032 510	€ 863	€ –	€ 29 460	€ 1 062 833
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ 40 244	\$ 8 200	\$ –	\$ 846	\$ 49 290
Réal brésilien	–	–	21 614	–	–	21	21 635
Livre sterling	–	–	57 318	5 860	–	593	63 771
Dollar canadien	–	–	49 509	–	–	(5 967)	43 542
Renminbi chinois	–	–	–	1 376	–	–	1 376
Euro	–	–	88 419	45 189	–	775	134 383
Dollar de Hong Kong	–	–	4 748	–	–	–	4 748
Yen japonais	–	–	14 256	–	–	–	14 256
Dollar de Singapour	–	–	–	65 895	–	49	65 944
Dollar américain	–	–	123 182	(128 725)	–	12 646	7 103
Total	\$ –	\$ –	\$ 399 290	\$ (2 205)	\$ –	\$ 8 963	\$ 406 048
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 5 819	\$ –	\$ (2)	\$ 5 817
Réal brésilien	–	–	–	6 595	–	–	6 595
Livre sterling	–	–	–	457	–	101	558
Dollar canadien	–	–	7 728	–	–	(4 628)	3 100
Renminbi chinois	–	–	–	2 348	–	–	2 348
Euro	–	–	–	32 066	–	(281)	31 785
Zloty polonais	–	–	–	3 756	–	–	3 756
Dollar de Singapour	–	–	–	26 050	–	177	26 227
Couronne suédoise	–	–	–	79	–	–	79
Dollar américain	–	–	736 385	(78 643)	–	3 522	661 264
Total	\$ –	\$ –	\$ 744 113	\$ (1 473)	\$ –	\$ (1 111)	\$ 741 529

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(b) Risque de change – (suite)

Au 28 février 2023 – (suite)

Devise	Investissements dans les titres à revenus fixes (en milliers)	Investissements dans les titres à revenus variables (en milliers)	Investissements dans les titres ne portant pas d'intérêts (en milliers)	Contrat à terme sur devises étrangères (en milliers)	Autres produits dérivés (en milliers)	Autres actifs/ (passifs) nets (en milliers)	Valeur liquidative totale (en milliers)
FTGF Royce US Smaller Companies Fund							
Dollar canadien	\$ –	\$ –	\$ 1 206	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1 206
Euro	–	–	–	98	–	10	108
Couronne suédoise	–	–	–	1	–	1	2
Dollar américain	–	–	77 448	(101)	–	(565)	76 782
Total	\$ –	\$ –	\$ 78 654	\$ (2)	\$ –	\$ (554)	\$ 78 098
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ 150	\$ –	\$ –	\$ 2	\$ 152
Réal brésilien	–	–	44	–	–	–	44
Livre sterling	–	–	573	–	–	(1)	572
Euro	–	–	295	–	–	1	296
Yen japonais	–	–	496	–	–	–	496
Zloty polonais	–	–	57	–	–	–	57
Won sud-coréen	–	–	85	–	–	1	86
Couronne suédoise	–	–	46	–	–	–	46
Franc suisse	–	–	76	–	–	–	76
Dollar américain	–	–	2 451	–	–	(22)	2 429
Total	\$ –	\$ –	\$ 4 273	\$ –	\$ –	\$ (19)	\$ 4 254
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ 2 708	\$ 2 549	\$ –	\$ 12	\$ 5 269
Renminbi chinois	–	–	–	174	–	(1)	173
Dollar de Hong Kong	–	–	7 445	–	–	–	7 445
Roupie indienne	–	–	1 478	–	–	(41)	1 437
Roupie indonésienne	–	–	1 102	–	–	–	1 102
Ringgit malais	–	–	482	–	–	–	482
Roupie pakistanaise	–	–	93	–	–	–	93
Peso philippin	–	–	310	–	–	–	310
Zloty polonais	–	–	–	36	–	–	36
Dollar de Singapour	–	–	261	32	–	–	293
Won sud-coréen	–	–	2 654	–	–	41	2 695
Dollar de Taiwan	–	–	3 609	–	–	–	3 609
Baht thaïlandais	–	–	293	–	–	–	293
Dollar américain	–	–	448	(2 881)	–	286	(2 147)
Total	\$ –	\$ –	\$ 20 883	\$ (90)	\$ –	\$ 297	\$ 21 090
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^]							
Dollar de Hong Kong	\$ –	\$ –	\$ 1 697	\$ –	\$ –	\$ 1	\$ 1 698
Roupie indienne	–	–	251	–	–	4	255
Roupie indonésienne	–	–	67	–	–	–	67
Dollar de Singapour	–	–	562	–	–	–	562
Won sud-coréen	–	–	584	–	–	13	597
Dollar de Taiwan	–	–	437	–	–	–	437
Dollar américain	–	–	–	–	–	(78)	(78)
Total	\$ –	\$ –	\$ 3 598	\$ –	\$ –	\$ (60)	\$ 3 538
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ 4 608	\$ –	\$ –	\$ 1	\$ 4 609
Livre sterling	–	–	3 291	2 614	–	18	5 923
Couronne danoise	–	–	4 935	–	–	28	4 963
Euro	–	–	43 115	87 573	–	(30)	130 658
Dollar de Hong Kong	–	–	8 564	–	–	–	8 564
Couronne suédoise	–	–	14 064	–	–	–	14 064
Dollar américain	–	–	63 952	(91 568)	–	(116)	(27 732)
Total	\$ –	\$ –	\$ 142 529	\$ (1 381)	\$ –	\$ (99)	\$ 141 049
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ 8 456	\$ 377	\$ –	\$ 137	\$ 8 970
Renminbi chinois	–	–	–	1	–	–	1
Dollar de Hong Kong	–	–	6 999	–	–	1	7 000
Roupie indienne	–	–	2 993	–	–	5	2 998
Ringgit malais	–	–	647	–	–	(1)	646
Dollar néo-zélandais	–	–	2 015	–	–	–	2 015
Peso philippin	–	–	277	–	–	–	277
Dollar de Singapour	–	–	2 768	309	–	56	3 133
Baht thaïlandais	–	–	808	–	–	14	822
Dollar américain	–	–	–	(705)	–	(36)	(741)
Total	\$ –	\$ –	\$ 24 963	\$ (18)	\$ –	\$ 176	\$ 25 121

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(b) Risque de change – (suite)

Au 28 février 2023 – (suite)

Devise	Investissements dans les titres à revenus fixes (en milliers)	Investissements dans les titres à revenus variables (en milliers)	Investissements dans les titres ne portant pas d'intérêts (en milliers)	Contrat à terme sur devises étrangères (en milliers)	Autres produits dérivés (en milliers)	Autres actifs/ (passifs) nets (en milliers)	Valeur liquidative totale (en milliers)
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]							
Réal brésilien	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Livre sterling	–	–	2 089	–	–	6	2 095
Renminbi chinois	–	–	751	–	–	–	751
Dollar de Hong Kong	–	–	1 557	–	–	–	1 557
Roupie indienne	–	–	8 238	–	–	(1)	8 237
Roupie indonésienne	–	–	5 907	–	–	(43)	5 864
Peso mexicain	–	–	1 229	–	–	–	1 229
Peso philippin	–	–	1 587	–	–	–	1 587
Riyal saoudien	–	–	148	–	–	–	148
Won sud-coréen	–	–	617	–	–	–	617
Dollar de Taiwan	–	–	5 522	–	–	25	5 547
Dollar américain	–	–	4 327	–	–	–	4 327
	–	–	2 575	–	–	168	2 743
Total	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
	–	–	34 547	–	–	155	34 702
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]							
Réal brésilien	€	€	€	€	€	€	€
Livre sterling	–	–	–	1 333	–	–	1 333
Couronne danoise	–	–	9 887	–	–	871	10 758
Euro	–	–	7 103	–	–	39	7 142
Couronne suédoise	–	–	127 442	(1 383)	–	(760)	125 299
Franc suisse	–	–	25 502	–	–	132	25 634
Dollar américain	–	–	6 353	–	–	34	6 387
	–	–	12 493	52	–	(1)	12 544
Total	€	€	€	€	€	€	€
	–	–	188 780	2	–	315	189 097
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]							
Euro	€	€	€	€	€	€	€
	25 460	9 299	–	–	–	2 064	36 823
Total	€	€	€	€	€	€	€
	25 460	9 299	–	–	–	2 064	36 823

Au 28 février 2022

Devise	Investissements dans les titres à revenus fixes (en milliers)	Investissements dans les titres à revenus variables (en milliers)	Investissements dans les titres ne portant pas d'intérêts (en milliers)	Contrat à terme sur devises étrangères (en milliers)	Autres produits dérivés (en milliers)	Autres actifs/ (passifs) nets (en milliers)	Valeur liquidative totale (en milliers)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund							
Dollar américain	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
	806 429	133 015	–	–	–	(20 120)	919 324
Total	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
	806 429	133 015	–	–	–	(20 120)	919 324
FTGF Western Asset US Core Bond Fund							
Renminbi chinois	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Euro	82	–	–	–	–	16	98
Dollar américain	–	–	–	2 562	–	–	2 562
	180 989	48 325	5 470	(2 612)	1 106	(3 032)	230 246
Total	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
	181 071	48 325	5 470	(50)	1 106	(3 016)	232 906
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund							
Peso argentin	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Dollar australien	–	–	–	–	–	8	8
Réal brésilien	–	–	–	25 839	(523)	1 205	26 521
Livre sterling	5 274	1 692	–	(364)	(855)	2 539	8 286
Dollar canadien	–	–	–	9 076	–	1 698	10 774
Renminbi chinois	–	–	–	53 137	–	866	54 003
Euro	–	–	–	(41 391)	–	–	(41 391)
Roupie indienne	–	–	–	23 776	1 526	2 197	27 499
Roupie indonésienne	–	–	–	2 056	–	–	2 056
Yen japonais	11 786	–	–	2 802	–	633	15 221
Ringgit malais	–	–	–	18 877	167	1 339	20 383
Peso mexicain	–	–	–	–	–	27	27
Rouble russe	27 048	–	–	8 594	(313)	3 138	38 467
Rand sud-africain	9 825	–	–	7 310	–	1 062	18 197
Dollar américain	–	–	–	1 903	–	–	1 903
	1 022 043	366 296	34 088	(115 510)	3 882	(4 663)	1 306 136
Total	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
	1 075 976	367 988	34 088	(3 895)	3 884	10 049	1 488 090

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(b) Risque de change – (suite)

Au 28 février 2022 – (suite)

Devise	Investissements dans les titres à revenus fixes (en milliers)	Investissements dans les titres à revenus variables (en milliers)	Investissements dans les titres ne portant pas d'intérêts (en milliers)	Contrat à terme sur devises étrangères (en milliers)	Autres produits dérivés (en milliers)	Autres actifs/ (passifs) nets (en milliers)	Valeur liquidative totale (en milliers)
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund							
Dollar australien	€ –	€ –	€ –	€ (72)	€ (38)	€ 146	€ 36
Livre sterling	345	–	–	(433)	(136)	293	69
Dollar canadien	–	–	–	(224)	(13)	254	17
Couronne tchèque	–	–	–	(59)	(11)	78	8
Euro	110 688	14 737	–	17 280	84	1 887	144 676
Forint hongrois	–	–	–	1 348	–	–	1 348
Couronne norvégienne	–	–	–	2 011	–	–	2 011
Zloty polonais	–	–	–	1 352	–	26	1 378
Dollar américain	19 645	391	808	(21 713)	(583)	1 295	(157)
Total	€ 130 678	€ 15 128	€ 808	€ (510)	€ (697)	€ 3 979	€ 149 386
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^]							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 30	\$ –	\$ (1)	\$ 29
Dollar canadien	171	–	–	(175)	–	7	3
Euro	–	–	–	1 473	–	5	1 478
Dollar de Hong Kong	–	–	–	(8)	–	–	(8)
Dollar américain	42 570	7 761	216	(1 348)	–	2 291	51 490
Total	\$ 42 741	\$ 7 761	\$ 216	\$ (28)	\$ –	\$ 2 302	\$ 52 992
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 92 930	\$ (117)	\$ 595	\$ 93 408
Réal brésilien	7 847	–	–	(1 008)	–	312	7 151
Livre sterling	7 527	3 843	–	40 232	–	2 095	53 697
Dollar canadien	–	–	–	970	–	3	973
Renminbi chinois	9 405	–	–	(5 094)	–	413	4 724
Peso colombien	–	–	–	–	–	78	78
Couronne tchèque	–	–	–	–	–	38	38
Euro	11 387	5 594	17 332	(19 395)	(364)	1 782	16 336
Roupie indienne	–	–	–	1 442	–	–	1 442
Roupie indonésienne	7 388	–	–	2 386	–	419	10 193
Peso mexicain	8 613	–	–	334	–	403	9 350
Zloty polonais	–	–	–	3 701	–	–	3 701
Rouble russe	3 458	–	–	(3 038)	–	123	543
Dollar de Singapour	–	–	–	(5 692)	–	–	(5 692)
Rand sud-africain	3 160	–	–	(2 051)	–	785	1 894
Franc suisse	–	–	–	3 448	–	–	3 448
Dollar de Taiwan	–	–	–	(3 537)	–	–	(3 537)
Dollar américain	141 243	44 585	12 063	(103 298)	(1 353)	11 982	105 222
Total	\$ 200 028	\$ 54 022	\$ 29 395	\$ 2 330	\$ (1 834)	\$ 19 028	\$ 302 969
FTGF Western Asset US High Yield Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 3	\$ 3
Livre sterling	–	–	–	52	–	–	52
Dollar canadien	–	–	–	(7)	–	–	(7)
Euro	–	–	–	1 811	–	–	1 811
Peso mexicain	–	–	–	–	–	2	2
Dollar de Singapour	–	–	–	514	–	–	514
Dollar américain	218 734	32 137	5 005	(2 411)	68	3 192	256 725
Total	\$ 218 734	\$ 32 137	\$ 5 005	\$ (41)	\$ 68	\$ 3 197	\$ 259 100
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund							
Réal brésilien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (21)	\$ –	\$ 29	\$ 8
Livre sterling	–	–	–	139	–	–	139
Renminbi chinois	–	–	–	121	–	–	121
Livre égyptienne	255	–	–	–	–	43	298
Euro	–	–	–	2 663	–	–	2 663
Roupie indienne	527	–	–	(546)	–	8	(11)
Roupie indonésienne	681	–	–	(710)	–	37	8
Peso mexicain	183	–	–	(223)	–	12	(28)
Rouble russe	–	–	–	(33)	–	4	(29)
Dollar de Singapour	–	–	–	9	–	–	9
Rand sud-africain	–	–	–	–	–	19	19
Dollar américain	27 702	3 881	4 048	(1 418)	(94)	3 802	37 921
Total	\$ 29 348	\$ 3 881	\$ 4 048	\$ (19)	\$ (94)	\$ 3 954	\$ 41 118
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^]							
Euro	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1 963	\$ –	\$ (1)	\$ 1 962
Dollar américain	24 491	2 599	–	(2 002)	(17)	815	25 886
Total	\$ 24 491	\$ 2 599	\$ –	\$ (39)	\$ (17)	\$ 814	\$ 27 848

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(b) Risque de change – (suite)

Au 28 février 2022 – (suite)

Devise	Investissements dans les titres à revenus fixes (en milliers)	Investissements dans les titres à revenus variables (en milliers)	Investissements dans les titres ne portant pas d'intérêts (en milliers)	Contrat à terme sur devises étrangères (en milliers)	Autres produits dérivés (en milliers)	Autres actifs/ (passifs) nets (en milliers)	Valeur liquidative totale (en milliers)
FTGF Western Asset Global High Yield Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 7 754	\$ –	\$ 2	\$ 7 756
Réal brésilien	–	–	–	–	–	17	17
Livre sterling	3 389	542	–	561	–	222	4 714
Euro	2 683	134	4 505	874	–	430	8 626
Roupie indonésienne	705	–	–	–	–	35	740
Peso mexicain	874	–	–	–	–	17	891
Zloty polonais	–	–	–	–	–	6	6
Rouble russe	634	–	–	–	–	79	713
Dollar de Singapour	–	–	–	2 201	–	–	2 201
Livre turque	–	–	–	–	–	1	1
Dollar américain	54 852	5 337	2 128	(11 336)	51	5 281	56 313
Total	\$ 63 137	\$ 6 013	\$ 6 633	\$ 54	\$ 51	\$ 6 090	\$ 81 978
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^]							
Dollar australien	\$ –	\$ 353	\$ –	\$ (956)	\$ (26)	\$ 113	\$ (516)
Livre sterling	–	–	–	(47)	(51)	124	26
Dollar canadien	–	366	–	(1 041)	(9)	119	(565)
Couronne tchèque	–	–	–	(22)	(5)	30	3
Euro	1 129	14 002	–	(7 231)	114	211	8 225
Forint hongrois	–	–	–	530	–	–	530
Roupie indonésienne	125	–	–	–	–	12	137
Yen japonais	–	5 064	–	(5 187)	28	76	(19)
Peso mexicain	922	–	–	73	–	171	1 166
Dollar néo-zélandais	–	177	–	(52)	–	4	129
Couronne norvégienne	–	–	–	368	–	–	368
Zloty polonais	–	–	–	532	–	8	540
Rouble russe	–	–	–	10	–	–	10
Rand sud-africain	817	–	–	(790)	–	81	108
Won sud-coréen	–	–	–	(3)	–	–	(3)
Couronne suédoise	–	–	–	–	–	3	3
Dollar américain	1 725	30 213	3 010	13 871	(234)	798	49 383
Total	\$ 4 718	\$ 50 175	\$ 3 010	\$ 55	\$ (183)	\$ 1 750	\$ 59 525
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 21 831	\$ –	\$ 96	\$ 21 927
Renminbi chinois	121 775	–	–	5 390	–	2 557	129 722
Euro	–	–	–	11 798	–	(15)	11 783
Dollar de Hong Kong	–	960	–	–	–	7	967
Roupie indienne	48 494	–	–	–	–	2 433	50 927
Roupie indonésienne	62 358	–	–	–	7 755	970	71 083
Ringgit malais	54 031	–	–	–	–	692	54 723
Peso philippin	46 748	–	–	–	–	318	47 066
Dollar de Singapour	14 571	7 600	–	40 602	–	433	63 206
Won sud-coréen	67 112	–	–	7 066	(1 113)	2 979	76 044
Franc suisse	–	–	–	331	–	(1)	330
Baht thaïlandais	26 180	–	–	–	–	164	26 344
Dollar américain	24 366	6 264	12 311	(87 234)	–	(35)	(44 328)
Total	\$ 465 635	\$ 14 824	\$ 12 311	\$ (216)	\$ 6 642	\$ 10 598	\$ 509 794
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 10 316	\$ –	\$ 701	\$ 11 017
Livre sterling	65 822	1 793	–	194 510	(181)	3 194	265 138
Euro	145 958	18 816	–	(107 634)	2 014	(4 998)	54 156
Couronne suédoise	–	–	–	22 926	–	74	23 000
Dollar américain	179 489	26 839	6 636	(120 587)	180	(1 619)	90 938
Total	\$ 391 269	\$ 47 448	\$ 6 636	\$ (469)	\$ 2 013	\$ (2 648)	\$ 444 249

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(b) Risque de change – (suite)

Au 28 février 2022 – (suite)

Devise	Investissements dans les titres à revenus fixes (en milliers)	Investissements dans les titres à revenus variables (en milliers)	Investissements dans les titres ne portant pas d'intérêts (en milliers)	Contrat à terme sur devises étrangères (en milliers)	Autres produits dérivés (en milliers)	Autres actifs/ (passifs) nets (en milliers)	Valeur liquidative totale (en milliers)
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (2 641)	\$ (201)	\$ 517	\$ (2 325)
Réal brésilien	–	–	–	(8)	–	8	–
Livre sterling	7 880	1 175	–	(10 423)	(217)	587	(998)
Dollar canadien	2 914	–	–	99 084	(50)	337	102 285
Renminbi chinois	–	–	–	(18 194)	–	–	(18 194)
Couronne tchèque	–	–	–	(88)	(18)	118	12
Euro	22 518	4 533	–	18 692	66	1 887	47 696
Forint hongrois	–	–	–	2 273	–	–	2 273
Roupie indonésienne	2 219	–	–	(55)	–	108	2 272
Shekel israélien	–	–	–	–	–	81	81
Yen japonais	4 308	8 744	–	(13 466)	(52)	168	(298)
Peso mexicain	4 257	–	–	(139)	–	109	4 227
Dollar néo-zélandais	–	–	–	6 139	–	–	6 139
Couronne norvégienne	–	–	–	2 073	–	–	2 073
Zloty polonais	–	–	–	2 310	–	35	2 345
Rouble russe	1 465	–	–	(1 323)	–	155	297
Rand sud-africain	3 266	–	–	(3 128)	–	160	298
Won sud-coréen	2 056	–	–	(2 124)	–	47	(21)
Dollar de Taiwan	–	–	–	9	–	–	9
Dollar américain	109 935	4 367	20 460	(79 101)	(1 235)	351	54 777
Total	\$ 160 818	\$ 18 819	\$ 20 460	\$ (110)	\$ (1 707)	\$ 4 668	\$ 202 948
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ (3)	\$ –	\$ 23	\$ 20
Réal brésilien	–	–	–	310	–	–	310
Livre sterling	6 219	2 961	–	(9 457)	(14)	294	3
Euro	21 475	11 056	–	(29 337)	(17)	1 057	4 234
Yen japonais	–	–	–	815	–	–	815
Peso mexicain	167	–	–	–	–	37	204
Zloty polonais	–	–	–	–	–	14	14
Rouble russe	51	–	–	–	–	20	71
Dollar américain	27 062	4 745	718	38 383	31	743	71 682
Total	\$ 54 974	\$ 18 762	\$ 718	\$ 711	\$ –	\$ 2 188	\$ 77 353
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^]							
Livre sterling	€ 6 855	€ 332	€ –	€ (8 180)	€ –	€ 833	€ (160)
Euro	21 219	4 362	–	8 100	–	3 904	37 585
Dollar américain	–	–	2	22	–	(1)	23
Total	€ 28 074	€ 4 694	€ 2	€ (58)	€ –	€ 4 736	€ 37 448
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]							
Dollar australien	\$ 73 065	\$ –	\$ –	\$ 129 453	\$ 3 205	\$ 6 311	\$ 212 034
Réal brésilien	71 683	–	–	353 355	(71 375)	524	354 187
Livre sterling	–	16 247	–	359 157	(6 434)	10 238	379 208
Dollar canadien	–	–	–	57 700	–	4 387	62 087
Renminbi chinois	145 773	–	–	(418 925)	–	2 033	(271 119)
Peso colombien	–	–	–	47 481	–	–	47 481
Livre égyptienne	5 128	–	–	–	–	(10)	5 118
Euro	13 327	76 463	14 535	1 381 169	56 396	680	1 542 570
Roupie indienne	174 083	–	–	(167 733)	–	4 598	10 948
Roupie indonésienne	380 772	–	–	(198 637)	–	8 385	190 520
Yen japonais	–	–	–	(277 380)	–	4 834	(272 546)
Ringgit malais	–	–	–	47 030	–	–	47 030
Peso mexicain	378 593	–	–	(308 946)	–	11 394	81 041
Dollar néo-zélandais	–	–	–	1 450	–	–	1 450
Couronne norvégienne	–	–	–	13 047	–	34	13 081
Zloty polonais	–	–	–	1 605	–	–	1 605
Rouble russe	183 535	–	–	(26 567)	(87 606)	17 422	86 784
Dollar de Singapour	–	–	–	70 491	–	194	70 685
Rand sud-africain	–	–	–	6 840	–	–	6 840
Won sud-coréen	–	–	–	75 532	–	–	75 532
Couronne suédoise	–	–	–	3 531	–	15	3 546
Franc suisse	–	–	–	67 796	–	64	67 860
Dollar de Taiwan	–	–	–	(74 813)	–	–	(74 813)
Dollar américain	1 485 150	657 162	150 896	(1 128 786)	(30 071)	408 354	1 542 705
Total	\$ 2 911 109	\$ 749 872	\$ 165 431	\$ 13 850	\$ (135 885)	\$ 479 457	\$ 4 183 834

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(b) Risque de change – (suite)

Au 28 février 2022 – (suite)

Devise	Investissements dans les titres à revenus fixes (en milliers)	Investissements dans les titres à revenus variables (en milliers)	Investissements dans les titres ne portant pas d'intérêts (en milliers)	Contrat à terme sur devises étrangères (en milliers)	Autres produits dérivés (en milliers)	Autres actifs/ (passifs) nets (en milliers)	Valeur liquidative totale (en milliers)
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]							
Peso argentin	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2	\$ 2
Dollar australien	–	–	–	103 709	(43)	236	103 902
Réal brésilien	1 313	92	–	(1 863)	(350)	225	(583)
Livre sterling	3 126	1 196	–	178 307	–	688	183 317
Dollar canadien	326	–	–	6 088	–	77	6 491
Renminbi chinois	–	–	–	(1 470)	–	–	(1 470)
Euro	1 010	5 709	2 845	57 361	210	(59)	67 076
Roupie indonésienne	6 560	–	–	(6 692)	–	576	444
Yen japonais	–	266	–	3 339	–	1	3 606
Peso mexicain	1 214	–	–	1 523	(182)	468	3 023
Dollar néo-zélandais	–	–	–	2 373	–	10	2 383
Couronne norvégienne	–	–	–	7 697	–	–	7 697
Rouble russe	1 971	–	–	1 404	–	286	3 661
Couronne suédoise	–	–	–	–	–	3	3
Franc suisse	–	–	–	48	–	–	48
Livre turque	–	–	–	–	–	4	4
Dollar américain	226 701	94 697	11 177	(353 719)	(1 260)	14 699	(7 705)
Total	\$ 242 221	\$ 101 960	\$ 14 022	\$ (1 895)	\$ (1 625)	\$ 17 216	\$ 371 899
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]							
Livre sterling	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 12 895	\$ –	\$ –	\$ 12 895
Euro	–	–	–	173 499	–	–	173 499
Yen japonais	–	–	–	53 383	–	–	53 383
Franc suisse	–	–	–	1 426	–	–	1 426
Dollar américain	161 497	856 860	36 257	(244 513)	400	6 237	816 738
Total	\$ 161 497	\$ 856 860	\$ 36 257	\$ (3 310)	\$ 400	\$ 6 237	\$ 1 057 941
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]							
Euro	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 718	\$ –	\$ –	\$ 718
Dollar américain	1 149 672	114 744	18 650	(732)	2 270	(138 042)	1 146 562
Total	\$ 1 149 672	\$ 114 744	\$ 18 650	\$ (14)	\$ 2 270	\$ (138 042)	\$ 1 147 280
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]							
Dollar australien	£ –	£ –	£ –	£ (105)	£ –	£ 124	£ 19
Livre sterling	54 931	12 121	–	3 756	2	2 802	73 612
Euro	538	317	–	(1 003)	22	110	(16)
Dollar américain	1 908	325	–	(2 675)	25	435	18
Total	£ 57 377	£ 12 763	£ –	£ (27)	£ 49	£ 3 471	£ 73 633
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]							
Réal brésilien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 280	\$ –	\$ –	\$ 280
Livre sterling	443	–	–	153 633	–	12	154 088
Euro	–	–	–	2 444	–	213	2 657
Peso mexicain	880	–	–	587	–	89	1 556
Rouble russe	88	–	–	–	–	8	96
Dollar américain	127 739	33 093	11 779	(158 540)	44	2 377	16 492
Total	\$ 129 150	\$ 33 093	\$ 11 779	\$ (1 596)	\$ 44	\$ 2 699	\$ 175 169
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^]							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 611	\$ (17)	\$ 34	\$ 628
Réal brésilien	258	–	–	280	–	19	557
Livre sterling	–	–	–	327	–	–	327
Dollar canadien	–	–	–	1 278	–	12	1 290
Renminbi chinois	–	–	–	(1 218)	–	–	(1 218)
Euro	–	–	–	(319)	12	186	(121)
Roupie indonésienne	272	–	–	214	–	18	504
Yen japonais	–	–	–	795	–	–	795
Peso mexicain	1 211	–	–	(290)	–	158	1 079
Rouble russe	184	–	–	209	–	18	411
Dollar américain	14 184	3 739	1 216	(1 956)	(28)	551	17 706
Total	\$ 16 109	\$ 3 739	\$ 1 216	\$ (69)	\$ (33)	\$ 996	\$ 21 958

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(b) Risque de change – (suite)

Au 28 février 2022 – (suite)

Devise	Investissements dans les titres à revenus fixes (en milliers)	Investissements dans les titres à revenus variables (en milliers)	Investissements dans les titres ne portant pas d'intérêts (en milliers)	Contrat à terme sur devises étrangères (en milliers)	Autres produits dérivés (en milliers)	Autres actifs/ (passifs) nets (en milliers)	Valeur liquidative totale (en milliers)
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]							
Réal brésilien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2 622	\$ –	\$ –	\$ 2 622
Livre sterling	402	257	–	(643)	–	22	38
Euro	2 366	1 450	–	(3 862)	12	63	29
Dollar américain	3 634	1 262	64	2 127	9	81	7 177
Total	\$ 6 402	\$ 2 969	\$ 64	\$ 244	\$ 21	\$ 166	\$ 9 866
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund							
Dollar australien	\$ 17 565	\$ –	\$ –	\$ (549)	\$ –	\$ 144	\$ 17 160
Réal brésilien	9 592	–	–	–	–	(72)	9 520
Livre sterling	11 455	–	–	30 138	–	99	41 692
Dollar canadien	–	–	–	(1 380)	–	–	(1 380)
Peso chilien	–	–	–	18 353	–	–	18 353
Renminbi chinois	–	–	–	(630)	–	–	(630)
Peso colombien	8 926	–	–	(8 930)	–	456	452
Couronne danoise	–	–	–	(289)	–	–	(289)
Euro	10 756	–	–	49 382	–	44	60 182
Forint hongrois	–	–	–	7 039	–	–	7 039
Shekel israélien	–	–	–	(301)	–	(1)	(302)
Yen japonais	–	–	–	10 157	–	–	10 157
Ringgit malais	9 125	–	–	–	–	137	9 262
Peso mexicain	30 602	–	–	(22 426)	–	472	8 648
Dollar néo-zélandais	8 843	–	–	4 400	–	151	13 394
Couronne norvégienne	9 268	–	–	4 840	–	141	14 249
Nouveau sol péruvien	–	–	–	4 961	–	–	4 961
Zloty polonais	12 911	–	–	5 227	–	898	19 036
Rouble russe	4 085	–	–	(3 165)	–	39	959
Dollar de Singapour	–	–	–	(301)	–	–	(301)
Rand sud-africain	11 147	–	–	(11 098)	–	16	65
Won sud-coréen	11 689	–	–	(11 448)	–	59	300
Couronne suédoise	–	–	–	9 610	–	–	9 610
Baht thaïlandais	–	–	–	2 060	–	–	2 060
Dollar américain	18 460	36 549	4 135	(85 876)	–	(1 830)	(28 562)
Total	\$ 174 424	\$ 36 549	\$ 4 135	\$ (226)	\$ –	\$ 753	\$ 215 635
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 568 312	\$ –	\$ –	\$ 568 312
Réal brésilien	38 563	–	–	8 855	–	568	47 986
Livre sterling	14 331	–	–	(23 217)	–	41	(8 845)
Peso chilien	–	–	–	67 418	–	–	67 418
Renminbi chinois	23 798	–	–	(62 023)	–	392	(37 833)
Peso colombien	23 795	–	–	(24 512)	–	935	218
Euro	–	5 163	–	221 400	(4 865)	78	221 776
Roupie indonésienne	45 736	–	–	(45 993)	–	983	726
Yen japonais	–	–	–	37 820	–	–	37 820
Peso mexicain	46 956	–	–	(46 852)	–	863	967
Dollar néo-zélandais	–	–	–	46 313	–	–	46 313
Couronne norvégienne	–	–	–	23 306	–	–	23 306
Nouveau sol péruvien	–	–	–	39 544	–	–	39 544
Zloty polonais	–	–	–	35 801	–	319	36 120
Rouble russe	–	–	–	21 839	–	–	21 839
Dollar de Singapour	–	–	–	(45 623)	–	–	(45 623)
Rand sud-africain	29 793	–	–	(30 262)	–	(5)	(474)
Won sud-coréen	60 610	–	–	(59 420)	–	188	1 378
Couronne suédoise	–	–	–	72 256	–	–	72 256
Franc suisse	–	–	–	(152 009)	–	–	(152 009)
Baht thaïlandais	–	–	–	39 208	–	–	39 208
Dollar américain	44 161	395 100	752	(692 400)	1 272	23 430	(227 685)
Total	\$ 327 743	\$ 400 263	\$ 752	\$ (239)	\$ (3 593)	\$ 27 792	\$ 752 718
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]							
Réal brésilien	\$ 241	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 3	\$ 244
Livre sterling	–	–	–	107	–	–	107
Dollar canadien	–	–	–	11 201	–	–	11 201
Euro	102	–	–	(141)	86	17	64
Couronne suédoise	–	–	–	(1)	–	–	(1)
Franc suisse	–	–	–	(4)	–	(1)	(5)
Dollar américain	10 354	181	538	(11 132)	(1)	40	(20)
Total	\$ 10 697	\$ 181	\$ 538	\$ 30	\$ 85	\$ 59	\$ 11 590

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(b) Risque de change – (suite)

Au 28 février 2022 – (suite)

Devise	Investissements dans les titres à revenus fixes (en milliers)	Investissements dans les titres à revenus variables (en milliers)	Investissements dans les titres ne portant pas d'intérêts (en milliers)	Contrat à terme sur devises étrangères (en milliers)	Autres produits dérivés (en milliers)	Autres actifs/ (passifs) nets (en milliers)	Valeur liquidative totale (en milliers)
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund							
Dollar australien	\$ 20 980	\$ –	\$ –	\$ (294)	\$ –	\$ 165	\$ 20 851
Réal brésilien	12 658	–	–	(1 465)	–	187	11 380
Livre sterling	12 420	–	–	(8 833)	–	3	3 590
Dollar canadien	–	–	–	(374)	–	–	(374)
Peso chilien	–	–	–	22 542	–	–	22 542
Renminbi chinois	7 876	–	–	(7 687)	–	129	318
Peso colombien	8 034	–	–	(8 097)	–	293	230
Couronne danoise	–	–	–	(78)	–	–	(78)
Euro	11 700	54	–	18 864	–	–	30 618
Forint hongrois	–	–	–	8 458	–	–	8 458
Roupie indonésienne	–	–	–	–	–	10	10
Shekel israélien	–	–	–	(82)	–	–	(82)
Yen japonais	–	–	–	20 980	–	–	20 980
Ringgit malais	10 886	–	–	–	–	174	11 060
Peso mexicain	22 203	–	–	(11 907)	–	408	10 704
Dollar néo-zélandais	9 811	–	–	25 242	–	168	35 221
Couronne norvégienne	10 086	–	–	7 392	–	155	17 633
Zloty polonais	21 393	–	–	775	–	1 103	23 271
Rouble russe	404	–	–	3 137	–	21	3 562
Dollar de Singapour	–	–	–	(82)	–	–	(82)
Rand sud-africain	10 099	–	–	(10 100)	–	(1)	(2)
Won sud-coréen	17 525	–	–	(16 984)	–	92	633
Couronne suédoise	–	–	–	11 724	–	–	11 724
Baht thaïlandais	–	–	–	2 504	–	–	2 504
Dollar américain	20 930	42 236	3 333	(56 855)	–	81	9 725
Total	\$ 197 005	\$ 42 290	\$ 3 333	\$ (1 220)	\$ –	\$ 2 988	\$ 244 396
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 56 572	\$ –	\$ –	\$ 56 572
Réal brésilien	52 270	–	–	(227)	–	735	52 778
Livre sterling	–	1 443	–	56 126	–	16	57 585
Peso chilien	–	–	–	81 824	–	–	81 824
Renminbi chinois	–	–	–	1 177	–	–	1 177
Euro	2 673	–	–	501 635	11 485	1 582	517 375
Peso mexicain	14 838	–	–	(13 664)	–	236	1 410
Dollar néo-zélandais	–	–	–	49 652	–	–	49 652
Rouble russe	1 285	–	–	(1 356)	–	9	(62)
Dollar de Singapour	–	–	–	53 926	–	(818)	53 108
Couronne suédoise	–	–	–	3 370	–	3	3 373
Franc suisse	7 999	–	–	(1 496)	–	24	6 527
Baht thaïlandais	–	–	–	63 944	–	–	63 944
Dollar américain	882 292	518 584	40 689	(859 558)	9 956	70 847	662 810
Total	\$ 961 357	\$ 520 027	\$ 40 689	\$ (8 075)	\$ 21 441	\$ 72 634	\$ 1 608 073
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]							
Réal brésilien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1 055	\$ –	\$ –	\$ 1 055
Peso chilien	–	–	–	1 025	–	–	1 025
Renminbi chinois	1 388	–	–	(1 310)	–	23	101
Couronne tchèque	–	–	–	495	–	–	495
Euro	–	1 923	–	(1 214)	(13)	1	697
Yen japonais	–	–	–	1 047	–	–	1 047
Couronne suédoise	–	–	–	486	–	–	486
Baht thaïlandais	–	–	–	1 549	–	–	1 549
Dollar américain	15 347	31 237	1 958	(3 199)	172	416	45 931
Total	\$ 16 735	\$ 33 160	\$ 1 958	\$ (66)	\$ 159	\$ 440	\$ 52 386
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]							
Réal brésilien	\$ 204	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 3	\$ 207
Livre sterling	–	–	–	(50)	–	–	(50)
Dollar canadien	–	–	–	(70)	–	–	(70)
Euro	223	–	–	9 709	74	14	10 020
Dollar américain	8 856	–	882	(9 785)	(6)	109	56
Total	\$ 9 283	\$ –	\$ 882	\$ (196)	\$ 68	\$ 126	\$ 10 163

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(b) Risque de change – (suite)

Au 28 février 2022 – (suite)

Devise	Investissements dans les titres à revenus fixes (en milliers)	Investissements dans les titres à revenus variables (en milliers)	Investissements dans les titres ne portant pas d'intérêts (en milliers)	Contrat à terme sur devises étrangères (en milliers)	Autres produits dérivés (en milliers)	Autres actifs/ (passifs) nets (en milliers)	Valeur liquidative totale (en milliers)
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 113 113	\$ –	\$ –	\$ 113 113
Réal brésilien	10 797	–	–	–	–	156	10 953
Livre sterling	–	–	–	7	–	–	7
Dollar canadien	–	–	–	7 251	–	–	7 251
Peso chilien	–	–	–	10 831	–	–	10 831
Peso colombien	3 350	–	–	(3 448)	–	171	73
Couronne tchèque	5 060	–	–	(4 961)	–	85	184
Euro	–	–	–	3 259	248	1	3 508
Yen japonais	–	–	–	9 178	–	–	9 178
Ringgit malais	3 901	–	–	–	–	62	3 963
Peso mexicain	17 927	–	–	(1 173)	–	328	17 082
Dollar néo-zélandais	–	–	–	3 319	–	–	3 319
Zloty polonais	10 076	–	–	–	–	183	10 259
Rouble russe	1 017	–	–	7 824	–	53	8 894
Dollar de Singapour	–	–	–	4 099	–	–	4 099
Rand sud-africain	9 841	–	–	(1 043)	–	(1)	8 797
Won sud-coréen	7 216	–	–	(1 771)	–	39	5 484
Couronne suédoise	–	–	–	10 231	–	–	10 231
Baht thaïlandais	–	–	–	3 388	–	–	3 388
Dollar américain	3 123	24 340	4 248	(161 140)	(523)	3 569	(126 383)
Total	\$ 72 308	\$ 24 340	\$ 4 248	\$ (1 036)	\$ (275)	\$ 4 646	\$ 104 231
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]							
Euro	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1 431	\$ –	\$ –	\$ 1 431
Dollar américain	–	–	2 236	(1 459)	–	(31)	746
Total	\$ –	\$ –	\$ 2 236	\$ (28)	\$ –	\$ (31)	\$ 2 177
FTGF ClearBridge Value Fund							
Dollar canadien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 219	\$ 219
Euro	–	–	27 459	31 036	–	(226)	58 269
Yen japonais	–	–	8 397	–	–	–	8 397
Dollar de Singapour	–	–	–	2 329	–	1	2 330
Dollar américain	–	–	845 932	(33 992)	–	11 083	823 023
Total	\$ –	\$ –	\$ 881 788	\$ (627)	\$ –	\$ 11 077	\$ 892 238
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund							
Euro	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1	\$ –	\$ –	\$ 1
Dollar américain	–	–	207 470	(1)	–	6 010	213 479
Total	\$ –	\$ –	\$ 207 470	\$ –	\$ –	\$ 6 010	\$ 213 480
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund							
Réal brésilien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 54 603	\$ –	\$ –	\$ 54 603
Livre sterling	–	–	–	(84)	–	(25)	(109)
Euro	–	–	–	36 993	–	604	37 597
Dollar américain	–	–	1 756 332	(88 618)	–	12 890	1 680 604
Total	\$ –	\$ –	\$ 1 756 332	\$ 2 894	\$ –	\$ 13 469	\$ 1 772 695
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 5 820	\$ –	\$ 2	\$ 5 822
Livre sterling	–	–	–	2 236	–	87	2 323
Renminbi chinois	–	–	–	1 334	–	–	1 334
Euro	–	–	–	928	–	58	986
Zloty polonais	–	–	–	1 137	–	–	1 137
Dollar de Singapour	–	–	–	2 292	–	–	2 292
Couronne suédoise	–	–	–	22	–	–	22
Franc suisse	–	–	–	60	–	–	60
Dollar américain	–	–	536 471	(13 839)	–	1 551	524 183
Total	\$ –	\$ –	\$ 536 471	\$ (10)	\$ –	\$ 1 698	\$ 538 159

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(b) Risque de change – (suite)

Au 28 février 2022 – (suite)

Devise	Investissements dans les titres à revenus fixes (en milliers)	Investissements dans les titres à revenus variables (en milliers)	Investissements dans les titres ne portant pas d'intérêts (en milliers)	Contrat à terme sur devises étrangères (en milliers)	Autres produits dérivés (en milliers)	Autres actifs/ (passifs) nets (en milliers)	Valeur liquidative totale (en milliers)
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1 154	\$ –	\$ –	\$ 1 154
Dollar canadien	–	–	–	–	–	9	9
Renminbi chinois	–	–	–	122	–	–	122
Euro	–	–	–	1 673	–	–	1 673
Dollar de Singapour	–	–	–	440	–	–	440
Dollar américain	836	–	41 374	(3 407)	–	1 078	39 881
Total	\$ 836	\$ –	\$ 41 374	\$ (18)	\$ –	\$ 1 087	\$ 43 279
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]							
Livre sterling	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 80 105	\$ –	\$ (801)	\$ 79 304
Euro	–	–	–	61 158	–	(304)	60 854
Couronne suédoise	–	–	–	–	–	36	36
Dollar américain	–	–	1 618 990	(143 217)	–	(16 652)	1 459 121
Total	\$ –	\$ –	\$ 1 618 990	\$ (1 954)	\$ –	\$ (17 721)	\$ 1 599 315
FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ 73	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 73
Livre sterling	–	–	362	–	–	–	362
Dollar canadien	–	–	491	–	–	1	492
Euro	–	–	1 848	–	–	–	1 848
Dollar de Hong Kong	–	–	242	–	–	–	242
Yen japonais	–	–	467	–	–	–	467
Won sud-coréen	–	–	112	–	–	1	113
Couronne suédoise	–	–	342	–	–	–	342
Franc suisse	–	–	469	–	–	–	469
Dollar américain	–	–	9 886	–	–	1 724	11 610
Total	\$ –	\$ –	\$ 14 292	\$ –	\$ –	\$ 1 726	\$ 16 018
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]							
Dollar australien	€ –	€ –	€ 12 746	€ 3 869	€ –	€ (2)	€ 16 613
Réal brésilien	–	–	–	5 242	–	–	5 242
Livre sterling	–	–	52 025	13 891	–	256	66 172
Dollar canadien	–	–	57 019	43 209	–	344	100 572
Renminbi chinois	–	–	–	7 466	–	–	7 466
Couronne danoise	–	–	–	–	–	40	40
Euro	–	–	181 973	(128 367)	–	18 075	71 681
Yen japonais	–	–	20 475	(2 755)	–	(244)	17 476
Dollar de Singapour	–	–	–	4 243	–	–	4 243
Dollar américain	–	–	324 060	55 959	–	1 900	381 919
Total	€ –	€ –	€ 648 298	€ 2 757	€ –	€ 20 369	€ 671 424
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^]							
Réal brésilien	\$ –	\$ –	\$ 434	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 434
Renminbi chinois	–	–	52	–	–	–	52
Euro	–	–	–	1 506	–	–	1 506
Dollar de Hong Kong	–	–	675	–	–	–	675
Roupie indienne	–	–	525	–	–	–	525
Roupie indonésienne	–	–	115	–	–	–	115
Ringgit malais	–	–	124	–	–	–	124
Peso mexicain	–	–	496	–	–	1	497
Peso philippin	–	–	188	–	–	–	188
Baht thaïlandais	–	–	28	–	–	–	28
Dollar américain	–	–	30	(1 536)	–	27	(1 479)
Total	\$ –	\$ –	\$ 2 667	\$ (30)	\$ –	\$ 28	\$ 2 665
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ 16 494	\$ 5 446	\$ –	\$ 185	\$ 22 125
Réal brésilien	–	–	5 712	–	–	–	5 712
Livre sterling	–	–	19 993	292	–	132	20 417
Dollar canadien	–	–	20 220	–	–	127	20 347
Renminbi chinois	–	–	–	309	–	–	309
Euro	–	–	42 484	4 673	–	78	47 235
Peso mexicain	–	–	7 880	–	–	–	7 880
Dollar de Singapour	–	–	–	27 455	–	(218)	27 237
Dollar américain	–	–	51 350	(38 425)	–	9 207	22 132
Total	\$ –	\$ –	\$ 164 133	\$ (250)	\$ –	\$ 9 511	\$ 173 394

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(b) Risque de change – (suite)

Au 28 février 2022 – (suite)

Devise	Investissements dans les titres à revenus fixes (en milliers)	Investissements dans les titres à revenus variables (en milliers)	Investissements dans les titres ne portant pas d'intérêts (en milliers)	Contrat à terme sur devises étrangères (en milliers)	Autres produits dérivés (en milliers)	Autres actifs/ (passifs) nets (en milliers)	Valeur liquidative totale (en milliers)
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 7 254	\$ –	\$ (4)	\$ 7 250
Réal brésilien	–	–	–	16 354	–	–	16 354
Livre sterling	–	–	–	1 252	–	477	1 729
Dollar canadien	–	–	6 555	–	–	(2 913)	3 642
Renminbi chinois	–	–	–	2 406	–	–	2 406
Euro	–	–	–	39 523	–	12 046	51 569
Zloty polonais	–	–	–	5 274	–	–	5 274
Dollar de Singapour	–	–	–	26 304	–	51	26 355
Couronne suédoise	–	–	–	88	–	(1)	87
Dollar américain	–	–	926 975	(98 778)	–	(26 654)	801 543
Total	\$ –	\$ –	\$ 933 530	\$ (323)	\$ –	\$ (16 998)	\$ 916 209
FTGF Royce US Smaller Companies Fund							
Dollar canadien	\$ –	\$ –	\$ 2 110	\$ –	\$ –	\$ (1)	\$ 2 109
Euro	–	–	–	174	–	–	174
Couronne suédoise	–	–	–	1	–	–	1
Dollar américain	–	–	86 350	(179)	–	(520)	85 651
Total	\$ –	\$ –	\$ 88 460	\$ (4)	\$ –	\$ (521)	\$ 87 935
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ 315	\$ –	\$ –	\$ 2	\$ 317
Réal brésilien	–	–	50	–	–	–	50
Livre sterling	–	–	499	–	–	–	499
Dollar canadien	–	–	33	–	–	–	33
Euro	–	–	389	–	–	–	389
Yen japonais	–	–	513	–	–	–	513
Zloty polonais	–	–	62	–	–	–	62
Couronne suédoise	–	–	136	–	–	–	136
Franc suisse	–	–	89	–	–	–	89
Dollar américain	–	–	2 464	–	–	(18)	2 446
Total	\$ –	\$ –	\$ 4 550	\$ –	\$ –	\$ (16)	\$ 4 534
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^]							
Dollar australien	€ –	€ –	€ –	€ 1 396	€ –	€ –	€ 1 396
Livre sterling	–	–	7 898	–	–	28	7 926
Renminbi chinois	–	–	–	156	–	–	156
Couronne danoise	–	–	1 379	–	–	33	1 412
Euro	–	–	10 946	(7 520)	–	327	3 753
Couronne norvégienne	–	–	674	–	–	1	675
Zloty polonais	–	–	–	469	–	–	469
Rouble russe	–	–	34	–	–	–	34
Dollar de Singapour	–	–	–	223	–	(50)	173
Couronne suédoise	–	–	1 606	–	–	–	1 606
Franc suisse	–	–	5 297	–	–	–	5 297
Dollar américain	–	–	–	5 415	–	25	5 440
Total	€ –	€ –	€ 27 834	€ 139	€ –	€ 364	€ 28 337
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund							
Dollar australien	\$ –	\$ –	\$ 1 981	\$ 2 146	\$ –	\$ 19	\$ 4 146
Renminbi chinois	–	–	–	227	–	–	227
Dollar de Hong Kong	–	–	10 706	–	–	–	10 706
Roupie indienne	–	–	1 964	–	–	–	1 964
Roupie indonésienne	–	–	748	–	–	56	804
Ringgit malais	–	–	794	–	–	–	794
Roupie pakistanaise	–	–	185	–	–	–	185
Peso philippin	–	–	362	–	–	54	416
Zloty polonais	–	–	–	2 324	–	–	2 324
Dollar de Singapour	–	–	273	34	–	–	307
Won sud-coréen	–	–	3 371	–	–	57	3 428
Dollar de Taiwan	–	–	4 876	–	–	1	4 877
Baht thaïlandais	–	–	302	–	–	–	302
Dollar américain	–	–	335	(4 836)	–	(96)	(4 597)
Total	\$ –	\$ –	\$ 25 897	\$ (105)	\$ –	\$ 91	\$ 25 883

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(b) Risque de change – (suite)

Au 28 février 2022 – (suite)

Devise	Investissements dans les titres à revenus fixes (en milliers)	Investissements dans les titres à revenus variables (en milliers)	Investissements dans les titres ne portant pas d'intérêts (en milliers)	Contrat à terme sur devises étrangères (en milliers)	Autres produits dérivés (en milliers)	Autres actifs/ (passifs) nets (en milliers)	Valeur liquidative totale (en milliers)
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^							
Dollar australien	\$ -	\$ -	\$ 283	\$ 456	\$ -	\$ 3	\$ 742
Livre sterling	-	-	432	-	-	6	438
Dollar canadien	-	-	152	-	-	1	153
Euro	-	-	1 098	-	-	11	1 109
Dollar de Hong Kong	-	-	616	-	-	1	617
Yen japonais	-	-	1 014	-	-	-	1 014
Ringgit malais	-	-	96	-	-	-	96
Dollar de Singapour	-	-	-	53	-	-	53
Franc suisse	-	-	412	-	-	-	412
Dollar de Taiwan	-	-	937	-	-	1	938
Livre turque	-	-	113	-	-	12	125
Dollar américain	-	-	7 219	(503)	-	130	6 846
Total	\$ -	\$ -	\$ 12 372	\$ 6	\$ -	\$ 165	\$ 12 543
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^							
Dollar de Hong Kong	\$ -	\$ -	\$ 6 614	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 6 614
Roupie indienne	-	-	1 901	-	-	28	1 929
Roupie indonésienne	-	-	362	-	-	-	362
Dollar de Singapour	-	-	1 937	-	-	-	1 937
Won sud-coréen	-	-	2 174	-	-	24	2 198
Dollar de Taiwan	-	-	1 879	-	-	-	1 879
Dollar américain	-	-	596	-	-	603	1 199
Total	\$ -	\$ -	\$ 15 463	\$ -	\$ -	\$ 655	\$ 16 118
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^							
Dollar australien	\$ -	\$ -	\$ 5 028	\$ (377)	\$ -	\$ 377	\$ 5 028
Livre sterling	-	-	889	2 460	-	-	3 349
Couronne danoise	-	-	5 093	-	-	17	5 110
Euro	-	-	41 268	94 884	-	1 786	137 938
Dollar de Hong Kong	-	-	14 747	(1 083)	-	1 083	14 747
Couronne suédoise	-	-	18 215	(926)	-	926	18 215
Dollar de Taiwan	-	-	10 526	-	-	789	11 315
Dollar américain	-	-	74 692	(96 875)	-	(4 138)	(26 321)
Total	\$ -	\$ -	\$ 170 458	\$ (1 917)	\$ -	\$ 840	\$ 169 381
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund							
Dollar australien	\$ -	\$ -	\$ 9 168	\$ 681	\$ -	\$ 143	\$ 9 992
Renminbi chinois	-	-	-	1	-	-	1
Dollar de Hong Kong	-	-	6 848	-	-	(1)	6 847
Roupie indienne	-	-	3 665	-	-	(1)	3 664
Ringgit malais	-	-	708	-	-	-	708
Dollar néo-zélandais	-	-	1 154	-	-	1	1 155
Peso philippin	-	-	1 005	-	-	-	1 005
Dollar de Singapour	-	-	3 744	1 022	-	16	4 782
Baht thaïlandais	-	-	1 321	-	-	22	1 343
Dollar américain	-	-	-	(1 703)	-	140	(1 563)
Total	\$ -	\$ -	\$ 27 613	\$ 1	\$ -	\$ 320	\$ 27 934
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^							
Réal brésilien	\$ -	\$ -	\$ 2 427	\$ -	\$ -	\$ 3	\$ 2 430
Livre sterling	-	-	906	-	-	-	906
Renminbi chinois	-	-	2 232	-	-	(1)	2 231
Euro	-	-	664	-	-	-	664
Dollar de Hong Kong	-	-	9 993	-	-	-	9 993
Forint hongrois	-	-	998	-	-	-	998
Roupie indienne	-	-	8 569	-	-	(148)	8 421
Roupie indonésienne	-	-	1 424	-	-	-	1 424
Peso mexicain	-	-	368	-	-	-	368
Peso philippin	-	-	203	-	-	(1)	202
Riyal saoudien	-	-	911	-	-	-	911
Won sud-coréen	-	-	8 972	-	-	51	9 023
Dollar de Taiwan	-	-	6 329	-	-	-	6 329
Dollar américain	-	-	3 643	-	-	295	3 938
Total	\$ -	\$ -	\$ 47 639	\$ -	\$ -	\$ 199	\$ 47 838

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(b) Risque de change – (suite)

Au 28 février 2022 – (suite)

Devise	Investissements dans les titres à revenus fixes (en milliers)	Investissements dans les titres à revenus variables (en milliers)	Investissements dans les titres ne portant pas d'intérêts (en milliers)	Contrat à terme sur devises étrangères (en milliers)	Autres produits dérivés (en milliers)	Autres actifs/ (passifs) nets (en milliers)	Valeur liquidative totale (en milliers)
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]							
Réal brésilien	€	€	€	€	€	€	€
Livre sterling	–	–	11 052	–	–	–	11 052
Couronne danoise	–	–	13 417	–	–	17	13 434
Euro	–	–	203 394	(3 034)	–	808	201 168
Couronne suédoise	–	–	42 376	–	–	1	42 377
Franc suisse	–	–	11 864	–	–	–	11 864
Dollar américain	–	–	20 448	77	–	1	20 526
Total	€	€	€	€	€	€	€
	–	–	302 551	212	–	827	303 590

Certains fonds ont également des catégories d'actions émises en devises étrangères. Certains fonds (comme indiqué dans le supplément au prospectus correspondant) peuvent conclure des contrats de change à terme, livrables ou non, pour se couvrir contre le risque de change, pour augmenter l'exposition à une devise, pour transférer l'exposition aux fluctuations des devises, d'une devise à une autre, ou pour améliorer le rendement. Chaque fonds à revenu fixe peut également conclure des options sur des contrats de change à terme, livrables ou non, qui, en échange d'une prime, donnent au fonds la possibilité, mais non l'obligation, de conclure un tel contrat à un moment donné avant une date déterminée.

Les tableaux suivants présentent une analyse de la sensibilité au risque de change et son effet sur la valeur liquidative des fonds pour lesquels le risque de change est jugé important. Un relevé des positions sous-jacentes de tous les compartiments a été effectué aux 28 février 2023 et 28 février 2022. Les taux de change se sont appréciés/dépréciés de +/- 5 % (taux d'appréciation/dépréciation de 5 % appliqué compte tenu de la nature des marchés dans lesquels les Compartiments sont investis); l'effet de change correspondant a été estimé pour le total de la valeur liquidative. Tous les autres paramètres de marché sont également supposés être inchangés.

		Incidence de la fluctuation des taux de change sur la valeur liquidative* (montant dans la devise de référence du compartiment) (en milliers)			
		28 février 2023		28 février 2022	
Fonds	Devise	Positive de 5 %	Négative de 5 %	Positive de 5 %	Négative de 5 %
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Dollar australien	3 257	(2 947)	4 916	(4 448)
	Livre sterling	s.o.	s.o.	2 826	(2 557)
	Franc suisse	2 873	(2 599)	s.o.	s.o.
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Euro	s.o.	s.o.	454	(411)
	Euro	s.o.	s.o.	433	(392)
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]	Renminbi chinois	s.o.	s.o.	6 827	(6 177)
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Roupie indonésienne	3 357	(3 037)	3 741	(3 385)
	Ringgit malais	2 666	(2 412)	2 880	(2 606)
	Dollar de Singapour	2 489	(2 252)	3 327	(3 010)
	Won sud-coréen	4 113	(3 722)	4 002	(3 621)
	Livre sterling	15 035	(13 603)	13 955	(12 626)
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Euro	5 320	(4 813)	2 850	(2 579)
	Dollar canadien	4 723	(4 273)	5 383	(4 871)
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Euro	963	(871)	2 510	(2 271)
	Euro	40 788	(36 903)	81 188	(73 456)
	Yen japonais	(11 299)	10 222	s.o.	s.o.
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	Dollar australien	s.o.	s.o.	5 469	(4 948)
	Livre sterling	9 295	(8 410)	9 648	(8 729)
	Euro	2 612	(2 363)	3 530	(3 194)
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	Euro	s.o.	s.o.	9 132	(8 262)
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	Livre sterling	4 119	(3 726)	8 110	(7 338)
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	Réal brésilien	133	121	138	(125)
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	Livre sterling	1 272	(1 150)	2 194	(1 985)
	Euro	2 399	(2 171)	3 167	(2 866)
	Yen japonais	1 332	(1 205)	s.o.	s.o.
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	Dollar australien	7 890	(7 138)	29 911	(27 062)
	Euro	8 261	(7 474)	11 672	(10 561)
	Franc suisse	(3 417)	3 092	(8 000)	7 239
	Dollar canadien	520	(471)	590	(533)
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	Euro	1 789	(1 619)	1 611	(1 458)
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	Yen japonais	2 160	(1 954)	s.o.	s.o.
	Dollar néo-zélandais	s.o.	s.o.	1 854	(1 677)
	Euro	22 697	(20 535)	27 230	(24 637)
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	Euro	445	(403)	527	(477)
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	Dollar australien	3 760	(3 402)	5 953	(5 386)
	Réal brésilien	408	(369)	576	(522)
	Peso chilien	s.o.	s.o.	570	(516)
	Dollar canadien	388	(351)	s.o.	s.o.
	Yen japonais	762	(689)	s.o.	s.o.
	Peso mexicain	748	(677)	899	(813)
	Euro	70	(64)	75	(68)
	Euro	5 050	(4 569)	s.o.	s.o.
FTGF ClearBridge Value Fund	Euro	71	(64)	97	(88)
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	Livre sterling	6 438	(5 825)	s.o.	s.o.
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	Dollar canadien	7 008	(6 341)	5 293	(4 789)
	Dollar américain	26 565	(24 035)	20 101	(18 187)
	Réal brésilien	s.o.	s.o.	23	(21)
	Euro	s.o.	s.o.	79	(72)
	Dollar de Hong Kong	s.o.	s.o.	36	(32)
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	Roupie indienne	s.o.	s.o.	28	(25)
	Peso mexicain	s.o.	s.o.	26	(24)
	Dollar australien	2 594	(2 347)	1 164	(1 054)
	Livre sterling	3 356	(3 037)	1 075	(972)
	Dollar canadien	2 292	(2 073)	1 071	(969)
	Euro	7 073	(6 399)	2 486	(2 249)
	Dollar de Singapour	3 471	(3 140)	1 434	(1 297)

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(b) Risque de change – (suite)

Fonds	Devise	Incidence de la fluctuation des taux de change sur la valeur liquidative* (montant dans la devise de référence du compartiment) (en milliers)			
		28 février 2023		28 février 2022	
		Positive de 5 %	Négative de 5 %	Positive de 5 %	Négative de 5 %
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	Livre sterling	30	(27)	26	(24)
	Yen japonais	26	(24)	27	(24)
	Dollar de Singapour	3 471	(3 140)	s.o.	s.o.
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	Livre sterling	s.o.	s.o.	417	(377)
	Dollar américain	s.o.	s.o.	286	(259)
	Franc suisse	s.o.	s.o.	279	(252)
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	Dollar australien	277	(251)	218	(197)
	Dollar de Hong Kong	392	(355)	563	(510)
	Won sud-coréen	142	(128)	180	(163)
	Dollar de Taiwan	190	(172)	257	(232)
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	Dollar de Hong Kong	89	(81)	348	(315)
	Roupie indienne	s.o.	s.o.	102	(92)
	Dollar de Singapour	30	(27)	102	(92)
	Won sud-coréen	31	(28)	116	(105)
	Dollar de Taiwan	23	(21)	99	(89)
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	Euro	6 877	(6 222)	7 260	(6 568)
	Couronne suédoise	s.o.	s.o.	959	(867)
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	Dollar australien	472	(427)	526	(476)
	Dollar de Hong Kong	368	(333)	360	(326)
	Roupie indienne	158	(143)	193	(174)
	Dollar de Singapour	165	(149)	252	(228)
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	Dollar de Hong Kong	434	(392)	526	(476)
	Roupie indienne	309	(279)	443	(401)
	Won sud-coréen	292	(264)	475	(430)
	Dollar de Taiwan	228	(206)	333	(301)
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	Couronne suédoise	1 349	(1 221)	2 230	(2 018)

L'analyse présentée concerne des situations où un risque d'exposition aux devises étrangères important est encouru par le compartiment. Une exposition est considérée comme importante lorsqu'elle dépasse 10 % de l'actif net. Les fluctuations de l'ensemble des taux de change des devises étrangères auront un impact direct sur la valeur liquidative. Les taux de change aux 28 février 2023 et 28 février 2022 sont indiqués dans la note 11. Cette analyse de sensibilité ne doit pas servir à des fins de prédiction des performances futures.

L'analyse de sensibilité au risque de change pour les fonds FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] et FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] a été incorporé dans le calcul du risque de marché en utilisant l'approche VaR (Note 12.1 ci-dessus).

(c) Risque de taux d'intérêt

Une analyse de sensibilité pour les fonds d'actions n'a pas été préparée car la majorité des actifs des fonds d'actions sont des actifs ne portant pas d'intérêts et le risque n'est donc pas suffisamment important.

Toutes les liquidités détenues par les fonds sont détenues aux 28 février 2023 et 28 février 2022 auprès du Dépositaire ou d'autres courtiers et sont susceptibles de générer des revenus d'intérêts, dont le niveau dépendra des taux d'intérêt en vigueur sur le marché.

Les résultats de l'analyse des titres à taux d'intérêt fixe et variable et des titres non porteurs d'intérêts sont présentés dans la Note 12.1(b) ci-dessus.

La moyenne pondérée des rendements et la moyenne pondérée du nombre d'années restant jusqu'à l'échéance de chaque compartiment concernant leurs instruments à taux fixe par devise étaient les suivantes au 28 février 2023 et au 28 février 2022 :

Au 28 février 2023

Devise	Weighted Average Yield	Weighted Average Years to Maturity
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		
Dollar US	2,10 %	0,05
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		
Dollar US	3,91 %	17,10
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Réal brésilien	11,46 %	6,45
Roupie indonésienne	6,53 %	9,13
Peso mexicain	8,96 %	17,37
Rouble russe	0,00 %	8,80
Dollar US	4,07 %	16,48
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		
Euro	1,65 %	9,72
Zloty polonais	2,57 %	9,16
Livre sterling	4,59 %	5,01
Dollar US	4,98 %	13,87
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Réal brésilien	10,92 %	3,84
Euro	5,73 %	5,10
Roupie indonésienne	7,30 %	5,32
Peso mexicain	9,03 %	19,72
Zloty polonais	2,57 %	9,16
Livre sterling	5,29 %	6,46
Rouble russe	0,00 %	8,26
Rand sud-africain	10,32 %	18,01
Dollar US	5,55 %	10,34
FTGF Western Asset US High Yield Fund		
Dollar US	7,47 %	5,97
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		
Euro	5,46 %	4,27
Peso mexicain	8,78 %	14,10
Livre sterling	6,55 %	3,51
Rouble russe	0,00 %	5,52
Dollar US	6,10 %	6,18

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(c) Risque de taux d'intérêt – (suite)

Au 28 février 2023 – (suite)

Devise	Moyenne pondérée des rendements	Moyenne pondérée des années jusqu'à échéance
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Renminbi chinois	3,54 %	9,88
Roupie indienne	7,62 %	5,39
Roupie indonésienne	7,41 %	4,02
Ringgit malais	3,94 %	8,13
Peso philippin	6,58 %	12,88
Dollar de Singapour	1,62 %	11,90
Won sud-coréen	2,15 %	7,88
Baht thaïlandais	3,18 %	15,31
Dollar US	3,87 %	20,28
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Euro	1,29 %	4,27
Livre sterling	3,12 %	3,47
Dollar US	2,55 %	4,41
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^		
Réal brésilien	11,82 %	7,85
Dollar canadien	3,15 %	12,68
Euro	2,11 %	10,77
Roupie indonésienne	7,45 %	16,14
Yen japonais	0,37 %	18,27
Peso mexicain	9,03 %	19,72
Zloty polonais	2,57 %	9,16
Livre sterling	4,49 %	10,37
Rand sud-africain	10,32 %	18,01
Won sud-coréen	1,99 %	3,28
Dollar US	3,03 %	12,58
FTGF Western Asset Global Credit Fund^		
Euro	1,72 %	6,04
Livre sterling	3,52 %	5,93
Dollar US	5,03 %	13,42
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^		
Dollar australien	3,66 %	24,07
Réal brésilien	11,53 %	6,58
Livre égyptienne	19,19 %	1,25
Euro	6,35 %	8,93
Roupie indienne	7,41 %	4,13
Roupie indonésienne	7,17 %	9,92
Peso mexicain	9,06 %	21,28
Zloty polonais	2,57 %	9,16
Rouble russe	0,00 %	10,55
Rand sud-africain	9,68 %	14,57
Dollar US	5,32 %	14,38
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^		
Dollar canadien	5,78 %	3,21
Euro	4,75 %	32,52
Roupie indonésienne	6,80 %	5,57
Peso mexicain	8,88 %	6,26
Livre sterling	6,99 %	4,12
Dollar US	6,74 %	8,16
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^		
Dollar US	6,02 %	10,84
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^		
Dollar US	4,27 %	25,94
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^		
Euro	2,89 %	8,65
Livre sterling	4,00 %	9,73
Dollar US	4,21 %	24,53
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^		
Euro	5,09 %	15,01
Peso mexicain	9,10 %	15,73
Livre sterling	6,82 %	15,89
Dollar US	4,80 %	9,16
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^		
Réal brésilien	12,15 %	9,85
Roupie indonésienne	6,69 %	6,82
Peso mexicain	9,03 %	19,72
Rouble russe	0,00 %	6,24
Dollar US	4,33 %	16,65
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^		
Euro	2,05 %	6,12
Livre sterling	2,86 %	6,35
Dollar US	4,65 %	13,12

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(c) Risque de taux d'intérêt – (suite)

Au 28 février 2023 – (suite)

Devise	Moyenne pondérée des rendements	Moyenne pondérée des années jusqu'à échéance
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		
Réal brésilien	10,44 %	2,99
Dollar canadien	2,55 %	2,26
Peso colombien	7,95 %	5,17
Euro	1,84 %	9,47
Peso mexicain	8,90 %	15,49
Dollar néo-zélandais	4,24 %	16,51
Couronne norvégienne	2,00 %	0,23
Zloty polonais	2,57 %	9,16
Livre sterling	0,76 %	0,39
Rouble russe	8,30 %	3,38
Rand sud-africain	9,63 %	16,25
Won sud-coréen	3,15 %	21,80
Dollar US	2,60 %	23,18
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^		
Réal brésilien	11,93 %	8,54
Peso colombien	12,00 %	20,55
Peso mexicain	9,16 %	28,81
Dollar néo-zélandais	3,92 %	28,23
Sol péruvien	7,00 %	9,46
Zloty polonais	2,57 %	9,16
Rand sud-africain	11,21 %	25,02
Dollar US	3,98 %	16,53
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^		
Euro	3,00 %	8,47
Dollar US	6,93 %	4,77
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Réal brésilien	11,43 %	6,24
Dollar canadien	2,03 %	0,51
Peso colombien	9,94 %	10,86
Euro	1,79 %	8,29
Ringgit malais	3,67 %	2,07
Peso mexicain	9,05 %	18,22
Dollar néo-zélandais	3,92 %	28,23
Couronne norvégienne	2,00 %	0,23
Zloty polonais	2,57 %	9,16
Livre sterling	0,76 %	0,39
Rouble russe	0,00 %	7,12
Rand sud-africain	10,77 %	21,57
Won sud-coréen	2,37 %	13,30
Dollar US	4,05 %	26,32
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Dollar australien	2,79 %	7,80
Réal brésilien	11,75 %	9,41
Peso colombien	9,86 %	8,08
Euro	2,01 %	28,20
Yen japonais	0,00 %	0,00
Peso mexicain	8,86 %	28,40
Dollar US	5,18 %	7,34
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^		
Réal brésilien	12,15 %	9,85
Peso colombien	13,18 %	27,68
Dollar US	5,87 %	21,21
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^		
Euro	5,06 %	3,59
Dollar US	6,47 %	4,48
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^		
Réal brésilien	11,60 %	6,72
Peso colombien	9,42 %	7,79
Couronne tchèque	2,28 %	9,32
Ringgit malais	3,67 %	2,12
Peso mexicain	9,03 %	17,86
Rand sud-africain	11,04 %	23,65
Won sud-coréen	2,37 %	13,18
Dollar US	5,27 %	23,41
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^		
Réal brésilien	10,39 %	7,67
Peso colombien	9,86 %	8,08
Euro	1,95 %	7,29
Yen japonais	0,00 %	0,00
Peso mexicain	7,89 %	21,98
Livre sterling	5,20 %	1,22
Dollar US	5,28 %	6,84
Franklin Responsible Income 2028 Fund^		
Euro	2,74 %	5,00

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(c) Risque de taux d'intérêt – (suite)

Au 28 février 2022

Devise	Moyenne pondérée des rendements	Moyenne pondérée des années jusqu'à échéance
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		
Dollar US	0,15 %	0,10
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		
Renminbi chinois	3,20 %	3,76
Dollar US	3,13 %	17,76
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Réal brésilien	10,36 %	3,23
Roupie indonésienne	6,45 %	10,13
Peso mexicain	8,17 %	19,44
Rouble russe	12,36 %	8,78
Dollar US	3,00 %	15,82
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		
Euro	1,39 %	10,60
Livre sterling	4,21 %	7,18
Dollar US	2,98 %	12,73
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^]		
Dollar canadien	5,33 %	4,21
Dollar US	6,08 %	4,67
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Réal brésilien	10,32 %	2,74
Livre sterling	5,48 %	8,58
Renminbi chinois	3,67 %	10,40
Euro	5,47 %	6,30
Roupie indonésienne	7,05 %	6,31
Peso mexicain	7,97 %	16,81
Rouble russe	14,03 %	8,80
Rand sud-africain	9,74 %	19,01
Dollar US	4,93 %	10,72
FTGF Western Asset US High Yield Fund		
Dollar US	5,94 %	7,05
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^]		
Livre égyptienne	14,04 %	0,64
Roupie indienne	5,86 %	0,78
Roupie indonésienne	7,46 %	4,40
Peso mexicain	8,09 %	20,72
Dollar US	5,35 %	14,25
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^]		
Dollar US	5,51 %	9,28
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		
Livre sterling	5,76 %	4,47
Euro	4,46 %	5,40
Roupie indonésienne	6,94 %	0,21
Peso mexicain	7,94 %	14,74
Rouble russe	13,40 %	6,50
Dollar US	5,41 %	7,38
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Renminbi chinois	3,47 %	11,45
Roupie indienne	7,31 %	4,88
Roupie indonésienne	7,33 %	4,95
Ringgit malais	3,93 %	7,58
Peso philippin	4,93 %	8,33
Dollar de Singapour	2,67 %	41,56
Won sud-coréen	1,51 %	9,27
Baht thaïlandais	3,09 %	16,31
Dollar US	4,22 %	42,42
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Euro	0,69 %	4,48
Livre sterling	1,26 %	3,35
Dollar US	2,19 %	5,81
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]		
Livre sterling	3,82 %	16,24
Dollar canadien	2,78 %	14,31
Euro	2,45 %	15,52
Roupie indonésienne	7,36 %	17,14
Yen japonais	0,48 %	27,91
Peso mexicain	8,09 %	20,72
Rouble russe	13,67 %	7,24
Rand sud-africain	9,74 %	19,01
Won sud-coréen	1,92 %	4,28
Dollar US	2,16 %	11,92

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(c) Risque de taux d'intérêt – (suite)

Au 28 février 2022 – (suite)

Devise	Moyenne pondérée des rendements	Moyenne pondérée des années jusqu'à échéance
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]		
Livre sterling	3,32 %	6,26
Euro	1,65 %	7,05
Peso mexicain	8,09 %	20,72
Rouble russe	13,67 %	7,24
Dollar US	4,18 %	14,38
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^]		
Livre sterling	5,27 %	6,23
Euro	4,52 %	4,68
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]		
Dollar australien	2,60 %	26,34
Réal brésilien	10,78 %	8,00
Renminbi chinois	3,43 %	23,24
Livre égyptienne	5,03 %	0,75
Euro	3,61 %	6,47
Roupie indienne	7,24 %	4,44
Roupie indonésienne	7,18 %	10,15
Peso mexicain	8,10 %	21,72
Rouble russe	13,20 %	8,04
Dollar US	4,68 %	17,52
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		
Réal brésilien	10,50 %	5,09
Livre sterling	5,69 %	4,78
Dollar canadien	5,33 %	4,21
Euro	3,18 %	37,61
Roupie indonésienne	6,99 %	5,01
Peso mexicain	8,20 %	7,26
Rouble russe	13,18 %	5,89
Dollar US	5,29 %	7,98
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]		
Dollar US	4,28 %	13,01
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]		
Dollar US	3,38 %	22,95
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]		
Livre sterling	3,29 %	10,42
Euro	0,47 %	9,58
Dollar US	3,19 %	16,22
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]		
Livre sterling	3,69 %	6,27
Peso mexicain	8,19 %	16,73
Rouble russe	13,67 %	7,24
Dollar US	3,60 %	12,79
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund[^]		
Réal brésilien	10,67 %	6,81
Roupie indonésienne	6,51 %	7,80
Peso mexicain	8,09 %	20,72
Rouble russe	13,67 %	7,24
Dollar US	3,05 %	15,96
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]		
Livre sterling	2,92 %	6,54
Euro	1,40 %	6,92
Dollar US	3,86 %	14,47
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		
Dollar australien	5,29 %	0,74
Réal brésilien	10,21 %	3,86
Livre sterling	0,28 %	9,42
Peso colombien	7,05 %	6,17
Euro	0,00 %	9,75
Ringgit malais	3,61 %	2,53
Peso mexicain	7,68 %	13,86
Dollar néo-zélandais	4,69 %	8,21
Couronne norvégienne	1,98 %	1,23
Zloty polonais	4,00 %	1,65
Rouble russe	8,89 %	4,38
Rand sud-africain	9,35 %	18,74
Won sud-coréen	2,72 %	22,80
Dollar US	2,06 %	27,93

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(c) Risque de taux d'intérêt – (suite)

Au 28 février 2022 – (suite)

Devise	Moyenne pondérée des rendements	Moyenne pondérée des années jusqu'à échéance
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]		
Réal brésilien	10,84 %	8,59
Livre sterling	0,80 %	28,67
Renminbi chinois	3,55 %	28,56
Peso colombien	8,38 %	17,91
Roupie indonésienne	7,53 %	11,09
Peso mexicain	8,17 %	21,87
Rand sud-africain	10,47 %	26,02
Won sud-coréen	1,65 %	8,79
Dollar US	4,71 %	26,32
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]		
Réal brésilien	10,47 %	4,84
Euro	3,69 %	5,88
Dollar US	5,91 %	6,13
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Dollar australien	5,34 %	0,69
Réal brésilien	10,70 %	7,19
Livre sterling	0,28 %	9,42
Renminbi chinois	3,55 %	28,56
Peso colombien	6,96 %	5,19
Euro	0,00 %	9,75
Ringgit malais	3,72 %	2,01
Peso mexicain	8,16 %	16,51
Dollar néo-zélandais	4,70 %	8,15
Couronne norvégienne	1,98 %	1,23
Zloty polonais	4,00 %	1,65
Rouble russe	14,56 %	8,12
Rand sud-africain	10,11 %	22,58
Won sud-coréen	2,14 %	14,55
Dollar US	3,79 %	27,61
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Réal brésilien	10,23 %	4,79
Euro	0,48 %	7,18
Peso mexicain	7,55 %	21,80
Rouble russe	6,80 %	3,90
Franc suisse	0,50 %	0,41
Dollar US	4,21 %	5,43
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]		
Renminbi chinois	3,55 %	28,56
Dollar US	4,89 %	8,77
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]		
Réal brésilien	10,47 %	4,84
Euro	4,20 %	5,24
Dollar US	5,95 %	6,38
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]		
Réal brésilien	10,77 %	7,71
Peso colombien	7,05 %	6,17
Couronne tchèque	1,98 %	10,32
Ringgit malais	3,76 %	2,14
Peso mexicain	8,13 %	18,91
Zloty polonais	2,14 %	10,16
Rouble russe	14,56 %	8,12
Rand sud-africain	10,33 %	24,67
Won sud-coréen	2,14 %	14,53
Dollar US	6,22 %	24,91

Réforme des taux d'intérêt de référence

Les principaux taux de référence font l'objet actuellement d'une réforme fondamentale à l'échelle mondiale, celle-ci prévoyant notamment le remplacement de certains taux interbancaires offerts (IBOR) par d'autres taux presque sans risque (la « réforme des taux IBOR »). Les compartiments sont exposés aux taux IBOR par le biais de leurs instruments financiers, ceux-ci devant être remplacés ou réformés dans le cadre de ces initiatives à l'échelle du marché. Certaines juridictions sont en train de réformer ou de remiser leurs taux d'intérêt de référence, notamment, parmi les plus connus, les taux IBOR de Londres (« LIBOR »), pour toute une série de devises. La plupart de ces réformes ou retraits progressifs ont pris effet à la fin de l'année civile 2021, certains taux LIBOR de référence en dollar américain étant appelés à rester en vigueur jusqu'en juin 2023. Ces changements de taux peuvent avoir une incidence sur les transactions et dispositions contractuelles existantes. Les instances de gestion ont pris des mesures visant à s'adapter à cette réforme et à atténuer l'incidence du changement de ces taux de base, et continuent à la fois de gérer les efforts de transition et d'évaluer l'impact des changements potentiels sur les transactions et dispositions contractuelles existantes.

(d) Autres risques de cours – juste valeur de l'actif et du passif financiers

Outre le comité, Franklin Templeton a constitué un comité d'évaluation pour superviser la mise en œuvre des politiques d'évaluation et les procédures adoptées par le conseil d'administration (le « conseil » ou le « conseil d'administration »). Le Comité d'évaluation se compose d'un minimum de quatre membres et de dix membres au plus, dont le président. Les représentants des services Juridique et Conformité de Franklin Templeton assisteront le Comité d'évaluation à titre consultatif. Le Comité d'évaluation se réunit une fois par mois pour passer en revue tous les titres dont les prix sont établis manuellement, par un courtier, à l'aide de matrices, à la juste valeur, à la valeur non liquide ou tardive. Une réunion du Comité d'évaluation peut toutefois être convoquée à tout moment pour étudier toute question ou problème concernant ses procédures. Les réunions du Comité d'évaluation peuvent avoir lieu en personne, par courrier électronique ou sous une autre forme écrite.

Certains fonds ont conclu des contrats dérivés au cours de l'année. La valeur des produits dérivés est basée sur certaines actions ou obligations sous-jacentes, des taux d'intérêt, des devises ou des indices et comprend les contrats à terme, les options, les options sur les contrats à terme, les contrats différentiels et les accords de swap. Les produits dérivés peuvent être difficiles à vendre à un prix ou à un moment avantageux et sont sensibles aux variations du titre, du taux d'intérêt, de la devise ou de l'indice sous-jacent. Par conséquent, les produits dérivés peuvent être très volatils et entraîner une perte pour le fonds. Se référer au portefeuille d'investissements des fonds respectifs pour le détail des positions ouvertes sur les produits dérivés à la fin de l'exercice.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(d) Autres risques de cours – juste valeur de l'actif et du passif financiers – (suite)

Estimation de la juste valeur

Conformément à la norme FRS 102, la Société a choisi d'appliquer les dispositions comptabilisation et d'évaluation de la norme comptable internationale (International Accounting Standards, «IAS») 39, «Instruments financiers: comptabilisation et évaluation» («IAS 39»), telle qu'adoptée en vue de son utilisation dans l'Union européenne et aux exigences d'informations à fournir, prévues aux sections 11 et 12 de la Norme FRS 102.

La valeur de marché des instruments financiers négociés sur les marchés actifs (tels que les titres et produits dérivés négociés sur un marché ouvert au public) est basée sur les cours de marché cotés à la date de l'État de la situation financière. Lorsqu'il n'y a pas de « cotation boursière aisément disponible » pour un titre, la Société a recours à des méthodes de « juste valeur » pour évaluer les titres. En règle générale, la juste valeur est le cours que le Compartiment pourrait raisonnablement recevoir dans le cadre d'une vente actuelle. Le processus d'évaluation à la juste valeur requiert que le Comité d'évaluation détermine de bonne foi la valeur d'un titre particulier ou d'un groupe de titres en fonction des faits et circonstances particuliers.

Parmi les circonstances dans lesquelles une cotation boursière n'est pas aisément disponible, on peut citer des suspensions de cotation avant la clôture du marché concerné, des événements qui provoquent la fermeture inattendue de marchés dans leur totalité, comme des catastrophes naturelles, des pannes d'électricité ou autres événements importants de cet ordre, les jours fériés ou le volume inhabituel de transactions sur un titre.

Lorsqu'il procède à la détermination de la juste valeur d'un titre du Portefeuille, le Comité d'évaluation peut avoir recours à toutes les méthodes qui lui semblent appropriées, notamment, mais sans limitation, à l'une ou l'autre des méthodes d'évaluation suivantes :

- (i) un multiple des résultats ;
- (ii) une décote par rapport au cours de marché d'un titre similaire librement négociable ;
- (iii) une analyse de la valeur actualisée des flux de trésorerie ;
- (iv) la valeur comptable ou un multiple de celle-ci ;
- (v) une analyse prime de risque/rendement ;
- (vi) le taux de rendement actuariel ;
- (vii) une analyse des fondamentaux des investissements.

Le Comité d'évaluation examine le bien-fondé et l'exactitude des méthodes utilisées pour déterminer la juste valeur des titres sur une base mensuelle en procédant notamment à une comparaison des justes valeurs entre le dernier cours de marché et le cours de marché suivant disponible, tel que le cours d'ouverture du lendemain.

La Société a classé les évaluations de la juste valeur en fonction d'une hiérarchie de la juste valeur qui souligne l'importance des paramètres utilisés lors de ces évaluations. La hiérarchie de la juste valeur comprend les niveaux suivants :

Les paramètres de niveau 1 sont des cours non ajustés sur un marché actif pour des actifs et passifs identiques auxquels l'entité a accès à la date d'évaluation.

Les paramètres de niveau 2 sont des paramètres autres que les cours des marchés actifs du niveau 1 (tirés de données de marché) et pouvant être observés directement ou indirectement au regard de l'actif ou du passif.

Les paramètres de niveau 3 sont des paramètres non observables (c'est-à-dire pour lesquels des données de marché ne sont pas disponibles) au regard de l'actif ou du passif.

Un investissement est toujours classé dans sa totalité en tant qu'investissement de niveau 1, 2 ou 3. Dans certains cas, l'évaluation de la juste valeur d'un investissement peut utiliser un certain nombre de paramètres divers appartenant à différents niveaux de la hiérarchie de la juste valeur. Dans de tels cas, le niveau d'un investissement au sein de la hiérarchie de la juste valeur est basé sur le paramètre du niveau le plus bas pertinent au regard de l'évaluation de la juste valeur. L'évaluation de l'importance d'un paramètre particulier pour les besoins de l'évaluation de la juste valeur exige un certain jugement et est propre à chaque investissement.

Les paramètres ou la méthode utilisés pour évaluer les titres ne sont pas nécessairement une indication des risques associés à tout investissement dans ces titres.

Le tableau suivant analyse, conformément à la hiérarchie de la juste valeur, les actifs et les passifs financiers des compartiments évalués à la juste valeur au 28 février 2023 :

	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Western Asset US Core Bond Fund au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund au 28 février 2023 (en milliers)
Niveau 1					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	€ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	414
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	367	3 030	480	74
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	(250)	(4 240)	(1 069)	(29)
	–	117	(1 210)	(589)	459
Niveau 2					
Obligations et bons	\$ 599 348	\$ 138 314	\$ 1 182 487	€ 125 184	\$ 198 461
Instruments du marché monétaire	244 848	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	1 741	–	654	4 016
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	2 534	8 816	72	775
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	(46)	(4 445)	(338)	(4 011)
	844 196	142 543	1 186 858	125 572	199 241
Niveau 3					
Obligations et bons	\$ –	\$ 111	\$ 642	€ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	–	111	642	–	–
Total des investissements	\$ 844 196	\$ 142 771	\$ 1 186 290	€ 124 983	\$ 199 700

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(d) Autres risques de cours – juste valeur de l'actif et du passif financiers – (suite)

	FTGF Western Asset US High Yield Fund au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)
Niveau 1					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	1	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	38	–	4 839	343
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	(31)	–	(373)	(61)	(1 047)
	(31)	39	(373)	4 778	(704)
Niveau 2					
Obligations et bons	\$ 121 003	\$ 52 582	\$ 429 611	\$ 515 122	\$ 135 809
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	1 661	133	3 862	17 040	11 217
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	103	60	162	3 920	1 025
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	(151)	(271)	(1 130)	(3 219)	(2 097)
	122 616	52 504	432 505	532 863	145 954
Niveau 3					
Obligations et bons	\$ 101	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	642	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	743	–	–	–	–
Total des investissements	\$ 123 328	\$ 52 543	\$ 432 132	\$ 537 641	\$ 145 250

	FTGF Western Asset Global Credit Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund Securities Fund [^] au au 28 février 2023 (en milliers)
Niveau 1					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	202	26 445	277	317	353
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	(34)	(86 734)	(926)	(73)	(731)
	168	(60 289)	(649)	244	(378)
Niveau 2					
Obligations et bons	\$ 43 206	\$ 1 888 885	\$ 263 595	\$ 521 432	\$ 1 147 183
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	559	18 550	507	17 212	1 154
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	343	177 483	1 911	8	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	(166)	(93 430)	(3 726)	(1 683)	–
	43 942	1 991 488	262 287	536 969	1 148 337
Niveau 3					
Obligations et bons	\$ –	\$ 7 808	\$ 1 339	\$ 18 407	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	2 424	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	–	7 808	3 763	18 407	–
Total des investissements	\$ 44 110	\$ 1 939 007	\$ 265 401	\$ 555 620	\$ 1 147 959

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(d) Autres risques de cours – juste valeur de l'actif et du passif financiers – (suite)

	FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)	Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund au 28 février 2023 (en milliers)
Niveau 1					
Obligations et bons	£ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	253	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	45	4	175	59	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	(29)	(103)	(158)	(5)	–
	16	154	17	54	–
Niveau 2					
Obligations et bons	£ 43 921	\$ 93 939	\$ 15 938	\$ 8 541	\$ 160 235
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	1 342	30	4 095
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	27	35	910	92	3 132
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	(7)	(478)	(60)	(107)	(3 966)
	43 941	93 496	18 130	8 556	163 496
Niveau 3					
Obligations et bons	£ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Total des investissements	£ 43 957	\$ 93 650	\$ 18 147	\$ 8 610	\$ 163 496

	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)
Niveau 1					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	22
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	2 190	2	–	–	69
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	(3 704)	(175)
	2 190	2	–	(3 704)	(84)
Niveau 2					
Obligations et bons	\$ 508 142	\$ 9 964	\$ 200 639	\$ 1 068 451	\$ 43 555
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	30 565	396	4 087	85 354	2 216
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	13 024	10	1 448	4 819	403
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	(23 627)	(202)	(4 239)	(13 267)	(416)
	528 104	10 168	201 935	1 145 357	45 758
Niveau 3					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Total des investissements	\$ 530 294	\$ 10 170	\$ 201 935	\$ 1 141 653	\$ 45 674

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(d) Autres risques de cours – juste valeur de l'actif et du passif financiers – (suite)

	FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^] as at 28 February 2023 (en milliers)	FTGF Brandywine Global Multi- Sector Impact Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF ClearBridge Value Fund au 28 février 2023 (en milliers)
Niveau 1					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	2 542	921 986
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	(283)	(123)	–	–
	–	(283)	(123)	2 542	921 986
Niveau 2					
Obligations et bons	\$ 8 077	\$ 65 808	\$ 13 130	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	411	3 886	–	41	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	249	119	–	10
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	(192)	(3 482)	(64)	(20)	(976)
	8 296	66 461	13 185	21	(966)
Niveau 3					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Total des investissements	\$ 8 296	\$ 66 178	\$ 13 062	\$ 2 563	\$ 921 020

	FTGF ClearBridge US Appreciation Fund au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)
Niveau 1					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	180 681	1 172 787	214 039	36 033	1 629 033
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	180 681	1 172 787	214 039	36 033	1 629 033
Niveau 2					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 557	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	286	4	1	22
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	(1 551)	(229)	(56)	(840)
	–	(1 265)	(225)	502	(818)
Niveau 3					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Total des investissements	\$ 180 681	\$ 1 171 522	\$ 213 814	\$ 36 535	\$ 1 628 215

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(d) Autres risques de cours – juste valeur de l'actif et du passif financiers – (suite)

	FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] comme au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Royce US Smaller Companies Fund au 28 février 2023 (en milliers)
Niveau 1					
Obligations et bons	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	12 820	1 032 510	399 290	711 568	77 554
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	12 820	1 032 510	399 290	711 568	77 554
Niveau 2					
Obligations et bons	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	3	–	–	32 545	1 100
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	1 921	24	150	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	(1 058)	(2 229)	(1 623)	(2)
	3	863	(2 205)	31 072	1 098
Niveau 3					
Obligations et bons	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Total des investissements	\$ 12 823	€ 1 033 373	\$ 397 085	\$ 742 640	\$ 78 652

	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)	Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund au 28 février 2023 (en milliers)	Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)	Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)
Niveau 1					
Obligations et bons	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	4 093	–	20 882	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	4 093	–	20 882	–	–
Niveau 2					
Obligations et bons	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	180	–	1	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	(90)	–	–
	180	–	(89)	–	–
Niveau 3					
Obligations et bons	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Total des investissements	\$ 4 273	€ –	\$ 20 793	\$ –	\$ –

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(d) Autres risques de cours – juste valeur de l'actif et du passif financiers – (suite)

	FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Martin Currie Global Emerging Emerging Markets Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)
Niveau 1					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	3 598	142 529	24 928	34 547	188 780
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	3 598	142 529	24 928	34 547	188 780
Niveau 2					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	35	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	41	1	–	22
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	(1 422)	(19)	–	(20)
	–	(1 381)	17	–	2
Niveau 3					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Total des investissements	\$ 3 598	\$ 141 148	\$ 24 945	\$ 34 547	€ 188 782

	Franklin Responsible Income 2028 Fund [^] au 28 février 2023 (en milliers)
Niveau 1	
Obligations et bons	€ –
Instruments du marché monétaire	–
Instruments de capitaux propres	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–
	–
Niveau 2	
Obligations et bons	€ 34 759
Instruments du marché monétaire	–
Instruments de capitaux propres	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–
	34 759
Niveau 3	
Obligations et bons	€ –
Instruments du marché monétaire	–
Instruments de capitaux propres	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–
	–
Total des investissements	€ 34 759

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(d) Autres risques de cours – juste valeur de l'actif et du passif financiers – (suite)

Le tableau suivant analyse, conformément à la hiérarchie de la juste valeur, les actifs et les passifs financiers des compartiments évalués à la juste valeur au 28 février 2022 :

	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Western Asset US Core Bond Fund au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund au 28 février 2022 (en milliers)	Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund^ as at 28 February 2022 (en milliers)
Niveau 1					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	€ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	151
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	784	6 335	567	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	(1 751)	(10 440)	(590)	–
	–	(967)	(4 105)	(23)	151
Niveau 2					
Obligations et bons	\$ 669 444	\$ 229 242	\$ 1 443 084	€ 145 806	\$ 49 581
Instruments du marché monétaire	270 000	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	5 470	34 088	808	65
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	2 494	15 164	131	1
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	(471)	(11 070)	(1 315)	(29)
	939 444	236 735	1 481 266	145 430	49 618
Niveau 3					
Obligations et bons	\$ –	\$ 154	\$ 880	€ –	\$ 921
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	–	154	880	–	921
Total des investissements	\$ 939 444	\$ 235 922	\$ 1 478 041	€ 145 407	\$ 50 690

	FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Western Asset US High Yield Fund au 28 février 2022 (en milliers)	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund^ au 28 février 2022 (en milliers)	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund^ au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund au 28 février 2022 (en milliers)
Niveau 1					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	438	2 853	–	–	1
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	104	47	–	1	51
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	(1 281)	(72)	(89)	(27)	–
	(739)	2 828	(89)	(26)	52
Niveau 2					
Obligations et bons	\$ 254 048	\$ 250 188	\$ 33 229	\$ 27 090	\$ 69 150
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	28 957	1 490	4 048	–	6 632
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	4 595	112	164	9	193
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	(2 922)	(60)	(188)	(39)	(139)
	284 678	251 730	37 253	27 060	75 836
Niveau 3					
Obligations et bons	\$ 2	\$ 683	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	662	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	2	1 345	–	–	–
Total des investissements	\$ 283 941	\$ 255 903	\$ 37 164	\$ 27 034	\$ 75 888

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(d) Autres risques de cours – juste valeur de l'actif et du passif financiers – (suite)

	Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^] au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^] au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Western Asset Global Credit Fund [^] au 28 février 2022 (en milliers)
Niveau 1					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	315	–	2 194	837	437
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	(236)	(1 113)	(181)	(1 170)	(44)
	79	(1 113)	2 013	(333)	393
Niveau 2					
Obligations et bons	\$ 54 893	\$ 480 459	\$ 438 717	\$ 179 636	\$ 73 736
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	3 010	12 311	6 636	20 460	718
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	379	8 133	4 176	1 939	827
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	(586)	(594)	(4 645)	(3 423)	(509)
	57 696	500 309	444 884	198 612	74 772
Niveau 3					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	–	–	–	1	–
Total des investissements	\$ 57 775	\$ 499 196	\$ 446 897	\$ 198 280	\$ 75 165

	Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^] au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] comme au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^] au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Western Fonds de titres hypothécaires américains Securities Fund [^] au 28 février 2022 (en milliers)
Niveau 1					
Obligations et bons	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	397	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	216 746	1 065	502	1 640
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	(303 469)	(2 253)	(2 083)	(666)
	–	(86 723)	(791)	(1 581)	974
Niveau 2					
Obligations et bons	€ 32 768	\$ 3 650 302	\$ 341 497	\$ 989 198	\$ 1 264 416
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	2	165 431	11 276	36 257	18 650
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	8	364 851	5 643	4 045	1 296
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	(66)	(400 163)	(7 975)	(5 374)	(14)
	32 712	3 780 421	350 441	1 024 126	1 284 348
Niveau 3					
Obligations et bons	€ –	\$ 10 679	\$ 2 684	\$ 29 159	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	2 349	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	–	10 679	5 033	29 159	–
Total des investissements	€ 32 712	\$ 3 704 377	\$ 354 683	\$ 1 051 704	\$ 1 285 322

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(d) Autres risques de cours – juste valeur de l'actif et du passif financiers – (suite)

	FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^] au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^] au 28 février 2022 (en milliers)	Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^] au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^] comme au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Brandywine Global Fixed Income Fonds tel que au 28 février 2022 (en milliers)
Niveau 1					
Obligations et bons	£ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	59	202	196	21	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	(10)	(158)	(614)	–	–
	49	44	(418)	21	–
Niveau 2					
Obligations et bons	£ 70 140	\$ 162 165	\$ 19 848	\$ 9 371	\$ 210 973
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	11 779	1 216	64	4 135
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	8	143	573	270	4 267
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	(35)	(1 739)	(257)	(26)	(4 493)
	70 113	172 348	21 380	9 679	214 882
Niveau 3					
Obligations et bons	£ –	\$ 78	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	–	78	–	–	–
Total des investissements	£ 70 162	\$ 172 470	\$ 20 962	\$ 9 700	\$ 214 882

	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fonds [^] au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^] au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^] comme au 28 février 2022 (en milliers)
Niveau 1					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	33
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	1 272	–	–	–	86
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	(4 865)	–	–	(1 309)	(81)
	(3 593)	–	–	(1 309)	38
Niveau 2					
Obligations et bons	\$ 728 006	\$ 10 878	\$ 239 295	\$ 1 481 384	\$ 49 895
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	752	538	3 333	40 689	1 925
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	21 946	147	2 854	31 828	233
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	(22 185)	(32)	(4 074)	(17 153)	(145)
	728 519	11 531	241 408	1 536 748	51 908
Niveau 3					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Total des investissements	\$ 724 926	\$ 11 531	\$ 241 408	\$ 1 535 439	\$ 51 946

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(d) Autres risques de cours – juste valeur de l'actif et du passif financiers – (suite)

	FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^ au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF ClearBridge Value Fund au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF ClearBridge US Appreciation Fund au 28 février 2022 (en milliers)
Niveau 1					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	2 157	878 948	207 470
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	1 151	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	(1 426)	–	–	–
	–	(275)	2 157	878 948	207 470
Niveau 2					
Obligations et bons	\$ 9 283	\$ 96 648	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	882	4 248	79	2 840	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	80	3 520	1	14	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	(208)	(4 556)	(29)	(641)	–
	10 037	99 860	51	2 213	–
Niveau 3					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Total des investissements	\$ 10 037	\$ 99 585	\$ 2 208	\$ 881 161	\$ 207 470

	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^ au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF ClearBridge Global Growth Fund^ au 28 février 2022 (en milliers)
Niveau 1					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	1 756 332	536 471	41 374	1 618 990	14 292
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	1 756 332	536 471	41 374	1 618 990	14 292
Niveau 2					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ 836	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	4 603	113	20	145	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	(1 709)	(123)	(38)	(2 099)	–
	2 894	(10)	818	(1 954)	–
Niveau 3					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Total des investissements	\$ 1 759 226	\$ 536 461	\$ 42 192	\$ 1 617 036	\$ 14 292

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(d) Autres risques de cours – juste valeur de l'actif et du passif financiers – (suite)

	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ comme au 28 février 2022 (en milliers)	Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund Markets Infrastructure Fund^ au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund as at 28 February 2022 (en milliers)	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Royce US Smaller Companies Fund au 28 février 2022 (en milliers)
Niveau 1					
Obligations et bons	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	648 298	2 667	164 133	891 617	86 980
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	648 298	2 667	164 133	891 617	86 980
Niveau 2					
Obligations et bons	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	41 913	1 480
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	3 195	–	82	1 468	1
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	(438)	(30)	(332)	(1 791)	(5)
	2 757	(30)	(250)	41 590	1 476
Niveau 3					
Obligations et bons	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Total des investissements	€ 651 055	\$ 2 637	\$ 163 883	\$ 933 207	\$ 88 456

	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^ au 28 février 2022 (en milliers)	Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^ au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund as at 28 février 2022 (en milliers)	Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^ 28 Février 2022 (en milliers)	Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^ au 28 février 2022 (en milliers)
Niveau 1					
Obligations et bons	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	4 410	27 800	25 897	–	12 372
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	4 410	27 800	25 897	–	12 372
Niveau 2					
Obligations et bons	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	140	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	162	34	–	7
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	(23)	(139)	–	(1)
	140	139	(105)	–	6
Niveau 3					
Obligations et bons	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	34	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	–	34	–	–	–
Total des investissements	\$ 4 550	€ 27 973	\$ 25 792	\$ –	\$ 12 378

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.1 Risque de marché – (suite)

(d) Autres risques de cours – juste valeur de l'actif et du passif financiers – (suite)

	FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^] au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^] au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Martin Currie Global Emerging Emerging Markets Fund [^] au 28 février 2022 (en milliers)	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^] au 28 février 2022 (en milliers)
Niveau 1					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	15 463	170 458	27 613	47 571	302 551
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	15 463	170 458	27 613	47 571	302 551
Niveau 2					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	–	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	197	11	–	281
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	(2 114)	(10)	–	(69)
	–	(1 917)	1	–	212
Niveau 3					
Obligations et bons	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Instruments du marché monétaire	–	–	–	–	–
Instruments de capitaux propres	–	–	–	68	–
Actifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
Passifs dérivés détenus à des fins de transaction	–	–	–	–	–
	–	–	–	68	–
Total des investissements	\$ 15 463	\$ 168 541	\$ 27 614	\$ 47 639	€ 302 763

Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 \$/0 €/0 £ soit inférieurs à 1 000 \$/1 000 €/1 000 £.

Les titres qui sont évalués à la juste valeur par le gestionnaire ou le gestionnaire d'investissement respectif au 28 février 2023 sont notés dans le portefeuille d'investissements. Dans le cas où un prix n'est pas disponible auprès d'un service de tarification, le comité d'évaluation peut obtenir un ou plusieurs prix indicatifs auprès de courtiers agréés.

La tarification matricielle est utilisée pour les fonds lorsque le comité d'évaluation n'est pas en mesure d'obtenir une ou plusieurs cotations de courtiers pour un titre pour lequel il n'existe pas de prix disponible auprès d'un service de tarification. La tarification matricielle estime la valeur de marché actuelle d'un titre libellé en dollars américains en utilisant la cotation la plus récente reçue d'un courtier et en ajustant le prix en fonction de l'évolution du rendement du titre du Trésor américain, dont la durée est la plus proche de celle du titre évalué.

Les tableaux suivants présentent la valeur des titres de chaque fonds dont le prix a été déterminé à l'aide de sources provenant d'un seul courtier et évalué à la juste valeur par le Comité d'évaluation au 28 février 2023 et au 28 février 2022 :

	Prix du courtier unique (en milliers)	Juste Évalué par le comité d'évaluation (en milliers)
Au 28 février 2023		
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	111\$	111\$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	642\$	642\$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	642\$	642\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	7 808\$	7 808\$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	2 424\$	2 626\$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	–	19 190\$
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	–	3\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	–	1\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	–	35\$

	Prix du courtier unique (en milliers)	Juste Évalué par le comité d'évaluation (en milliers)
Au 28 février 2022		
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	154\$	154\$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	880\$	880\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	2\$	2\$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	662\$	662\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	–	7 755\$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	1\$	1\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	10 679\$	10 679\$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	2 349\$	2 551\$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	–	29 940\$
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	–	34€
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	–	68\$

Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 ou inférieurs à 1 000.

Pour plus de détails sur les actifs et passifs dérivés détenus à des fins de transaction qui ont été évalués à leur juste valeur au 28 février 2023, veuillez vous référer au portefeuille d'investissements.

Dans certaines circonstances, la société utilise les prix ajustés d'ICE Data Services ("ICE") pour l'évaluation des actions non américaines. L'ICE calcule et fournit un prix de clôture ajusté à utiliser comme prix de la juste valeur.

Au 28 février 2023, le prix ajusté ICE a été appliqué aux fonds FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF ClearBridge Value Fund, FTGF ClearBridge US Appreciation Fund, FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund, FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund, FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund, FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^], FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund, FTGF Royce US Smaller Companies Fund, FTGF Royce US Smaller Companies Fund, FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^], FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^] et FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] (28 février 2022 : FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^], FTGF ClearBridge Value Fund, FTGF ClearBridge US Appreciation Fund, FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund, FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund, FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund, FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^], FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^], FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund, FTGF Royce US Smaller Companies Fund, FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund, FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^] et FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]).

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.2 Risque de crédit

Le risque de crédit est le risque qu'une contrepartie ou un émetteur d'un instrument financier ne parvienne pas à s'acquitter d'une obligation ou à respecter un engagement envers les fonds. La Société sera exposée à des risques de crédit à l'égard des parties avec lesquelles elle négocie et elle doit également supporter le risque de défaut de règlement. Les gestionnaires de portefeuille et/ou les gestionnaires de portefeuille délégué minimisent les concentrations de risques de crédit en concluant des transactions avec de nombreux courtiers et contreparties sur des marchés reconnus et réputés. Toutes les transactions de titres cotés font l'objet d'un règlement à la livraison en ayant recours à des courtiers agréés. Le risque de défaut est considéré comme minime, dès lors que la livraison des titres vendus est uniquement effectuée à réception du règlement par le courtier. Le paiement est effectué à l'achat dès lors que les titres ont été reçus par le courtier. La négociation est abandonnée dès lors que l'une ou l'autre des parties manque d'acquiescer son obligation.

Chaque Fonds sera exposé au risque de crédit des contreparties avec lesquelles il négocie des options, des contrats à terme et d'autres instruments financiers dérivés qui ne sont pas négociés sur un marché reconnu. Ces instruments ne bénéficient pas des mêmes protections que celles qui peuvent s'appliquer aux participants négociant des swaps, des contrats à terme ou des options sur des marchés organisés, telles que la garantie de bonne fin d'une chambre de compensation. Les Fonds seront soumis à l'éventualité de l'insolvabilité, de la faillite ou de la défaillance d'une contrepartie avec laquelle les Fonds négocient de tels instruments, ce qui pourrait entraîner des pertes substantielles pour les Fonds.

La société est exposée au risque de crédit des contreparties de gré à gré avec lesquelles elle effectue des transactions. Toutes les contreparties de gré à gré doivent répondre aux critères suivants, tels qu'ils sont définis dans les règlements, à savoir :

- (i) Être un établissement de crédit conformément à l'article 7 de la réglementation de la Banque centrale sur les OPCVM, ou une entreprise d'investissement agréée conformément à la directive sur les marchés d'instruments financiers dans un État membre de l'EEE, ou une entité soumise à une réglementation en tant qu'entité supervisée consolidée par la Securities and Exchange Commission (Commission des valeurs mobilières et des changes), ou
- (ii) Avoir une notation de crédit minimale de A2 ou équivalente, ou, de l'avis du Gestionnaire de portefeuille et/ou des Gestionnaires de portefeuille délégués concernés, une notation de crédit implicite minimale de A2 ou équivalente.

Les expositions à des contreparties individuelles sont normalement limitées à 10 % de la valeur liquidative dans le cas des établissements de crédit agréés et à 5 % de la valeur liquidative dans le cas des autres contreparties.

Les transactions portant sur des instruments financiers dérivés sont généralement effectuées avec des contreparties avec lesquelles l'entreprise a signé des accords-cadres de compensation. Les accords-cadres de compensation prévoient le règlement net des contrats d'un Fonds donné avec la même contrepartie en cas de défaillance. Le risque de crédit associé aux actifs financiers dérivés soumis à un accord-cadres de compensation n'est éliminé que dans la mesure où les passifs financiers dus à la même contrepartie seront réglés après la réalisation des actifs.

Les transactions se soldant par d'importants gains latents pour un compartiment peuvent exiger que celui-ci détienne des garanties provenant d'un courtier. Dans ces cas, le risque de crédit du Compartiment est réduit à hauteur de la valeur de la garantie reçue. Si un courtier fait faillite aux États-Unis (bien que la réglementation puisse être différente selon les juridictions), les garanties déposées en relation avec certains instruments financiers dérivés sont exemptes du sursis de plein droit mis en place lors du lancement de la procédure de faillite. Cette exemption des instruments financiers dérivés permettrait à un Fonds de saisir immédiatement les garanties déposées par la partie insolvable afin de rembourser les créances dues par celle-ci.

La valeur des titres reçus dans le cadre de la négociation de dérivés détenus par les Fonds suivants aux 28 février 2023 et 28 février 2022 était la suivante :

Fonds	Courtier	Au 28 février 2023, valeurs de marché des garanties financières (en milliers)	Au 28 février 2022, valeurs de marché des garanties financières (en milliers)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Morgan Stanley	– \$	433\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	JP Morgan	– \$	464\$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Morgan Stanley	– \$	283\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	BNP Paribas	– \$	892\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Goldman Sachs	567\$	– \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Morgan Stanley	– \$	5 363\$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	Morgan Stanley	202\$	– \$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	Credit Suisse	– \$	753\$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	BNP Paribas	– \$	692\$
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	Morgan Stanley	– \$	71\$

Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 ou inférieurs à 1 000.

La Société maîtrise son risque en contrôlant périodiquement la solvabilité et la situation financière des contreparties auxquelles les Compartiments ont recours. Les Compartiments ne sont autorisés à effectuer des transactions qu'avec des contreparties agréées. Une liste de contreparties approuvées est tenue à jour et les Fonds ne peuvent négocier qu'avec ces contreparties approuvées. Les ajouts à la liste sont révisés une fois par trimestre et une réévaluation rigoureuse de toutes les contreparties est conduite une fois par an. La révision consiste à analyser l'adéquation du capital, la rentabilité et la disposition de liquidités de la contrepartie ainsi que d'autres facteurs, le cas échéant.

À des fins de gestion efficace de portefeuille, chaque Compartiment peut conclure des Contrats de mise en pension, des contrats de prise en pension et des contrats de prêts de titres, sous réserve des conditions et limites stipulées à la Réglementation sur les OPCVM de la Banque centrale.

Jusqu'à l'expiration des contrats de rachat, des contrats de prise en pension et des transactions de prêts de titres, les garanties obtenues en vertu de tels contrats ou opérations :

- (i) doivent être évaluées quotidiennement au prix de marché ;
- (ii) doivent être d'une valeur supérieure ou égale en toutes circonstances à la valeur du montant investi ou des titres empruntés ;
- (iii) doivent être transférées à l'administrateur ou à son agent ;
- (iv) doivent être immédiatement disponibles dans le cadre de l'opération concernée, sans qu'il soit nécessaire d'avoir recours à la contrepartie en cas de défaillance de la part de cette entité.

Toute garantie reçue par la société, qui n'est pas en liquide, ne peut être vendue ou faire l'objet d'un nouveau nantissement ; doit être détenue au risque de crédit de la contrepartie ; et doit être émise par une entité indépendante de la contrepartie. Le risque de crédit est contrôlé à l'aide d'un emploi diversifié des contreparties et des émetteurs, et d'une sélection faite en termes de notations minimums eu égard aux titres ou de notations moyennes eu égard aux portefeuilles. Le gestionnaire d'investissement et/ou les gestionnaires d'investissement adjoints respectifs peuvent imposer des limites au portefeuille et peuvent effectuer des investissements en fonction de paramètres internes avec des limites établies d'un commun accord avec le client et fixées au moment de la création de chaque portefeuille, y compris des limites en termes de types de valeur et de types d'émetteurs, de minimums de crédit et de qualité de crédit moyenne des valeurs sélectionnées. Chaque compte est ensuite contrôlé à intervalles réguliers afin de s'assurer qu'il continue à satisfaire de tels critères. Une analyse indépendante rigoureuse de tous les titres de crédit avant acquisition, comprenant une modélisation financière ainsi qu'une analyse des différents scénarios et un contrôle des changements de profils de risque, peut également être réalisée. Généralement, la part maximale du portefeuille investie dans un seul et même émetteur privé ne dépasse pas 5 % de sa valeur à la date d'acquisition.

Le Comité de valorisation se réunit au moins une fois par mois et dès lors que les circonstances l'exigent, afin de réviser et de débattre des préoccupations relatives aux valorisations, lesquelles incluent le risque de crédit. Le Gestionnaire d'investissement et / ou les sous-gestionnaires d'investissement respectifs préparent une analyse des risques pour le compte du Conseil et du Comité une fois tous les six mois.

La quasi-totalité des liquidités et titres détenus par les Compartiments sont détenus par l'intermédiaire du Dépositaire qui a une notation de crédit de AA- (28 février 2022 : AA-). La faillite ou l'insolvabilité du Dépositaire peut retarder ou limiter l'exercice des droits dont jouissent les Compartiments sur les liquidités détenues par le Dépositaire. La note de crédit attribuée au Dépositaire par des agences de notation reconnues est élevée. Si la qualité de crédit ou la situation financière du Dépositaire venait à se détériorer de manière significative, le Gestionnaire d'investissement et / ou les sous-gestionnaires d'investissement respectifs pourraient transférer les liquidités détenues dans une autre banque.

Le détail de tous les titres donnés en garantie est présenté dans les Portefeuilles des Investissements. La trésorerie et les équivalents de trésorerie détenus auprès du Dépositaire et les comptes sur marge et les liquidités soumises à restrictions sont présentés dans l'État de la situation financière.

Si un Compartiment a fourni une garantie à une contrepartie, il se peut que ce Compartiment soit autorisé à rappeler cette garantie conformément aux accords commerciaux conclus avec la contrepartie, si celle-ci devient insolvable. Dans la pratique, cependant, le Compartiment cherchera probablement à réduire tout montant dû à la contrepartie afin de régler toute transaction ouverte en remboursant les montants dus et adossés par la garantie remise. Si le Fonds n'a pas récupéré la totalité de la valeur de la garantie remise après le règlement des montants dus (par ex. dans le cas où la valeur de la garantie remise aurait dépassé les montants dus), il ne pourrait bénéficier que d'une réclamation non garantie contre la contrepartie mise en faillite pour le montant de la garantie en dépassement.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.2 Risque de crédit – (suite)

Le tableau suivant présente la valeur de marché des titres qui ont été déposés comme garanties auprès de courtiers aux 28 février 2023 et 28 février 2022 dans le cadre de la négociation de dérivés :

Fonds	Courtier	Au 28 février 2023, valeurs de marché des garanties financières (en milliers)	Au 28 février 2022, valeurs de marché des garanties financières (en milliers)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Citi	– \$	280\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Morgan Stanley	– \$	89\$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Citi	152\$	– \$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	JP Morgan	– \$	314\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Bank of America Merrill Lynch	1 590\$	– \$

Les montants désignés par « – » sont égaux à 0 ou inférieurs à 1 000.

Afin d'atténuer le risque de crédit de la contrepartie, certains produits dérivés de gré à gré sont compensés via des chambres de compensation centrales. En vertu de cet accord, les opérations conclues avec des contreparties sont transférées à des chambres de compensation qui, après acceptation, remplacent la contrepartie au titre des risques de l'opération.

Le tableau ci-dessous présente un résumé de l'exposition au risque de crédit sur la base des notations financières des titres de créance détenus par les Fonds à revenu fixe :

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		
Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22
AAA	100,00 %	72,81 %	AAA	54,62 %	47,10 %	AAA	44,86 %	45,02 %	AAA	20,84 %	24,57 %
Sans notation	–	27,19 %	AA	10,57 %	11,07 %	AA	5,62 %	5,26 %	AA	26,73 %	22,15 %
			A	16,58 %	18,44 %	A	15,52 %	15,20 %	A	23,27 %	24,74 %
			BBB	17,85 %	19,94 %	BBB	21,97 %	19,35 %	BBB	24,69 %	24,89 %
			BB	0,38 %	0,67 %	BB	8,18 %	8,44 %	BB	3,57 %	2,67 %
			CCC et inférieure	–	–	B	1,51 %	2,85 %	B	0,90 %	0,98 %
			Sans notation	–	2,78 %	CCC et inférieure	2,34 %	1,78 %			
						Sans notation	–	2,10 %			
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^]			FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund			FTGF Western Asset US High Yield Fund			Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^]		
Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22
BBB	–	10,05 %	AAA	12,54 %	3,71 %	A	0,24 %	–	AAA	–	2,74 %
BB	–	41,49 %	AA	1,27 %	1,22 %	BBB	5,14 %	10,04 %	AA	–	1,62 %
B	–	39,45 %	A	7,23 %	6,53 %	BB	30,19 %	38,40 %	A	–	9,02 %
CCC et inférieure	–	5,24 %	BBB	35,87 %	38,17 %	B	47,96 %	40,14 %	BBB	–	44,63 %
Sans notation	–	3,77 %	BB	27,14 %	31,77 %	CCC et inférieure	16,47 %	8,62 %	BB	–	30,15 %
			B	13,35 %	16,07 %	Sans notation	–	2,80 %	B	–	11,61 %
			CCC et inférieure	2,40 %	2,51 %				CCC et inférieure	–	0,23 %
			Sans notation	0,20 %	0,02 %						
	0,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		0,00 %	100,00 %

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]			FTGF Western Asset Global High Yield Fund			Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]			FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22
AA	–	3,97 %	AA	4,85 %	–	AAA	–	65,48 %	AAA	11,27 %	3,21 %
A	–	3,64 %	BBB	3,26 %	16,12 %	AA	–	10,87 %	AA	20,43 %	16,36 %
BBB	–	48,05 %	BB	33,42 %	47,45 %	A	–	10,52 %	A	29,69 %	32,21 %
BB	–	32,90 %	B	44,10 %	29,73 %	BBB	–	11,66 %	BBB	26,60 %	31,43 %
B	–	11,00 %	CCC et inférieure	14,22 %	5,95 %	BB	–	1,47 %	BB	0,66 %	–
CCC et inférieure	–	0,44 %	Sans notation	0,15 %	0,75 %				B	–	–
									Sans notation	11,35 %	16,79 %
	0,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		0,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund			FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]			FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]			Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]		
Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22
AAA	18,93 %	18,78 %	AAA	32,86 %	37,05 %	AAA	11,77 %	2,96 %	AA	–	0,32 %
AA	27,37 %	25,34 %	AA	15,13 %	9,75 %	AA	2,67 %	2,90 %	BBB	–	4,67 %
A	53,43 %	55,38 %	A	27,67 %	27,60 %	A	21,00 %	28,97 %	BB	–	44,13 %
BBB	0,27 %	0,50 %	BBB	17,24 %	20,71 %	BBB	57,17 %	53,75 %	B	–	46,14 %
			BB	6,19 %	4,16 %	BB	7,39 %	10,00 %	CCC et inférieure	–	4,74 %
			B	0,91 %	0,73 %	B	–	0,25 %			
						Non évalué	–	1,17 %			
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		0,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]			FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]			FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund ^{^β}			FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]		
Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22
AAA	20,30 %	0,78 %	AAA	5,53 %	7,10 %	AAA	1,35 %	0,49 %	AAA	98,38 %	97,64 %
AA	2,80 %	1,98 %	AA	0,66 %	1,21 %	AA	0,38 %	0,25 %	AA	0,10 %	–
A	5,42 %	8,85 %	A	4,15 %	1,83 %	A	1,73 %	2,74 %	A	0,22 %	0,53 %
BBB	44,03 %	58,67 %	BBB	21,63 %	20,53 %	BBB	12,14 %	3,69 %	BBB	1,07 %	0,96 %
BB	22,63 %	21,03 %	BB	38,14 %	32,49 %	BB	15,83 %	8,44 %	BB	0,23 %	–
B	4,55 %	2,97 %	B	20,23 %	22,97 %	B	18,36 %	12,67 %	Sans notation	–	0,87 %
CCC et inférieure	0,27 %	–	CCC et inférieure	9,66 %	8,05 %	CCC et inférieure	50,21 %	12,61 %			
Sans notation	–	5,72 %	Sans notation	–	5,82 %	Sans notation	–	59,11 %			
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.2 Risque de crédit – (suite)

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]			FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]			Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]			FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]		
Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22
AAA	7,61 %	9,21 %	AAA	0,80 %	6,98 %	AAA	6,91 %	38,15 %	AAA	9,60 %	4,22 %
AA	9,33 %	10,55 %	AA	10,66 %	11,56 %	AA	0,42 %	2,44 %	AA	4,25 %	5,57 %
A	45,81 %	44,78 %	A	31,89 %	28,98 %	A	1,65 %	10,98 %	A	41,98 %	40,12 %
BBB	36,31 %	34,35 %	BBB	45,59 %	42,26 %	BBB	34,03 %	26,87 %	BBB	39,62 %	39,39 %
BB	0,94 %	1,11 %	BB	8,94 %	7,91 %	BB	25,58 %	12,83 %	BB	4,55 %	8,40 %
			B	2,04 %	1,10 %	B	8,50 %	4,13 %	Sans notation	–	2,30 %
			CCC et inférieure	0,08 %	–	CCC et inférieure	2,31 %	0,44 %			
			Sans notation	–	1,21 %	Sans notation	20,60 %	4,16 %			
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund			FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]			FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]			FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22
AAA	55,13 %	47,36 %	AAA	59,94 %	38,24 %	A	0,39 %	–	AAA	50,78 %	22,15 %
AA	9,96 %	18,30 %	AA	2,93 %	15,13 %	BBB	7,12 %	2,66 %	AA	9,75 %	23,12 %
A	8,03 %	6,91 %	A	9,21 %	13,75 %	BB	36,83 %	43,83 %	A	8,22 %	20,10 %
BBB	18,38 %	19,86 %	BBB	14,30 %	20,68 %	B	43,32 %	41,86 %	BBB	20,25 %	22,75 %
BB	8,50 %	7,57 %	BB	13,62 %	12,20 %	CCC et inférieure	8,61 %	10,50 %	BB	10,90 %	11,86 %
						Sans notation	3,73 %	1,15 %	B	0,02 %	0,02 %
									Sans notation	0,08 %	–
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund			FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]			FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]			FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]		
Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22	Notation	Fév.-23	Fév.-22
AAA	11,57 %	16,94 %	AAA	22,78 %	16,25 %	A	0,39 %	–	AAA	27,27 %	9,45 %
AA	1,61 %	0,67 %	AA	9,04 %	2,30 %	BBB	6,82 %	2,07 %	AA	14,11 %	18,21 %
A	7,74 %	5,77 %	A	11,44 %	17,22 %	BB	41,27 %	47,97 %	A	6,10 %	17,92 %
BBB	39,90 %	34,90 %	BBB	22,46 %	13,24 %	B	48,05 %	49,24 %	BBB	26,76 %	31,87 %
BB	18,89 %	20,58 %	BB	9,63 %	17,77 %	CCC et inférieure	0,81 %	0,72 %	BB	25,76 %	22,55 %
B	14,48 %	15,64 %	B	6,93 %	11,71 %	Sans notation	2,66 %	–			
CCC et inférieure	5,81 %	5,11 %	CCC et inférieure	2,22 %	5,74 %						
Sans notation	–	0,39 %	Sans notation	15,50 %	15,77 %						
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]		
Notation	Fév.-23	Fév.-22
AAA	8,27 %	–
AA	3,00 %	–
A	9,72 %	–
BBB	47,17 %	–
BB	15,96 %	–
B	13,72 %	–
CCC et inférieure	2,16 %	–
	100,00 %	0,00 %

β Le portefeuille est construit sur une base ascendante en utilisant le processus de valeur fondamentale de Western Asset. L'équipe d'investissement ne s'appuie pas sur les recherches des agences de notation, mais elle évalue leur travail et les niveaux d'amélioration des titres. Pour les titres qui ne sont pas notés par une agence de notation statistique reconnue au niveau national (NRSRO), l'équipe d'investissement attribue une note de crédit interne basée sur l'analyse fondamentale de l'équipe d'investissement.

12.3 Risque de liquidité

Le Prospectus de la Société prévoit la création et l'annulation quotidiennes d'actions. La Société se trouve donc exposée au risque de liquidité en raison du fait qu'elle est tenue de faire face aux demandes de rachat des actionnaires à tout moment.

L'Agent administratif surveille quotidiennement les volumes de souscription et de rachat et informe le Gestionnaire de portefeuille ou les Gestionnaires de portefeuille délégués concernés des mouvements importants et des tendances inhabituelles, le cas échéant. Si les demandes de rachat lors d'un jour de transaction (tel que défini dans le prospectus) dépassent 10 % des actions en circulation d'un fonds, la société peut choisir de limiter le nombre total d'actions rachetées ce jour de transaction à 10 % des actions en circulation du fonds, auquel cas toutes les demandes de rachat correspondantes seront réduites au prorata. La Société reportera les demandes de rachat excédentaires et traitera les demandes différées comme si elles avaient été reçues pour chaque jour de transaction suivant (pour lequel la Société dispose du même pouvoir de report au plafond alors en vigueur) jusqu'à ce que toutes les actions auxquelles la demande initiale se rapporte aient été rachetées. Dans ce cas, la Société peut réduire les demandes au prorata le jour de négociation suivant et les jours suivants afin de donner effet à la limitation ci-dessus.

La Société peut suspendre temporairement la détermination de la valeur nette d'inventaire et la vente ou le rachat d'actions d'un Compartiment pendant ces périodes :

- (i) lorsqu'un marché constituant le principal marché d'une grande partie des investissements du compartiment est fermé, ou lorsque la négociation est limitée ou suspendue sur ce marché ;
- (ii) lorsqu'il existe une situation d'urgence qui a pour résultat que la liquidation, par la Société, des investissements représentant une partie substantielle des actifs du fonds n'est pas réalisable en pratique ;
- (iii) lorsque pour quelque motif que ce soit, les prix de l'un des investissements du compartiment ne peuvent être établis de manière raisonnable, rapide ou exacte par le Fonds ;
- (iv) lorsque le paiement de toute somme liée, ou pouvant être liée, à la réalisation ou au paiement d'investissements du compartiment ne peut, selon l'opinion des administrateurs, être effectué à des taux de change normaux ; ou
- (v) lorsque le produits de la vente ou du rachat des actions ne peuvent être transférés de ou sur le compte du Fonds.

La société a la capacité d'emprunter à court terme pour assurer le règlement. Conformément à la réglementation sur les OPCVM, un fonds ne peut emprunter de l'argent que dans les conditions suivantes :

- (a) un Fonds peut acquérir des devises étrangères au moyen d'un prêt « adossé » ; et
- (b) un Fonds peut emprunter :
 - (i) jusqu'à 10 % de sa valeur liquidative, à condition que cet emprunt soit temporaire ; et
 - (ii) jusqu'à 10 % de sa valeur liquidative, à condition que l'emprunt soit destiné à permettre l'acquisition de biens immobiliers nécessaires à l'exercice de ses activités ;

à condition que les emprunts visés aux points b) i) et b) ii) ne dépassent pas au total 15 % des actifs de l'emprunteur.

Facilité de crédit mondiale

Avec effet au 5 février 2021, la Société, conjointement avec d'autres organismes de placement collectif immatriculés en Europe et aux États-Unis et gérés par Franklin Templeton (dénommés individuellement l'« emprunteur » et ensemble les « emprunteurs »), a créé une facilité de crédit senior non garantie syndiquée conjointe s'élevant à 2 675 millions de dollars américains (la « facilité de crédit mondiale ») afin de procurer une source de fonds aux emprunteurs à des fins temporaires et urgentes, avec la capacité de répondre à des demandes de rachats futures imprévues ou inhabituellement élevées.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.3 Risque de liquidité – (suite)

Facilité de crédit mondiale – (suite)

Au titre de la facilité de crédit mondiale, la Société paiera, en sus des intérêts facturés sur tout emprunt contracté par la Société et de tous autres coûts engagés par la Société, sa part des frais et commissions engagés dans le cadre de la mise en application et du maintien de la facilité de crédit mondiale, proportionnellement à sa part de l'actif net total de l'ensemble des emprunteurs, y compris une commission d'engagement annuelle basée sur la part non utilisée de la facilité de crédit mondiale.

Tous les fonds de la Société, à l'exception du FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, relèvent du champ d'application de la facilité de crédit mondiale.

L'un des responsabilités du comité d'évaluation est d'examiner et de délibérer sur les questions d'évaluation, y compris les titres illiquides. La société peut de temps à autre investir dans des contrats dérivés négociés de gré à gré, qui ne sont pas négociés sur un marché public organisé et peuvent être illiquides. Par conséquent, la société pourrait ne pas être en mesure de liquider rapidement ses investissements dans ces instruments à un montant proche de leur juste valeur afin de répondre à ses besoins de liquidités ou de réagir à des événements spécifiques tels que la détérioration de la solvabilité d'un émetteur particulier.

Les tableaux ci-dessous ont été préparés sur la base des sorties de trésorerie brutes non actualisées liées aux passifs financiers respectifs. Les contrats de change à terme figurant dans les tableaux ci-dessous sont réglés sur une base brute. Veuillez vous référer au portefeuille d'investissement concerné pour plus de détails sur les montants bruts de règlement de ces contrats.

Les échéances résiduelles contractuelles des passifs financiers de chaque fonds sont détaillées ci-dessous :

Passifs (en milliers)	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	
	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022
Moins de 1 mois								
Découvert bancaire	\$ –	\$ –	\$ 620	\$ 659	\$ 849	\$ 1 199	€ –	€ –
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions	–	–	2 826	2 642	445	2 114	9	508
Options	–	–	18	220	161	1 420	4	–
Contrats de swap	–	–	46	421	1 867	3 508	–	743
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	–	–	–	50	709	820	–	–
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	7	–	1 793	1 273	868	84
Montants à payer au titre des investissements acquis	9 879	19 972	11 726	5 654	101 191	44 980	187	1
Distributions aux Détenteurs d'actions de participation rachetables	2 054	6	132	55	148	48	1	–
Commissions de gestion à payer	363	55	71	141	487	668	3	2
Commissions de performance à payer	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissions de la Société d'administration et du Dépositaire à payer	24	22	16	17	73	78	14	10
Commissions d'agent de services aux actionnaires à payer	–	–	1	16	20	31	–	1
Montants à payer pour les actions de participation rachetables rachetées	–	–	1	1 814	1 904	3 508	–	–
Actions de participation rachetables	833 615	919 324	131 919	232 906	1 148 700	1 488 090	132 467	149 386
1-3 mois								
Options	–	–	–	9	–	56	–	3
Options sur swaps	–	–	–	–	–	258	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	–	–	–	–	1 869	6 484	338	569
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	–	–	–	–	–	–
Sur 3 mois								
Options	–	–	52	–	454	–	–	–
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	173	1 522	1 832	7 691	197	506
Charges à payer et autres passifs	298	379	116	86	375	283	55	52
Total des passifs financiers	\$ 846 233	\$ 939 758	\$ 147 724	\$ 246 212	\$1 262 877	\$1 562 509	€ 134 143	€ 151 865

Passifs (en milliers)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund^		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund^		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^	
	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022
Moins de 1 mois								
Découvert bancaire	\$ 140	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions	38	51	–	–	–	–	–	181
Options	–	–	–	–	–	–	–	–
Contrats de swap	–	–	–	–	–	–	–	286
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	265	109	–	–	–	–	–	149
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	–	–	–	–	–	36
Montants à payer au titre des investissements acquis	4	158	–	–	–	–	–	–
Distributions aux Détenteurs d'actions de participation rachetables	89	29	–	–	–	–	–	–
Commissions de gestion à payer	41	72	–	–	–	–	–	9
Commissions de performance à payer	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissions de la Société d'administration et du Dépositaire à payer	11	9	–	5	–	2	3	7
Commissions d'agent de services aux actionnaires à payer	4	8	–	–	–	–	–	1
Montants à payer pour les actions de participation rachetables rachetées	–	1 011	–	–	–	–	–	–
Actions de participation rachetables	57 431	81 978	–	–	–	–	–	59 525
1-3 mois								
Options	–	–	–	–	–	–	–	2
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	6	30	–	–	–	–	–	149
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	–	–	–	–	–	–
Sur 3 mois								
Options	–	–	–	–	–	–	–	–
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	–	–	–	–	–	200
Charges à payer et autres passifs	94	91	14	9	17	15	42	37
Total des passifs financiers	\$ 58 123	\$ 83 546	\$ 14	\$ 14	\$ 17	\$ 17	\$ 45	\$ 60 582

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^]		FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		FTGF Western Asset US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^]		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]	
au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022
\$	–	\$	–	\$	–	\$	–	\$	–
–	–	559	–	155	578	–	–	–	–
–	–	27	330	–	190	–	127	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	657	116	19	–	8	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	29	3 642	1 704	35	41	–	165	–	39
–	–	–	117	–	–	–	–	–	–
–	214	266	42	1 250	341	–	–	–	–
12	16	94	28	172	59	–	3	–	–
14	49	91	114	67	119	–	18	–	1
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
9	24	20	20	14	18	3	19	3	6
2	5	6	7	7	9	–	1	–	–
1 366	488	45	2 408	74	5 179	11	10	–	44
–	52 992	227 355	302 969	125 240	259 100	–	41 118	–	27 848
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	366	561	–	–	–	9	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	6	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	3	–	–	–	–	–	–	–
–	–	29	1 164	31	72	–	89	–	27
23	38	184	164	79	75	48	42	32	29
\$ 1 426	\$ 53 855	\$ 232 687	\$ 310 285	\$ 127 240	\$ 265 800	\$ 62	\$ 41 615	\$ 35	\$ 27 994

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]		FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	
au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022
\$	522	\$	–	\$	–	\$	–	€	–
6	–	484	161	–	5	–	9	–	–
–	–	1	1 642	17	777	3	339	–	–
–	–	–	–	4	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	1 508	76	393	–	–
789	266	–	–	–	–	–	–	–	–
373	1 113	3 188	4 524	1 985	1 280	69	103	–	–
770	120	–	–	747	253	–	–	–	–
15	7	25 758	5 838	9 282	3 922	306	3	–	140
200	241	2	–	–	–	–	–	–	–
–	–	153	137	17	32	2	2	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
32	30	36	26	15	15	9	9	3	5
13	19	11	10	–	–	–	–	–	–
299	1 467	1 106	7 487	72	3 467	–	5	–	–
437 707	509 794	523 970	444 249	146 703	202 948	46 050	77 353	–	37 448
–	–	–	–	–	8	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	328	31	121	98	627	21	13	–	66
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
341	–	–	–	14	–	–	–	–	–
–	–	61	181	296	917	34	44	–	–
313	403	84	86	101	91	56	53	28	48
\$ 441 380	\$ 513 788	\$ 554 885	\$ 464 462	\$ 159 351	\$ 215 850	\$ 46 626	\$ 78 326	€ 31	€ 37 707

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.3 Risque de liquidité – (suite)

Passifs (en milliers)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^		FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	
	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022
Moins de 1 mois						
Découvert bancaire	\$ 83 849	\$ 101 514	\$ –	\$ –	\$ 2	\$ –
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions	76 579	266 033	–	–	119	836
Options	36 086	53 594	–	–	–	14
Contrats de swap	43 002	239 384	–	–	761	572
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	19 856	43 262	–	–	2 113	3 533
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	21 228	5 137	–	–	63	43
Montants à payer au titre des investissements acquis	4 384	14 790	–	–	7 800	2 415
Distributions aux Détenteurs d'actions de participation rachetables	–	–	–	–	–	–
Commissions de gestion à payer	2 062	4 149	–	–	24	27
Commissions de performance à payer	–	–	–	–	–	–
Commissions de la Société d'administration et du Dépositaire à payer	151	243	–	5	22	22
Commissions d'agent de services aux actionnaires à payer	136	279	–	–	–	–
Montants à payer pour les actions de participation rachetables rachetées	3 140	23 005	–	–	82	61
Actions de participation rachetables	2 132 501	4 183 834	–	–	275 012	371 899
1-3 mois						
Options	4 816	72 352	–	–	24	163
Options sur swaps	–	528	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	23 760	54 894	–	–	852	3 707
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	–	–	–	–
Sur 3 mois						
Options	5 450	1 754	–	–	12	–
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	25 966	232 727	–	–	827	2 196
Charges à payer et autres passifs	1 652	3 399	30	25	207	177
Total des passifs financiers	\$ 2 484 618	\$ 5 300 878	\$ 30	\$ 30	\$ 287 920	\$ 385 665

Passifs (en milliers)	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^		FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^		FTGF Brandywine Global High Yield Fund^	
	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022
Moins de 1 mois								
Découvert bancaire	\$ –	\$ –	\$ 4	\$ 3	\$ 7	\$ 13	\$ –	\$ 1
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions	26	5	850	1 190	2 495	5 014	–	90
Options	–	–	–	–	–	–	–	–
Contrats de swap	–	–	–	–	–	–	–	12
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	78	4	2 038	2 791	17 448	11 667	149	4
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	–	–	–	4 865	–	–
Montants à payer au titre des investissements acquis	145	–	490	230	1 798	–	163	–
Distributions aux Détenteurs d'actions de participation rachetables	–	–	–	–	–	–	1	–
Commissions de gestion à payer	–	–	83	124	260	150	–	2
Commissions de performance à payer	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissions de la Société d'administration et du Dépositaire à payer	13	5	24	16	38	42	7	5
Commissions d'agent de services aux actionnaires à payer	–	–	11	18	–	–	–	–
Montants à payer pour les actions de participation rachetables rachetées	–	–	2 595	638	–	–	–	–
Actions de participation rachetables	8 995	9 866	162 009	215 635	539 271	752 718	10 394	11 590
1-3 mois								
Options	–	–	–	–	–	–	–	–
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	29	22	1 928	1 692	6 179	10 197	53	16
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	–	–	–	–	–	–
Sur 3 mois								
Options	–	–	–	–	–	–	–	–
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	–	–	–	10	–	321	–	–
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	5	–	–	–	–	–	–	–
Charges à payer et autres passifs	31	23	386	478	247	431	44	45
Total des passifs financiers	\$ 9 322	\$ 9 925	\$ 170 418	\$ 222 825	\$ 567 743	\$ 785 418	\$ 10 811	\$ 11 765

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^		FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^		FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^		FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^		Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund^	
au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022
\$ –	\$ –	\$ 878	\$ 189	£ –	£ –	\$ –	\$ 10	\$ –	\$ –
–	380	54	2 408	–	–	6	280	389	–
–	–	–	–	–	–	–	–	21	67
–	592	–	–	–	–	74	–	2	68
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
1 683	3 513	–	14	–	–	361	1 637	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	55	154
–	–	83 125	200 768	229	–	1 787	–	193	661
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
77	255	13	–	–	–	4	5	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
38	56	69	60	11	7	12	13	31	17
2	2	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
559 548	1 057 941	1 119 507	1 147 280	45 912	73 633	94 775	175 169	18 441	21 958
–	–	–	–	–	–	–	–	1	14
–	561	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	7	35	43	102	58	189
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	16	–
–	708	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
73	2 083	731	666	29	10	103	158	65	379
350	309	222	207	45	39	64	57	52	40
\$ 561 771	\$ 1 066 400	\$ 1 204 599	\$ 1 351 592	£ 46 233	£ 73 724	\$ 97 229	\$ 177 431	\$ 19 324	\$ 23 547
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^		FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^		FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	
au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022
\$ 3	\$ 4	\$ –	\$ –	\$ 1	\$ 10 850	\$ –	\$ 325	\$ 103	\$ –
110	610	–	–	–	2 390	–	20	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	878	–	37	–	–	12
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
1 723	2 089	–	–	11 891	11 105	311	–	144	182
–	–	–	–	2 581	–	175	40	–	–
9 308	–	–	–	5 978	61 079	–	–	30	–
–	–	–	–	106	37	–	–	–	–
100	119	–	–	701	998	39	46	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
27	17	–	–	77	83	20	7	7	5
1	1	–	–	78	107	–	1	1	–
4	1	–	–	714	3 099	–	–	–	–
205 146	244 396	–	–	1 210 305	1 608 073	46 756	52 386	8 389	10 163
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
2 507	1 970	–	–	498	6 048	68	145	48	14
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
9	15	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
148	166	2 173	253	1 123	1 309	–	41	–	–
–	–	–	–	128	71	66	67	60	38
\$ 219 086	\$ 249 388	\$ 2 173	\$ 253	\$ 1 235 059	\$ 1 705 249	\$ 47 472	\$ 53 078	\$ 8 782	\$ 10 414

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.3 Risque de liquidité – (suite)

Passifs (en milliers)	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^		FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^		FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	
	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022
Moins de 1 mois						
Découvert bancaire	\$ 1	\$ 2	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions	122	630	–	–	–	–
Options	–	–	–	–	–	–
Contrats de swap	–	–	–	–	–	–
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	3 010	3 495	44	–	20	29
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	283	903	109	–	–	–
Montants à payer au titre des investissements acquis	327	508	–	–	–	–
Distributions aux Détenteurs d'actions de participation rachetables	–	–	–	–	–	–
Commissions de gestion à payer	–	5	–	–	–	–
Commissions de performance à payer	–	–	–	–	–	–
Commissions de la Société d'administration et du Dépositaire à payer	13	12	4	–	7	5
Commissions d'agent de services aux actionnaires à payer	–	–	–	–	–	–
Montants à payer pour les actions de participation rachetables rachetées	–	–	–	–	–	–
Actions de participation rachetables	69 410	104 231	14 804	–	2 534	2 177
1-3 mois						
Options	–	–	–	–	–	–
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	462	1 061	20	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	–	–	–	–
Sur 3 mois						
Options	–	–	–	–	–	–
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	10	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	523	14	–	–	–
Charges à payer et autres passifs	132	115	27	–	50	29
Total des passifs financiers	\$ 73 770	\$ 111 485	\$ 15 022	\$ –	\$ 2 611	\$ 2 240

Passifs (en milliers)	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^		FTGF ClearBridge Global Growth Fund^	
	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022
Moins de 1 mois								
Découvert bancaire	\$ –	\$ 397	\$ –	\$ –	\$ 7	\$ 8 610	\$ –	\$ –
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions	–	–	–	–	–	–	–	–
Options	–	–	–	–	–	–	–	–
Contrats de swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	229	123	56	38	840	2 099	–	–
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	–	–	–	–	–	–
Montants à payer au titre des investissements acquis	179	2 179	–	207	3 682	1 602	–	–
Distributions aux Détenteurs d'actions de participation rachetables	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissions de gestion à payer	200	391	33	38	704	694	6	7
Commissions de performance à payer	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissions de la Société d'administration et du Dépositaire à payer	43	61	11	8	130	106	9	6
Commissions d'agent de services aux actionnaires à payer	35	50	4	5	170	108	–	–
Montants à payer pour les actions de participation rachetables rachetées	176	2 136	44	100	28 161	12 990	–	–
Actions de participation rachetables	224 793	538 159	38 528	43 279	1 639 979	1 599 315	13 179	16 018
1-3 mois								
Options	–	–	–	–	–	–	–	–
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	–	–	–	–	–	–
Sur 3 mois								
Options	–	–	–	–	–	–	–	–
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	–	–	–	–	–	–
Charges à payer et autres passifs	224	318	47	46	111	62	27	20
Total des passifs financiers	\$ 225 879	\$ 543 814	\$ 38 723	\$ 43 721	\$1 673 784	\$1 625 586	\$ 13 221	\$ 16 051

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

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	
au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022
\$ 2 030	\$ 1	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 5	\$ 1
–	–	–	–	–	–	–	–	–	4 240
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
976	641	–	–	–	–	–	–	1 284	1 267
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
6 635	304	–	–	–	–	43	–	429	1 938
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
609	567	–	–	–	–	165	196	795	1 137
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
86	67	–	–	–	5	27	23	165	158
56	56	–	–	–	–	23	31	109	148
288	701	29	29	–	–	55	11 979	3 685	19 322
929 726	892 238	–	–	–	–	189 610	213 480	1 225 735	1 772 695
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	267	442
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
118	110	30	29	55	52	81	72	368	326
\$ 940 524	\$ 894 685	\$ 59	\$ 58	\$ 55	\$ 57	\$ 190 004	\$ 225 781	\$1 232 842	\$ 1 801 674

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		FTGF Royce US Smaller Companies Fund	
au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022
€ 2	€ 2	\$ –	\$ –	\$ 6	\$ 14	\$ 643	\$ 56	\$ 142	\$ 341
–	340	–	–	–	–	–	1 170	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
1 018	367	–	30	2 229	332	1 547	1 654	2	5
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
2 286	1 204	–	–	3 872	2 075	1 944	14 230	358	99
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
826	549	–	2	377	186	624	747	83	91
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
103	53	3	5	31	14	82	68	16	12
99	69	–	–	74	42	109	130	12	15
1 022	1 968	–	–	2 062	368	915	15 803	37	249
1 062 833	671 424	–	2 665	406 048	173 394	741 529	916 209	78 098	87 935
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
40	71	–	–	–	–	76	137	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
94	95	47	47	62	29	207	200	68	64
€1 068 323	€ 676 142	\$ 50	\$ 2 749	\$ 414 761	\$ 176 454	\$ 747 676	\$ 950 404	\$ 78 816	\$ 88 811

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

12. Exposition aux risques et gestion des risques – (suite)

12.3 Risque de liquidité – (suite)

Passifs (en milliers)	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]		Legg Mason US Equity Fund [^]		Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]		FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	
	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022
Moins de 1 mois								
Découvert bancaire	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –	€ –	\$ –	\$ 182
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions	–	–	–	–	–	–	–	–
Options	–	–	–	–	–	–	–	–
Contrats de swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	–	–	–	–	–	23	90	139
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	–	–	–	–	–	–
Montants à payer au titre des investissements acquis	–	5	–	–	–	51	–	214
Distributions aux Détenteurs d'actions de participation rachetables	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissions de gestion à payer	1	–	–	–	–	29	25	30
Commissions de performance à payer	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissions de la Société d'administration et du Dépositaire à payer	7	4	–	–	3	5	11	8
Commissions d'agent de services aux actionnaires à payer	–	–	–	–	–	3	2	5
Montants à payer pour les actions de participation rachetables rachetées	–	–	–	–	1 185	49	–	20
Actions de participation rachetables	4 254	4 534	–	–	–	28 337	21 090	25 883
1-3 mois								
Options	–	–	–	–	–	–	–	–
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	–	–	–	–	–	–
Sur 3 mois								
Options	–	–	–	–	–	–	–	–
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	–	–	–	–	–	–
Charges à payer et autres passifs	19	21	23	23	71	79	133	184
Total des passifs financiers	\$ 4 281	\$ 4 564	\$ 23	\$ 23	€ 1 259	€ 28 576	\$ 21 351	\$ 26 665

Passifs (en milliers)	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund [^]		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund [^]	
	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022
Moins de 1 mois								
Découvert bancaire	\$ –	\$ –	€ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Comptes sur marge et espèces soumises à restrictions	–	–	–	–	–	–	–	–
Options	–	–	–	–	–	–	–	–
Contrats de swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	–	–	–	–	–	–
Montants à payer au titre des investissements acquis	–	–	–	–	–	–	–	–
Distributions aux Détenteurs d'actions de participation rachetables	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissions de gestion à payer	–	–	–	–	–	–	–	–
Commissions de performance à payer	–	–	–	3	–	–	–	–
Commissions de la Société d'administration et du Dépositaire à payer	–	4	–	3	–	–	–	3
Commissions d'agent de services aux actionnaires à payer	–	–	–	–	–	–	–	–
Montants à payer pour les actions de participation rachetables rachetées	–	–	–	–	51	51	38	38
Actions de participation rachetables	–	–	–	–	–	–	–	–
1-3 mois								
Options	–	–	–	–	–	–	–	–
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	–	–	–	–	–	–
Sur 3 mois								
Options	–	–	–	–	–	–	–	–
Options sur swaps	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats de change à terme	–	–	–	–	–	–	–	–
Moins-value latente sur les contrats à terme standardisés	–	–	–	–	–	–	–	–
Charges à payer et autres passifs	28	24	65	70	–	–	23	20
Total des passifs financiers	\$ 28	\$ 28	€ 65	€ 76	\$ 51	\$ 51	\$ 61	\$ 61

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund [^]		Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^]		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]		Legg Mason Japan Equity Fund [^]		FTGF Martin Currie Asia Long- Term Unconstrained Fund [^]	
au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022
\$	\$	\$	\$	\$	\$	¥	¥	\$	\$
-	-	-	-	-	5	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	1	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	1 033	-	-	-	-
-	-	-	-	-	12	-	-	2	12
-	-	-	-	4	6	-	-	14	11
59	59	2	1	2 516	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	12 543	-	-	3 538	16 118
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1	1	39	55	49	45	114 974	97 595	74	76
\$ 60	\$ 60	\$ 41	\$ 56	\$ 2 569	\$ 13 645	¥ 114 974	¥ 97 595	\$ 3 628	\$ 16 217
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]		FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund		FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]		FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]		Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	
au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022	au 28 février 2023	au 28 février 2022
\$	\$	\$	\$	\$	\$	€	€	€	€
-	-	-	-	-	-	3	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1 422	2 114	19	10	-	-	1	26	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
154	6 577	-	280	-	-	4 372	86	815	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
76	105	18	19	26	36	55	99	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
19	17	9	6	11	9	41	34	2	-
8	12	3	5	1	2	1	2	-	-
184	15 197	-	-	-	443	2 603	662	-	-
141 049	169 381	25 121	27 934	34 702	47 838	189 097	303 590	36 823	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	19	43	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
45	38	95	141	116	213	37	19	22	-
\$ 142 957	\$ 193 441	\$ 25 265	\$ 28 395	\$ 34 856	\$ 48 541	€ 196 229	€ 304 561	€ 37 662	€ -

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

13. Informations concernant les investissements croisés des Compartiments de la Société

Certains Fonds investissent dans d'autres Fonds de la Société. Ces investissements croisés ont été éliminés dans les états financiers de la Société, comme suit :

- les valeurs de marché des organismes de placement collectif sous-jacents ont été éliminées dans les montants totaux de la Société dans l'état de la situation financière ;
- les plus-values et moins-values réalisées, y compris les fluctuations des plus-values et moins-values latentes, ainsi que les dividendes et distributions pertinents sur les investissements croisés, ont été éliminés dans les montants totaux de la Société indiqués dans l'état du résultat global ;
- les montants monétaires des achats et ventes d'unités dans ces organismes de placement collectif ont été éliminés du produit net des ventes d'actions et du coût des actions rachetées, respectivement, sur les montants totaux de la Société indiqués dans l'état des variations de l'actif net attribuable aux détenteurs d'actions participatives rachetables.

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund détenu néant (2022 : néant), néant (2022 : 75 173) et néant (2022 : 51 333) actions du fonds FTGF Western Asset US High Yield Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] et Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], respectivement, à la fin de l'exercice. Les transactions comprenant ces actions et les gains, pertes et distributions liés au cours de la période étaient :

	FTGF Western Asset US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	
	Pour la période close le 28 février 2023 (en milliers)	Pour la période close le 28 février 2022 (en milliers)	Pour la période close le 28 février 2023 (en milliers)	Pour la période close le 28 février 2022 (en milliers)	Pour la période close le 28 février 2023 (en milliers)	Pour la période close le 28 février 2022 (en milliers)
Émission d'actions	– \$	123\$	83\$	354\$	– \$	– \$
Rachat d'actions	–	(10 502)	(6 388)	(1 293)	(9 302)	(5 037)
(Moins)/plus-value nette réalisée sur actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat	–	613	(1 391)	(98)	979	1 315
Distributions reçues	–	123	83	354	–	–
Coût	–	–	–	7 696	–	8 323
Juste valeur	–	–	–	6 804	–	10 500
(Moins)/plus-value nette non réalisée sur actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat	– \$	– \$	– \$	(892) \$	– \$	2 177\$

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^]

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^] détenu néant (2022 : 44 725) actions du Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] à la fin de l'exercice. Les transactions comprenant ces actions et les gains, pertes et distributions liés au cours de la période étaient :

	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]	
	Pour la période close le 28 février 2023 (en milliers)	Pour la période close le 28 février 2022 (en milliers)
Émission d'actions	53\$	2 868\$
Rachat d'actions	(3 781)	(308)
(Moins)/plus-value nette réalisée sur actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat	(756)	28
Distributions reçues	53	169
Coût	–	4 483
Juste valeur	–	4 048
Perte nette latente sur les actifs financiers à leur juste valeur par le biais du profit ou de la perte	– \$	(435) \$

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

FTGF Western Asset Global High Yield Fund détenu néant (2022 : 20 491) et néant (2022 : 18 300) actions du Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] et Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], respectivement, à la fin de l'exercice. Les transactions comprenant ces actions et les gains, pertes et distributions liés au cours de la période étaient :

	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	
	Pour la période close le 28 février 2023 (en milliers)	Pour la période close le 28 février 2022 (en milliers)	Pour la période close le 28 février 2023 (en milliers)	Pour la période close le 28 février 2022 (en milliers)
Émission d'actions	20\$	1 533\$	– \$	– \$
Rachat d'actions	(1 761)	(1 500)	(3 283)	(1 736)
(Moins)/plus-value nette réalisée sur actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat	(378)	(4)	295	425
Distributions reçues	20	83	–	–
Coût	–	2 119	–	2 988
Juste valeur	–	1 855	–	3 743
(Moins)/plus-value nette non réalisée sur actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat	– \$	(264) \$	– \$	755\$

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

13. Informations concernant les investissements croisés des Compartiments de la Société – (suite)

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^] détenu néant (2022 : 32 057) actions du Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] à la fin de l'exercice. Les transactions comprenant ces actions et les gains, pertes et distributions liés au cours de la période étaient :

	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]	
	Pour la période close le 28 février 2023 (en milliers)	Pour la période close le 28 février 2022 (en milliers)
Émission d'actions	39\$	466\$
Rachat d'actions	(2 706)	(6 502)
(Moins)/plus-value nette réalisée sur actifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat	(503)	248
Distributions reçues	39	284
Coût	–	3 170
Juste valeur	–	2 902
Gain net latent sur les actifs financiers à leur juste valeur par le biais du profit ou de la perte	– \$	(268) \$

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] détenait 29,816 (2022 : 29 816) actions de FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^] à la fin de l'exercice. Les transactions comprenant ces actions et les gains, pertes et distributions liés au cours de la période étaient :

	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	
	Pour la période close le 28 février 2023 (en milliers)	Pour la période close le 28 février 2022 (en milliers)
Émission d'actions	– \$	– \$
Rachat d'actions	–	(7 509)
Gain net réalisé sur les actifs financiers à leur juste valeur par le biais du profit ou de la perte	–	698
Distributions reçues	–	–
Coût	3 500	3 500
Juste valeur	3 886	3 871
Gain net latent sur les actifs financiers à leur juste valeur par le biais du profit ou de la perte	386\$	371\$

14. Événements importants

À compter du 27 avril 2022, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] a cessé ses activités.

À compter du 21 juin 2022, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] et Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] ont cessé leurs activités.

À compter du 11 juillet 2022, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] a cessé ses activités.

Le 17 juin 2022, la Société a publié une mise à jour des prospectus principaux et spécialisés qui a reçu l'agrément de la Banque centrale. Les modifications importantes sont les suivantes :

- Ajout d'un fonds : Western Asset China Bond Fund ; et
- Ajout de fréquences de distribution supplémentaires pour certaines catégories d'actions de distribution pour les fonds suivants : FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund et FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^].

À compter du 1^{er} juillet 2022, Franklin Templeton Investments (Asia) Limited a remplacé Legg Mason Asset Management Hong Kong Limited en tant que distributeur supplémentaire et agent de services aux actionnaires supplémentaire de la Société.

À partir du 3 octobre 2022, Joseph Carrier a cessé d'être employé à plein temps de Franklin Templeton Investments. M. Carrier continuera d'agir en qualité d'administrateur non exécutif de la Société et, à partir du 3 octobre 2022, sera rémunéré comme les autres administrateurs non exécutifs de la Société.

À compter du 10 octobre 2022, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund a cessé ses activités.

À compter du 17 novembre 2022, Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^] a cessé ses activités.

Le 1 Décembre 2022, la Société a publié une mise à jour des prospectus principaux et spécialisés qui a reçu l'agrément de la Banque centrale. Les modifications importantes comprenaient des modifications du prospectus de base et de certains suppléments du fonds, comme suit :

- Requalification à partir d'une classification Article 6 existante à une classification Article 8 conformément au règlement sur la divulgation en matière de finance durable (l'UE 2019/2088) (« SFDR ») pour les fonds suivants : FTGF Western Asset US High Yield Fund, FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund, FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund, FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^], FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^], FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^], FTGF Western Asset Global High Yield Fund et FTGF Western Asset US Core Bond Fund. Les suppléments des compartiments concernés ont été mis à jour pour refléter les informations requises en vertu de l'article 8. Des informations sur la taxonomie ont été ajoutées pour préciser qu'il se peut qu'il n'y ait aucun investissement qualifié d'activité économique durable sur le plan environnemental en vertu du règlement sur la Taxonomie. Cependant, les Fonds peuvent détenir des investissements qui contribuent à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation à celui-ci ;
- La divulgation de la Taxonomie des Fonds suivants a été mise pour préciser qu'il se peut qu'il n'y ait aucun investissement qualifié d'activité économique durable sur le plan environnemental en vertu du règlement « sur la Taxonomie. FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund, FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^], FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund, FTGF ClearBridge US Appreciation Fund, FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^], FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund, FTGF ClearBridge Value Fund, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^], FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund, FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund (formerly Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund) et FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]. Cependant, les Fonds peuvent détenir des investissements qui contribuent à l'atténuation du changement climatique et à l'adaptation à celui-ci ;
- La section Politique d'investissement des compartiments respectifs a été mise à jour pour préciser qu'une limite de 10 % sera appliquée sur l'investissement dans des titres convertibles conditionnels (« CoCos ») : Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^], FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, FTGF Western Asset US Core Bond Fund, FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund, FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund, FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^], FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^], FTGF Western Asset US High Yield Fund, FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^], FTGF Western Asset Global High Yield Fund, FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Global Credit Fund, FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^] et FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^];
- La section Politique d'investissement des compartiments respectifs a été mise à jour pour préciser qu'une limite de 5 % sur l'investissement dans les CoCos : FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^] et FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund;

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

14. Événements significatifs – (suite)

- Les frais de gestion annuels des actions de Catégorie Premier et de Classe X du FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund ont été réduits dans le prospectus de 0,55 % à 0,45 %. La commission de gestion annuelle des actions de la catégorie S est réduite dans le prospectus, passant de 0,45 % à 0,35 % pour correspondre à ce qui est déjà imputé ;
- La politique d'investissement du FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund a été mise à jour pour intégrer la possibilité d'investir dans des titres de créance non notés. Tous les titres de créance achetés par le compartiment seront soit notés investment grade soit, s'ils ne sont pas notés, considérés par le gestionnaire de portefeuille comme étant doté d'une notation comparable au moment de l'achat ; et
- le nom du Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund a été changé en FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund.

À compter du 1er décembre 2022, FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] a commencé ses activités.

À compter du 5 décembre 2022, Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^] a cessé ses activités.

Martin Currie Investment Management Ltd, conformément à un contrat de sous-gestionnaire de portefeuille daté du 1er janvier 2023, tel que modifié, a nommé Templeton Asset Management Ltd. (anciennement Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited) pour agir en tant que sous-gestionnaire de portefeuille de Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] et Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund[^].

À compter du 23 janvier 2023, le Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] a commencé à ses activités.

À compter du 16 février 2023, Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^] a cessé ses activités.

Le 21 février 2023, la Société a publié une mise à jour des prospectus principaux et spécialisés qui a reçu l'agrément de la Banque centrale. À compter de la même date, afin de refléter le nom du dirigeant de la Société, Franklin Templeton International Services S.à r.l., le nom de la Société a été changé en Franklin Templeton Global Solutions plc et les changements de nom suivants ont eu lieu sur les Fonds respectifs :

Fonds	Modifications apportées au fonds
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund	FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund [^]	FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund
Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]
Legg Mason Western Asset Asian Income Fund	FTGF Western Asset Asian Income Fund
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund [^]	FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	FTGF Western Asset Global High Yield Fund
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]
Legg Mason Western Asset Infrastructure Debt Fund	FTGF Western Asset Infrastructure Debt Fund
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]
Legg Mason Western Asset Short-Dated High Yield Fund	FTGF Western Asset Short-Dated High Yield Fund
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	FTGF Western Asset US Core Bond Fund
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund ;	FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	FTGF Western Asset US High Yield Fund
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]
Western Asset China Bond Fund	FTGF Western Asset China Bond Fund
Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund [^]	FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	FTGF ClearBridge US Appreciation Fund
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund
Legg Mason ClearBridge Value Fund	FTGF ClearBridge Value Fund
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]
Legg Mason Martin Currie European Select Absolute Alpha Fund	FTGF Martin Currie European Select Absolute Alpha Fund
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	FTGF Royce US Smaller Companies Fund
Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund
Legg Mason Brandywine Global – EM Macro Bond Fund	FTGF Brandywine Global – EM Macro Bond Fund
Legg Mason Multi-Asset Infrastructure Income Fund	FTGF Multi-Asset Infrastructure Income Fund
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]

Le 28 février 2023, les autorisations pour les fonds Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund[^], Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund[^] et Legg Mason Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund[^] ont été révoquées, à la demande de la société, par la Banque centrale.

Le 24 février 2022, la Russie a entamé des opérations militaires sur le territoire souverain de l'Ukraine. Les incertitudes politiques et financières actuelles entourant la Russie et l'Ukraine ont augmenté la volatilité des marchés et le risque économique d'un investissement dans les titres de ces pays ainsi que d'autres pays touchés dans la région. Compte tenu des sanctions, des mesures prises par les gouvernements, de l'évolution de la situation en Ukraine même ainsi que d'autres circonstances, le gestionnaire continue d'évaluer la situation et son influence sur la valorisation et la liquidité, et prendra toutes les mesures potentiellement nécessaires conformément aux politiques et procédures de valorisation des compartiments.

Aucun autre événement important ne s'est produit au cours de l'exercice financier clos le 28 février 2023.

15. Séparation des passifs

La Société est un fonds commun de placement à compartiments multiples avec séparation des passifs entre les Compartiments. Dans ce sens, conformément à la législation irlandaise, les actifs de chaque Compartiment ne seront pas exposés aux passifs des autres Compartiments de la Société. Nonobstant ce qui précède, rien ne permet de garantir qu'au cas où une procédure serait engagée contre la Société auprès de tribunaux appartenant à d'autres juridictions, le caractère de passif séparé des Compartiments sera nécessairement maintenu.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Notes aux états financiers – (suite)

16. Événements ultérieurs

Le 24 mars 2023, les fonds FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] et FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^] ont cessé leurs activités.

Le 20 avril 2023, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] a cessé ses activités.

A compter du 17 juillet 2023, le fonds Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund cesse ses activités.

Aucun autre événement important postérieur à la date de l'État de la situation financière exigeant une mention aux états financiers ne s'est produit.

17. Approbation du rapport annuel et des états financiers audités

Les administrateurs ont approuvé le rapport annuel et les états financiers audités le 30 juin 2023.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Informations supplémentaires – Total des frais sur encours (TFE) (non audités)

	Ratio des frais d'exploitation dans en UM (1) sur la moyenne de l'actif net quotidien du compartiment en UM (1) (%) Pour l'exercice clos le 28 février 2023**		Ratio des frais d'exploitation dans en UM (1) sur la moyenne de l'actif net quotidien du compartiment en UM (1) (%) Pour l'exercice clos le 28 février 2023**
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	0,58	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,38
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	0,56	Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	1,38
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	0,89	Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	1,38
Actions de distribution (D) en USD de catégorie B	1,01	Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	1,38
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	1,00	Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	1,37
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	1,06	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	1,38
Actions de distribution (D) en USD de catégorie X	0,41	Actions de distribution (M) en EUR de catégorie A (couvertes)	1,38
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie A	0,57	Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A (couvertes)	1,38
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A (G)	0,56	Actions de distribution (M) en GBP de catégorie A (couvertes)	1,38
Actions de distribution (D) en USD de catégorie L (G)	0,60	Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	1,38
FTGF Western Asset US Core Bond Fund			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,11	Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	1,38
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	1,11	Actions de distribution (D) en USD de catégorie B	1,63
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	1,61	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	1,88
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	1,61	Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	1,88
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	1,77	Actions de Distribution (M) Plus en ZAR de Classe A (couvertes)	1,38
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	0,74	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	1,98
Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	0,76	Actions de distribution (D) en USD de catégorie E	1,98
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	0,61	Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)	1,98
Actions de distribution (D) en USD de catégorie X	0,61	Actions de distribution (M) en EUR de catégorie E (couvertes)	1,98
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,49	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	0,78
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	0,21	Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	0,78
Actions de capitalisation en USD de catégorie GA	1,03	Actions de distribution (D) en USD de catégorie X	0,83
Actions de capitalisation en USD de Classe GE	1,62	Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	0,80
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,29	Actions de distribution (D) en GBP de catégorie X (couvertes)	0,83
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	1,29	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,53
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	1,29	Actions de distribution (M) en USD de catégorie Premier	0,53
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	1,28	Actions de capitalisation en CHF de catégorie Premier (couvertes)	0,52
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	1,29	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	0,54
Actions de distribution (D) en USD de catégorie B	1,54	Actions de Distribution (M) en EUR de Classe Premier (couvertes)	0,53
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	1,79	Actions de distribution (M) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	0,53
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	1,79	Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	0,53
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	1,90	Actions de capitalisation en PLN de catégorie Premier (couvertes)	0,53
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	0,67	Actions de distribution (M) en AUD de catégorie LM (couvertes)	0,13
Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	0,67	Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM (couvertes)	0,13
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	0,61	FTGF Western Asset US High Yield Fund	
Actions de distribution (D) en USD de catégorie X	0,61	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,26
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	0,62	Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	1,26
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,42	Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	1,26
Actions de distribution (M) en USD de catégorie Premier	0,42	Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	1,26
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	0,42	Actions de distribution (M) en EUR de catégorie A (couvertes)	1,25
Actions de distribution (M) en USD de catégorie Premier	0,42	Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	1,25
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	0,42	Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	1,26
Actions de distribution (M) en USD de catégorie LM	0,12	Actions de distribution (D) en USD de catégorie B	1,52
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	0,12	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	1,75
Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM (couvertes)	0,13	Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	1,76
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie A	1,27	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	1,87
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A (G)	1,27	Actions de distribution (D) en USD de catégorie E	1,87
Actions de distribution (D) en USD de catégorie B (G)	1,77	Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)	1,87
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie L	1,77	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	0,84
Actions de distribution (D) en USD de catégorie L (G)	1,77	Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	0,84
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund			
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	1,10	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,58
Actions de distribution (D) en EUR de catégorie A	1,10	Parts de Capitalisation en GBP de Classe Premier (couvertes)	0,61
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	1,60	Actions de distribution (M) en USD de catégorie S	0,45
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	0,42	Actions de distribution (M) en EUR de catégorie S (couvertes)	0,43
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	0,12	Actions de distribution (M) en USD de catégorie LM	0,13
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GA	0,94	Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM (couvertes)	0,13
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie GA	0,94	Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie A	1,29
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GE	1,54	Actions de distribution (D) en USD de catégorie A (G)	1,29
		Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie L	1,79
		Actions de distribution (D) en USD de catégorie L (G)	1,79
		Actions de capitalisation en USD de catégorie GF	1,09

Informations supplémentaires – Total des frais sur encours (TFE) (non audités) – (suite)

	Ratio des frais d'exploitation dans en UM (1) sur la moyenne de l'actif net quotidien du compartiment en UM (1) (%) Pour l'exercice clos le 28 février 2023**		Ratio des frais d'exploitation dans en UM (1) sur la moyenne de l'actif net quotidien du compartiment en UM (1) (%) Pour l'exercice clos le 28 février 2023**
FTGF Western Asset Global High Yield Fund			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,29		
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	1,28		
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	1,29		
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	1,29		
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	1,29		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	1,28		
Actions de distribution (D) en EUR de catégorie A (couvertes)	1,26		
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	1,29		
Actions de distribution (D) en USD de catégorie B	1,53		
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	1,79		
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	1,78		
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	1,93		
Actions de distribution (D) en USD de catégorie E	1,93		
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie E (couvertes)	1,93		
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	0,90		
Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	0,89		
Actions de distribution (D) en USD de catégorie X	0,82		
Actions de distribution (D) en GBP de catégorie X (couvertes)	0,82		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	0,65		
Actions de distribution (D) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	0,64		
Actions de distribution (M) en USD de catégorie S	0,45		
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie S (couvertes)	0,44		
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie A	1,45		
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A (G)	1,45		
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie L	1,95		
Actions de distribution (D) en USD de catégorie L (G)	1,95		
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,37		
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	1,37		
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	1,37		
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	1,37		
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	1,37		
Actions de capitalisation en CHF de catégorie A (couvertes)	1,37		
Actions de Distribution (M) Plus en CNH de Classe A (couvertes)	1,37		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	1,37		
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A	1,37		
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	1,37		
Classe de Capitalisation en SGD de Classe A (couvertes)	1,37		
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	1,37		
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A	1,37		
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	1,62		
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	1,87		
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	1,87		
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	1,97		
Actions de distribution (D) en USD de catégorie E	1,97		
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	0,97		
Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	0,97		
Actions de distribution (M) en USD de catégorie X	0,87		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	0,87		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,72		
Actions de distribution (M) en USD de catégorie Premier	0,71		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	0,72		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	0,72		
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie Premier	0,72		
Actions de Distribution (M) en EUR de Classe Premier	0,72		
Actions de Distribution (M) en GBP de Classe Premier	0,72		
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	0,12		
Actions de distribution (M) en USD de catégorie LM	0,12		
Actions de Distribution (M) en Euros de Classe LM (couvertes)	0,12		
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,11		
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	1,11		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	1,11		
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie A (couvertes)	1,10		
Actions de Capitalisation en SEK de Classe A (couvertes)	1,11		
Catégorie A (M) SEK de Distribution (couvertes)	0,96		
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	1,35		
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	1,61		
Actions de distribution (M) en USD de catégorie C	1,61		
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	1,71		
Actions de distribution (D) en USD de catégorie E	1,71		
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	0,71		
Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	0,71		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	0,62		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,46		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	0,46		
Actions de Distribution (M) en EUR de Classe Premier (couvertes)	0,46		
Parts de Capitalisation en GBP de Classe Premier (couvertes)	0,46		
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	0,46		
Actions de Distribution (M) Plus (e) en USD de Classe S	0,35		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	0,36		
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie S (couvertes)	0,36		
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie S (couvertes)	0,36		
Classe de Capitalisation en AUD de Classe LM (couvertes)	0,11		
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]			
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	1,20		
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	0,71		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,54		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	0,54		
Parts de Capitalisation en GBP de Classe Premier (couvertes)	0,55		
Actions de capitalisation en NZD de catégorie Premier (couvertes)	0,54		
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	0,45		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	0,43		
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	0,14		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM (couvertes)	0,14		
Actions de capitalisation en CAD de catégorie LM (couvertes)	0,14		
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,16		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	1,16		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	0,51		
Parts de Capitalisation en GBP de Classe Premier (couvertes)	0,51		
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	0,16		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM (couvertes)	0,16		
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,76		
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	1,76		
Actions de distribution (S) en USD de catégorie A	1,76		
Actions de capitalisation en AUD de catégorie A (couvertes)	1,76		
Actions de distribution (M) Plus (e) en AUD de catégorie A (couvertes)	1,76		
Actions de capitalisation en CHF de catégorie A (couvertes)	1,76		
Actions de capitalisation en CNH de catégorie A (couvertes)	1,76		
Actions de Distribution (M) Plus (e) en CNH de catégorie A (couvertes)	1,76		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	1,76		
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A	1,76		
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A (couvertes)	1,76		
Actions de Distribution (S) en EUR de Classe A (couvertes)	1,75		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie A	1,75		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie A (couvertes)	1,76		
Actions de Distribution (M) Plus (e) en GBP de Classe A (couvertes)	1,76		
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	1,75		
Actions de distribution (M) Plus (e) en HKD de catégorie A	1,78		
Actions de Capitalisation en SEK de Classe A (couvertes)	1,76		
Classe de Capitalisation en SGD de Classe A (couvertes)	1,75		
Actions de distribution (M) Plus (e) en SGD de catégorie A (couvertes)	1,76		
Actions de distribution (M) Plus (e) en SGD de catégorie A	1,75		
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	2,01		
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	2,26		
Actions de distribution (S) en USD de catégorie C	2,26		
Actions de distribution (M) Plus (e) en JPY de catégorie A	1,75		
Actions de capitalisation en NOK de catégorie A (couvertes)	1,75		
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	2,36		
Actions de distribution (S) en USD de catégorie E	2,36		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)	2,36		
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1,36		
Actions de distribution (S) en USD de catégorie F	1,36		
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	1,26		
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie X	1,26		
Actions de distribution (S) en USD de catégorie X	1,26		
Actions de Capitalisation en CHF de Classe X (couvertes)	1,26		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X	1,26		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	1,26		
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie X (couvertes)	1,26		
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie X (couvertes)	1,26		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie X	1,26		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)	1,26		
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie X (couvertes)	1,26		
Actions de capitalisation en SGD de catégorie X (couvertes)	1,25		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	1,11		
Actions de distribution (S) en USD de catégorie Premier	1,11		
Actions de capitalisation en AUD de catégorie Premier (couvertes)	1,11		
Actions de distribution (S) en AUD de catégorie Premier (couvertes)	1,12		
Classe de Capitalisation en BRL de Classe Premier (couvertes)	1,11		
Actions de capitalisation en CHF de catégorie Premier (couvertes)	1,11		
Actions de distribution (S) en CHF de catégorie Premier (couvertes)	1,11		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	1,11		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	1,11		
Actions de distribution (S) en EUR de catégorie Premier (couvertes)	1,10		
Parts de Capitalisation en GBP de Classe Premier (couvertes)	1,11		
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	1,11		
Actions de capitalisation en JPY de catégorie Premier (couvertes)	1,11		
Actions de capitalisation en PLN de catégorie Premier (couvertes)	1,10		
Actions de capitalisation en SEK de catégorie Premier (couvertes)	1,11		
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	0,72		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	0,70		
Actions de distribution (S) en AUD de catégorie LM (couvertes)	0,11		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	0,10		

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Informations supplémentaires – Total des frais sur encours (TFE) – (suite)

	Ratio des frais d'exploitation dans en UM (1) sur la moyenne de l'actif net quotidien du compartiment en UM (1) (%) Pour l'exercice clos le 28 février 2023**		Ratio des frais d'exploitation dans en UM (1) sur la moyenne de l'actif net quotidien du compartiment en UM (1) (%) Pour l'exercice clos le 28 février 2023**
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,53		
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	1,53		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	1,52		
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	2,05		
Actions de distribution (M) en CHF de catégorie X (couvertes)	0,90		
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	0,73		
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	0,53		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	0,53		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie S (couvertes)	0,53		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM (couvertes)	0,13		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM (couvertes)	0,13		
Actions de capitalisation en CAD de catégorie LM (couvertes)	0,13		
Actions de distribution (A) en CHF de catégorie S	0,53		
Actions de distribution (A) en CHF de catégorie S (couvertes)	0,52		
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]			
Actions de capitalisation en EUR de catégorie D (couvertes)	1,46		
Actions de distribution (M) en EUR de catégorie D (couvertes)	1,46		
Actions de capitalisation en USD de catégorie D	1,46		
Actions de distribution (M) en USD de catégorie D	1,46		
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie D	1,46		
Actions de capitalisation en CHF de catégorie M (couvertes)	0,86		
Actions de distribution (M) en USD de catégorie M	0,86		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie M (couvertes)	0,86		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,71		
Actions de distribution (Q) en USD de catégorie Premier	0,71		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	0,71		
Actions de distribution (Q) en EUR de catégorie Premier (couvertes)	0,71		
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	0,71		
Actions de capitalisation en JPY de catégorie Premier (couvertes)	0,71		
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	0,11		
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]			
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	1,25		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,39		
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	0,09		
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]			
Actions de capitalisation en GBP de catégorie A	1,10		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	0,56		
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie LM	0,15		
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,08		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,43		
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	0,35		
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie LM (couvertes)	0,13		
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund[^]			
Actions de distribution (Q) en USD de catégorie LM	s.o.		
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,15		
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	0,74		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,50		
Classe de Capitalisation en BRL de Classe Premier (couvertes)	0,50		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	0,50		
Parts de Capitalisation en GBP de Classe Premier (couvertes)	0,50		
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	0,40		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	0,40		
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,36		
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	1,36		
Actions de distribution (S) en USD de catégorie A	1,36		
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	1,36		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	1,36		
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A (couvertes)	1,36		
Actions de distribution (S) en EUR de catégorie A	1,36		
Actions de distribution (S) en EUR de catégorie A (couvertes) (IH)	1,36		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie A	1,36		
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie A (couvertes)	1,36		
Actions de distribution (S) en GBP de catégorie A (couvertes) (IH)	1,36		
Actions de capitalisation en SGD de catégorie A	1,36		
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	1,62		
Actions de distribution (S) en USD de catégorie B	1,61		
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	1,86		
Actions de distribution (S) en USD de catégorie C	1,86		
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	1,96		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes) (IH)	1,96		
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	0,96		
Actions de distribution (S) en USD de catégorie F	0,97		
Actions de distribution (S) en GBP de catégorie R (couvertes) (IH)	0,96		
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	0,87		
Actions de distribution (S) en USD de catégorie X	0,87		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	0,86		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes) (IH)	0,86		
Actions de distribution (S) en EUR de catégorie X (couvertes) (IH)	0,86		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie X	0,86		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)	0,87		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes) (IH)	0,86		
Actions de distribution (S) en GBP de catégorie X (couvertes)	0,86		
Actions de distribution (S) en GBP de catégorie X (couvertes) (IH)	0,86		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,71		
Actions de distribution (S) en USD de catégorie Premier	0,71		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	0,71		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	0,70		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes) (IH)	0,71		
Parts de Capitalisation en GBP de Classe Premier (couvertes)	0,72		
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	0,71		
Actions de distribution (S) en GBP de catégorie Premier (couvertes) (IH)	0,71		
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	0,11		
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM (couvertes) (IH)	0,11		
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,60		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	1,60		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	1,60		
Actions de capitalisation en SGD de catégorie A	1,62		
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	2,10		
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	2,21		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie E	2,20		
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1,20		
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	1,15		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)	1,15		
Actions de Distribution (M) en GBP de Classe X (couvertes)	1,15		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	1,00		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier	1,00		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	1,00		
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie Premier (couvertes)	1,00		
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	1,00		
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	0,10		
Classe de Capitalisation en AUD de Classe LM (couvertes)	0,11		
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,39		
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	1,39		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,75		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier (couvertes) (IH)	0,74		
Actions de capitalisation en CAD de catégorie S (couvertes) (IH)	0,57		
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,41		
Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	1,41		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	1,45		
Actions de capitalisation en SGD de catégorie A	1,41		
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	1,91		
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	2,01		
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1,01		
Actions de distribution (M) en USD de catégorie F	1,01		
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	0,91		
Actions de Distribution (M) en GBP de Classe X (couvertes)	0,91		
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie X (couvertes) (IH)	0,91		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,76		
Actions de distribution (M) en GBP de catégorie Premier (couvertes) (IH)	0,76		
Actions de capitalisation en NZD de catégorie Premier (couvertes) (IH)	0,76		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	0,11		
Actions de capitalisation en NZD de catégorie LM (couvertes) (IH)	0,11		

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Informations supplémentaires – Total des frais sur encours (TFE) (non audités) – (suite)

	Ratio des frais d'exploitation dans en UM (1) sur la moyenne de l'actif net quotidien du compartiment en UM (1) (%) Pour l'exercice clos le 28 février 2023**		Ratio des frais d'exploitation dans en UM (1) sur la moyenne de l'actif net quotidien du compartiment en UM (1) (%) Pour l'exercice clos le 28 février 2023**
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,36		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	1,36		
Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	1,36		
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	1,36		
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	1,36		
Actions de capitalisation en AUD de catégorie A (couvertes)	1,36		
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	1,36		
Actions de Distribution (M) Plus en CNH de Classe A (couvertes)	1,36		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	1,40		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	1,36		
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A (couvertes)	1,36		
Actions de distribution (M) Plus en EUR de catégorie A (couvertes)	1,36		
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A (couvertes)	1,36		
Actions de Distribution (M) Plus en GBP de catégorie A (couvertes)	1,36		
Actions de Distribution (M) Plus (e) en GBP de Classe A (couvertes)	1,36		
Actions de Capitalisation en HKD de Classe A	1,36		
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	1,36		
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	1,36		
Actions de distribution (M) Plus (e) en SGD de catégorie A (couvertes)	1,36		
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A	1,36		
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	1,86		
Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	1,86		
Actions de capitalisation en CZK de catégorie A (couvertes)	1,36		
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	1,96		
Actions de distribution (D) en USD de catégorie E	1,96		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)	1,96		
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	0,91		
Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	0,91		
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	0,79		
Actions de distribution (D) en USD de catégorie X	0,75		
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie X	0,79		
Actions de Capitalisation en CHF de Classe X (couvertes)	0,80		
Actions de distribution (A) en CHF de catégorie X (couvertes)	0,79		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X	0,79		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	0,79		
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie X (couvertes)	0,79		
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie X (couvertes)	0,79		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,64		
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie Premier	0,63		
Classe de Capitalisation en BRL de Classe Premier (couvertes)	0,64		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	0,64		
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie Premier (couvertes)	0,63		
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	0,60		
Actions de capitalisation en SEK de catégorie Premier (couvertes)	0,64		
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	0,46		
Actions de distribution (Q) Plus (e) en USD de catégorie S	0,46		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	0,46		
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie S (couvertes)	0,46		
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie S (couvertes)	0,46		
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	0,12		
Actions de distribution (M) en USD de catégorie LM	0,11		
Actions de Distribution (M) Plus (e) en EUR de Classe LM (couvertes)	0,11		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM (couvertes)	0,11		
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,95		
Actions de distribution (M) en USD de catégorie X	1,45		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	1,30		
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	0,15		
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]			
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	1,35		
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie S (couvertes) (IH)	0,55		
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	2,29		
Classe de Capitalisation en SGD de Classe A (couvertes)	2,29		
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie X (couvertes)	1,45		
Classe de Capitalisation en AUD de Classe LM (couvertes)	0,14		
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]			
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	1,40		
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	0,60		
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie S (couvertes)	0,60		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie S (couvertes)	0,60		
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,70		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,75		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	0,75		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	0,50		
FTGF ClearBridge Value Fund			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,80		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	1,80		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	1,80		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	1,81		
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A (couvertes)	1,80		
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie A	1,80		
Actions de capitalisation en SGD de catégorie A	1,80		
Classe de Capitalisation en SGD de Classe A (couvertes)	1,80		
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	2,30		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	2,30		
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	2,55		
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1,20		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie F	1,20		
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	1,13		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie X	1,12		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X	1,13		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,78		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier	0,78		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	0,78		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	0,78		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie LM	0,10		
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,73		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	1,73		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	1,76		
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	2,23		
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	2,23		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	2,23		
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	2,50		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie E	2,50		
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1,15		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie F	1,15		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie X	1,13		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X	1,12		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,79		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier	0,78		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	0,78		
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	0,15		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	0,15		
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie A	1,40		
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie B	2,35		
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie L	1,90		
Actions de capitalisation en USD de catégorie GA	1,57		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GA	1,57		
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie GA	1,57		
Actions de capitalisation en USD de Classe GE	2,32		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GE	2,33		
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,71		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	1,71		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	1,71		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	1,71		
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	2,21		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie B	2,21		
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	2,21		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	2,21		
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	2,46		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie E	2,46		
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1,11		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie F	1,11		
Actions de capitalisation en USD de catégorie U	0,64		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie U	0,64		
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	1,09		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X	1,09		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	1,09		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie X	1,09		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,74		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier	0,74		
Classe de Capitalisation en BRL de Classe Premier (couvertes)	0,74		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	0,74		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	0,74		
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie Premier	0,74		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	0,74		
Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	0,11		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	0,11		
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie A	1,36		
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie L	1,86		
Actions de capitalisation en USD de catégorie GA	1,53		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GA	1,53		

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Informations supplémentaires – Total des frais sur encours (TFE) – (suite)

	Ratio des frais d'exploitation dans en UM (1) sur la moyenne de l'actif net quotidien du compartiment en UM (1) (%) Pour l'exercice clos le 28 février 2023**		Ratio des frais d'exploitation dans en UM (1) sur la moyenne de l'actif net quotidien du compartiment en UM (1) (%) Pour l'exercice clos le 28 février 2023**
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]	
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,75	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,80
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	1,75	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,80
Actions de capitalisation en AUD de catégorie A (couvertes)	1,75		
Actions de capitalisation en CHF de catégorie A (couvertes)	1,75	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]	
Actions de capitalisation en CNH de catégorie A (couvertes)	1,75	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,95
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	1,75	Actions de capitalisation en USD de catégorie A (couvertes)	1,95
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	1,75	Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A (couvertes)	1,95
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A (couvertes)	1,75	Actions de distribution (Q) en USD de catégorie A	1,95
Actions de capitalisation en GBP de catégorie A	1,75	Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	1,95
Actions de Capitalisation en HKD de Classe A	1,75	Actions de Distribution (M) Plus en CNH de Classe A (couvertes)	1,95
Actions de Capitalisation en SEK de Classe A (couvertes)	1,75	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	1,95
Classe de Capitalisation en SGD de Classe A (couvertes)	1,75	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes) (PH)	1,95
Actions de distribution (A) en USD de catégorie B	2,25	Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A	1,95
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	2,25	Actions de distribution (M) Plus en EUR de catégorie A	1,95
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	2,25	Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	1,95
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	2,50	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	2,45
Actions de distribution (A) en USD de catégorie E	2,50	Actions de capitalisation en USD de catégorie C (couvertes)	2,45
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E	2,50	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	2,70
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)	2,50	Actions de capitalisation en USD de catégorie E (couvertes)	2,70
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1,15	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1,35
Actions de distribution (A) en USD de catégorie F	1,15	Actions de capitalisation en USD de catégorie F (couvertes)	1,35
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	1,10	Actions de capitalisation en USD de catégorie X	1,05
Actions de distribution (A) en USD de catégorie X	1,10	Actions de distribution (A) en USD de catégorie X	1,05
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X	1,10	Actions de capitalisation en EUR de catégorie X	1,05
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	1,10	Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes) (PH)	1,05
Actions de capitalisation en GBP de catégorie X	1,10	Actions de distribution (Q) en GBP de catégorie X	1,05
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,75	Actions de distribution (Q) en GBP de catégorie X (couvertes)	1,05
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	0,75	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,85
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	0,75	Classe de Capitalisation en BRL de Classe Premier (couvertes)	0,85
Parts de Capitalisation en GBP de Classe Premier (couvertes)	0,75	Actions de distribution (Q) Plus (e) en CAD de catégorie Premier (PH) (couvertes)	0,85
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie Premier	0,75	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	0,85
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	0,10	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes) (PH)	0,85
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie A	1,40	Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	0,85
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie B	1,90	Actions de distribution (A) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes) (PH)	0,85
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie L	1,90	Actions de distribution (Q) en GBP de catégorie Premier	0,85
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GA	1,52		
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie GA	1,52	FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	
Actions de capitalisation en USD de Classe GE	2,27	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,96
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GE	2,27	Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	1,96
		Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	1,95
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	1,96
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,75	Actions de Distribution (M) Plus en CNH de Classe A (couvertes)	1,96
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	1,75	Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A	1,97
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	1,75	Actions de distribution (M) Plus en EUR de catégorie A (couvertes)	1,96
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	1,75	Actions de Distribution (M) Plus en GBP de catégorie A (couvertes)	1,96
Actions de distribution (Q) en USD de catégorie A	1,75	Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	1,95
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	1,75	Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	1,96
Actions de Distribution (M) Plus en CNH de Classe A (couvertes)	1,75	Actions de capitalisation en USD de catégorie U	0,75
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	1,75	Actions de capitalisation en EUR de catégorie U	0,75
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	1,75	Actions de distribution (Q) Plus (e) en EUR de catégorie U	0,75
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A (couvertes)	1,75	Actions de capitalisation en GBP de catégorie U	0,75
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	1,75	Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie X	1,20
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	1,75	Actions de distribution (M) en EUR de catégorie X (couvertes)	1,21
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	2,25	Actions de Distribution (Q) Plus (e) en EUR de Classe X (couvertes)	1,21
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	2,25	Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie X (couvertes)	1,21
Actions de distribution (Q) en USD de catégorie C	2,25	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,85
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1,15	Actions de distribution (M) en USD de catégorie Premier	0,85
Actions de capitalisation en EUR de catégorie F	1,15	Actions de Distribution (M) en EUR de Classe Premier (couvertes)	0,88
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie F	1,15	Actions de capitalisation en USD de catégorie S	0,51
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie X (couvertes)	1,13	Actions de distribution USD catégorie S (M) Plus	0,50
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,65		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	1,65		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	1,66		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	1,65		
Actions de capitalisation en SEK de catégorie A	1,50		
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1,05		
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	1,05		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie X	1,05		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X	1,05		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	1,05		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie X	1,05		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)	1,05		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,70		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier	0,70		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	0,75		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	0,70		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	0,70		
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	0,50		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S	0,50		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	0,50		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie S	0,50		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie S (couvertes)	0,50		
Actions de distribution (Q) en GBP de catégorie S	0,50		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	0,10		

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Informations supplémentaires – Total des frais sur encours (TFE) (non audités) – (suite)

	Ratio des frais d'exploitation dans en UM (1) sur la moyenne de l'actif net quotidien du compartiment en UM (1) (%) Pour l'exercice clos le 28 février 2023**		Ratio des frais d'exploitation dans en UM (1) sur la moyenne de l'actif net quotidien du compartiment en UM (1) (%) Pour l'exercice clos le 28 février 2023**
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,97		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	1,97		
Actions de capitalisation en AUD de catégorie A (couvertes)	1,97		
Actions de capitalisation en CNH de catégorie A (couvertes)	1,97		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	1,97		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	1,97		
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A (couvertes)	1,97		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie A (couvertes)	1,97		
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie A	1,97		
Actions de Capitalisation en SEK de Classe A (couvertes)	1,97		
Actions de capitalisation en SGD de catégorie A	1,97		
Classe de Capitalisation en SGD de Classe A (couvertes)	1,97		
Actions de capitalisation en USD de catégorie B	2,47		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie B	2,47		
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	2,47		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	2,47		
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	2,72		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie E	2,72		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E	2,72		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)	2,72		
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1,37		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie F	1,37		
Actions de capitalisation en USD de catégorie R	0,91		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie R	1,47		
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	1,21		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie X	1,22		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X	1,22		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	1,22		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie X	1,22		
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie X	1,22		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,87		
Classe de Capitalisation en BRL de Classe Premier (couvertes)	0,87		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	0,87		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	0,86		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	0,87		
Actions de capitalisation en PLN de catégorie Premier (couvertes)	0,87		
FTGF Royce US Smaller Companies Fund			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	2,00		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	2,03		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	2,03		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	2,03		
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A	2,03		
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie A	2,03		
Actions de Capitalisation en SEK de Classe A (couvertes)	2,02		
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	2,50		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	2,53		
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	2,78		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie E	2,79		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie E	2,78		
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1,43		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie F	1,43		
Actions de capitalisation en USD de catégorie R	1,53		
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	1,27		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie X	1,30		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,93		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier	0,93		
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie Premier	0,93		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	0,18		
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie A	1,43		
Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie L	1,93		
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	2,00		
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	1,23		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie X	1,24		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,90		
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,84		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	1,84		
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	1,84		
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	1,84		
Actions de Distribution (M) Plus en CNH de Classe A (couvertes)	1,84		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	1,84		
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	1,84		
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	1,84		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie B	2,34		
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	2,34		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	2,34		
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	2,82		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie E	2,82		
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1,44		
Actions de capitalisation en PLN de catégorie Premier (couvertes)	0,89		
Actions de capitalisation en USD de catégorie GA	1,98		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie GA	1,98		
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie GA	2,00		
Actions de capitalisation en USD de Classe GE	2,73		
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^]			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,99		
Actions de distribution (A) en GBP de catégorie M	1,18		
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1,40		
Actions de distribution (A) en USD de catégorie M	1,18		
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie M	1,18		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,78		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	0,78		
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1,98		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	1,98		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	1,98		
Actions de capitalisation en USD de catégorie C	2,48		
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	2,73		
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1,38		
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	1,23		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X	1,23		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie X	1,23		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)	1,23		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,88		
Parts de Capitalisation en GBP de Classe Premier (couvertes)	0,88		
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	0,53		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	0,53		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie S	0,53		
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund			
Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	2,00		
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A	2,00		
Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A	2,00		
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A	2,00		
Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie D (couvertes)	1,60		
Actions de distribution (M) Plus en CNH de catégorie D (couvertes)	1,60		
Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie D	1,60		
Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie D (couvertes)	1,60		
Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie D	1,60		
Actions de capitalisation en USD de catégorie D	1,60		
Actions de Capitalisation en AUD de Classe X	1,25		
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	1,25		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie S	0,59		
Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie S	0,59		
Actions de Capitalisation en AUD de Classe LM	0,15		
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A	2,00		
Actions de capitalisation en USD de catégorie E	2,75		
Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1,40		
Actions de capitalisation en USD de catégorie X	1,25		
Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	0,90		
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	0,70		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S	0,70		
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]			
Actions de capitalisation en USD de catégorie A (couvertes)	1,97		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	1,96		
Actions de capitalisation en USD de catégorie E (couvertes)	2,72		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X	1,22		
Classe de Capitalisation en BRL de Classe Premier (couvertes)	0,87		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	0,85		
Actions de capitalisation en USD de catégorie S	0,50		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie S	0,47		
Actions de capitalisation en GBP de catégorie S	0,47		
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]			
Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	0,75		
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A	0,75		
Actions de distribution (A) Plus en EUR de catégorie A	0,75		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie D	1,30		
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie D	1,30		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie K	0,95		
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie K	0,95		
Actions de capitalisation en EUR de catégorie X	0,35		
Actions de distribution (A) en EUR de catégorie X	0,35		

La méthode de calcul du total des frais sur encours (TFE) est décrite sur le site Web de l'Asset Management Association Switzerland (AMAS) (www.am-switzerland.ch).

(1) UM = unités monétaires dans la devise comptable du compartiment

** Annualisé pour les périodes inférieures à un an

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Informations complémentaires – Données sur la performance des fonds (non auditées)

Fonds	Catégories d'actions	Date d'entrée en vigueur	Catégorie CCY	YTD fiscal 01/03/22-28/02/22	Calendrier 01/01/22-31/12/22	Cumulatif 3 ans 01/01/20-31/12/22	Performance sur 10 ans 01/03/13-28/02/23
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	5/08/2007	USD	1,78 %	1,18 %	1,39 %	5,60 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	27/02/2004	USD	1,78 %	1,16 %	1,37 %	5,67 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie B	15/11/2007	USD	1,45 %	0,92 %	1,05 %	3,83 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	15/11/2007	USD	1,27 %	0,78 %	0,84 %	2,96 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	27/02/2004	USD	1,27 %	0,77 %	0,83 %	3,05 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie X	10/10/2018	USD	1,94 %	1,29 %	1,56 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)	20/04/2007	USD	1,78 %	1,17 %	1,39 %	5,61 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie A (G)	20/04/2007	USD	1,78 %	1,16 %	1,37 %	5,59 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie L (G)	20/04/2007	USD	1,79 %	1,18 %	1,41 %	5,62 %
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	5/09/2007	USD	(11,77) %	(16,69) %	(12,39) %	7,44 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	30/08/2002	USD	(11,78) %	(16,71) %	(12,39) %	6,92 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	15/11/2007	USD	(12,21) %	(17,11) %	(13,70) %	2,21 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	24/02/2004	USD	(12,21) %	(17,12) %	(13,67) %	1,72 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	16/08/2019	USD	(12,36) %	(17,24) %	(14,00) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	8/09/2013	USD	(11,46) %	(16,36) %	(11,07) %	–
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	27/02/2017	USD	(11,45) %	(16,37) %	(11,03) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie X	13/05/2016	USD	(11,33) %	(16,28) %	(11,11) %	–
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie X	5/03/2016	USD	(11,32) %	(16,28) %	(11,11) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	19/04/2017	USD	(11,24) %	(16,16) %	(10,40) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	4/08/2021	USD	(10,97) %	(15,91) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie GA	27/08/2010	USD	(11,70) %	(16,59) %	(11,79) %	9,77 %
	Actions de capitalisation en USD de Classe GE	27/08/2010	USD	(12,22) %	(17,09) %	(13,36) %	3,37 %
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	20/04/2007	USD	(12,98) %	(18,10) %	(13,83) %	6,11 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	20/04/2007	USD	(12,98) %	(18,11) %	(13,81) %	6,11 %
	Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	19/02/2016	USD	(12,98) %	(18,11) %	(13,82) %	–
	Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	19/02/2016	AUD	(14,21) %	(19,04) %	(15,98) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	6/12/2018	EUR	(15,27) %	(19,99) %	(17,89) %	–
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie B	20/04/2007	USD	(13,33) %	(18,44) %	(14,50) %	3,41 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	15/11/2007	USD	(13,41) %	(18,51) %	(15,11) %	0,94 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	20/04/2007	USD	(13,41) %	(18,52) %	(15,10) %	0,94 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	2/03/2012	USD	(13,51) %	(18,60) %	(15,37) %	(0,11) %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	4/05/2013	USD	(12,45) %	(17,58) %	(11,96) %	–
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	31/10/2018	USD	(12,45) %	(17,59) %	(11,94) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie X	20/03/2015	USD	(12,39) %	(17,56) %	(12,25) %	–
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie X	28/11/2017	USD	(12,40) %	(17,56) %	(12,22) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	10/10/2019	EUR	(14,77) %	(19,52) %	(16,49) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	14/09/2010	USD	(12,23) %	(17,38) %	(11,30) %	17,07 %
	Actions de distribution (M) en USD de catégorie Premier	29/09/2011	USD	(12,23) %	(17,37) %	(11,37) %	16,97 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	3/02/2016	EUR	(14,51) %	(19,24) %	(15,47) %	–
	Actions de distribution (M) en USD de catégorie LM	13/08/2021	USD	(11,97) %	(17,13) %	–	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	4/05/2016	EUR	(6,68) %	(11,87) %	(6,24) %	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM (couvertes)	19/11/2010	GBP	(13,07) %	(18,03) %	(12,66) %	12,03 %
	Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie A	20/04/2007	USD	(12,97) %	(18,08) %	(13,53) %	7,52 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie A (G)	20/04/2007	USD	(12,96) %	(18,08) %	(13,52) %	7,48 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie B (G)	20/04/2007	USD	(13,42) %	(18,48) %	(14,75) %	2,48 %
	Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie L	20/04/2007	USD	(13,41) %	(18,48) %	(14,82) %	2,28 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie L (G)	20/04/2007	USD	(13,40) %	(18,48) %	(14,80) %	2,25 %
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	24/02/2004	USD	(20,49) %	(23,31) %	(20,66) %	(21,51) %
	Actions de distribution (D) en EUR de catégorie A	30/09/2003	EUR	(15,65) %	(18,38) %	(16,82) %	(0,24) %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	24/02/2004	USD	(20,83) %	(23,64) %	(21,71) %	(22,66) %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	3/01/2019	EUR	(15,09) %	(17,80) %	(14,79) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	5/02/2017	EUR	(14,84) %	(17,55) %	(14,02) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie GA	27/08/2010	EUR	(15,53) %	(18,22) %	(16,11) %	2,90 %
	Actions de distribution (A) en EUR de catégorie GA	27/08/2010	EUR	(15,53) %	(18,22) %	(16,11) %	2,90 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie GE	27/08/2010	EUR	(16,04) %	(18,71) %	(17,61) %	(3,09) %
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	5/09/2007	USD	(6,70) %	(11,73) %	(7,81) %	11,25 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	30/08/2002	USD	(6,70) %	(11,74) %	(7,81) %	11,11 %
	Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	19/02/2008	USD	(6,70) %	(11,74) %	(7,81) %	11,22 %
	Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	19/01/2017	USD	(6,69) %	(11,73) %	(7,80) %	–
	Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	19/01/2017	AUD	(7,79) %	(12,57) %	(10,26) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	2/12/2008	EUR	(9,03) %	(13,67) %	(12,09) %	(4,41) %
	Actions de distribution (M) en EUR de catégorie A (couvertes)	28/04/2008	EUR	(9,02) %	(13,66) %	(12,10) %	(4,42) %
	Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A (couvertes)	4/02/2013	EUR	(9,05) %	(13,69) %	(12,13) %	–
	Actions de distribution (M) en GBP de catégorie A (couvertes)	29/05/2008	GBP	(7,59) %	(12,40) %	(9,86) %	3,88 %
	Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	9/07/2017	HKD	(6,25) %	(11,61) %	(7,63) %	–
	Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	26/05/2009	SGD	(7,01) %	(11,89) %	(8,49) %	8,56 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie B	24/02/2004	USD	(6,93) %	(11,95) %	(8,50) %	8,37 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	15/11/2007	USD	(7,16) %	(12,18) %	(9,19) %	5,82 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	24/02/2004	USD	(7,16) %	(12,18) %	(9,18) %	5,69 %

Informations complémentaires – Données sur la performance des fonds (non auditées) – (suite)

Fonds	Catégories d'actions	Date d'entrée en vigueur	Catégorie CCY	YTD fiscal 01/03/22-28/02/22	Calendrier 01/01/22-31/12/22	Cumulatif 3 ans 01/01/20-31/12/22	Performance sur 10 ans 01/03/13-28/02/23
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – (suite)	Actions de Distribution (M) Plus en ZAR de Classe A (couvertes)	26/04/2018	ZAR	(3,77) %	(8,75) %	2,84 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	21/01/2010	USD	(7,26) %	(12,27) %	(9,46) %	4,75 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie E	21/01/2010	USD	(7,25) %	(12,26) %	(9,45) %	4,62 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)	19/05/2011	EUR	(9,57) %	(14,17) %	(13,66) %	(9,95) %
	Actions de distribution (M) en EUR de catégorie E (couvertes)	8/02/2013	EUR	(9,56) %	(14,17) %	(13,67) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	2/04/2010	USD	(6,14) %	(11,20) %	(6,13) %	18,12 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	21/01/2010	USD	(6,12) %	(11,20) %	(6,14) %	17,94 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie X	7/03/2013	USD	(6,19) %	(11,26) %	(6,24) %	–
	Actions de distribution (D) en GBP de catégorie X (couvertes)	27/06/2016	GBP	(7,09) %	(11,96) %	(8,39) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	9/10/2008	USD	(5,91) %	(10,98) %	(5,43) %	21,10 %
	Actions de distribution (M) en USD de catégorie Premier	2/06/2009	USD	(5,89) %	(10,97) %	(5,42) %	21,12 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	17/12/2009	EUR	(8,33) %	(13,00) %	(9,89) %	4,25 %
	Actions de distribution (M) en EUR de catégorie Premier (couvertes)	23/11/2012	EUR	(8,26) %	(12,95) %	(9,83) %	4,01 %
	Actions de distribution (M) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	18/04/2008	GBP	(6,80) %	(11,67) %	(7,54) %	12,43 %
	Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	2/05/2013	GBP	(6,78) %	(11,65) %	(7,56) %	13,50 %
	Actions de capitalisation en PLN de catégorie Premier (couvertes)	10/08/2015	PLN	(2,22) %	(7,59) %	(2,74) %	–
	Actions de distribution (M) en AUD de catégorie LM (couvertes)	12/03/2010	AUD	(6,69) %	(11,50) %	(6,76) %	30,77 %
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM (couvertes)	12/03/2010	GBP	(6,45) %	(11,34) %	(6,40) %	17,44 %
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	5/09/2007	USD	(7,98) %	(13,85) %	(3,82) %	28,78 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	27/02/2004	USD	(7,96) %	(13,84) %	(3,83) %	28,61 %
	Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	20/12/2010	USD	(7,98) %	(13,85) %	(3,82) %	28,77 %
	Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	21/11/2012	USD	(7,98) %	(13,85) %	(3,83) %	28,78 %
	Actions de distribution (M) en EUR de catégorie A (couvertes)	19/12/2012	EUR	(10,33) %	(15,78) %	(8,33) %	10,88 %
	Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	31/01/2013	SGD	(8,44) %	(14,11) %	(4,67) %	25,68 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie B	27/02/2004	USD	(8,21) %	(14,07) %	(4,59) %	25,39 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	15/11/2007	USD	(8,44) %	(14,27) %	(5,25) %	22,51 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	27/02/2004	USD	(8,42) %	(14,27) %	(5,29) %	22,26 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	21/01/2010	USD	(8,54) %	(14,36) %	(5,54) %	21,26 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie E	21/01/2010	USD	(8,56) %	(14,36) %	(5,58) %	21,09 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)	25/09/2019	EUR	(10,82) %	(16,24) %	(9,88) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1/04/2011	USD	(7,60) %	(13,46) %	(2,22) %	36,56 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	1/04/2011	USD	(7,58) %	(13,43) %	(2,43) %	48,08 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	11/08/2010	USD	(7,36) %	(13,24) %	(1,48) %	39,94 %
	Parts de Capitalisation en GBP de Classe Premier (couvertes)	8/09/2019	GBP	(8,14) %	(13,83) %	(3,70) %	–
	Actions de distribution (M) en USD de catégorie LM	27/05/2008	USD	(6,94) %	(12,84) %	(0,13) %	46,40 %
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM (couvertes)	6/12/2020	GBP	(7,96) %	(13,64) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)	20/04/2007	USD	(8,01) %	(13,85) %	(3,54) %	30,47 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie A (G)	20/04/2007	USD	(7,99) %	(13,84) %	(3,57) %	30,22 %
	Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie L	20/04/2007	USD	(8,47) %	(14,28) %	(4,97) %	24,11 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie L (G)	20/04/2007	USD	(8,46) %	(14,28) %	(5,00) %	23,87 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie GF	19/11/2010	USD	(7,83) %	(13,67) %	(2,95) %	33,12 %
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	20/04/2007	USD	(8,25) %	(15,03) %	(8,91) %	15,32 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	20/04/2007	USD	(8,23) %	(15,02) %	(8,78) %	15,34 %
	Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	30/01/2008	USD	(8,26) %	(15,03) %	(8,93) %	15,24 %
	Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	21/11/2012	USD	(8,26) %	(15,03) %	(8,92) %	15,25 %
	Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	28/06/2010	AUD	(9,56) %	(16,04) %	(11,68) %	19,27 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	23/05/2017	EUR	(2,77) %	(9,67) %	(4,58) %	–
	Actions de distribution (D) en EUR de catégorie A (couvertes)	25/09/2012	EUR	(10,61) %	(16,95) %	(13,15) %	(0,97) %
	Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	18/01/2011	SGD	(8,73) %	(15,33) %	(9,84) %	12,20 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie B	20/04/2007	USD	(8,45) %	(15,21) %	(9,45) %	12,47 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	15/11/2007	USD	(8,71) %	(15,46) %	(10,28) %	9,70 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	20/04/2007	USD	(8,70) %	(15,45) %	(10,16) %	9,71 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	21/01/2010	USD	(8,85) %	(15,58) %	(10,60) %	8,47 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie E	21/01/2010	USD	(8,84) %	(15,57) %	(10,47) %	8,45 %
	Actions de distribution (M) en EUR de catégorie E (couvertes)	8/02/2013	EUR	(11,27) %	(17,57) %	(14,90) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1/04/2011	USD	(7,90) %	(14,67) %	(7,25) %	23,27 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	1/04/2011	USD	(7,90) %	(14,68) %	(7,13) %	23,02 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie X	21/03/2018	USD	(7,82) %	(14,59) %	(7,13) %	–
	Actions de distribution (D) en GBP de catégorie X (couvertes)	15/01/2013	GBP	(8,87) %	(15,40) %	(9,45) %	13,79 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	10/12/2012	EUR	(10,11) %	(16,44) %	(11,01) %	8,51 %
	Actions de distribution (D) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	8/12/2011	GBP	(8,72) %	(15,24) %	(8,71) %	16,88 %

Informations complémentaires – Données sur la performance des fonds (non auditées) – (suite)

Fonds	Catégories d'actions	Date d'entrée en vigueur	Catégorie CCY	YTD fiscal 01/03/22-28/02/22	Calendrier 01/01/22-31/12/22	Cumulatif 3 ans 01/01/20-31/12/22	Performance sur 10 ans 01/03/13-28/02/23
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – (suite)	Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie A	20/04/2007	USD	(8,41) %	(15,13) %	(8,76) %	16,61 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie A (G)	20/04/2007	USD	(8,40) %	(15,12) %	(8,64) %	16,58 %
	Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie L	20/04/2007	USD	(8,87) %	(15,56) %	(10,12) %	10,93 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie L (G)	20/04/2007	USD	(8,84) %	(15,53) %	(10,00) %	10,97 %
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	7/02/2008	USD	(8,27) %	(9,70) %	(6,98) %	2,71 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	7/02/2008	USD	(8,26) %	(9,70) %	(6,99) %	2,55 %
	Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	1/07/2010	USD	(8,27) %	(9,69) %	(6,97) %	2,70 %
	Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	21/11/2012	USD	(8,26) %	(9,69) %	(6,97) %	2,71 %
	Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	28/09/2011	AUD	(9,28) %	(10,43) %	(8,64) %	7,00 %
	Actions de capitalisation en CHF de catégorie A (couvertes)	26/01/2015	CHF	(11,10) %	(12,04) %	(12,01) %	–
	Actions de distribution (M) Plus en CNH de catégorie A (couvertes)	20/06/2013	CNH	(8,86) %	(9,60) %	(3,28) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	7/02/2008	EUR	(2,67) %	(3,89) %	(2,51) %	26,80 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	19/05/2011	EUR	(10,51) %	(11,62) %	(11,16) %	(11,91) %
	Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A	4/01/2011	EUR	(2,76) %	(3,95) %	(2,50) %	24,24 %
	Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	27/10/2015	HKD	(7,88) %	(9,61) %	(6,90) %	–
	Actions de capitalisation en SGD de catégorie A (couvertes)	19/05/2009	SGD	(8,60) %	(9,90) %	(7,55) %	(0,07) %
	Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	18/01/2011	SGD	(8,62) %	(9,85) %	(7,46) %	(0,29) %
	Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A	8/04/2010	SGD	(8,73) %	(10,21) %	(7,67) %	11,15 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie B	7/02/2008	USD	(8,50) %	(9,92) %	(7,67) %	0,16 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	7/02/2008	USD	(8,73) %	(10,15) %	(8,36) %	(2,30) %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	7/02/2008	USD	(8,72) %	(10,15) %	(8,38) %	(2,44) %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	21/01/2010	USD	(8,81) %	(10,23) %	(8,63) %	(3,27) %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie E	21/01/2010	USD	(8,81) %	(10,23) %	(8,64) %	(3,42) %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	2/04/2010	USD	(7,90) %	(9,33) %	(5,85) %	6,90 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	21/01/2010	USD	(7,90) %	(9,32) %	(5,84) %	6,84 %
	Actions de distribution (M) en USD de catégorie X	5/07/2015	USD	(7,81) %	(9,25) %	(5,57) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	9/11/2020	EUR	(10,03) %	(11,15) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	7/02/2008	USD	(7,67) %	(9,11) %	(5,14) %	9,60 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	9/03/2010	EUR	(2,12) %	(3,33) %	(0,63) %	34,93 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	3/10/2011	EUR	(9,89) %	(11,01) %	(9,34) %	(5,84) %
	Actions de distribution (A) en EUR de catégorie Premier	1/09/2013	EUR	(2,14) %	(3,35) %	(0,62) %	35,03 %
	Actions de distribution (M) en EUR de catégorie Premier	9/08/2010	EUR	(2,13) %	(3,32) %	(0,60) %	35,42 %
	Actions de distribution (M) en GBP de catégorie Premier	16/07/2010	GBP	3,00 %	1,80 %	4,19 %	38,59 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	6/12/2008	USD	(7,12) %	(8,56) %	(3,41) %	16,38 %
	Actions de distribution (M) en EUR de catégorie LM (couvertes)	27/07/2021	EUR	(9,34) %	(10,43) %	–	–
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	25/06/2009	USD	(4,42) %	(6,67) %	(4,48) %	3,62 %
	Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	6/02/2009	USD	(4,42) %	(6,67) %	(4,48) %	3,66 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	30/01/2014	EUR	(6,71) %	(8,62) %	(8,60) %	–
	Actions de capitalisation en SEK de catégorie A (couvertes)	23/06/2020	SEK	(6,25) %	(8,17) %	–	–
	Catégorie A (M) SEK de Distribution (couvertes)	23/06/2020	SEK	(5,88) %	(7,79) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	25/06/2009	USD	(4,90) %	(7,14) %	(5,91) %	(1,41) %
	Actions de distribution (M) en USD de catégorie C	25/06/2009	USD	(4,90) %	(7,14) %	(5,92) %	(1,42) %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	21/01/2010	USD	(4,99) %	(7,23) %	(6,20) %	(2,29) %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie E	21/01/2010	USD	(4,99) %	(7,23) %	(6,20) %	(2,39) %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	2/04/2010	USD	(4,04) %	(6,30) %	(3,33) %	8,22 %
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	22/06/2020	USD	(4,04) %	(6,31) %	–	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	17/06/2020	EUR	(6,28) %	(8,18) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	6/02/2009	USD	(3,80) %	(6,06) %	(2,61) %	10,83 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	3/01/2019	EUR	(6,11) %	(8,02) %	(6,79) %	–
	Actions de distribution (M) en EUR de catégorie Premier (couvertes)	6/02/2009	EUR	(5,93) %	(8,04) %	(6,86) %	(4,43) %
	Parts de Capitalisation en GBP de Classe Premier (couvertes)	6/02/2009	GBP	(4,64) %	(6,68) %	(4,29) %	3,73 %
	Actions de distribution (M) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	6/02/2009	GBP	(4,69) %	(6,74) %	(4,34) %	3,92 %
	Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie S	15/12/2017	USD	(3,70) %	(5,97) %	(2,31) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	15/10/2021	EUR	(6,07) %	(7,96) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie S (couvertes)	12/12/2017	EUR	(6,03) %	(7,93) %	(6,55) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie S (couvertes)	12/12/2017	GBP	(4,56) %	(6,61) %	(4,02) %	–
	Classe de Capitalisation en AUD de Classe LM (couvertes)	24/08/2021	AUD	(4,52) %	(6,51) %	–	–

Informations complémentaires – Données sur la performance des fonds (non auditées) – (suite)

Fonds	Catégories d'actions	Date d'entrée en vigueur	Catégorie CCY	YTD fiscal 01/03/22-28/02/22	Calendrier 01/01/22-31/12/22	Cumulatif 3 ans 01/01/20-31/12/22	Performance sur 10 ans 01/03/13-28/02/23
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	3/05/2015	USD	(10,39) %	(14,35) %	(11,01) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie X	17/02/2015	USD	(10,26) %	(14,21) %	(10,13) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	12/03/2010	USD	(10,10) %	(14,04) %	(9,42) %	19,44 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	27/06/2014	EUR	(12,36) %	(15,92) %	(13,53) %	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier (couvertes)	12/09/2021	GBP	(10,94) %	(14,68) %	–	–
	Actions de capitalisation en NZD de catégorie Premier (couvertes)	12/12/2017	NZD	(10,56) %	(14,30) %	(10,25) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	28/03/2019	USD	(9,74) %	(13,70) %	(8,33) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM (couvertes)	27/07/2021	EUR	(11,99) %	(15,57) %	–	–
	Actions de capitalisation en CAD de catégorie LM (couvertes)	17/10/2018	CAD	(10,02) %	(13,91) %	(9,14) %	–
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	15/11/2011	USD	(10,40) %	(16,72) %	(10,31) %	14,56 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	15/11/2011	EUR	(12,69) %	(18,57) %	(14,46) %	(1,66) %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	11/03/2021	EUR	(12,11) %	(18,03) %	–	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier (couvertes)	11/03/2021	GBP	(10,78) %	(16,92) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	27/01/2011	USD	(9,49) %	(15,88) %	(7,22) %	28,85 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM (couvertes)	15/01/2021	EUR	(11,78) %	(17,74) %	–	–
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	29/11/2013	USD	(9,72) %	(22,16) %	(18,22) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	8/01/2014	USD	(9,72) %	(22,15) %	(18,21) %	–
	Actions de distribution (S) en USD de catégorie A	4/08/2014	USD	(9,72) %	(22,16) %	(18,22) %	–
	Actions de capitalisation en AUD de catégorie A (couvertes)	16/10/2017	AUD	(11,09) %	(23,15) %	(20,83) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en AUD de catégorie A (couvertes)	27/02/2015	AUD	(11,12) %	(23,17) %	(20,87) %	–
	Actions de capitalisation en CHF de catégorie A (couvertes)	14/02/2014	CHF	(12,77) %	(24,38) %	(23,00) %	–
	Actions de capitalisation en CNH de catégorie A (couvertes)	19/09/2014	CNH	(10,30) %	(22,05) %	(15,04) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en CNH de catégorie A (couvertes)	12/03/2014	CNH	(10,32) %	(22,05) %	(15,06) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	14/02/2014	EUR	(12,22) %	(24,09) %	(22,29) %	–
	Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A	4/07/2015	EUR	(4,30) %	(17,22) %	(14,44) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A (couvertes)	15/03/2019	EUR	(12,23) %	(24,10) %	(22,30) %	–
	Actions de distribution (S) en EUR de catégorie A (couvertes)	4/07/2016	EUR	(12,20) %	(24,07) %	(22,30) %	–
	Classe de capitalisation en GBP de catégorie A	23/12/2014	GBP	0,68 %	(12,86) %	(10,38) %	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie A (couvertes)	14/02/2014	GBP	(10,86) %	(22,99) %	(21,12) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie A (couvertes)	18/08/2016	GBP	(10,90) %	(23,03) %	(20,47) %	–
	Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	6/04/2019	HKD	(9,31) %	(22,16) %	(18,16) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en HKD de catégorie A	7/01/2021	HKD	(9,38) %	(22,14) %	–	–
	Actions de capitalisation en SEK de catégorie A (couvertes)	15/05/2015	SEK	(11,95) %	(23,93) %	(22,17) %	–
	Actions de capitalisation en SGD de catégorie A (couvertes)	3/10/2014	SGD	(10,14) %	(22,41) %	(19,05) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en SGD de catégorie A (couvertes)	12/03/2014	SGD	(10,24) %	(22,47) %	(19,06) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en SGD de catégorie A	2/09/2022	SGD	(10,17) %	–	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie B	15/09/2014	USD	(9,95) %	(22,36) %	(18,83) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	5/05/2014	USD	(10,17) %	(22,55) %	(19,43) %	–
	Actions de distribution (S) en USD de catégorie C	15/07/2014	USD	(10,16) %	(22,54) %	(19,43) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en JPY de catégorie A	17/12/2019	JPY	6,94 %	(11,18) %	(1,21) %	–
	Actions de capitalisation en NOK de catégorie A (couvertes)	21/09/2017	NOK	(11,09) %	(23,04) %	(21,20) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	13/05/2014	USD	(10,26) %	(22,62) %	(19,67) %	–
	Actions de distribution (S) en USD de catégorie E	28/07/2014	USD	(10,26) %	(22,62) %	(19,68) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)	25/08/2014	EUR	(12,73) %	(24,53) %	(23,67) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	18/06/2014	USD	(9,36) %	(21,85) %	(17,23) %	–
	Actions de distribution (S) en USD de catégorie F	16/10/2014	USD	(9,35) %	(21,85) %	(17,23) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie X	3/05/2014	USD	(9,27) %	(21,77) %	(16,97) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie X	26/10/2015	USD	(9,28) %	(21,76) %	(16,97) %	–
	Actions de distribution (S) en USD de catégorie X	2/03/2015	USD	(9,27) %	(21,77) %	(16,97) %	–
	Actions de Capitalisation en CHF de Classe X (couvertes)	3/05/2014	CHF	(12,32) %	(23,97) %	(21,80) %	–
	Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	29/07/2014	EUR	(3,68) %	(16,69) %	(12,88) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	14/02/2014	EUR	(11,84) %	(23,76) %	(21,17) %	–

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Informations complémentaires – Données sur la performance des fonds (non auditées) – (suite)

Fonds	Catégories d'actions	Date d'entrée en vigueur	Catégorie CCY	YTD fiscal 01/03/22-28/02/22	Calendrier 01/01/22-31/12/22	Cumulatif 3 ans 01/01/20-31/12/22	Performance sur 10 ans 01/03/13-28/02/23
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – (suite)	Actions de distribution (A) en EUR de catégorie X (couvertes)	8/11/2016	EUR	(11,74) %	(23,69) %	(21,09) %	–
	Actions de distribution (M) en EUR de catégorie X (couvertes)	17/05/2016	EUR	(11,77) %	(23,71) %	(21,11) %	–
	Classe de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)	23/12/2014	GBP	1,20 %	(12,39) %	(9,04) %	–
	Classe de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)	14/02/2014	GBP	(10,42) %	(22,61) %	(19,25) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie X (couvertes)	20/10/2015	GBP	(10,47) %	(22,66) %	(19,26) %	–
	Actions de capitalisation en SGD de catégorie X (couvertes)	3/10/2014	SGD	(9,75) %	(22,07) %	(17,87) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	29/11/2013	USD	(9,11) %	(21,64) %	(16,60) %	–
	Actions de distribution (S) en USD de catégorie Premier	2/10/2015	USD	(9,13) %	(21,65) %	(16,61) %	–
	Actions de capitalisation en AUD de catégorie Premier (couvertes)	7/03/2017	AUD	(10,51) %	(22,65) %	(19,29) %	–
	Actions de distribution (S) en AUD de catégorie Premier (couvertes)	24/07/2015	AUD	(10,52) %	(22,65) %	(19,36) %	–
	Actions de capitalisation en BRL de catégorie Premier (couvertes)	22/12/2015	BRL	(1,75) %	(15,13) %	(8,11) %	–
	Actions de capitalisation en CHF de catégorie Premier (couvertes)	12/04/2014	CHF	(12,22) %	(23,91) %	(21,51) %	–
	Actions de distribution (S) en CHF de catégorie Premier (couvertes)	27/11/2015	CHF	(12,19) %	(23,87) %	(21,49) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	7/03/2014	EUR	(3,65) %	(16,65) %	(12,63) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	26/03/2014	EUR	(11,64) %	(23,59) %	(20,74) %	–
	Actions de distribution (S) en EUR de catégorie Premier (couvertes)	27/11/2015	EUR	(11,63) %	(23,60) %	(20,78) %	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier (couvertes)	12/01/2014	GBP	(10,31) %	(22,51) %	(18,91) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	21/05/2014	GBP	(10,33) %	(22,53) %	(18,92) %	–
	Actions de capitalisation en JPY de catégorie Premier (couvertes)	12/01/2016	JPY	(12,08) %	(23,54) %	(20,01) %	–
	Actions de capitalisation en PLN de catégorie Premier (couvertes)	21/07/2017	PLN	(5,88) %	(18,98) %	(14,72) %	–
	Actions de capitalisation en SEK de catégorie Premier (couvertes)	15/05/2015	SEK	(11,38) %	(23,43) %	(20,69) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie S (couvertes)	29/11/2013	USD	(8,76) %	(21,33) %	(15,60) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	29/11/2013	EUR	(11,27) %	(23,27) %	(19,79) %	–
	Actions de distribution (S) en AUD de catégorie LM (couvertes)	8/09/2016	AUD	(9,62) %	(21,87) %	(16,82) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	4/05/2016	EUR	(2,68) %	(15,82) %	(9,96) %	–
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	8/11/2016	USD	(8,21) %	(13,48) %	(9,51) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	16/12/2015	USD	(8,22) %	(13,48) %	(8,95) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	23/01/2017	EUR	(10,49) %	(15,36) %	(13,61) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	8/09/2016	USD	(8,37) %	(13,63) %	(9,83) %	–
	Actions de distribution (M) en CHF de catégorie X (couvertes)	22/02/2017	CHF	(10,52) %	(15,21) %	(12,88) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	12/06/2019	GBP	(8,40) %	(13,48) %	(9,27) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie S	15/01/2021	USD	(7,30) %	(12,63) %	–	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	18/11/2019	EUR	(9,58) %	(14,49) %	(10,96) %	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie S (couvertes)	20/11/2019	GBP	(8,20) %	(13,30) %	(8,71) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM (couvertes)	25/07/2019	EUR	(9,27) %	(14,19) %	(9,93) %	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM (couvertes)	16/12/2015	GBP	(7,83) %	(12,95) %	(7,60) %	–
	Actions de capitalisation en CAD de catégorie LM (couvertes)	28/02/2022	CAD	(7,24) %	–	–	–
	Actions de distribution (A) en CHF de catégorie S	26/11/2021	CHF	(4,80) %	(11,33) %	–	–
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	Actions de capitalisation en EUR de catégorie D (couvertes)	23/05/2018	EUR	(7,41) %	(10,57) %	(14,49) %	–
	Actions de distribution (M) en EUR de catégorie D (couvertes)	13/06/2018	EUR	(7,52) %	(10,58) %	(14,47) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie D	24/01/2018	USD	(5,32) %	(8,78) %	(10,84) %	–
	Actions de distribution (M) en USD de catégorie D	14/02/2018	USD	(5,32) %	(8,79) %	(10,84) %	–
	Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie D	30/05/2018	USD	(5,33) %	(8,79) %	(10,84) %	–
	Actions de capitalisation en CHF de catégorie M (couvertes)	30/05/2018	CHF	(7,45) %	(10,38) %	(13,75) %	–
	Actions de distribution (M) en USD de catégorie M	28/11/2018	USD	(4,76) %	(8,24) %	(9,22) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie M (couvertes)	31/01/2018	EUR	(6,89) %	(10,02) %	(12,89) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	5/04/2016	USD	(4,61) %	(8,10) %	(8,81) %	–
	Actions de distribution (Q) en USD de catégorie Premier	13/12/2017	USD	(4,61) %	(8,10) %	(8,80) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	5/04/2016	EUR	(6,82) %	(9,95) %	(12,56) %	–
	Actions de distribution (Q) en EUR de catégorie Premier (couvertes)	27/12/2017	EUR	(6,73) %	(9,86) %	(12,50) %	–

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Informations complémentaires – Données sur la performance des fonds (non auditées) – (suite)

Fonds	Catégories d'actions	Date d'entrée en vigueur	Catégorie CCY	YTD fiscal 01/03/22-28/02/22	Calendrier 01/01/22-31/12/22	Cumulatif 3 ans 01/01/20-31/12/22	Performance sur 10 ans 01/03/13-28/02/23
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^] – (suite)	Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	18/04/2018	GBP	(5,26) %	(8,52) %	(9,24) %	–
	Actions de capitalisation en JPY de catégorie Premier (couvertes)	4/01/2020	JPY	(7,31) %	(10,03) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	13/01/2016	USD	(4,03) %	(7,55) %	(7,15) %	–
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	13/01/2016	USD	(10,73) %	(13,00) %	(13,15) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	13/01/2016	USD	(9,69) %	(11,99) %	(10,07) %	–
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	Actions de capitalisation en GBP de catégorie A	17/11/2016	GBP	(13,13) %	(18,72) %	(15,42) %	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	11/03/2021	GBP	(12,88) %	(18,50) %	–	–
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	17/11/2016	USD	(12,06) %	(17,63) %	(9,98) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	14/06/2019	USD	(11,46) %	(17,09) %	(8,17) %	–
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	Actions de distribution (Q) en USD de catégorie LM	1/11/2021	USD	(15,14) %	(22,44) %	–	–
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	1/10/2022	USD	(10,53) %	–	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1/10/2022	USD	(10,16) %	–	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	1/10/2022	USD	(9,94) %	–	–	–
	Actions de capitalisation en BRL de catégorie Premier (couvertes)	1/10/2022	BRL	(2,13) %	–	–	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	1/10/2022	EUR	(12,20) %	–	–	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier (couvertes)	1/10/2022	GBP	(10,87) %	–	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie S	1/10/2022	USD	(9,85) %	–	–	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	1/10/2022	EUR	(12,11) %	–	–	–
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	5/09/2007	USD	(14,96) %	(16,48) %	(19,20) %	(16,78) %
	Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	12/06/2010	USD	(14,96) %	(16,48) %	(19,21) %	(16,78) %
	Actions de distribution (S) en USD de catégorie A	10/01/2003	USD	(14,97) %	(16,48) %	(19,20) %	(16,78) %
	Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	28/07/2014	AUD	(16,55) %	(17,77) %	(22,31) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	19/02/2013	EUR	(17,56) %	(18,76) %	(23,71) %	(30,42) %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes) (IH)	18/01/2008	EUR	(11,34) %	(13,17) %	(16,97) %	(7,62) %
	Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A (couvertes)	6/07/2013	EUR	(17,57) %	(18,78) %	(23,77) %	–
	Actions de distribution (S) en EUR de catégorie A (couvertes)	14/10/2016	EUR	(9,88) %	(11,18) %	(15,38) %	–
	Actions de distribution (S) en EUR de catégorie A (couvertes) (IH)	22/11/2010	EUR	(11,31) %	(13,13) %	(16,95) %	(7,54) %
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie A	22/06/2018	GBP	(5,16) %	(6,49) %	(11,48) %	–
	Actions de distribution (M) en GBP de catégorie A (couvertes)	14/11/2014	GBP	(16,54) %	(17,85) %	(22,20) %	–
	Actions de distribution (S) en GBP de catégorie A (couvertes) (IH)	2/07/2008	GBP	(9,89) %	(11,86) %	(15,04) %	(1,23) %
	Actions de capitalisation en SGD de catégorie A	6/08/2015	SGD	(15,45) %	(16,95) %	(20,32) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie B	15/11/2007	USD	(15,17) %	(16,68) %	(19,81) %	(18,82) %
	Actions de distribution (S) en USD de catégorie B	24/02/2004	USD	(15,17) %	(16,69) %	(19,85) %	(18,86) %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	15/11/2007	USD	(15,38) %	(16,90) %	(20,42) %	(20,84) %
	Actions de distribution (S) en USD de catégorie C	24/02/2004	USD	(15,38) %	(16,89) %	(20,41) %	(20,84) %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	9/08/2011	USD	(15,47) %	(16,98) %	(20,65) %	(21,62) %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes) (IH)	13/07/2012	EUR	(11,89) %	(13,69) %	(18,45) %	(13,09) %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	14/09/2012	USD	(16,14) %	(16,14) %	(18,23) %	(13,39) %
	Actions de distribution (S) en USD de catégorie F	10/04/2012	USD	(14,61) %	(16,14) %	(18,23) %	(13,38) %
	Actions de distribution (S) en GBP de catégorie R (couvertes) (IH)	5/02/2013	GBP	(9,52) %	(11,48) %	(13,84) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie X	6/04/2013	USD	(14,53) %	(16,06) %	(17,99) %	–
	Actions de distribution (S) en USD de catégorie X	26/03/2013	USD	(14,54) %	(16,07) %	(17,99) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	28/06/2013	EUR	(17,13) %	(18,35) %	(22,53) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes) (IH)	19/08/2015	EUR	(10,91) %	(12,74) %	(15,73) %	–
	Actions de distribution (S) en EUR de catégorie X (couvertes) (IH)	12/11/2017	EUR	(11,23) %	(12,67) %	(15,72) %	–
	Classe de capitalisation en GBP de catégorie X	23/12/2014	GBP	(4,76) %	(6,07) %	(10,26) %	–
	Classe de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)	10/10/2014	GBP	(16,27) %	(17,57) %	(21,13) %	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes) (IH)	19/08/2015	GBP	(9,55) %	(11,52) %	(13,94) %	–
	Actions de distribution (S) en GBP de catégorie X (couvertes)	25/02/2013	GBP	(16,16) %	(17,50) %	(21,12) %	(21,23) %
	Actions de distribution (S) en GBP de catégorie X (couvertes) (IH)	15/07/2014	GBP	(9,43) %	(11,41) %	(13,79) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	24/03/2011	USD	(14,40) %	(15,93) %	(17,62) %	(11,19) %
	Actions de distribution (S) en USD de catégorie Premier	24/02/2012	USD	(14,39) %	(15,92) %	(17,60) %	(11,17) %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	25/01/2011	EUR	(9,27) %	(10,59) %	(13,79) %	8,87 %

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Informations complémentaires – Données sur la performance des fonds (non auditées) – (suite)

Fonds	Catégories d'actions	Date d'entrée en vigueur	Catégorie CCY	YTD fiscal 01/03/22-28/02/22	Calendrier 01/01/22-31/12/22	Cumulatif 3 ans 01/01/20-31/12/22	Performance sur 10 ans 01/03/13-28/02/23
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – (suite)	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	30/01/2013	EUR	(17,00) %	(18,21) %	(22,22) %	(25,82) %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes) (IH)	11/04/2011	EUR	(10,77) %	(12,60) %	(15,43) %	(1,33) %
	Parts de Capitalisation en GBP de Classe Premier (couvertes)	15/09/2021	GBP	(16,07) %	(17,42) %	–	–
	Actions de distribution (M) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	10/10/2014	GBP	(16,02) %	(17,32) %	(20,70) %	–
	Actions de distribution (S) en GBP de catégorie Premier (couvertes) (IH)	14/08/2012	GBP	(9,30) %	(11,28) %	(13,55) %	5,31 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	28/03/2019	USD	(13,89) %	(15,42) %	(16,11) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie LM (couvertes) (IH)	25/11/2015	USD	(7,88) %	(10,03) %	(9,73) %	–
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	4/03/2012	USD	(4,36) %	(4,92) %	(0,07) %	3,95 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	17/09/2013	USD	(4,38) %	(4,93) %	(0,01) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	18/06/2013	EUR	(6,93) %	(7,15) %	(4,91) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	17/07/2013	USD	(4,85) %	(5,41) %	(1,59) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	17/07/2013	USD	(4,95) %	(5,50) %	(1,88) %	–
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie E	27/08/2013	USD	(4,94) %	(5,50) %	(1,86) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	29/07/2014	USD	(3,99) %	(4,55) %	1,11 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie X	16/03/2018	USD	(3,94) %	(4,50) %	1,27 %	–
	Classe de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)	16/06/2014	GBP	(5,05) %	(5,38) %	(1,10) %	–
	Actions de distribution (M) en GBP de catégorie X (couvertes)	21/01/2014	GBP	(5,04) %	(5,37) %	(0,98) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	25/03/2013	USD	(3,80) %	(4,36) %	1,72 %	–
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier	13/05/2014	USD	(3,79) %	(4,36) %	1,61 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	7/02/2012	EUR	(6,32) %	(6,53) %	(3,07) %	(5,30) %
	Actions de distribution (A) en EUR de catégorie Premier (couvertes)	23/05/2013	EUR	(6,31) %	(6,52) %	(3,11) %	–
	Actions de distribution (M) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	25/03/2013	GBP	(4,91) %	(5,23) %	(0,57) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	6/12/2014	USD	(2,93) %	(3,49) %	4,50 %	–
	Classe de Capitalisation en AUD de Classe LM (couvertes)	4/03/2012	AUD	(4,23) %	(4,47) %	1,98 %	25,26 %
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	14/10/2016	USD	(5,94) %	(12,58) %	(3,90) %	–
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	18/07/2016	USD	(5,94) %	(12,58) %	(3,97) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	30/11/2012	USD	(5,27) %	(11,91) %	(1,83) %	37,64 %
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier (couvertes) (IH)	30/11/2012	GBP	(4,61) %	(11,17) %	(2,69) %	35,51 %
	Actions de capitalisation en CAD de catégorie S (couvertes) (IH)	23/02/2016	CAD	(3,92) %	(10,64) %	(1,08) %	–
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	5/06/2011	USD	(15,91) %	(17,30) %	(14,96) %	(8,89) %
	Actions de distribution (M) en USD de catégorie A	25/06/2010	USD	(15,91) %	(17,30) %	(14,97) %	(8,91) %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	4/04/2018	EUR	(18,46) %	(19,44) %	(19,67) %	–
	Classe de capitalisation en SGD de catégorie A	17/04/2020	SGD	(16,43) %	(17,89) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	21/03/2012	USD	(16,33) %	(17,72) %	(16,22) %	(13,37) %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	17/02/2012	USD	(16,41) %	(17,80) %	(16,47) %	(14,22) %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	22/07/2014	USD	(15,57) %	(16,96) %	(13,93) %	–
	Actions de distribution (M) en USD de catégorie F	19/07/2013	USD	(15,57) %	(16,98) %	(13,93) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie X	5/03/2016	USD	(15,48) %	(16,89) %	(13,67) %	–
	Actions de distribution (M) en GBP de catégorie X (couvertes)	10/10/2014	GBP	(17,29) %	(18,43) %	(17,11) %	–
	Actions de distribution (M) en GBP de catégorie X (couvertes) (IH)	27/05/2020	GBP	(10,54) %	(12,40) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	1/06/2012	USD	(15,37) %	(16,76) %	(13,28) %	(2,81) %
	Actions de distribution en GBP de catégorie Premier (couvertes) (IH)	24/06/2016	GBP	(10,41) %	(12,27) %	(8,98) %	–
	Actions de capitalisation en NZD de catégorie Premier (couvertes) (IH)	19/09/2012	NZD	(10,09) %	(11,92) %	(8,46) %	33,09 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	4/05/2016	EUR	(9,70) %	(10,91) %	(7,39) %	–
	Actions de capitalisation en NZD de catégorie LM (couvertes) (IH)	13/01/2012	NZD	(9,51) %	(11,35) %	(6,75) %	41,76 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	30/08/2013	USD	(10,82) %	(14,59) %	(2,22) %	–
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	26/08/2020	USD	(10,83) %	(14,59) %	–	–
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie A	28/08/2020	USD	(10,82) %	(14,60) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	15/01/2021	USD	(10,83) %	(14,59) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	6/03/2013	USD	(10,82) %	(14,60) %	(2,21) %	–
	Actions de capitalisation en AUD de catégorie A (couvertes)	23/06/2021	AUD	(12,19) %	(15,65) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	30/08/2021	AUD	(12,17) %	(15,62) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus en CNH de catégorie A (couvertes)	15/04/2021	CNH	(11,51) %	(14,59) %	–	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	25/11/2020	EUR	(5,31) %	(9,02) %	–	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	22/08/2016	EUR	(13,40) %	(16,74) %	(7,24) %	–

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Informations complémentaires – Données sur la performance des fonds (non auditées) – (suite)

Fonds	Catégories d'actions	Date d'entrée en vigueur	Catégorie CCY	YTD fiscal 01/03/22-28/02/22	Calendrier 01/01/22-31/12/22	Cumulatif 3 ans 01/01/20-31/12/22	Performance sur 10 ans 01/03/13-28/02/23
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – (suite)	Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A (couvertes)	19/05/2015	EUR	(13,40) %	(16,75) %	(7,38) %	–
	Actions de distribution (M) Plus en EUR de catégorie A (couvertes)	30/08/2021	EUR	(13,39) %	(16,77) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A (couvertes)	21/10/2013	EUR	(13,38) %	(16,76) %	(7,29) %	–
	Actions de distribution (M) Plus en GBP de catégorie A (couvertes)	30/08/2021	GBP	(12,15) %	(15,72) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie A (couvertes)	24/10/2013	GBP	(12,13) %	(15,70) %	(4,95) %	–
	Classe de capitalisation en HKD de catégorie A	30/08/2021	HKD	(10,43) %	(14,51) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	4/09/2021	HKD	(10,44) %	(14,52) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	21/10/2015	SGD	(11,25) %	(14,90) %	(3,22) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en SGD de catégorie A (couvertes)	17/02/2021	SGD	(11,30) %	(14,90) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A	29/01/2021	SGD	(11,32) %	(15,22) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	23/09/2020	USD	(11,26) %	(15,02) %	–	–
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie C	24/11/2020	USD	(11,25) %	(15,01) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	21/04/2020	USD	(11,36) %	(15,10) %	–	–
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie E	22/01/2021	USD	(11,33) %	(15,10) %	–	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)	4/03/2017	EUR	(13,93) %	(17,26) %	(8,83) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	22/10/2020	USD	(10,42) %	(14,20) %	–	–
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie F	24/07/2019	USD	(10,41) %	(14,20) %	(0,91) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie X	25/09/2020	USD	(10,31) %	(14,11) %	–	–
	Actions de distribution (D) en USD de catégorie X	18/07/2017	USD	(10,58) %	(14,41) %	(1,01) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie X	21/01/2014	USD	(10,30) %	(14,11) %	(0,54) %	–
	Actions de Capitalisation en CHF de Classe X (couvertes)	16/07/2021	CHF	(13,36) %	(16,61) %	–	–
	Actions de distribution (A) en CHF de catégorie X (couvertes)	22/02/2021	CHF	(13,31) %	(16,56) %	–	–
	Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	17/02/2021	EUR	(4,92) %	(8,64) %	–	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	16/02/2021	EUR	(12,93) %	(16,31) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie X (couvertes)	23/12/2013	EUR	(12,88) %	(16,29) %	(5,73) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie X (couvertes)	20/12/2013	GBP	(11,63) %	(15,24) %	(3,42) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	10/09/2020	USD	(10,17) %	(13,99) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie Premier	6/03/2013	USD	(10,17) %	(13,99) %	(0,13) %	–
	Actions de capitalisation en BRL de catégorie Premier (couvertes)	9/10/2021	BRL	(2,53) %	(6,33) %	–	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	10/07/2014	EUR	(12,77) %	(16,15) %	(5,18) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie Premier (couvertes)	13/12/2013	EUR	(12,73) %	(16,14) %	(5,29) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes)	23/10/2014	GBP	(11,45) %	(15,04) %	(2,90) %	–
	Actions de capitalisation en SEK de catégorie Premier (couvertes)	22/10/2014	SEK	(12,64) %	(16,07) %	(4,86) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie S	7/06/2020	USD	(10,01) %	(13,82) %	–	–
	Actions de distribution (Q) Plus (e) en USD de catégorie S	14/09/2021	USD	(10,01) %	(13,82) %	–	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	4/10/2018	EUR	(12,64) %	(16,01) %	(4,75) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie S (couvertes)	18/09/2018	EUR	(12,59) %	(16,01) %	(4,81) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie S (couvertes)	2/01/2018	GBP	(11,42) %	(14,99) %	(2,46) %	–
	Actions de distribution (M) en USD de catégorie LM	30/09/2021	USD	(9,70) %	(13,51) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie LM (couvertes)	8/11/2021	EUR	(12,30) %	(15,68) %	–	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie LM (couvertes)	10/08/2020	GBP	(11,05) %	(14,65) %	–	–
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	30/06/2014	USD	(1,42) %	(0,85) %	(0,34) %	–
	Actions de distribution (M) en USD de catégorie X	30/04/2021	USD	(0,58) %	0,04 %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	30/06/2014	USD	(0,77) %	(0,21) %	1,61 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	30/06/2014	USD	0,38 %	0,95 %	5,20 %	–
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	4/06/2017	USD	(7,43) %	(13,92) %	(5,28) %	–
	Actions de distribution (A) en EUR de catégorie S (couvertes) (IH)	4/06/2017	EUR	(7,17) %	(13,37) %	(5,29) %	–
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	16/08/2018	USD	(10,85) %	(13,09) %	(21,99) %	–
	Actions de capitalisation en SGD de catégorie A (couvertes)	16/09/2019	SGD	(11,64) %	(13,73) %	(23,72) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie X (couvertes)	16/08/2018	GBP	(12,07) %	(14,08) %	(23,51) %	–
	Classe de Capitalisation en AUD de Classe LM (couvertes)	16/08/2018	AUD	(10,99) %	(12,94) %	(21,03) %	–

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Informations complémentaires – Données sur la performance des fonds (non auditées) – (suite)

Fonds	Catégories d'actions	Date d'entrée en vigueur	Catégorie CCY	YTD fiscal 01/03/22-28/02/22	Calendrier 01/01/22-31/12/22	Cumulatif 3 ans 01/01/20-31/12/22	Performance sur 10 ans 01/03/13-28/02/23
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	31/12/2015	USD	(2,39) %	(7,57) %	28,13 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	31/12/2015	USD	(1,46) %	(6,69) %	31,83 %	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	12/09/2021	GBP	9,90 %	4,47 %	–	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	31/12/2015	EUR	(4,52) %	(9,34) %	25,34 %	–
FTGF ClearBridge Value Fund	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	24/04/2007	USD	(2,64) %	(8,00) %	28,83 %	146,07 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	23/03/1998	USD	(2,65) %	(8,00) %	28,83 %	146,03 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	6/12/2007	EUR	3,25 %	(2,12) %	34,85 %	202,05 %
	Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A (couvertes)	9/02/2014	EUR	(6,30) %	(11,19) %	20,87 %	–
	Actions de distribution (A) en GBP de catégorie A	28/08/2014	GBP	8,58 %	2,88 %	40,46 %	–
	Classe de capitalisation en SGD de catégorie A	18/05/2007	SGD	(3,16) %	(8,57) %	28,13 %	167,13 %
	Classe de Capitalisation en SGD de Classe A (couvertes)	9/10/2012	SGD	(3,73) %	(8,88) %	25,67 %	134,44 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	15/11/2007	USD	(3,14) %	(8,46) %	26,90 %	134,06 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	24/02/2004	USD	(3,13) %	(8,46) %	26,91 %	134,04 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	26/03/2021	USD	(3,37) %	(8,69) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	21/01/2010	USD	(2,06) %	(7,44) %	31,17 %	162,91 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie F	19/10/2016	USD	(2,07) %	(7,44) %	31,17 %	–
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie X	10/07/2013	USD	(1,98) %	(7,37) %	31,47 %	–
	Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	22/02/2021	EUR	3,97 %	(1,43) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	7/01/2008	USD	(1,64) %	(7,05) %	32,85 %	172,59 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier	25/04/2014	USD	(1,64) %	(7,05) %	32,85 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	30/06/2014	EUR	4,27 %	(1,15) %	38,62 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	4/08/2021	EUR	(5,40) %	(10,28) %	–	–
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie LM	21/07/2021	USD	(0,98) %	(6,42) %	–	–
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	20/04/2007	USD	(8,26) %	(16,05) %	15,21 %	136,75 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	20/04/2007	USD	(8,26) %	(16,05) %	15,21 %	136,78 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	6/03/2008	EUR	(2,78) %	(10,73) %	20,76 %	192,26 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie B	15/11/2007	USD	(8,72) %	(16,47) %	13,50 %	125,32 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	15/11/2007	USD	(8,72) %	(16,47) %	13,49 %	125,21 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	20/04/2007	USD	(8,72) %	(16,47) %	13,50 %	125,22 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	21/01/2010	USD	(8,95) %	(16,67) %	12,65 %	119,62 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie E	21/01/2010	USD	(8,97) %	(16,69) %	12,63 %	119,58 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	17/09/2012	USD	(7,73) %	(15,55) %	17,29 %	151,31 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie F	2/04/2010	USD	(7,73) %	(15,55) %	17,29 %	151,29 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie X	10/07/2013	USD	(7,71) %	(15,53) %	17,38 %	–
	Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	10/07/2013	EUR	(2,15) %	(10,15) %	23,06 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	5/06/2010	USD	(7,38) %	(15,23) %	18,62 %	160,95 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier	4/09/2009	USD	(7,38) %	(15,23) %	18,62 %	160,88 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	6/07/2010	EUR	(1,75) %	(9,80) %	24,19 %	221,90 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	4/05/2016	USD	(6,80) %	(14,70) %	20,86 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	4/05/2016	EUR	(1,19) %	(9,27) %	26,64 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)	20/04/2007	USD	(7,96) %	(15,76) %	16,42 %	145,10 %
	Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie B	20/04/2007	USD	(8,46) %	(16,22) %	14,50 %	132,68 %
	Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie L	20/04/2007	USD	(8,42) %	(16,18) %	14,68 %	133,15 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie GA	6/10/2011	USD	(8,11) %	(15,91) %	15,82 %	140,95 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie GA	6/10/2011	EUR	(2,59) %	(10,56) %	21,36 %	197,68 %
	Actions de distribution (A) en EUR de catégorie GA	6/10/2011	EUR	(2,59) %	(10,56) %	21,40 %	197,38 %
	Actions de capitalisation en USD de Classe GE	6/10/2011	USD	(8,80) %	(16,53) %	13,24 %	123,56 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie GE	6/10/2011	EUR	(3,34) %	(11,24) %	18,66 %	176,47 %
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	20/04/2007	USD	(15,39) %	(32,88) %	5,94 %	196,31 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	20/04/2007	USD	(15,39) %	(32,88) %	5,94 %	196,36 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	27/08/2008	EUR	(10,32) %	(28,62) %	10,98 %	264,20 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	2/05/2016	EUR	(18,58) %	(35,23) %	(0,31) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie B	15/11/2007	USD	(15,82) %	(33,21) %	4,35 %	181,86 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie B	20/04/2007	USD	(15,82) %	(33,21) %	4,36 %	181,88 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	15/11/2007	USD	(15,82) %	(33,21) %	4,36 %	181,88 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	20/04/2007	USD	(15,82) %	(33,21) %	4,36 %	181,86 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	14/01/2016	USD	(16,03) %	(33,38) %	3,57 %	–
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie E	13/10/2015	USD	(16,03) %	(33,38) %	3,57 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	19/04/2016	USD	(14,88) %	(32,47) %	7,87 %	–
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie F	11/04/2015	USD	(14,89) %	(32,47) %	7,86 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie U	3/02/2018	USD	(14,48) %	(32,15) %	9,41 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie U	3/02/2018	EUR	(9,36) %	(27,83) %	14,70 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie X	29/09/2015	USD	(14,86) %	(32,46) %	7,95 %	–
	Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	17/01/2018	EUR	(9,75) %	(28,28) %	12,82 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	27/07/2016	EUR	(18,17) %	(34,90) %	1,48 %	–
	Classe de capitalisation en GBP de catégorie X	12/04/2015	GBP	(5,04) %	(24,36) %	18,22 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	19/09/2014	USD	(14,56) %	(32,22) %	9,08 %	–
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier	21/02/2020	USD	(14,56) %	(32,22) %	–	–
	Actions de capitalisation en BRL de catégorie Premier (couvertes)	15/02/2018	BRL	(8,62) %	(27,29) %	17,19 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	15/09/2016	EUR	(9,46) %	(27,93) %	14,28 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	3/02/2016	EUR	(17,84) %	(34,64) %	2,57 %	–
	Actions de distribution (A) en EUR de catégorie Premier	21/02/2020	EUR	(9,41) %	(27,89) %	–	–

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Informations complémentaires – Données sur la performance des fonds (non auditées) – (suite)

Fonds	Catégories d'actions	Date d'entrée en vigueur	Catégorie CCY	YTD fiscal 01/03/22-28/02/22	Calendrier 01/01/22-31/12/22	Cumulatif 3 ans 01/01/20-31/12/22	Performance sur 10 ans 01/03/13-28/02/23
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund – (suite)	Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	12/02/2015	GBP	(4,68) %	(24,09) %	19,20 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie LM	4/05/2016	USD	(14,03) %	(31,79) %	11,15 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	4/05/2016	EUR	(8,84) %	(27,44) %	16,48 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)	20/04/2007	USD	(15,10) %	(32,64) %	7,06 %	206,72 %
	Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie L	20/04/2007	USD	(15,52) %	(32,98) %	5,46 %	191,77 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie GA	27/08/2010	USD	(15,24) %	(32,76) %	6,51 %	201,57 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie GA	27/08/2010	EUR	(10,15) %	(28,48) %	11,63 %	272,40 %
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	20/04/2007	USD	(14,95) %	(27,82) %	(11,01) %	72,10 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	20/04/2007	USD	(14,95) %	(27,82) %	(11,01) %	72,17 %
	Actions de capitalisation en AUD de catégorie A (couvertes)	6/03/2013	AUD	(17,68) %	(29,86) %	(17,21) %	–
	Actions de capitalisation en CHF de catégorie A (couvertes)	23/10/2014	CHF	(18,32) %	(30,30) %	(16,53) %	–
	Actions de capitalisation en CNH de catégorie A (couvertes)	14/11/2014	CNH	(16,15) %	(28,22) %	(8,75) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	9/07/2010	EUR	(9,85) %	(23,24) %	(6,82) %	111,88 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	4/02/2013	EUR	(18,16) %	(30,28) %	(16,26) %	–
	Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A (couvertes)	28/08/2014	EUR	(18,14) %	(30,26) %	(16,22) %	–
	Classe de capitalisation en GBP de catégorie A	29/09/2014	GBP	(5,13) %	(19,18) %	(2,51) %	–
	Classe de capitalisation en HKD de catégorie A	27/10/2015	HKD	(14,57) %	(27,75) %	(10,93) %	–
	Actions de capitalisation en SEK de catégorie A (couvertes)	31/01/2013	SEK	(18,36) %	(30,51) %	(18,08) %	41,43 %
	Classe de Capitalisation en SGD de Classe A (couvertes)	31/01/2013	SGD	(15,96) %	(28,48) %	(13,11) %	63,64 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie B	20/04/2007	USD	(15,37) %	(28,18) %	(12,33) %	63,73 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	15/11/2007	USD	(15,37) %	(28,18) %	(12,33) %	63,73 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	20/04/2007	USD	(15,37) %	(28,18) %	(12,33) %	63,72 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	1/04/2011	USD	(15,59) %	(28,37) %	(12,99) %	59,66 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie E	1/04/2011	USD	(15,58) %	(28,36) %	(12,99) %	59,67 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie E	16/03/2021	EUR	(10,53) %	(23,83) %	–	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)	9/10/2013	EUR	(18,78) %	(30,80) %	(18,14) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1/04/2011	USD	(14,43) %	(27,39) %	(9,39) %	82,76 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie F	1/04/2011	USD	(14,43) %	(27,39) %	(9,38) %	82,88 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie X	17/05/2013	USD	(14,39) %	(27,35) %	(9,25) %	–
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie X	13/02/2013	USD	(14,39) %	(27,35) %	(9,25) %	83,65 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie X	21/01/2014	EUR	(9,25) %	(22,73) %	(4,90) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	19/02/2014	EUR	(17,63) %	(29,82) %	(14,62) %	–
	Classe de capitalisation en GBP de catégorie X	24/04/2013	GBP	(4,53) %	(18,66) %	(0,63) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	17/03/2010	USD	(14,09) %	(27,10) %	(8,30) %	90,18 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	14/12/2010	EUR	(8,91) %	(22,46) %	(3,93) %	134,06 %
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	27/02/2017	GBP	(4,24) %	(18,43) %	0,29 %	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier (couvertes)	22/04/2014	GBP	(16,34) %	(28,84) %	(12,79) %	–
	Actions de distribution (A) en GBP de catégorie Premier	13/12/2012	GBP	(4,21) %	(18,39) %	0,42 %	139,14 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	4/05/2016	EUR	(8,34) %	(21,96) %	(2,04) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)	20/04/2007	USD	(14,65) %	(27,57) %	(10,06) %	78,24 %
	Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie B	20/04/2007	USD	(15,07) %	(27,93) %	(11,40) %	69,60 %
	Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie L	20/04/2007	USD	(15,08) %	(27,93) %	(11,41) %	69,53 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie GA	27/08/2010	EUR	(9,63) %	(23,06) %	(6,10) %	117,18 %
	Actions de distribution (A) en EUR de catégorie GA	27/08/2010	EUR	(9,63) %	(23,06) %	(6,10) %	117,06 %
	Actions de capitalisation en USD de Classe GE	27/08/2010	USD	(15,39) %	(28,20) %	(12,38) %	63,39 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie GE	27/08/2010	EUR	(10,31) %	(23,63) %	(8,19) %	101,66 %
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	13/08/2013	USD	(9,33) %	(15,59) %	4,49 %	–
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	27/03/2015	USD	(9,33) %	(15,58) %	4,48 %	–
	Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	19/06/2014	USD	(9,33) %	(15,58) %	4,49 %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	6/03/2013	USD	(9,33) %	(15,59) %	4,49 %	–
	Actions de distribution (Q) en USD de catégorie A	5/08/2015	USD	(9,33) %	(15,58) %	4,49 %	–
	Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	25/06/2014	AUD	(11,84) %	(17,64) %	(2,28) %	–
	Actions de distribution (M) Plus en CNH de catégorie A (couvertes)	28/07/2014	CNH	(10,31) %	(15,81) %	7,51 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	27/03/2015	EUR	(3,88) %	(10,22) %	9,48 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	21/11/2014	EUR	(12,40) %	(18,18) %	(1,51) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A (couvertes)	27/02/2014	EUR	(12,35) %	(18,14) %	(1,47) %	–
	Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	28/07/2014	HKD	(8,98) %	(15,53) %	4,52 %	–
	Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	28/07/2014	SGD	(10,23) %	(16,25) %	2,26 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	27/09/2013	USD	(9,78) %	(16,00) %	2,93 %	–
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	27/03/2015	USD	(9,78) %	(16,01) %	2,92 %	–
	Actions de distribution (Q) en USD de catégorie C	29/08/2014	USD	(9,78) %	(16,01) %	2,93 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	27/03/2015	USD	(8,78) %	(15,07) %	6,39 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie F	27/03/2015	EUR	(3,31) %	(9,67) %	11,48 %	–
	Actions de distribution (A) en EUR de catégorie F	27/03/2015	EUR	(3,30) %	(9,68) %	11,47 %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie X (couvertes)	24/04/2017	EUR	(11,88) %	(17,69) %	0,32 %	–

Informations complémentaires – Données sur la performance des fonds (non auditées) – (suite)

Fonds	Catégories d'actions	Date d'entrée en vigueur	Catégorie CCY	YTD fiscal 01/03/22-28/02/22	Calendrier 01/01/22-31/12/22	Cumulatif 3 ans 01/01/20-31/12/22	Performance sur 10 ans 01/03/13-28/02/23
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	3/11/2020	USD	(9,28) %	(22,37) %	–	–
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	30/09/2015	USD	(9,28) %	(22,37) %	24,08 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	28/02/2022	EUR	(3,73) %	–	–	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	30/09/2015	EUR	(12,67) %	(25,02) %	16,68 %	–
	Classe de capitalisation en SEK de catégorie A	21/01/2020	SEK	0,40 %	(10,23) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	3/11/2020	USD	(8,73) %	(21,90) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie X	30/07/2020	USD	(8,73) %	(21,91) %	–	–
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie X	30/09/2015	USD	(8,73) %	(21,90) %	26,34 %	–
	Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	24/03/2021	EUR	(3,19) %	(16,84) %	–	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	30/09/2015	EUR	(12,02) %	(24,44) %	18,94 %	–
	Classe de capitalisation en GBP de catégorie X	22/12/2015	GBP	1,71 %	(12,65) %	38,23 %	–
	Classe de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)	18/12/2019	GBP	(10,84) %	(23,59) %	20,42 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	24/06/2020	USD	(8,41) %	(21,63) %	–	–
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier	30/09/2015	USD	(8,41) %	(21,63) %	27,73 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	30/09/2015	EUR	(11,69) %	(24,19) %	20,26 %	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	30/09/2015	GBP	2,07 %	(12,32) %	39,89 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie S	7/11/2018	USD	(8,23) %	(21,47) %	28,70 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie S	13/07/2020	EUR	(2,71) %	(16,48) %	–	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	13/07/2020	EUR	(11,50) %	(24,02) %	–	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie S	31/07/2019	GBP	2,34 %	(12,10) %	40,85 %	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie S (couvertes)	19/11/2019	GBP	(10,35) %	(23,16) %	22,74 %	–
	Actions de distribution (Q) en GBP de catégorie S	31/07/2019	GBP	2,41 %	(12,04) %	40,85 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	21/05/2021	EUR	(2,35) %	(16,18) %	–	–
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	29/06/2018	USD	(9,08) %	(23,50) %	12,09 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	29/06/2018	USD	(8,17) %	(22,73) %	15,51 %	–
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	11/10/2017	USD	(3,27) %	(5,22) %	8,34 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie A (couvertes)	16/03/2017	USD	5,08 %	2,93 %	18,60 %	–
	Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A (couvertes)	19/06/2017	USD	4,97 %	2,90 %	18,51 %	–
	Actions de distribution (Q) en USD de catégorie A	12/12/2016	USD	(3,24) %	(5,17) %	8,95 %	–
	Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	24/10/2019	AUD	2,94 %	1,23 %	12,98 %	–
	Actions de distribution (M) Plus en CNH de catégorie A (couvertes)	24/10/2019	CNH	4,47 %	3,03 %	22,95 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	12/12/2016	EUR	2,66 %	0,91 %	14,24 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes) (PH)	12/03/2019	EUR	(0,95) %	(2,94) %	10,72 %	–
	Actions de distribution (M) Plus en EUR de catégorie A	22/10/2018	EUR	2,66 %	0,89 %	14,15 %	–
	Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	6/05/2017	SGD	4,44 %	2,58 %	16,98 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	26/09/2017	USD	(3,64) %	(5,66) %	7,25 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C (couvertes)	26/09/2017	USD	4,47 %	2,29 %	16,65 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	12/12/2016	USD	(3,83) %	(5,80) %	6,40 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E (couvertes)	4/12/2021	USD	4,26 %	2,08 %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	8/10/2017	USD	(2,66) %	(4,68) %	10,80 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F (couvertes)	26/09/2017	USD	5,65 %	3,49 %	20,64 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie X	20/03/2019	USD	(2,33) %	(4,26) %	11,86 %	–
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie X	17/05/2017	USD	(2,23) %	(4,20) %	12,11 %	–
	Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	24/10/2018	EUR	3,55 %	1,81 %	17,29 %	–
	Actions de distribution (Q) en GBP de catégorie X	30/05/2019	GBP	8,93 %	7,19 %	22,33 %	–
	Actions de Distribution (Q) en GBP de Classe X (couvertes)	11/09/2021	GBP	4,56 %	2,73 %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	2/04/2014	USD	(2,16) %	(4,16) %	12,65 %	–
	Actions de capitalisation en BRL de catégorie Premier (couvertes)	15/02/2018	BRL	14,81 %	12,77 %	35,48 %	–
	Actions de distribution (Q) Plus (e) en CAD de catégorie Premier (PH) (couvertes)	16/06/2017	CAD	2,02 %	(0,30) %	16,35 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	5/11/2012	EUR	3,74 %	2,03 %	18,06 %	106,48 %
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	30/06/2016	GBP	9,18 %	7,41 %	23,40 %	–
	Actions de distribution (A) Plus (e) en GBP de catégorie Premier (couvertes) (PH)	25/06/2009	GBP	1,23 %	(0,93) %	14,98 %	82,80 %
	Actions de distribution (Q) en GBP de catégorie Premier	26/04/2018	GBP	9,20 %	7,34 %	23,32 %	–
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	16/06/2021	USD	(8,42) %	(7,48) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	30/04/2021	USD	(8,42) %	(7,48) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	30/04/2021	USD	(8,41) %	(7,49) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	8/12/2021	AUD	(10,71) %	(9,46) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus en CNH de catégorie A (couvertes)	10/01/2021	CNH	(9,32) %	(7,71) %	–	–

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Informations complémentaires – Données sur la performance des fonds (non auditées) – (suite)

Fonds	Catégories d'actions	Date d'entrée en vigueur	Catégorie CCY	YTD fiscal 01/03/22-28/02/22	Calendrier 01/01/22-31/12/22	Cumulatif 3 ans 01/01/20-31/12/22	Performance sur 10 ans 01/03/13-28/02/23
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – (suite)	Actions de distribution (M) Plus en EUR de catégorie A (couvertes)	8/11/2021	EUR	(11,62) %	(10,40) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus en GBP de catégorie A (couvertes)	23/11/2021	GBP	(10,50) %	(9,34) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	7/01/2021	HKD	(8,01) %	(7,40) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	16/06/2021	SGD	(9,30) %	(8,07) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie X	30/04/2021	USD	(7,74) %	(6,82) %	–	–
	Actions de distribution (Q) Plus (e) en EUR de catégorie X (couvertes)	30/04/2021	EUR	(10,97) %	(9,78) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie X (couvertes)	1/12/2022	GBP	(9,71) %	–	–	–
	Actions de distribution (M) en USD de catégorie Premier	6/09/2021	USD	(7,40) %	(6,46) %	–	–
	Actions de distribution (M) en EUR de catégorie Premier (couvertes)	24/06/2021	EUR	(10,55) %	(9,33) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie S	17/06/2021	USD	(7,08) %	(6,13) %	–	–
	Actions de distribution USD catégorie S (M) Plus	7/06/2021	USD	(7,08) %	(6,13) %	–	–
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	5/09/2007	USD	(4,14) %	(17,74) %	31,87 %	148,82 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	11/08/2002	USD	(4,15) %	(17,74) %	31,87 %	148,80 %
	Actions de capitalisation en AUD de catégorie A (couvertes)	6/03/2013	AUD	(7,11) %	(20,02) %	20,00 %	–
	Actions de capitalisation en CNH de catégorie A (couvertes)	12/05/2016	CNH	(5,40) %	(18,14) %	34,94 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	7/12/2007	EUR	1,63 %	(12,49) %	38,03 %	206,53 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	20/02/2013	EUR	(7,66) %	(20,48) %	23,66 %	109,49 %
	Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A (couvertes)	16/11/2016	EUR	(7,73) %	(20,53) %	23,05 %	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie A (couvertes)	20/12/2013	GBP	(6,64) %	(19,76) %	23,53 %	–
	Actions de distribution (A) en GBP de catégorie A	26/04/2011	GBP	6,91 %	(7,90) %	44,43 %	216,08 %
	Actions de Capitalisation en SEK de Classe A (couvertes)	31/01/2013	SEK	(7,99) %	(20,86) %	19,63 %	100,75 %
	Actions de capitalisation en SGD de catégorie A	16/02/2011	SGD	(4,65) %	(18,24) %	30,94 %	169,21 %
	Classe de Capitalisation en SGD de Classe A (couvertes)	9/10/2012	SGD	(5,20) %	(18,46) %	28,15 %	135,09 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie B	15/11/2007	USD	(4,62) %	(18,15) %	29,91 %	136,68 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie B	24/02/2004	USD	(4,63) %	(18,16) %	29,85 %	136,47 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	15/11/2007	USD	(4,63) %	(18,15) %	29,91 %	136,67 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	24/02/2004	USD	(4,62) %	(18,15) %	29,91 %	136,70 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	1/04/2011	USD	(4,86) %	(18,36) %	28,93 %	130,83 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie E	1/04/2011	USD	(4,86) %	(18,35) %	28,94 %	130,83 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie E	26/11/2010	EUR	0,89 %	(13,19) %	34,91 %	185,05 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie E (couvertes)	23/09/2013	EUR	(8,31) %	(21,05) %	20,94 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1/04/2011	USD	(3,57) %	(17,25) %	34,27 %	164,20 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie F	1/04/2011	USD	(3,57) %	(17,24) %	34,27 %	164,42 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie R	2/01/2021	USD	(3,06) %	(16,80) %	–	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie R	12/09/2013	EUR	2,12 %	(12,08) %	40,59 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie X	25/02/2013	USD	(3,42) %	(17,12) %	34,88 %	168,19 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie X	28/11/2016	USD	(3,42) %	(17,12) %	34,88 %	–
	Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	10/11/2017	EUR	2,35 %	(11,88) %	41,40 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie X (couvertes)	21/10/2013	EUR	(6,99) %	(19,90) %	26,42 %	–
	Classe de capitalisation en GBP de catégorie X	18/01/2013	GBP	7,73 %	(7,19) %	47,69 %	237,43 %
	Actions de distribution (A) en GBP de catégorie X	23/04/2013	GBP	7,75 %	(7,18) %	47,73 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	27/04/2010	USD	(3,09) %	(16,83) %	36,30 %	177,73 %
	Classe de Capitalisation en BRL de Classe Premier (couvertes)	15/02/2018	BRL	3,37 %	(10,72) %	41,23 %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	6/07/2010	EUR	2,71 %	(11,56) %	42,67 %	242,89 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier (couvertes)	31/08/2015	EUR	(6,61) %	(19,56) %	27,86 %	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	15/02/2013	GBP	8,09 %	(6,87) %	49,10 %	248,43 %
	Actions de capitalisation en PLN de catégorie Premier (couvertes)	8/03/2018	PLN	(1,38) %	(15,37) %	34,18 %	–
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	5/09/2007	USD	0,26 %	(15,43) %	14,85 %	98,21 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	3/01/2004	USD	0,22 %	(15,45) %	14,80 %	97,96 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	10/01/2008	EUR	6,28 %	(10,01) %	20,23 %	143,36 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	6/05/2013	EUR	(3,44) %	(18,30) %	7,73 %	–
	Actions de distribution (A) en EUR de catégorie A	2/09/2011	EUR	6,17 %	(10,14) %	20,05 %	148,16 %
	Actions de distribution (A) en GBP de catégorie A	11/05/2009	GBP	11,75 %	(5,36) %	25,70 %	149,44 %
	Actions de Capitalisation en SEK de Classe A (couvertes)	31/01/2013	SEK	(3,57) %	(18,55) %	5,20 %	62,37 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	15/11/2007	USD	(0,24) %	(15,85) %	13,14 %	88,50 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	3/01/2004	USD	(0,28) %	(15,87) %	13,09 %	88,31 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	21/01/2010	USD	(0,53) %	(16,08) %	12,24 %	83,66 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie E	6/03/2020	USD	(0,58) %	(16,13) %	–	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie F	14/01/2019	EUR	5,45 %	(10,77) %	17,60 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	21/01/2010	USD	0,83 %	(14,94) %	16,89 %	110,25 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie F	2/04/2010	USD	0,82 %	(14,94) %	16,88 %	110,22 %

Informations complémentaires – Données sur la performance des fonds (non auditées) – (suite)

Fonds	Catégories d'actions	Date d'entrée en vigueur	Catégorie CCY	YTD fiscal 01/03/22-28/02/22	Calendrier 01/01/22-31/12/22	Cumulatif 3 ans 01/01/20-31/12/22	Performance sur 10 ans 01/03/13-28/02/23
FTGF Royce US Smaller Companies Fund – (suite)	Actions de capitalisation en USD de catégorie R	5/09/2014	USD	0,72 %	(15,03) %	16,54 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie X	2/08/2013	USD	0,97 %	(14,82) %	17,36 %	113,33 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie X	15/04/2021	USD	1,16 %	(14,68) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	24/11/2009	USD	1,33 %	(14,51) %	18,65 %	120,95 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie Premier	18/02/2011	USD	1,33 %	(14,51) %	18,66 %	120,97 %
	Actions de distribution (A) en GBP de catégorie Premier	20/05/2011	GBP	13,02 %	(4,27) %	30,05 %	178,29 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	4/05/2016	EUR	8,22 %	(8,40) %	27,03 %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie A (G)	20/04/2007	USD	0,83 %	(14,94) %	16,89 %	110,19 %
	Actions de capitalisation (G) en USD de catégorie L	20/04/2007	USD	0,32 %	(15,37) %	15,14 %	99,94 %
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	12/01/2021	USD	(7,50) %	(24,49) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie X	12/01/2021	USD	(6,81) %	(23,93) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	12/01/2021	USD	(6,48) %	(23,66) %	–	–
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	5/09/2007	USD	(8,34) %	(8,83) %	(4,27) %	27,36 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie A	25/02/2004	USD	(8,34) %	(8,82) %	(4,26) %	26,91 %
	Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie A	30/09/2014	USD	(8,34) %	(8,82) %	(4,27) %	–
	Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A (couvertes)	21/07/2016	AUD	(10,40) %	(10,46) %	(8,59) %	–
	Actions de distribution (M) Plus en CNH de catégorie A (couvertes)	16/04/2018	CNH	(9,31) %	(9,06) %	(1,16) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	31/10/2007	EUR	(2,89) %	(3,18) %	0,17 %	56,72 %
	Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie A	30/09/2014	HKD	(7,94) %	(8,74) %	(4,14) %	–
	Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A (couvertes)	24/06/2016	SGD	(9,01) %	(9,40) %	(5,67) %	–
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie B	25/02/2004	USD	(8,79) %	(9,27) %	(5,69) %	20,69 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	15/11/2007	USD	(8,80) %	(9,28) %	(5,69) %	21,07 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie C	25/02/2004	USD	(8,80) %	(9,28) %	(5,69) %	20,67 %
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	21/01/2010	USD	(9,23) %	(9,70) %	(6,75) %	17,03 %
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie E	7/05/2017	USD	(9,23) %	(9,70) %	(6,76) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	1/04/2011	USD	(8,00) %	(8,47) %	(2,90) %	33,94 %
	Actions de capitalisation en PLN de catégorie Premier (couvertes)	10/08/2015	PLN	(4,73) %	(5,28) %	(0,01) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie GA	27/08/2010	USD	(8,48) %	(8,94) %	(4,40) %	27,82 %
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie GA	27/08/2010	EUR	(2,97) %	(3,15) %	0,20 %	57,88 %
	Actions de distribution (A) en EUR de catégorie GA	27/08/2010	EUR	(2,92) %	(2,99) %	0,34 %	58,24 %
	Actions de capitalisation en USD de Classe GE	27/08/2010	USD	(9,15) %	(9,61) %	(6,52) %	18,60 %
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	30/03/2016	USD	(13,52) %	(15,49) %	(12,01) %	–
	Actions de distribution (A) en GBP de catégorie M	3/11/2016	GBP	(2,80) %	(4,62) %	(1,92) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	30/03/2016	USD	(13,02) %	(14,99) %	(10,33) %	–
	Actions de distribution (A) en USD de catégorie M	3/11/2016	USD	(12,82) %	(14,83) %	(9,99) %	–
	Actions de distribution (A) en EUR de catégorie M	3/11/2016	EUR	(7,59) %	(9,33) %	(4,96) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	6/06/2018	USD	(12,45) %	(14,46) %	(8,87) %	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier	5/09/2018	GBP	(2,35) %	(4,22) %	(0,29) %	–
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	28/06/2016	USD	(14,15) %	(33,67) %	(8,36) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	28/06/2016	EUR	(8,94) %	(29,41) %	(3,56) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A (couvertes)	24/03/2021	EUR	(17,86) %	(36,28) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie C	9/09/2021	USD	(14,59) %	(34,00) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	14/08/2019	USD	(14,80) %	(34,16) %	(10,62) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	29/07/2021	USD	(13,64) %	(33,27) %	–	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie X	4/01/2021	USD	(13,50) %	(33,17) %	–	–
	Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	28/06/2016	EUR	(8,29) %	(28,91) %	(1,58) %	–
	Classe de capitalisation en GBP de catégorie X	28/06/2016	GBP	(3,53) %	(25,16) %	2,32 %	–
	Classe de capitalisation en GBP de catégorie X (couvertes)	28/06/2016	GBP	(16,24) %	(35,08) %	(11,37) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	28/06/2016	USD	(13,20) %	(32,93) %	(5,29) %	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie Premier (couvertes)	16/04/2019	GBP	(15,94) %	(34,85) %	(10,41) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie S	25/08/2020	USD	(12,90) %	(32,69) %	–	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie S (couvertes)	3/05/2021	EUR	(16,63) %	(35,34) %	–	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie S	28/06/2016	GBP	(2,91) %	(24,69) %	4,50 %	–
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	Actions de distribution (M) Plus (e) en USD de catégorie A	28/06/2016	USD	(6,76) %	(5,95) %	(6,71) %	–
	Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie A	28/06/2016	AUD	0,62 %	0,49 %	(3,85) %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en EUR de catégorie A	28/06/2016	EUR	(1,19) %	–	(2,26) %	–
	Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie A	9/12/2018	SGD	(7,35) %	(6,67) %	(7,43) %	–
	Actions de distribution (M) Plus en AUD de catégorie D (couvertes)	29/04/2020	AUD	(8,62) %	(7,56) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus en CNH de catégorie D (couvertes)	29/04/2020	CNH	(7,30) %	(5,79) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus en HKD de catégorie D	29/04/2020	HKD	(5,98) %	(5,51) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus en SGD de catégorie D (couvertes)	29/04/2020	SGD	(7,11) %	(6,20) %	–	–
	Actions de distribution (M) Plus en USD de catégorie D	29/04/2020	USD	(6,40) %	(5,58) %	–	–

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Informations complémentaires – Données sur la performance des fonds (non auditées) – (suite)

Fonds	Catégories d'actions	Date d'entrée en vigueur	Catégorie CCY	YTD fiscal 01/03/22-28/02/22	Calendrier 01/01/22-31/12/22	Cumulatif 3 ans 01/01/20-31/12/22	Performance sur 10 ans 01/03/13-28/02/23
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – (suite)	Actions de capitalisation en USD de catégorie D	29/04/2020	USD	(6,39) %	(5,58) %	–	–
	Actions de Capitalisation en AUD de Classe X	31/05/2017	AUD	1,34 %	1,20 %	(1,83) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie X	28/06/2016	USD	(6,07) %	(5,25) %	(4,58) %	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie S	28/06/2016	GBP	5,46 %	6,79 %	6,65 %	–
	Actions de distribution (M) Plus (e) en GBP de catégorie S	28/06/2016	GBP	5,44 %	6,76 %	6,62 %	–
	Actions de Capitalisation en AUD de Classe LM	11/10/2017	AUD	2,52 %	2,36 %	1,67 %	–
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	Actions de capitalisation en USD de catégorie A	24/11/2017	USD	(18,16) %	(27,15) %	(13,90) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E	9/10/2018	USD	(18,77) %	(27,69) %	(15,65) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie F	13/11/2018	USD	(17,66) %	(26,71) %	(12,31) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie X	13/12/2017	USD	(17,55) %	(26,60) %	(11,95) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie Premier	13/12/2017	USD	(17,25) %	(26,34) %	(11,00) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie S	29/10/2018	USD	(17,08) %	(26,18) %	(10,46) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie S	16/01/2018	EUR	(12,03) %	(21,44) %	(6,02) %	–
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	Actions de capitalisation en USD de catégorie A (couvertes)	15/10/2021	USD	(6,82) %	(31,85) %	–	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie A	11/09/2018	EUR	(10,00) %	(33,98) %	(3,62) %	–
	Actions de capitalisation en USD de catégorie E (couvertes)	15/10/2021	USD	(7,51) %	(32,36) %	–	–
	Classe de capitalisation en EUR de catégorie X	11/09/2018	EUR	(9,33) %	(33,48) %	(1,43) %	–
	Actions de capitalisation en BRL de catégorie Premier (couvertes)	6/01/2021	BRL	1,23 %	(25,78) %	–	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie Premier	11/09/2018	EUR	(9,01) %	(33,25) %	(0,39) %	–
	Actions de capitalisation en EUR de catégorie S	5/07/2019	EUR	(8,65) %	(32,99) %	0,81 %	–
	Actions de capitalisation en GBP de catégorie S	19/11/2021	GBP	(3,91) %	(29,46) %	–	–

Les données relatives à la performance des fonds ne tiennent pas compte des commissions et des frais encourus lors de l'émission et du rachat d'actions.

Les performances passées n'indiquent pas des performances actuelles ou futures.

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité)

Pour l'exercice clos le 28 février 2023

Conformément à la réglementation sur les OPCVM, un état des principales évolutions de la composition du Portefeuille d'investissement de chaque Compartiment au cours de l'exercice considéré est fourni pour permettre aux actionnaires d'identifier les changements effectués dans les placements détenus par chaque Compartiment. Ces évolutions sont définies comme les achats et les ventes cumulés d'un investissement (y compris les titres à très courte échéance, mais à l'exclusion des contrats de prise en pension, des billets d'escompte à un jour et des dépôts à terme fixe, lesquels sont principalement utilisés à des fins de gestion efficace du portefeuille) supérieurs à 1,00 % de la valeur totale des achats et des ventes pour l'exercice. Au minimum, les 20 acquisitions et les 20 ventes les plus importantes sont indiquées. Si un Compartiment a réalisé moins de vingt achats ou ventes au cours de l'exercice considéré, alors l'ensemble de ses opérations est présenté.

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT (en milliers) USD	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers) USD
FHLDN, 0,000 %, échéance le 16/09/2022	92 911	FHLDN, 0,000 %, échéance le 16/09/2022	92 964
FHLDN, 0,000 %, échéance le 15/12/2022	81 432	FHLDN, 0,000 %, échéance le 15/12/2022	81 440
Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 15/09/2022	71 618	Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 29/03/2022	73 692
FHLDN, 0,000 %, échéance le 16/12/2022	70 872	Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 15/09/2022	71 643
Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 29/03/2022	63 690	Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 22/03/2022	71 558
FHLDN, 0,000 %, échéance le 19/09/2022	60 009	FHLDN, 0,000 %, échéance le 16/12/2022	70 880
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis, échéance le 31/01/2023	55 071	Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 15/03/2022	66 337
FHLDN, 0,000 %, échéance le 11/05/2022	52 219	FHLDN, 0,000 %, échéance le 19/09/2022	60 020
Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 22/03/2022	51 557	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis, échéance le 31/01/2023	55 007
Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 15/03/2022	51 337	FHLDN, 0,000 %, échéance le 11/05/2022	52 223
FHLDN, 0,000 %, échéance le 04/08/2022	49 997	Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 17/03/2022	50 250
Federal Home Loan Bank Discount, échéance le 18/03/2022	47 232	FHLDN, 0,000 %, échéance le 04/08/2022	50 000
FHLDN, 0,000 %, échéance le 20/09/2022	44 277	Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 10/03/2022	50 000
FHLDN, 0,000 %, échéance le 15/06/2022	44 220	Federal Home Loan Bank Discount, échéance le 18/03/2022	47 232
Federal Home Loan Bank Discount, échéance le 25/03/2022	42 723	Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 31/03/2022	45 876
Federal Home Loan Bank Discount, échéance le 01/11/2022	41 999	FHLDN, 0,000 %, échéance le 09/20/2022	44 280
Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 12/04/2022	40 700	FHLDN, 0,000 %, échéance le 15/06/2022	44 223
FHLDN, 0,000 %, échéance le 19/10/2022	38 877	Federal Home Loan Bank Discount, échéance le 25/03/2022	42 723
FHLDN, 0,000 %, échéance le 29/04/2022	37 364	FHLDN, 0,000 %, échéance le 01/11/2022	42 000
Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 28/02/2023	36 925	Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 12/04/2022	40 702

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT (en milliers) USD	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distributing)	93 701	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distributing)	97 430
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,875 %, échéance le 31/12/2027	8 358	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,250 %, échéance le 15/05/2050	7 565
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	6 201	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	6 195
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	5 624	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	5 742
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 3,500 %	5 134	Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 2,500 %	5 053
Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 2,500 %	4 952	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 3,500 %	5 039
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	4 194	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,500 %, échéance le 31/01/2027	4 315
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	4 049	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	4 176
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 3,000 %	3 925	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,375 %, échéance le 15/08/2050	4 006
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/02/2052	3 786	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 3,000 %	3 903
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	3 720	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	3 712
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	3 660	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	3 668
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 31/05/2029	3 304	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/02/2052	3 229
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	3 099	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 31/05/2029	3 210
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, arrivant à échéance le 15/08/2052	3 007	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	3 053
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 3,500 %	2 989	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 3,500 %	3 026
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2052	2 925	Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 2,500 %	2 882
Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 2,500 %	2 915	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	2 873
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	2 885	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	2 835
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	2 829	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	2 661

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT (en milliers) USD	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers) USD
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	47 079	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,750 %, échéance le 31/05/2026	55 871
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	40 848	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	46 834
Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 0,000 %	39 904	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	41 835
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	33 654	Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 0,000 %	40 863
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2052	32 946	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	33 048
Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 0,000 %	32 320	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class LM	32 843
Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 0,000 %	31 421	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,500 %, échéance le 31/01/2027	32 837
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	29 597	Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 0,000 %	31 948
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	28 406	Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 0,000 %	31 464
Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 0,000 %	28 340	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	30 230
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	28 105	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	28 511
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/02/2052	26 360	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	28 302
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	25 879	Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 0,000 %	27 895
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	25 096	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2052	26 911
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	25 037	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	25 441
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	24 544	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	24 932
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	24 043	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	24 753
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 31/05/2029	22 821	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	24 733
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	22 816	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	23 847
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 0,000 %	21 282	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 31/05/2029	22 792

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

	COÛT (en milliers) Euro	PRODUITS (en milliers) Euro	
PRINCIPAUX ACHATS		PRINCIPALES VENTES	
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/02/2031	10 438	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	9 192
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribution)	9 002	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/02/2031	9 073
Obligation du royaume des Pays-Bas, 0,000 %, échéance le 15/07/2023	5 916	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,375 %, échéance le 30/04/2025	4 286
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, échéance le 15/08/2032	5 582	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, échéance le 15/02/2027	3 971
Obligation de l'État autrichien, 0,900 %, échéance le 20/02/2032	3 352	Bundesobligation, série 177, 0,000 %, échéance le 14/04/2023	3 256
Obligation de l'État polonais, série 0432, 1,750 %, échéance le 25/04/2032	1 684	Buoni Poliennali Del Tesoro italien, 4,500 %, échéance le 01/03/2024	3 187
Obligation de l'État français, OAT, 0,000 %, échéance le 25/05/2032	1 471	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/08/2030	3 075
Buoni Poliennali Del Tesoro italien, 2,500 %, échéance le 01/12/2032	1 430	Obligation internationale de l'État indonésien, 4,200 %, échéance le 15/10/2050	2 107
Obligation de l'État irlandais, 0,350 %, échéance le 18/10/2032	1 415	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,375 %, échéance le 31/01/2026	1 914
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,125 %, échéance le 15/05/2040	1 322	Obligation de l'État espagnol, 0,450 %, échéance le 31/10/2022	1 353
BNP Paribas SA, 0,500 %, échéance le 30/05/2028	1 251	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,125 %, échéance le 15/05/2040	1 259
Banque de Montréal, 2,750 %, échéance le 15/06/2027	1 249	HSBC Holdings Plc, 3,000 %, échéance le 30/06/2025	1 227
HSBC Holdings Plc, 3,019 %, échéance le 15/06/2027	1 220	KBC Group NV, 0,022 %, échéance le 24/11/2022	1 100
Banco Santander SA, 2,500 %, échéance le 18/03/2025	1 092	Vonovia Finance BV, 0,000 %, échéance le 22/12/2022	1 100
Obligation de l'État espagnol, 144A, 1,400 %, échéance le 30/04/2028	1 002	Obligation internationale de l'État du Qatar, 4,817 %, échéance le 14/03/2049	1 020
Obligation de l'État norvégien, série 484, 144A, 2,125 %, échéance le 18/05/2032	887	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,500 %, échéance le 15/02/2023	1 010
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/08/2030	751	ABN AMRO Bank NV, 7,125 %, échéance le 06/07/2022	850
Suzano Austria GmbH, 3,125 %, échéance le 15/01/2032	693	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, échéance le 15/02/2025	787
Banque Royale du Canada, 5,000 %, échéance le 24/01/2028	686	Obligation de l'État norvégien, série 484, 144A, 2,125 %, échéance le 18/05/2032	733
Credit Agricole SA, 1,875 %, arrivant à échéance le 22/04/2027	663	Obligation de l'État français, OAT, 1,000 %, échéance le 25/05/2027	676
Obligation de l'État français, OAT, 3,250 %, échéance le 25/05/2045	653	Volkswagen International Finance NV, 1,250 %, échéance le 23/09/2032	644
Banque Royale du Canada, 3,625 %, échéance le 14/06/2027	635		

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^]

	COÛT (en milliers) USD		PRODUITS (en milliers) USD
PRINCIPAUX ACHATS		PRINCIPALES VENTES	
Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500 %, échéance le 01/04/2027	536	Ford Motor Credit Co LLC, 2,700 %, échéance le 10/08/2026	748
Thermostat Purchaser III Inc, 0,000 %, échéance le 31/08/2028	265	DISH DBS Corp, 7,750 %, échéance le 01/07/2026	747
Legacy LifePoint Health LLC, 6,750 %, échéance le 15/04/2025	264	Sprint Capital Corp, 6,875 %, échéance le 15/11/2028	625
Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, échéance le 28/05/2027	220	Penn Virginia Holdings LLC, 144A, 9,250 %, échéance le 15/08/2026	594
Ardagh Metal Packaging Finance USA, 6,000 %, échéance le 15/06/2027	210	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 7,875 %, échéance le 15/11/2025	482
Ford Motor Credit Co LLC, 7,350 %, échéance le 11/04/2027	200	Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, échéance le 15/02/2026	478
Credit Suisse Group AG, 9,750 %, perpétuelle	200	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, échéance le 09/05/2027	470
InterGen NV, 7,000 %, échéance le 30/06/2023	197	Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500 %, échéance le 01/04/2027	466
Ballyrock CLO 19 Ltd FRN, 0,000 %, échéance le 20/04/2035	196	Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, échéance le 01/03/2028	452
Canpack SA / Canpack US LLC, 144A, 3,125 %, échéance le 01/11/2025	187	Occidental Petroleum Corp, 3,400 %, échéance le 15/04/2026	448
Ford Motor Credit Co LLC, 4,125 %, échéance le 17/08/2027	178	Caesars Entertainment Inc, 144A, 6,250 %, échéance le 01/07/2025	442
Holly Energy Partners LP, 6,375 %, échéance le 15/04/2027	170	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 2,875 %, échéance le 15/10/2026	440
American Airlines Inc, 5,750 %, échéance le 20/04/2029	169	United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, échéance le 15/04/2026	429
CommScope Inc, 4,750 %, échéance le 01/09/2029	168	Delta Air Lines Inc, 7,375 %, échéance le 15/01/2026	422
AMC Entertainment Holdings Inc, 7,500 %, échéance le 15/02/2029	165	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, échéance le 20/04/2026	422
Vertiv Group Corp, 4,125 %, échéance le 15/11/2028	162	Oasis Petroleum Inc, 144A, 6,375 %, échéance le 01/06/2026	405
GEO Group Inc/The, 9,500 %, échéance le 31/12/2028	160	Occidental Petroleum Corp, 3,200 %, échéance le 15/08/2026	400
Bausch Health Co Inc, 6,250 %, échéance le 15/02/2029	152	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, échéance le 20/01/2026	397
Melco Resorts Finance Ltd, 4,875 %, échéance le 06/06/2025	151	Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, échéance le 15/10/2025	385
Carnival Holdings Bermuda Ltd, 144A, 10,375 %, échéance le 01/05/2028	138	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, échéance le 15/10/2027	376
Gen Digital Inc, 6,750 %, échéance le 30/09/2027	130		
Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, échéance le 15/09/2024	126		
XPO Inc, 6,250 %, échéance le 01/05/2025	124		
Nabors Industries Ltd, 7,250 %, échéance le 15/01/2026	122		
Bombardier Inc, 7,875 %, échéance le 15/04/2027	122		
Royal Caribbean Cruises Ltd, 11,625 %, échéance le 15/08/2027	120		
Blackstone Mortgage Trust Inc, 5,500 %, échéance le 15/03/2027	110		
Service Properties Trust, 4,650 %, échéance le 15/03/2024	96		
GEO Group Inc/The, 10,500 %, échéance le 30/06/2028	87		
Michael Cos Inc/The, 7,875 %, échéance le 01/05/2026	69		
Earthstone Energy Holdings LLC, 8,000 %, échéance le 15/04/2027	60		

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

	COÛT (en milliers) USD	PRODUITS (en milliers) USD	
PRINCIPAUX ACHATS		PRINCIPALES VENTES	
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,125 %, échéance le 15/05/2048	6 249	Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund – LM Class Euro (Accumulating)	9 302
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,000 %, échéance le 30/04/2024	6 033	Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Class US\$ Distributing (M)	6 388
Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 10/05/2034	5 292	Obligation de l'État chinois, 4,290 %, échéance le 22/05/2029	6 202
Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 19/01/2028	4 856	Obligation fédérale russe – OFZ, Series 6225, 7,250 %, échéance le 10/05/2034	5 292
United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, arrivant à échéance le 15/11/2031	3 614	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	4 995
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, arrivant à échéance le 15/05/2032	3 523	Obligation fédérale russe – OFZ, Series 6212, 7,050 %, échéance le 19/01/2028	4 856
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,125 %, échéance le 15/11/2032	3 450	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2032	3 325
Obligation de l'État polonais, série 0432, 1,750 %, échéance le 25/04/2032	3 344	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTNFF, 10,000 %, échéance le 01/01/2025	3 091
Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 23/05/2029	1 584	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTNFF, 10,000 %, échéance le 01/01/2023	2 682
ING Groep NV, 5,000 %, échéance le 30/08/2026	1 298	MEG Energy Corp, 7,125 %, échéance le 01/02/2027	2 130
Citigroup Inc, 8,125 %, échéance le 15/07/2039	1 288	Itau Unibanco Holding SA/Itaú Caiman, 6,125 %, perpétuelle	2 094
Credit Suisse Group AG, 6,373 %, échéance le 15/07/2026	1 280	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2017 C01, catégorie 1M2, 3,737 %, échéance le 25/07/2029	2 091
Morgan Stanley, 3,622 %, échéance le 01/04/2031	1 273	Mexican Bonos, série M 20, 7,500 %, échéance le 03/06/2027	2 056
Intesa Sanpaolo SpA, 6,375 %, perpétuelle	1 263	FirstEnergy Corp, série C, 7,375 %, échéance le 15/11/2031	1 928
H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, échéance le 15/12/2028	1 225		
Whitbread Group Plc, 2,375 %, échéance le 31/05/2027	1 206		
Banco Mercantil del Norte SA/Grand Caiman, 7,500 %, perpétuelle	1 206		
B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, échéance le 20/09/2031	1 194		
Deutsche Bank AG, 4,000 %, échéance le 24/06/2026	1 119		

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – (suite)

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
Mexican Bonos, série M, 7,750 %, échéance le 13/11/2042	1 084	Ultrapar International SA, 144A, 5,250 %, échéance le 06/10/2026	1 745
BNP Paribas SA, 2,500 %, échéance le 31/03/2032	985	Obligation de l'État chinois, 3,950 %, échéance le 29/06/2043	1 699
		HSI Asset Securitization Corp Trust 2007-OPT1, série 2007 OPT1, catégorie 1A, 0,327 %, échéance le 25/12/2036	1 690
		Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, échéance le 17/03/2024	1 661
		Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – LM Class US\$ Accumulating	1 615
		Obligation fédérale russe – OFZ, Series 6224, 6,900 %, échéance le 23/05/2029	1 584
		OCF SA, 4,500 %, échéance le 22/10/2025	1 550
		Scientific Games International Inc, 2,959 %, échéance le 14/08/2024	1 407

FTGF Western Asset US High Yield Fund

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	111 008	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	110 261
Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, échéance le 15/03/2043	1 977	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, échéance le 15/03/2043	2 511
Ford Motor Co, 6,100 %, échéance le 19/08/2032	1 654	Chord Energy Corp, 144A, 6,375 %, échéance le 01/06/2026	2 072
Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500 %, échéance le 01/04/2027	1 613	CoreCivic Inc, 8,250 %, échéance le 15/04/2026	1 912
Foot Locker Inc, 144A, 4,000 %, échéance le 01/10/2029	1 475	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, échéance le 09/05/2029	1 858
Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, perpétuelle	1 465	Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, échéance le 15/02/2026	1 774
Darling Ingredients Inc, 144A, 6,000 %, échéance le 15/06/2030	1 437	CommScope Inc, 144A, 8,250 %, échéance le 01/03/2027	1 739
NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, échéance le 15/03/2026	1 436	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, échéance le 15/02/2028	1 700
Ardagh Metal Packaging Finance USA, 6,000 %, échéance le 15/06/2027	1 398	NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, échéance le 15/03/2026	1 598
Chord Energy Corp, 144A, 6,375 %, échéance le 01/06/2026	1 347	Permian Resources Operating LLC, 144A, 5,875 %, échéance le 01/07/2029	1 517
Virgin Media Secured Finance plc, 144A, 5,500 %, échéance le 15/05/2029	1 275	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, échéance le 15/09/2024	1 507
Southwestern Energy Co, 4,750 %, échéance le 01/02/2032	1 256	Viking Cruises Ltd, 144A, 7,000 %, échéance le 15/02/2029	1 504
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, échéance le 09/05/2029	1 163	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, échéance le 15/08/2027	1 454
United Rentals North America Inc, 5,250 %, échéance le 15/01/2030	1 138	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, échéance le 01/04/2028	1 415
Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500 %, échéance le 01/04/2027	1 117	Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, échéance le 01/10/2030	1 411
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, échéance le 01/11/2033	1 116	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, échéance le 15/04/2029	1 405
GEO Group Inc/The, 9,500 %, échéance le 31/12/2028	1 113	Virgin Media Secured Finance plc, 144A, 5,500 %, échéance le 15/05/2029	1 386
Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, échéance le 15/02/2026	1 097	MEG Energy Corp, 144A, 7,125 %, échéance le 01/02/2027	1 380
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, échéance le 20/01/2026	1 081	Ardagh Metal Packaging Finance USA, 6,000 %, échéance le 15/06/2027	1 367
Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, échéance le 15/04/2030	1 080	Medline Borrower LP, 144A, 5,250 %, échéance le 01/10/2029	1 343

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund^

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
International Finance Corp, 8,250 %, échéance le 30/01/2023	434	Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Class US\$ Distributing (M)	3 781
Obligation internationale de l'État nigérian, 8,375 %, échéance le 24/03/2029	300	Sasol Financing USA LLC, 4,375 %, échéance le 18/09/2026	506
Asian Development Bank, 2,715 %, échéance le 16/01/2023	299	Obligation internationale de l'État jamaïcain, 6,750 %, échéance le 28/04/2028	474
Ras Laffan Liquefied Natural Gas C 5,838 %, échéance le 30/09/2027	226	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Colombia SA, 4,875 %, échéance le 21/04/2025	473
International Finance Corp., 6,280 %, 05/27/2024	219	ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, échéance le 27/04/2026	464
Asian Development Bank, 4,500 %, échéance le 07/12/2023	215	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT, 6,530 %, échéance le 15/11/2028	457
Obligation internationale de l'État uruguayen, 4,975 %, échéance le 25/04/2055	211	Oman Government International Bond, 4,125 %, arrivant à échéance le 17/01/2023	457
Abu Dhabi National Energy Co, 4,375 %, échéance le 23/04/2025	203	MEGlobal Canada ULC, 5,875 %, échéance le 18/05/2030	457
CDBL Funding 1, 4,250 %, échéance le 02/12/2024	202	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4,250 %, échéance le 19/06/2024	453
Banco Santander Mexico SA, 5,375 %, échéance le 17/04/2025	201	Turk Telekomunikasyon AS, 4,875 %, échéance le 19/06/2024	450
Obligation internationale de l'État d'Angola, 8,250 %, échéance le 09/05/2028	200	United Overseas Bank Ltd, 3,750 %, échéance le 15/04/2029	448
Obligation internationale de l'État d'Angola, 8,750 %, échéance le 14/04/2032	200	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,000 %, échéance le 15/04/2024	448
Consorcio Transmanto SA, 5,200 %, échéance le 11/04/2038	200	Ultrapar International SA, 5,250 %, échéance le 06/10/2026	445
Misc Capital Two Labuan Ltd, 3,625 %, échéance le 06/04/2025	200	Sagicor Financial Co Ltd, 5,300 %, échéance le 13/05/2028	443
Korea Water Resources Corp, 3,500 %, échéance le 27/04/2025	199	Itau Unibanco Holding SA/iles Caiman, 6,125 %, perpétuelle	433
Banco Nacional de Comercio Exterior, 4,375 %, échéance le 14/10/2025	199	Obligation internationale de l'État du Bahreïn, 6,750 %, échéance le 20/09/2029	430
Southern Copper Corp, 3,875 %, échéance le 23/04/2025	199	Lukoil International Finance BV, 6,656 %, échéance le 06/07/2022	430
Korea Gas Corp, 3,875 %, échéance le 13/07/2027	199	Huarong Finance 2019 Co Ltd, 2,125 %, échéance le 30/09/2023	429
Obligation internationale de l'État jordanien, 7,750 %, échéance le 15/01/2028	198	DBS Group Holdings Ltd, 3,300 %, perpétuelle	426
SingTel Group Treasury Pte Ltd, 3,250 %, échéance le 30/06/2025	197	International Finance Corp, 8,250 %, échéance le 30/01/2023	423
ICICI Bank Ltd/Dubai, 4,000 %, échéance le 18/03/2026	197		
Antofagasta PLC, 5,625 %, échéance le 13/05/2032	196		
Freeport Indonesia PT, 4,673 %, échéance le 14/04/2027	196		
NTPC Ltd, 4,500 %, échéance le 19/03/2028	196		
Singapore Airlines Ltd, 3,000 %, échéance le 20/07/2026	193		
Transportadora de Gas del Peru SA, 4,250 %, échéance le 30/04/2028	192		
Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC, 3,650 %, échéance le 02/11/2029	192		
EXPORT-IMPORT BK INDIA, 3,375 %, échéance le 05/08/2026	192		
Foxconn Far East Ltd, 3,000 %, échéance le 23/09/2026	190		
Banco del Estado de Chile, 2,704 %, échéance le 09/01/2025	190		
Banco de Credito del Peru SA, 2,700 %, échéance le 11/01/2025	190		
Indian Railway Finance Corp Ltd, 3,835 %, échéance le 13/12/2027	189		
Transportadora de Gas Internacional, 5,550 %, échéance le 01/11/2028	189		
CBQ Finance Ltd, 2,000 %, échéance le 15/09/2025	188		
CCBL Cayman 1 Corp Ltd, 1,990 %, échéance le 21/07/2025	188		
America Movil SAB de CV, 3,625 %, échéance le 22/04/2029	187		
ST Engineering RHQ Ltd, 1,500 %, échéance le 29/04/2025	187		
Empresa Nacional del Petroleo, 3,750 %, échéance le 05/08/2026	187		
CDBL Funding 2, 2,000 %, échéance le 04/03/2026	186		
Inventive Global Investments Ltd, 1,650 %, échéance le 09/03/2025	186		
Chinalco Capital Holdings Ltd, 2,125 %, échéance le 03/06/2026	185		

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^] – (suite)

	COÛT (en milliers)
PRINCIPAUX ACHATS	USD
Kallpa Generacion SA, 4,125 %, échéance le 16/08/2027	185
Kia Motors Corp, 2,750 %, échéance le 14/02/2027	184
Transec SA, 3,875 %, échéance le 12/01/2029	183
ICBCIL Finance Co Ltd, 1,750 %, échéance le 02/08/2026	182
Braskem Netherlands Finance BV, 4,500 %, échéance le 10/01/2028	182
QNB Finance Ltd, 1,375 %, échéance le 26/01/2026	182
Korea South-East Power, 1,000 %, échéance le 03/02/2026	181
Consorcio Transmuntaro SA, 4,700 %, échéance le 16/04/2034	181
TSMC Arizona Corp, 1,750 %, échéance le 25/10/2026	181
MDGH GMTN RSC Ltd, 2,875 %, échéance le 21/05/2030	180
Hyundai Assan Otomotiv Sanayi ve T AS, 1,625 %, échéance le 12/07/2026	179
Hana Bank, 1,250 %, échéance le 16/12/2026	178
Vale Overseas Ltd, 3,750 %, échéance le 08/07/2030	177
Empresa Generadora de Electricidad, 5,625 %, échéance le 08/11/2028	174
GNL Quintero SA, 4,634 %, échéance le 31/07/2029	171
Obligation internationale de l'État brésilien, 3,875 %, échéance le 12/06/2030	170
Petronas Capital Ltd, 2,480 %, échéance le 28/01/2032	170
Engie Energia Chile SA, 3,400 %, échéance le 28/01/2030	169
AIRPORT AUTHORITY HK, 1,625 %, échéance le 04/02/2031	168
GC Treasury Center Co Ltd, 2,980 %, échéance le 18/03/2031	168
DP World Ltd/Émirats Arabes Unis, 4,700 %, échéance le 30/09/2049	166
Obligation internationale de l'État mexicain, 2,659 %, échéance le 24/05/2031	164
Obligation internationale de l'État indonésien, 1,850 %, échéance le 12/03/2031	164
Obligation internationale de l'État chilien, 2,550 %, échéance le 27/07/2033	163
Alpek SAB de CV, 3,250 %, échéance le 25/02/2031	162
Pertamina Persero PT, 2,300 %, échéance le 09/02/2031	161
Banco Nacional de Panama, 2,500 %, échéance le 11/08/2030	160
Obligation de l'État du Costa Rica, 5,625 %, échéance le 30/04/2043	157
Comision Federal de Electricidad, 3,348 %, échéance le 09/02/2031	156
Qatar Energy, 3,125 %, échéance le 12/07/2041	156
Cemex SAB de CV, 3,875 %, échéance le 11/07/2031	154
Obligation internationale de l'État paraguayen, 2,739 %, échéance le 29/01/2033	152
Fondo Mivivienda SA, 4,625 %, échéance le 12/04/2027	149
Obligation internationale de l'État sud-africain, 5,375 %, échéance le 24/07/2044	146

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^]

	COÛT (en milliers)	PRODUITS (en milliers)
PRINCIPAUX ACHATS	USD	USD
Prosperous Ray Ltd, 4,625 %, échéance le 12/11/2023	343	724
Obligation internationale de l'État angolais, 8,750 %, échéance le 14/04/2032	200	535
Consorcio Transmuntaro SA, 5,200 %, échéance le 11/04/2038	200	436
Obligation internationale de l'État nigérian, 8 375 %, échéance le 24/03/2029	200	398
		396
		385
		381
		376
		374
		373
		364
		362
		346
		342
		341
		340
		337
		331
		317
		312
		307
		291
		287
		265
		262

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

	COÛT (en milliers)	PRODUITS (en milliers)
PRINCIPAUX ACHATS	USD	USD
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, échéance le 15/01/2034	1 793	3 283
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 29/12/2022	1 499	1 788
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,000 %, échéance le 15/02/2025	1 463	
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 28/02/2027	1 395	
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/06/2025	1 225	
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,500 %, échéance le 29/02/2024	1 162	
Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 19/01/2028	1 140	
Credit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, perpétuelle	799	
Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 23/05/2029	799	
Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, échéance le 01/04/2028	769	
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 31/05/2029	711	
United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, arrivant à échéance le 31/08/2029	679	
		1 761
		1 500
		1 484
		1 457
		1 234
		1 140
		963
		936
		914

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

FTGF Western Asset Global High Yield Fund – (suite)

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT (en milliers)	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers)
	USD		USD
Service Properties Trust, 5,500 %, échéance le 15/12/2027	664	DIRECTV Financing LLC, 5,750 %, échéance le 22/07/2027	862
Las Vegas Sands Corp, 3,900 %, échéance le 08/08/2029	646	Las Vegas Sands Corp, 3,900 %, échéance le 08/08/2029	847
NCL Finance Ltd, 144A, 6,125 %, échéance le 15/03/2028	643	Petroleos Mexicanos, 6,625 %, arrivant à échéance le 15/06/2035	831
CSC Holdings LLC, 144A, 5,000 %, échéance le 15/11/2031	624	Obligation fédérale russe – OFZ, Series 6224, 6,900 %, échéance le 23/05/2029	799
Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, échéance le 15/08/2027	621	United Airlines Inc, 4,500 %, échéance le 14/04/2028	732
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/11/2025	572	Bon du Trésor indonésien, série FR61, 7,000 %, échéance le 15/05/2022	687
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,500 %, échéance le 28/02/2026	571	Viking Cruises Ltd, 144A, 7,000 %, échéance le 15/02/2029	649
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, échéance le 01/06/2032	569	Saga Plc, 5,500 %, échéance le 15/07/2026	620
Yuzhou Group, 0,000 %, échéance le 25/10/2023	550	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, échéance le 15/04/2029	580
Ford Motor Co, 3,250 %, échéance le 12/02/2032	548	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/11/2025	572
CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, échéance le 15/01/2030	536	Transportadora de Gas del Sur SA, 144A, 6,750 %, échéance le 02/05/2025	568
NCL Corp Ltd, 144A, 3,625 %, échéance le 15/12/2024	506	Energy Transfer LP, série F, 6,750 %, perpétuelle	565
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 31/08/2023	498	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,500 %, échéance le 28/02/2026	557
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,500 %, échéance le 15/09/2025	493	CoreCivic Inc, 8,250 %, échéance le 15/04/2026	553
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 30/09/2023	493	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	551
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,750 %, échéance le 31/12/2023	480	Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 6,000 %, échéance le 25/10/2023	550
Obligation internationale de l'État ukrainien, 144A, 7,750 %, échéance le 01/09/2028	457		
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,500 %, échéance le 31/01/2027	446		
American Airlines Inc/Advantage Loyalty IP Ltd, 5,750 %, échéance le 20/04/2029	445		
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,500 %, échéance le 30/04/2027	445		
Obligation internationale de l'État jordanien, 144A, 7,750 %, échéance le 15/01/2028	436		

Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^]

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT (en milliers)	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers)
	USD		USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	8 516	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, arrivant à échéance le 15/04/2023	12 196
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, arrivant à échéance le 15/01/2027	2 542	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Classe WA (Distribution)	11 525
Obligation indexée sur l'IPC de l'État japonais, série 21, 0,100 %, échéance le 10/03/2026	2 033	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, arrivant à échéance le 15/01/2027	7 271
Obligation indexée sur l'inflation de la Deutsche Bundesrepublik, série VL, 0,500 %, échéance le 15/04/2030	1 921	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, arrivant à échéance le 15/01/2030	3 908
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,750 %, échéance le 31/05/2026	1 842	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 3,875 %, arrivant à échéance le 15/04/2029	3 726
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,250 %, échéance le 31/07/2031	1 736	Obligation indexée sur l'inflation de la Deutsche Bundesrepublik, série VL, 0,500 %, échéance le 15/04/2030	3 715
Bundesbol, 0,000 %, échéance le 16/04/2027	1 432	French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 0,250 %, arrivant à échéance le 25/07/2024	3 463
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, série CPI, 144A, 2,690 %, échéance le 15/09/2023	1 380	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, série CPI, 144A, 3,100 %, échéance le 15/09/2026	3 205
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, arrivant à échéance le 15/01/2030	1 252	Obligation indexée sur l'IPC de l'État japonais, série 22, 0,100 %, échéance le 10/03/2027	2 752
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,375 %, échéance le 31/10/2028	1 176	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,750 %, échéance le 31/05/2026	2 577
Obligation de l'État français, OAT, série OATe, 0,000 %, échéance le 25/11/2030	1 026	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, arrivant à échéance le 15/07/2025	2 395
Obligation indexée sur l'inflation de la Deutsche Bundesrepublik, série VL, 0,000 %, échéance le 15/02/2031	932	Obligation indexée sur l'inflation de la Deutsche Bundesrepublik, série VL, 0,100 %, échéance le 15/04/2023	2 104
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, arrivant à échéance le 15/04/2023	829	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, arrivant à échéance le 15/01/2026	2 074
Obligation de l'État polonais, 1,750 %, échéance le 25/04/2032	726	Obligation indexée sur l'IPC de l'État japonais, série 21, 0,100 %, échéance le 10/03/2026	2 030
French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 0,250 %, arrivant à échéance le 25/07/2024	615	French Republic Government Bond OAT, Series OATe, 1,850 %, arrivant à échéance le 25/07/2027	1 886
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,375 %, arrivant à échéance le 15/02/2044	550	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,500 %, arrivant à échéance le 15/01/2028	1 555
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 31/07/2027	479	Obligations indexées sur l'inflation du Trésor des États-Unis, 0,250 %, échéance le 31/07/2031	1 553
Obligation indexée sur l'inflation du Royaume-Uni, 1,250 %, échéance le 22/11/2027	454	Obligation indexée sur l'IPC de l'État japonais, série 23, 0,100 %, échéance le 10/03/2028	1 501
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,125 %, échéance le 15/05/2040	403	Bundesbol, 0,000 %, échéance le 16/04/2027	1 431
Bon du Trésor indonésien, série FR79, 8,375 %, échéance le 15/04/2039	343	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, série CPI, 144A, 2,690 %, échéance le 15/09/2023	1 328
		Obligations indexées sur l'inflation du Trésor des États-Unis, 1,375 %, échéance le 31/10/2028	1 192
		Obligation de l'État français, OAT, série OATe, 0,000 %, échéance le 25/11/2030	963
		Obligation indexée sur l'inflation de la Deutsche Bundesrepublik, série VL, 0,000 %, échéance le 15/02/2031	921

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT (en milliers)	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers)
	USD		USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	142 888	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	151 338
Bon du Trésor coréen, série 3206, 3,375 %, échéance le 10/06/2032	17 969	Obligation internationale de l'État philippin, 3,900 %, échéance le 26/11/2022	17 925
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,500 %, échéance le 29/02/2024	14 857	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,500 %, échéance le 29/02/2024	14 456
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,125 %, échéance le 15/12/2023	14 297	Bon de l'Autorité monétaire de Singapour, série 84, coupon zéro, échéance le 26/08/2022	13 856
Bon de l'Autorité monétaire de Singapour, série 84, coupon zéro, échéance le 26/08/2022	14 069	China Development Bank, série 2103, 3,300 %, échéance le 03/03/2026	12 876
Obligation de l'État malaisien, série 0122, 3,582 %, échéance le 15/07/2032	11 522	Obligation internationale de l'État australien, 0,250 %, échéance le 21/11/2025	10 051
Obligation internationale de l'État australien, 0,250 %, échéance le 21/11/2025	10 534	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,125 %, échéance le 15/12/2023	9 225
Bon de l'Autorité monétaire de Singapour, série 87, coupon zéro, échéance le 10/04/2023	8 544	China Government Bond, Series INBK, 3,810 %, arrivant à échéance le 14/09/2050	9 064
Bon du Trésor coréen, série 2409, 3,125 %, échéance le 10/09/2024	7 497	BNP Paribas SA VAR, 5,250 %, échéance le 12/07/2032	7 211
Bon de l'Autorité monétaire de Singapour, série 84, coupon zéro, échéance le 10/03/2023	7 350	Macquarie Group Ltd VAR, 4,500 %, échéance le 18/08/2026	6 635
Bon de l'Autorité monétaire de Singapour, série 84, coupon zéro, échéance le 03/03/2023	7 281	China Development Bank, série 2008, 2,890 %, échéance le 22/06/2025	6 351
BNP Paribas SA VAR, 5,250 %, échéance le 12/07/2032	7 162	Obligation de l'État malaisien, série 0115, 3,955 %, échéance le 15/09/2025	6 312
United Overseas Bank Ltd, 3,875 %, perpétuelle	6 866	Bon de l'Autorité monétaire de Singapour, série 84, coupon zéro, échéance le 18/11/2022	6 199
Macquarie Group Ltd VAR, 4,500 %, échéance le 18/08/2026	6 572	NTPC Ltd, 7,250 %, échéance le 03/05/2022	5 887
Bon de l'Autorité monétaire de Singapour, série 84, coupon zéro, échéance le 18/11/2022	6 241	ABN AMRO Bank NV, 5,500 %, échéance le 05/10/2032	5 884
Bon du Trésor indonésien, série FR87, 6,500 %, échéance le 15/02/2031	6 185	National Highways Authority of India, 7,300 %, échéance le 18/05/2022	5 800
ABN AMRO Bank NV, 5,500 %, échéance le 05/10/2032	5 765	Bon du Trésor coréen, série 2912, 1,375 %, échéance le 10/12/2029	5 003
Obligation de l'État indien, 7,380 %, échéance le 20/06/2027	4 818	Obligation de l'État malaisien, série 0118, 3,882 %, échéance le 14/03/2025	4 720
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/02/2048	4 559	Bon de l'Autorité monétaire de Singapour, série 84, coupon zéro, échéance le 09/12/2022	4 435
Bon de l'Autorité monétaire de Singapour, série 84, coupon zéro, échéance le 09/12/2022	4 233	Obligation de l'État chinois, série INBK, 3,390 %, échéance le 16/03/2050	4 394
Westpac Banking Corp VAR, 4,650 %, échéance le 07/09/2032	3 576	CNI Capital Ltd, 3,970 %, échéance le 01/11/2022	4 107
Mercatus Co-operative Ltd, série DMTN, 2,800 %, échéance le 26/07/2024	3 280	Bon du Trésor indonésien, série FR52, 10,500 %, échéance le 15/08/2030	3 817
		Westpac Banking Corp VAR, 4,650 %, échéance le 07/09/2032	3 558

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

	COÛT (en milliers) USD	PRODUITS (en milliers) USD
PRINCIPAUX ACHATS		
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	259 904	249 500
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,000 %, échéance le 15/12/2024	35 523	14 766
Nederlandse Waterschapsbank NV, 4,500 %, échéance le 18/06/2025	10 599	7 719
Svensk Exportkredit AB, 4,500 %, échéance le 11/03/2026	7 291	5 830
AstraZeneca Plc, 3,625 %, échéance le 03/03/2027	6 328	5 125
Temasek Financial I Ltd, 3,250 %, échéance le 15/02/2027	5 676	4 413
Union Pacific Corp, 4,750 %, échéance le 21/02/2026	5 316	3 837
American Express Co, 4,900 %, échéance le 13/02/2026	5 216	3 811
ABN AMRO Bank NV, 5,125 %, échéance le 22/02/2028	5 169	3 665
Sanofi, 1,250 %, échéance le 06/04/2029	4 986	2 334
GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,375 %, échéance le 12/09/2029	4 726	2 217
Bank of America Corp, 5,015 %, échéance le 22/07/2033	4 605	2 098
UBS Group AG, 4,703 %, échéance le 05/08/2027	4 430	2 057
Coca-Cola Co/The, 0,125 %, échéance le 15/03/2029	4 401	1 941
Banque Royale du Canada, 5,000 %, échéance le 24/01/2028	3 978	1 927
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3,375 %, échéance le 24/08/2031	3 942	1 905
Texas Instruments Inc, 4,600 %, échéance le 15/02/2028	3 843	1 810
Roche Finance Europe BV, 3,204 %, échéance le 27/08/2029	3 739	1 801
CPPIB Capital Inc, 4,375 %, échéance le 02/03/2026	3 620	1 422
Danske Bank A/S, 4,625 %, échéance le 13/04/2027	3 464	1 402
PRINCIPALES VENTES		
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)		
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/11/2027		14 766
Bank of America Corp, 3,550 %, arrivant à échéance le 05/03/2024		7 719
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,625 %, échéance le 15/05/2030		5 830
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,750 %, échéance le 31/03/2026		5 125
Citigroup Inc, 3,300 %, arrivant à échéance le 27/04/2025		4 413
Bank of Nova Scotia/The, 1,375 %, échéance le 05/12/2023		3 837
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, 1,000 %, échéance le 11/02/2023		3 811
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,500 %, échéance le 15/02/2030		3 665
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0,875 %, échéance le 18/09/2023		2 334
Nuveen LLC, 4,000 %, échéance le 01/11/2028		2 217
Enel Finance International NV, 0,000 %, échéance le 17/06/2024		2 098
BP Capital Markets Plc, 3,506 %, échéance le 17/03/2025		2 057
Prudential Financial Inc, 1,500 %, échéance le 10/03/2026		1 941
Abbott Laboratories, 3,750 %, échéance le 30/11/2026		1 927
European Investment Bank, 0,750 %, échéance le 14/07/2023		1 905
Toyota Finance Australia Ltd, 1,584 %, échéance le 21/04/2022		1 810
Lloyds Bank Corporate Markets Plc, 1,500 %, échéance le 23/06/2023		1 801
Medtronic Global Holding SCA, 0,250 %, échéance le 02/07/2025		1 422
Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, arrivant à échéance le 26/07/2029		1 402

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^

	COÛT (en milliers) USD	PRODUITS (en milliers) USD
PRINCIPAUX ACHATS		
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,125 %, échéance le 28/02/2025	18 824	18 053
United Kingdom Gilt, 4,250 %, arrivant à échéance le 06/07/2032	9 010	17 142
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,250 %, échéance le 31/08/2025	8 257	15 851
Obligation de l'État australien, série 139, 3,250 %, échéance le 21/04/2025	7 559	10 126
Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 30/11/2023	4 789	7 480
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,375 %, échéance le 30/04/2025	4 447	4 249
Obligation fédérale russe – OFZ, Series 6224, 6,900 %, échéance le 23/05/2029	4 249	4 126
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	4 147	4 074
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	4 068	4 058
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	3 975	3 962
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2052	3 598	3 484
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	3 506	3 254
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	3 305	3 217
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, échéance le 15/08/2028	2 829	3 188
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	2 720	2 793
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	2 643	2 714
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	2 506	2 668
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	2 235	2 566
Obligation de l'État polonais, série 0432, 1,750 %, échéance le 25/04/2032	1 957	2 329
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	1 889	2 140
PRINCIPALES VENTES		
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,375 %, échéance le 31/01/2026		18 053
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,250 %, échéance le 31/08/2025		17 142
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,375 %, échéance le 30/04/2025		15 851
Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class LM		10 126
Obligation de l'État australien, série 157, 3,250 %, échéance le 21/04/2025		7 480
Obligation fédérale russe – OFZ, Series 6224, 6,900 %, échéance le 23/05/2029		4 249
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro		4 126
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro		4 074
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,250 %, échéance le 30/06/2025		4 058
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro		3 962
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro		3 484
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro		3 254
Obligation indexée sur l'IPC de l'État japonais, série 21, 0,100 %, échéance le 10/03/2026		3 217
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,125 %, échéance le 28/02/2025		3 188
Obligation internationale de l'État indonésien, 4,200 %, échéance le 15/10/2050		2 793
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro		2 714
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro		2 668
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %		2 566
United Kingdom Gilt, 4,250 %, arrivant à échéance le 06/07/2032		2 329
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,375 %, échéance le 15/08/2050		2 140

FTGF Western Asset Global Credit Fund^

	COÛT (en milliers) USD	PRODUITS (en milliers) USD
PRINCIPAUX ACHATS		
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	22 704	22 863
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, arrivant à échéance le 15/02/2030	937	976
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/02/2031	656	611
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2052	650	607
UBS Group AG, 4,703 %, échéance le 05/08/2027	630	
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, série 2007, 4,250 %, échéance le 04/07/2039	616	590
Bundesobligation, série 182, 0,000 %, échéance le 10/10/2025	559	572
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, arrivant à échéance le 15/02/2029	558	549
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, échéance le 01/06/2041	479	486
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, échéance le 15/02/2027	421	466
Elo SACA, 4,875 %, échéance le 08/12/2028	418	
Suez SACA, 1,875 %, échéance le 24/05/2027	416	456
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/08/2029	390	419
Bank of America Corp, 2,676 %, échéance le 19/06/2041	384	414
Enel Finance International NV, 144A, 7,750 %, échéance le 14/10/2052	382	410
Vestas Wind Systems Finance BV, 1,500 %, échéance le 15/06/2029	359	401
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,250 %, échéance le 30/04/2028	346	398
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,000 %, échéance le 15/11/2026	326	373
SSE Plc, 4,000 %, perpétuelle	292	
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, échéance le 15/02/2025	276	372
PRINCIPALES VENTES		
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)		365
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, arrivant à échéance le 15/02/2030		355
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/02/2031		
UBS Group AG, 4,703 %, échéance le 05/08/2027		
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, série 2007, 4,250 %, échéance le 04/07/2039		
Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, arrivant à échéance le 26/07/2029		
Anheuser-Busch InBev SA/NV, 3,700 %, échéance le 02/04/2040		
NatWest Group Plc, 2,500 %, échéance le 22/03/2023		
AbbVie Inc, 3,200 %, échéance le 21/11/2029		
MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,692 %, échéance le 05/06/2028		
Elo SACA, 4,875 %, échéance le 08/12/2028		
Intesa Sanpaolo SpA, 1,000 %, échéance le 04/07/2024		
Allianz SE, 4,750 %, perpétuelle		
Annington Funding Plc, 1,650 %, échéance le 12/07/2024		
Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, échéance le 22/05/2045		
Schlumberger Holdings Corp, 4,000 %, échéance le 21/12/2025		
Marks & Spencer Plc, 3,750 %, arrivant à échéance le 19/05/2026		
Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 2,875 %, échéance le 15/10/2026		
Citigroup Inc, 8,125 %, échéance le 15/07/2039		
Wells Fargo & Co, 1,000 %, échéance le 02/02/2027		

Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^

	COÛT (en milliers) Euro	PRODUITS (en milliers) Euro
PRINCIPAUX ACHATS		
Whitbread Group Plc, 2,375 %, échéance le 31/05/2027	338	900
PRINCIPALES VENTES		
Telefonica Europe BV, 4,375 %, perpétuelle		665
Schenck Process Holding GmbH/Darmstadt, 5,375 %, échéance le 15/06/2023		659
Gateway Airport Finance Plc, 4,375 %, échéance le 07/04/2026		640
Petrobras Global Finance BV, 6,625 %, échéance le 16/01/2034		624
Summer BC Holdco B SARL, 5,750 %, échéance le 31/10/2026		

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] – (suite)

PRINCIPALES VENTES	Euro	PRODUITS
		(en milliers)
Eircom Finance DAC, 2,625 %, échéance le 15/02/2027	586	
Tendam Brands SAU, 5,000 %, échéance le 15/09/2024	581	
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,125 %, échéance le 15/10/2024	574	
Galaxy Bidco Ltd, 6,500 %, arrivant à échéance le 31/07/2026	571	
Petroleos Mexicanos, 2,750 %, arrivant à échéance le 21/04/2027	550	
ASR Media and Sponsorship SpA, 5,125 %, arrivant à échéance le 01/08/2024	544	
PCF GmbH, 4,750 %, échéance le 15/04/2026	527	
Telefonica Europe BV, Series NC5, 3,000 %, Perpetual	503	
Victoria Plc, 3,625 %, échéance le 24/08/2026	490	
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl, 4,875 %, échéance le 01/06/2028	485	
Saga Plc, 5,500 %, échéance le 15/07/2026	479	
Trivium Packaging Finance BV, 3,750 %, arrivant à échéance le 15/08/2026	466	
Renk AG/Francfort-sur-le-Main, 5,750 %, échéance le 15/07/2025	461	
United Group BV, 4,000 %, arrivant à échéance le 15/11/2027	455	
Energia Group NI FinanceCo Plc/Energia Group ROI Holdings DAC, 4,000 %, échéance le 15/09/2025	453	
Verisure Holding AB, 3,875 %, arrivant à échéance le 15/07/2026	450	
Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 4,375 %, arrivant à échéance le 15/01/2028	437	
Wheel Bidco Ltd, 6,750 %, échéance le 15/07/2026	437	
Schoeller Packaging BV, 6,375 %, échéance le 01/11/2024	429	
Altice France Holding SA, 8,000 %, arrivant à échéance le 15/05/2027	425	
Telecom Italia SpA/Milano, 3,625 %, arrivant à échéance le 25/05/2026	412	
RCS & RDS SA, 3,250 %, échéance le 05/02/2028	412	
Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, échéance le 18/09/2027	410	
Vmed O2 UK Financing I Plc, 4,500 %, échéance le 15/07/2031	407	
Nidda BondCo GmbH, 5,000 %, échéance le 30/09/2025	403	
ZF Finance GmbH, 2,000 %, échéance le 06/05/2027	393	
Renault SA, 2,500 %, échéance le 01/04/2028	388	
Kapla Holding SAS, 3,375 %, échéance le 15/12/2026	379	
Marcolin SpA, 6,125 %, échéance le 15/11/2026	374	
International Game Technology Plc, 2,375 %, échéance le 15/04/2028	369	
Pinewood Finance Co Ltd, 3,250 %, échéance le 30/09/2025	350	
Repsol International Finance BV, 4,500 %, échéance le 25/03/2075	350	
CT Investissements GmbH, 5,500 %, échéance le 15/04/2026	338	
Brunello Bidco SpA, 3,750 %, arrivant à échéance le 15/02/2028	334	
Whitbread Group Plc, 2,375 %, échéance le 31/05/2027	330	
Ideal Standard International SA, 6,375 %, échéance le 30/07/2026	326	
Marston's Issuer Plc, série B1, 3,049 %, échéance le 16/07/2035	313	
Goldstory SASU, 5,375 %, arrivant à échéance le 01/03/2026	308	
United Group BV, 5,250 %, arrivant à échéance le 02/01/2030	307	

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT (en milliers) USD		PRINCIPALES VENTES	USD	PRODUITS
					(en milliers)
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	2 296 315		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)		2 279 946
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/02/2052	433 569		Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/02/2052		349 149
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 28/02/2027	242 054		Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 28/02/2027		237 301
Obligation fédérale russe – OFZ, 7,050 %, échéance le 19/01/2028	174 142		Mexican Bonos, série M, 7,750 %, échéance le 13/11/2042		214 814
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, arrivant à échéance le 31/01/2028	151 757		Obligation fédérale russe – OFZ, Series 6212, 7,050 %, échéance le 19/01/2028		174 142
Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 23/05/2029	121 932		Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class LM		149 026
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 31/05/2029	89 178		Bon/obligation du Trésor des États-Unis – OFZ, Series 6224, 6,900 %, échéance le 23/05/2029		121 932
Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 10/05/2034	82 074		Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,775 %, échéance le 31/05/2029		89 273
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, arrivant à échéance le 15/11/2051	74 960		Obligation fédérale russe – OFZ, Series 6225, 7,250 %, échéance le 10/05/2034		82 074
Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 03/02/2027	73 240		Obligation de l'État chinois, série INBK, 3,390 %, échéance le 16/03/2050		75 611
Obligation de l'État polonais, série 0432, 1,750 %, échéance le 25/04/2032	68 219		Bon du Trésor indonésien, série FR82, 7,000 %, échéance le 15/09/2030		74 631
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,375 %, échéance le 15/02/2042	65 653		Obligation fédérale russe – OFZ, Series 6207, 8,150 %, échéance le 03/02/2027		73 240
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 15/08/2032	63 143		Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 15/08/2032		62 172
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,000 %, échéance le 15/11/2052	58 986		United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, arrivant à échéance le 15/11/2051		61 941
Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 16/03/2039	54 137		Obligation fédérale russe – OFZ, Series 6230, 7,500 %, échéance le 19/01/2028		55 907
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 30/04/2029	47 391		Obligation fédérale russe – OFZ, Series 6230, 7,700 %, échéance le 16/03/2039		54 137
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2052	46 268		Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,375 %, échéance le 15/02/2042		53 689
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,250 %, échéance le 30/06/2029	42 351		Obligation de l'État australien, série 150, 3,000 %, échéance le 21/03/2047		52 666
United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, arrivant à échéance le 31/08/2029	42 077		Occidental Petroleum Corp, coupon zéro, échéance le 10/10/2036		48 876
United States Treasury Note/Bond, 2,625 %, arrivant à échéance le 31/07/2029	41 572		Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 30/04/2029		47 265

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT (en milliers) USD		PRINCIPALES VENTES	USD	PRODUITS
					(en milliers)
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,500 %, échéance le 29/02/2024	11 350		Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 0,500 %, échéance le 30/11/2023		21 046
Obligation fédérale russe – OFZ, Series 6212, 7,050 %, échéance le 19/01/2028	6 122		Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,500 %, échéance le 29/02/2024		11 225
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 31/03/2024	5 782		Obligation fédérale russe – OFZ, Series 6212, 7,050 %, échéance le 19/01/2028		6 122
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 4,500 %	4 876		Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 31/03/2024		5 713
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,125 %, échéance le 31/10/2027	2 517		Targa Resources Corp, série A		5 345
Fannie Mae Pool, 4,500 %, échéance le 01/01/2053	2 461		Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 4,500 %		4 876
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 4,500 %	2 448		Southwestern Energy Co, 7,750 %, échéance le 01/10/2027		2 997
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 4,500 %	2 415		Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Class US\$ Distributing (M)		2 706
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 4,500 %	2 073		Bon du Trésor indonésien, série FR56, 8,375 % échéance le 15/09/2026		2 678
Warnermedia Holdings Inc, 144A, 3,755 %, échéance le 15/03/2027	2 013		Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 4,500 %		2 449
Ford Motor Co, 6,100 %, échéance le 19/08/2032	1 973				

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^] – (suite)

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT (en milliers) USD	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers) USD
Southwestern Energy Co, 7,750 %, échéance le 01/10/2027	1 719	Fannie Mae Pool, 4,500 %, échéance le 01/01/2053	2 415
ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750 %, échéance le 29/04/2025	1 642	Carnival Corp, 144A, 9,875 %, échéance le 01/08/2027	2 247
Southwestern Energy Co, 8,375 %, échéance le 15/09/2028	1 561	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,500 %, échéance le 31/05/2024	2 076
Royal Caribbean Cruises Ltd, 0,000 %, échéance le 05/04/2022	1 560	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European	
Titan International Inc, 7,000 %, échéance le 30/04/2028	1 553	Loan Fund – Actions de capitalisation en EUR de catégorie LM	2 046
Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250 %, échéance le 15/06/2029	1 489	Obligation fédérale russe – OFZ, Series 6212, 7,050 %, échéance le 19/01/2028	1 910
Gen Digital Inc, 144A, 7,125 %, échéance le 30/09/2030	1 439	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, échéance le 01/05/2025	1 870
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,500 %, échéance le 30/11/2024	1 401	Obligation internationale de l'État indonésien, 5,250 %, échéance le 17/01/2042	1 694
Darling Ingredients Inc, 144A, 6,000 %, échéance le 15/06/2030	1 374	Carnival Plc, 7,875 %, échéance le 01/06/2027	1 634
		Royal Caribbean Cruises Ltd, 0,000 %, échéance le 05/04/2022	1 560
		T-Mobile USA Inc, 4,750 %, échéance le 01/02/2028	1 493

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT (en milliers) USD	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	402 217	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	421 262
CSMC Trust 2018-J1 Trust, série 2018 J1, 144A, 3,591 %, échéance le 25/02/2048	16 893	CSMC Trust 2018-J1 Trust, série 2018 J1, catégorie B7, 144A, 5,117 %, échéance le 25/02/2048	32 798
CSMC Trust 2018-J1 Trust, série 2018 J1, catégorie B6, 144A, 3,591 %, échéance le 25/02/2048	9 236	CSMC Trust 2018-J1 Trust, série 2018 J1, 144A, 3,591 %, échéance le 25/02/2048	12 035
CSMC Trust 2018-J1 Trust, série 2018 J1, catégorie B5, 144A, 3,591 %, échéance le 25/02/2048	5 299	CSMC Trust 2017-CHOP, série 2017 CHOP, catégorie F, 144A, 4,541 %, échéance le 15/07/2032	10 923
PMT Credit Risk Transfer Trust, 144A, 6,867 %, échéance le 27/02/2025	3 455	BHMS 2018-MZB, série 2018 MZB, catégorie MZB, 144A, 11,224 %, échéance le 15/07/2025	9 588
PMT Credit Risk Transfer Trust, 144A, 8,217 %, échéance le 29/04/2024	3 374	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2017 C05, catégorie 1M2C, 2,387 %, échéance le 25/01/2030	8 657
Government National Mortgage Association, série 2022 202, catégorie Z, 3,000 %, échéance le 16/10/2063	2 964	Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, série 2019 1A, catégorie A2II, 144A, 4,723 %, échéance le 05/06/2049	7 868
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2022-JERI, série 2022 JERI, catégorie G, 144A, 12,020 %, échéance le 15/01/2039	2 912	Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, série 2020 1A, catégorie D, 144A, 3,340 %, échéance le 20/08/2026	7 841
Two Harbors Investment Corp, 6,250 %, échéance le 15/01/2026	2 576	Radnor Re 2018-1 Ltd, série 2018 1, catégorie M2, 144A, 2,887 %, échéance le 25/03/2028	7 659
Government National Mortgage Association, série 2023 16, catégorie Z, 3,500 %, échéance le 16/07/2063	1 896	KeyCorp Student Loan Trust 2005-A, série 2005 A, catégorie 2C, 1,520 %, échéance le 27/12/2038	7 569
Waterfall Commercial Mortgage Trust 2015-SBC5, série 2015 SBC5, catégorie B, 144A, 6,461 %, échéance le 14/09/2022	1 343	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, série 2017 FL11, catégorie E, 144A, 8,608 %, échéance le 15/10/2032	7 255
CSMC Trust 2018-J1 Trust, série 2018 J1, catégorie AX1, 144A, 0,091 %, échéance le 25/02/2048	1 319	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, série 2019 FAME, catégorie D, 144A, 4,398 %, échéance le 15/08/2036	6 788
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, série 2017 FL11, catégorie E, 144A, 8,608 %, échéance le 15/10/2032	511	ZH Trust 2021-1, série 2021 1, catégorie B, 144A, 3,262 %, échéance le 18/02/2027	6 540
Banc of America Funding 2015-R4 Trust, série 2015 R4, catégorie 4A3, 144A, 7,589 %, échéance le 27/01/2030	323	JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, série 2018 5, catégorie B3, 144A, 3,750 %, échéance le 25/10/2048	6 536
Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, série 2020 DNA2, catégorie B2, 144A, 9,417 %, échéance le 25/02/2050	88	Bellemeade Re 2018-3 Ltd, série 2018 3 A, catégorie B1, 144A, 4,087 %, échéance le 25/10/2028	6 509
Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2005-9XS, série 2005 9XS, catégorie M2, 5,592 %, échéance le 25/06/2035	71	Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3, série 2017 BNK3, catégorie E, 144A, 4,495 %, échéance le 15/02/2050	6 467
Opteum Mortgage Acceptance Corp Trust 2006-1, série 2006 1, catégorie M1, 5,172 %, échéance le 25/04/2036	66	BBCMS Trust 2018-BXH, série 2018 BXH, catégorie C, 144A, 1,691 %, échéance le 15/10/2037	6 453
BCAP LLC 2014-RR2, série 2014 RR2, catégorie 10A2, 144A, 3,540 %, échéance le 26/07/2046	30	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-3PCK, série 2018 3PCK, catégorie B, 144A, 2,691 %, échéance le 15/09/2031	6 240
DSL Mortgage Loan Trust 2007-AR1, série 2007 AR1, catégorie 2A1B, 4,771 %, échéance le 19/04/2047	22	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2018 C05, catégorie 1B1, 4,437 %, échéance le 25/01/2031	6 151
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR6, série 2005 AR6, catégorie 2A2, 5,277 %, échéance le 25/04/2035	19	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, série 2020 R01, catégorie 1B1, 144A, 3,437 %, échéance le 25/01/2040	5 955

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

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT (en milliers) USD	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	361 343	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	378 839
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	91 396	Bon du Trésor à très court terme des États-Unis, coupon zéro, échéance le 03/05/2022	104 644
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	76 311	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	91 396
Ginnie Mae, 30 ans, TBA, coupon zéro	66 124	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	74 020
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	51 114	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	72 634
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	43 317	Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 3,000 %	69 546
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	32 987	Ginnie Mae, 30 ans, TBA, coupon zéro	64 102
Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 3,000 %	32 691	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	51 192
Ginnie Mae, 30 ans, TBA, coupon zéro	32 549	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	33 271
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	30 455	Ginnie Mae, 30 ans, TBA, coupon zéro	32 555
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	29 569	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	29 654
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	28 299	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	29 513
Ginnie Mae, 30 ans, TBA, coupon zéro	28 130	Ginnie Mae, 30 ans, TBA, coupon zéro	27 892
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	27 114	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	27 497
Ginnie Mae, 30 ans, TBA, coupon zéro	25 898	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	27 157
Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 22/11/2022	25 581	Ginnie Mae, 30 ans, TBA, coupon zéro	26 028
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	24 230	Bon du Trésor des États-Unis, coupon zéro, échéance le 22/11/2022	25 597
Ginnie Mae, 30 ans, TBA, coupon zéro	24 200	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	24 224
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	23 524	Ginnie Mae, 30 ans, TBA, coupon zéro	23 966
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	23 089	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, coupon zéro	23 521

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]

	COÛT (en milliers) £		PRODUITS (en milliers) £
PRINCIPAUX ACHATS		PRINCIPALES VENTES	
DNB Bank ASA, 2,625 %, échéance le 10/06/2026	539	Fonds d'État du Royaume-Uni, 2,750 %, échéance le 07/09/2024	1 914
Bank of America Corp, 4,948 %, échéance le 22/07/2028	536	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 6,000 %, échéance le 07/12/2028	738
Annington Funding Plc, 4,750 %, échéance le 09/08/2033	520	Barclays Plc, 2,375 %, échéance le 06/10/2023	608
New York Life Global Funding, 4,350 %, échéance le 16/09/2025	490	Annington Funding Plc, 2,646 %, échéance le 12/07/2025	585
DNB Bank ASA, 4,000 %, échéance le 17/08/2027	480	CPUK Finance Ltd, 3,588 %, échéance le 28/08/2025	546
Bank of America Corp, 3,584 %, échéance le 27/04/2031	460	AbbVie Inc, 3,200 %, échéance le 21/11/2029	542
Toronto-Dominion Bank/The, 2,875 %, échéance le 05/04/2027	439	European Investment Bank, 3,750 %, échéance le 07/12/2027	525
Morgan Stanley, 4,210 %, échéance le 20/04/2028	423	Lloyds Banking Plc, 6,500 %, échéance le 17/09/2040	479
Wells Fargo & Co, 3,473 %, échéance le 26/04/2028	410	BAE Systems Plc, 4,125 %, échéance le 08/06/2022	444
Deutsche Bank AG, 4,000 %, échéance le 24/06/2026	398	Lloyds Banking Plc, 5,125 %, échéance le 07/03/2025	431
Credit Agricole SA, 4,875 %, échéance le 23/10/2029	397	HSBC Holdings Plc, 7,000 %, échéance le 07/04/2038	428
Fonds d'État du Royaume-Uni, 0,625 %, échéance le 22/10/2050	388	Morgan Stanley, 2,625 %, échéance le 09/03/2027	427
Motability Operations Group Plc, série EMtN, 4,875 %, échéance le 17/01/2043	359	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,500 %, échéance le 31/10/2024	404
Whitbread Group Plc, 2,375 %, échéance le 31/05/2027	356	Santander UK Plc, 3,875 %, échéance le 15/10/2029	399
Netflix Inc, 3,875 %, arrivant à échéance le 15/11/2029	356	Volkswagen Financial Services NV, 1,625 %, échéance le 30/11/2022	397
Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, échéance le 13/07/2044	341	Glencore Finance Europe Ltd, 6,000 %, échéance le 03/04/2022	370
Svenska Handelsbanken AB, 4,625 %, échéance le 23/08/2032	340	Western Power Distribution East Midlands Plc, 5,250 %, échéance le 17/01/2023	361
British Telecommunications Plc, 3,125 %, échéance le 21/11/2031	334	NIE Finance Plc, 5,875 %, échéance le 01/12/2032	348
NIE Finance Plc, 5,875 %, échéance le 01/12/2032	328	FCE Bank Plc, 2,727 %, arrivant à échéance le 06/03/2022	319
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 4,875 %, échéance le 29/04/2032	288	Wells Fargo & Co, 1,375 %, échéance le 30/06/2022	310
JPMorgan Chase & Co, 4,912 %, échéance le 25/07/2033	261	Cooperatieve Rabobank UA, série 2541, 4,000 %, échéance le 19/09/2022	302
Morgan Stanley, 5,789 %, échéance le 18/11/2033	250	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, arrivant à échéance le 15/02/2030	300
AT&T Inc, 7,000 %, échéance le 30/04/2040	240	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2,850 %, échéance le 25/05/2037	298
Fonds d'État du Royaume-Uni, 4,750 %, échéance le 07/12/2038	239	Bank of America Corp, 1,667 %, échéance le 02/06/2029	297
Koninklijke KPN NV, 5,750 %, échéance le 17/09/2029	233		
Metropolitan Life Global Funding I, 5,000 %, échéance le 10/01/2030	230		
Lloyds Banking Group Plc, 6,625 %, échéance le 02/06/2033	229		
PepsiCo Inc, 3,550 %, échéance le 22/07/2034	229		
United Kingdom Gilt, 4,250 %, arrivant à échéance le 12/07/2040	229		
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co, 5,125 %, échéance le 23/11/2052	228		
Danske Bank A/S, 4,625 %, échéance le 13/04/2027	219		
United Kingdom Gilt, 1,750 %, arrivant à échéance le 09/07/2037	217		
PepsiCo Inc, 3,200 %, échéance le 22/07/2029	210		
GSK Consumer Healthcare Capital UK Plc, 3,375 %, échéance le 29/03/2038	210		
Vodafone Group Plc, 5,125 %, échéance le 02/12/2052	207		
Fonds d'État du Royaume-Uni, 1,500 %, échéance le 22/07/2026	197		
NatWest Markets Plc, 6,375 %, échéance le 08/11/2027	190		
McDonald's Corp, série gmtN, 3,750 %, échéance le 31/05/2038	179		
Intesa Sanpaolo SpA, 2,625 %, échéance le 11/03/2036	178		
Tesco Corporate Treasury Services Plc, 5,500 %, échéance le 27/02/2035	169		
AT&T Inc, 4,375 %, échéance le 14/09/2029	168		
GreenSquareAccord Ltd, 5,250 %, échéance le 30/11/2047	167		
Rentokil Initial Plc, 5,000 %, échéance le 27/06/2032	167		
Vonovia SE, 2,375 %, échéance le 25/03/2032	166		
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,375 %, échéance le 15/08/2042	152		
CRH Finance UK Plc, 4,125 %, échéance le 02/12/2029	151		

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

	COÛT (en milliers) USD		PRODUITS (en milliers) USD
PRINCIPAUX ACHATS		PRINCIPALES VENTES	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	63 642	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	74 921
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 15/08/2032	3 564	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 15/08/2032	3 392
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 15/02/2032	3 466	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 15/02/2032	3 378
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/02/2032	3 309	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, arrivant à échéance le 15/11/2051	3 359
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, arrivant à échéance le 15/11/2051	3 200	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, arrivant à échéance le 15/05/2032	3 272
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/02/2032	2 516	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/02/2052	3 055
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/02/2052	1 956	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, arrivant à échéance le 15/11/2031	2 378
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 28/02/2027	1 716	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, arrivant à échéance le 15/08/2051	2 350
United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, arrivant à échéance le 15/05/2042	1 662	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, arrivant à échéance le 15/05/2032	2 305
Danske Bank A/S, 144A, 4,298 %, échéance le 01/04/2028	1 527	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 28/02/2027	1 699
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/08/2032	1 463	United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, arrivant à échéance le 15/05/2042	1 486
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,125 %, échéance le 15/11/2032	1 291	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/08/2032	1 456
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,500 %, échéance le 15/02/2025	1 266	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,500 %, échéance le 31/01/2027	1 352
DCP Midstream LP, série A, 7,375 %, perpétuelle	1 246	DCP Midstream LP, série A, 7,375 %, perpétuelle	1 336
Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, perpétuelle	1 110	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 4,125 %, échéance le 15/11/2032	1 300
Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,141 %, échéance le 15/03/2052	1 110	Société Générale SA, 144A, 1,488 %, échéance le 14/12/2026	1 256
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 31/07/2027	1 109	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,500 %, échéance le 15/02/2025	1 229
DNB Bank ASA, 144A, 2,968 %, échéance le 28/03/2025	1 043	Blackstone Mortgage Trust Inc, 4,375 %, échéance le 05/05/2022	1 110
ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750 %, échéance le 29/04/2025	1 022	Energy Transfer LP, série G, 7,125 %, perpétuelle	1 069
Banco Santander SA, 4,175 %, échéance le 24/03/2028	1 002	Boeing Co/The, 3,100 %, échéance le 01/05/2026	1 063

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

	COÛT (en milliers) USD		PRODUITS (en milliers) USD
PRINCIPAUX ACHATS		PRINCIPALES VENTES	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	9 080	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	7 951
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 3,000 %	857	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class LM	965
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/02/2052	697	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 3,000 %	848
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 31/05/2029	689	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 31/05/2029	678
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 3,000 %	684	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 3,000 %	677

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund^ – (suite)

	COÛT (en milliers) USD	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers) USD
PRINCIPAUX ACHATS			
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	652	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	640
Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 2,500 %	578	Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 2,500 %	568
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	571	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 2,500 %	566
Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 3,000 %	563	Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 3,000 %	563
Obligation fédérale russe – OFZ, 0,000 %, échéance le 23/05/2029	561	Obligation fédérale russe – OFZ, Series 6224, 6,900 %, échéance le 23/05/2029	561
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 15/08/2032	510	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 15/08/2032	507
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2052	453	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/02/2052	469
Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 3,500 %	387	Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 2,500 %	394
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 3,000 %	369	Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 3,500 %	389
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/08/2052	365	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 ans, TBA, 3,000 %	369
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 30/04/2029	349	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 30/04/2029	348
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,250 %, échéance le 30/06/2029	339	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,250 %, échéance le 30/06/2029	344
Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 3,500 %	292	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, arrivant à échéance le 31/05/2028	330
Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, arrivant à échéance le 20/09/2051	258	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,375 %, échéance le 31/10/2028	295
Obligations indexées sur l'inflation du Trésor des États-Unis, 1,125 %, échéance le 15/01/2033	238	Ginnie Mae, 30 ans, TBA, 3,500 %	292
		United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, arrivant à échéance le 31/01/2028	283

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^

	COÛT (en milliers) USD	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers) USD
PRINCIPAUX ACHATS			
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	3 643	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	3 677
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/02/2052	139	TSMC Arizona Corp, 3,250 %, échéance le 25/10/2051	162
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2052	126	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,000 %, échéance le 15/02/2025	141
Segro Capital Sarl, 1,875 %, échéance le 23/03/2030	109	Marks & Spencer Plc, 3,750 %, arrivant à échéance le 19/05/2026	128
Vestas Wind Systems Finance BV, 1,500 %, échéance le 15/06/2029	109	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 3,700 %, échéance le 02/04/2040	112
Iberdrola Finanzas SA, 1,375 %, échéance le 11/03/2032	109	Vestas Wind Systems Finance BV, 1,500 %, échéance le 15/06/2029	97
SSE Plc, 4,000 %, perpétuelle	108	Ball Corp, 1,500 %, échéance le 15/03/2027	96
Prologis Euro Finance LLC, 3,875 %, échéance le 31/01/2030	108	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, échéance le 15/02/2027	90
Elia Transmission Belgium SA, 3,625 %, échéance le 18/01/2033	107	JCDecaux SA, 1,625 %, échéance le 07/02/2030	87
Schneider Electric SE, 3,375 %, échéance le 13/04/2034	106	Iberdrola Finanzas SA, 1,375 %, échéance le 11/03/2032	86
Orsted AS, 3,625 %, échéance le 01/03/2026	106	Equinix Inc, 1,000 %, échéance le 15/03/2033	82
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, série 2007, 4,250 %, échéance le 04/07/2039	104	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/02/2031	78
Amprion GmbH, 3,971 %, échéance le 22/09/2032	100	Prologis Euro Finance LLC, 1,000 %, échéance le 06/02/2035	77
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, arrivant à échéance le 15/02/2029	98	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/02/2032	76
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, série 03, 4,750 %, échéance le 04/07/2034	94	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,500 %, échéance le 15/03/2031	76
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, échéance le 15/02/2027	93	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2052	75
Morgan Stanley, 3,622 %, échéance le 01/04/2031	88	Intel Corp, 3,050 %, échéance le 12/08/2051	75
Comcast Corp, 4,150 %, échéance le 15/10/2028	86	AbbVie Inc, 3,200 %, échéance le 21/11/2029	66
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/02/2031	86	United Rentals North America Inc, 3,750 %, échéance le 15/01/2032	50
UnitedHealth Group Inc, 4,000 %, échéance le 15/05/2029	86	Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, arrivant à échéance le 26/07/2029	44
Toronto-Dominion Bank/The, 4,456 %, échéance le 08/06/2032	85		
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/08/2029	84		
Visa Inc, 4,300 %, échéance le 14/12/2045	84		
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/02/2032	78		

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

	COÛT (en milliers) USD	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers) USD
PRINCIPAUX ACHATS			
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	107 788	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	107 828
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 3,334 %, échéance le 31/07/2024	33 455	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 0,064 %, échéance le 31/01/2023	28 325
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 2,410 %, échéance le 30/04/2024	16 189	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 3,334 %, échéance le 31/07/2024	22 743
Obligation de l'État suédois, 1,500 %, échéance le 13/11/2023	14 362	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 0,120 %, échéance le 31/10/2023	21 147
Obligation de l'État italien, 0,950 %, échéance le 15/02/2023	14 116	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 2,410 %, échéance le 30/04/2024	16 185
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 0,120 %, échéance le 31/10/2023	12 895	Obligation de l'État suédois, 1,500 %, échéance le 13/11/2023	13 289
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/02/2052	10 715	Obligation de l'État italien, 0,950 %, échéance le 15/02/2023	13 260
Obligation de l'État français, OAT, 0,000 %, échéance le 25/05/2032	10 678	Obligation de l'État polonais, série 1023, 4,000 %, échéance le 25/10/2023	13 129
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/08/2052	10 593	Obligation de l'État australien, série 128, 5,750 %, échéance le 15/07/2022	11 341
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 15/11/2051	9 692	Obligation de l'État français, OAT, 0,000 %, échéance le 25/11/2031	10 651
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, échéance le 15/08/2032	8 949	Obligation de l'État norvégien, série 475, 144A, 2,000 %, échéance le 24/05/2023	10 460
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,250 %, échéance le 19/10/2023	8 627	Fonds d'État du Royaume-Uni, 0,250 %, échéance le 31/07/2031	9 946
Obligation de l'État norvégien, série 475, 144A, 2,000 %, échéance le 24/05/2023	8 202	Obligation de l'État français, OAT, 0,000 %, échéance le 25/05/2032	9 832
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 2,875 %, échéance le 31/01/2024	8 187	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 2,875 %, échéance le 31/01/2024	8 171
Fonds d'État du Royaume-Uni, 0,750 %, échéance le 22/07/2023	7 241	Obligation de l'État néo-zélandais, série 0423, 5,500 %, échéance le 15/04/2023	8 087
Obligation de l'État polonais, série 0432, 1,750 %, échéance le 25/04/2032	6 866	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,000 %, échéance le 15/08/2023	6 469
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,000 %, échéance le 15/08/2023	6 690	Obligation de l'État suédois, 3,500 %, échéance le 01/06/2022	5 721
Obligation de l'État suédois, 3,500 %, échéance le 01/06/2022	6 115	Obligation de l'État hongrois, 1,750 %, échéance le 26/10/2022	4 953
Obligation de l'État hongrois, 1,750 %, échéance le 26/10/2022	5 855	Obligation de l'État malaisien, série 0313, 3,480 %, échéance le 15/03/2023	4 820
Province de Manitoba Canada, 2,450 %, échéance le 02/06/2025	4 742	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 15/02/2032	4 319
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 15/02/2032	4 606	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/08/2052	4 010
Mexican Bonos, série M, 8,000 %, échéance le 07/11/2047	4 102		
Obligation de l'État français, OAT, 0,750 %, échéance le 25/05/2052	4 025		
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/08/2052	3 527		

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

	COÛT (en milliers) USD		PRODUITS (en milliers) USD
PRINCIPAUX ACHATS		PRINCIPALES VENTES	
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	649 150	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	619 336
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l’émission, 3,334 %, échéance le 31/07/2024	155 937	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l’émission, 0,120 %, échéance le 31/10/2023	211 299
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l’émission, 0,837 %, échéance le 30/04/2024	136 752	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l’émission, 2,431 %, échéance le 30/04/2024	136 583
Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 2,750 %, échéance le 15/08/2032	126 893	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l’émission, 3,334 %, échéance le 31/07/2024	109 772
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l’émission, 0,120 %, échéance le 31/10/2023	97 391	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l’émission, 0,064 %, échéance le 31/07/2023	76 152
Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2052	68 092	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l’émission, 0,064 %, échéance le 31/01/2023	57 143
Obligation de l’État français, OAT, 0,000 %, échéance le 25/05/2032	42 932	Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 2,875 %, échéance le 15/05/2052	56 145
Obligation de l’État polonais, série 0432, 1,750 %, échéance le 25/04/2032	28 972	Bon du Trésor coréen, série 3012, 1,500 %, échéance le 10/12/2030	53 218
Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, échéance le 31/07/2053	28 693	Obligation de l’État français, OAT, 0,000 %, échéance le 25/05/2032	39 331
Obligation de l’État péruvien, 6,150 %, échéance le 12/08/2032	25 491	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTNf, 10,000 %, échéance le 01/01/2031	24 745
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l’émission, 0,656 %, échéance le 31/01/2024	22 892	China Government Bond, Series INBK, 3,810 %, arrivant à échéance le 14/09/2050	23 188
Freddie Mac Pool ‘SD8277’, 5,500 %, échéance le 12/01/2052	22 408	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l’émission, 2,491 %, échéance le 31/01/2024	22 835
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTNf, 10,000 %, échéance le 01/01/2031	20 894	Obligation de l’État sud-africain, série 2048, 8,750 %, échéance le 28/02/2048	20 495
TES colombien, série B, 7,250 %, échéance le 26/10/2050	18 801	Mexican Bonos, série M 30, 8,500 %, échéance le 18/11/2038	19 791
Fannie Mae Pool ‘MA4842’, 5,500 %, échéance le 01/12/2052	17 890	Mexican Bonos, série M, 8,000 %, échéance le 07/11/2047	19 053
Obligation de l’État néo-zélandais, série 0551, 2,750 %, échéance le 15/05/2051	16 570	Bon du Trésor indonésien, série FR71, 9,000 % échéance le 15/03/2029	17 925
Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,151 %, échéance le 14/03/2025	15 421	Banque de Montréal, 0,729 %, échéance le 10/03/2023	17 155
Fannie Mae Pool ‘MA4841’, 5,000 %, échéance le 01/12/2052	14 918	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,849 %, échéance le 17/03/2023	15 777
Obligation de l’État français, OAT, 0,750 %, échéance le 25/05/2052	14 618	Bank of Nova Scotia/The, 0,599 %, échéance le 15/09/2023	15 737
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTNf, 10,000 %, échéance le 01/01/2033	13 548	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 0,449 %, échéance le 07/07/2025	15 522

FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]

	COÛT (en milliers) USD		PRODUITS (en milliers) USD
PRINCIPAUX ACHATS		PRINCIPALES VENTES	
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	5 204	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	5 347
Playtika Holding Corp, 144A, 4,250 %, échéance le 15/03/2029	438	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, échéance le 30/09/2026	351
Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, échéance le 01/02/2029	436	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, échéance le 01/03/2025	346
Arko Corp, 144A, 5,125 %, échéance le 15/11/2029	418	Playtika Holding Corp, 144A, 4,250 %, échéance le 15/03/2029	339
Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, échéance le 15/05/2025	407	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, échéance le 15/09/2025	290
Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, échéance le 01/03/2025	400	First Quantum Minerals Ltd, 6,500 %, échéance le 01/03/2024	289
Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, échéance le 15/12/2027	395	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTNf, 10,000 %, échéance le 01/01/2027	235
MercadoLibre Inc, 3,125 %, échéance le 14/01/2031	366	Station Casinos LLC, 144A, 4,625 %, échéance le 01/12/2031	230
LCPR Senior Secured Financing DAC, 144A, 6,750 %, échéance le 15/10/2027	349	Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250 %, échéance le 15/02/2026	216
ANGI Group SA, 144A, 3,875 %, échéance le 15/08/2028	324	Petroleos Mexicanos, 5,350 %, arrivant à échéance le 02/12/2028	215
Turning Point Brands Inc, 144A, 5,625 %, échéance le 15/02/2026	307	ROBLOX Corp, 144A, 3,875 %, échéance le 01/05/2030	214
New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, échéance le 30/09/2026	306	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, échéance le 15/10/2027	205
Cimpress PLC, 7,000 %, échéance le 15/06/2026	293	Imperial Brands Finance PLC, 6,125 %, échéance le 27/07/2027	201
United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, échéance le 15/04/2029	292	Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, échéance le 01/02/2029	198
First Quantum Minerals Ltd, 6,500 %, échéance le 01/03/2024	285	Speedway Motorsports LLC, 4,875 %, échéance le 01/11/2027	194
New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, échéance le 15/09/2025	272	Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, échéance le 15/04/2025	188
Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, échéance le 01/10/2026	269	Graham Packaging Co Inc, 7,125 %, échéance le 15/08/2028	186
Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, échéance le 30/06/2030	267	FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 144A, 4,375 %, échéance le 01/04/2031	183
Station Casinos LLC, 144A, 4,625 %, échéance le 01/12/2031	261	Geopark Ltd, 144A, 5,500 %, échéance le 17/01/2027	181
ROBLOX Corp, 144A, 3,875 %, échéance le 01/05/2030	259	Avient Corp, 0,000 %, échéance le 27/07/2029	179

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

	COÛT (en milliers) USD		PRODUITS (en milliers) USD
PRINCIPAUX ACHATS		PRINCIPALES VENTES	
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	163 567	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	162 812
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l’émission, 3,334 %, échéance le 31/07/2024	28 628	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l’émission, 4,764 %, échéance le 30/04/2024	25 352
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l’émission, 4,764 %, échéance le 30/04/2024	25 371	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l’émission, 0,120 %, échéance le 31/10/2023	24 250
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l’émission, 0,120 %, échéance le 31/10/2023	19 309	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l’émission, 3,334 %, échéance le 31/07/2024	21 542
Obligation de l’État italien, 0,950 %, échéance le 15/03/2023	16 054	Obligation de l’État polonais, série 1023, 4,000 %, échéance le 25/10/2023	20 023
Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/02/2052	12 719	Obligation de l’État italien, 0,950 %, échéance le 15/03/2023	15 117
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l’émission, 4,824 %, échéance le 31/01/2024	12 084	Obligation de l’État australien, série 128, 5,750 %, échéance le 15/07/2022	14 727
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l’émission, 4,936 %, échéance le 31/01/2025	11 710	Obligation de l’État norvégien, série 475, 144A, 2,000 %, échéance le 24/05/2023	13 257
Obligation de l’État suédois, 1,500 %, échéance le 13/11/2023	11 100	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l’émission, 4,824 %, échéance le 31/01/2024	12 064
Obligation de l’État français, OAT, 0,000 %, échéance le 25/05/2032	11 054	Obligation de l’État français, OAT, 0,000 %, échéance le 25/11/2031	11 585
Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 15/11/2051	10 742	Obligation de l’État français, OAT, 0,000 %, échéance le 25/05/2032	10 203
Bon/Obligation du Trésor des États-Unis, 3,000 %, échéance le 15/08/2052	10 381	Obligation de l’État suédois, 1,500 %, échéance le 13/11/2023	10 065
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, échéance le 15/08/2032	10 344	Fonds d’État du Royaume-Uni, 0,250 %, échéance le 31/07/2031	9 829
Ginnie Mae II Pool, ‘MA8348’, 5,000 %, échéance le 20/10/2052	9 474	Obligation de l’État néo-zélandais, série 0423, 5,500 %, échéance le 15/04/2023	9 229
Obligation de la République Fédérale d’Allemagne, 2,000 %, échéance le 15/08/2023	7 922	Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos, 4,000 %, échéance le 01/03/2023	8 420
Obligation de l’État polonais, série 0432, 1,750 %, échéance le 25/04/2032	7 615	Obligation de la République Fédérale d’Allemagne, 2,000 %, échéance le 15/08/2023	7 681
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos, 4,000 %, échéance le 01/03/2023	7 338	China Government Bond, Series INBK, 3,810 %, arrivant à échéance le 14/09/2050	7 674
Obligation de l’État suédois, 3,500 %, échéance le 01/06/2022	6 542	Obligation de l’État suédois, 3,500 %, échéance le 01/06/2022	6 320
Obligation de l’État hongrois, 1,750 %, échéance le 26/10/2022	6 396	Bank of Nova Scotia/The, 0,599 %, échéance le 15/09/2023	5 415
		Obligation de l’État hongrois, 1,750 %, échéance le 26/10/2022	5 403

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund – (suite)

	COÛT (en milliers) USD	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers) USD
PRINCIPAUX ACHATS			
Obligation de l'État norvégien, série 475, 144A, 2,000 %, échéance le 24/05/2023	5 453	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 0,449 %, échéance le 07/07/2025	5 263
Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, échéance le 12/01/2052	5 438		
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 1,875 %, échéance le 15/02/2032	5 162		

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

	COÛT (en milliers) USD	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers) USD
PRINCIPAUX ACHATS			
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	1 029 926	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	985 261
Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/02/2052	207 370	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 0,120 %, échéance le 31/10/2023	375 171
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 0,120 %, échéance le 31/10/2023	181 625	Bon/obligation du Trésor des États-Unis, 2,250 %, échéance le 15/02/2052	187 285
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2018 C03, catégorie 1M2, 2,337 %, échéance le 25/10/2030	135 941	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 3,136 %, échéance le 31/07/2024	102 299
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 2,938 %, échéance le 31/07/2024	102 323	Obligation de l'État français, 1,750 %, échéance le 25/05/2023	67 171
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, arrivant à échéance le 15/08/2051	68 271	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, arrivant à échéance le 15/08/2051	60 740
Obligation de l'État français, 1,750 %, échéance le 25/05/2023	66 205	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTFN, 10,000 %, échéance le 01/01/2027	52 588
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTFN, 10,000 %, échéance le 01/01/2023	44 074	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/08/2052	27 834
Freddie Mac STACR Trust 2019-HQA2, série 2019 HQA2, catégorie M2, 144A, 6,667 %, échéance le 25/04/2049	40 724	Trésor du Royaume-Uni, 1,250 %, échéance le 31/07/2051	27 271
TES colombien, série B, 7,000 %, échéance le 26/03/2031	39 038	Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, échéance le 09/01/2052	26 369
Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, échéance le 31/07/2053	35 823	JPMorgan Chase & Co, 4,912 %, échéance le 25/07/2033	23 388
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/08/2052	33 429	Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-HQA2, série 2020 HQA2, catégorie M2, 144A, 3,287 %, échéance le 25/03/2050	22 027
Trésor du Royaume-Uni, 1,250 %, échéance le 31/07/2051	30 528	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2018 C03, catégorie 1M2C, 2,337 %, échéance le 25/10/2030	17 961
Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, échéance le 09/01/2052	27 004	Obligation à cinq ans de l'État japonais, série 137, 0,100 %, échéance le 20/09/2023	17 242
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,800 %, échéance le 15/08/2053	25 155	Trésor des États-Unis I/L, 0,125 %, échéance le 15/02/2052	16 900
Ginnie Mae II Pool, 'MA8646', 4,500 %, échéance le 20/02/2053	23 778	La Bank of America Corp, 4,571 %, échéance le 27/04/2033	16 319
JPMorgan Chase & Co, 4,912 %, échéance le 25/07/2033	22 269	Hercules Capital Inc, 2,625 %, échéance le 16/09/2026	15 365
Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, échéance le 01/09/2052	20 946	Western Digital Corp, 1,500 %, échéance le 01/02/2024	14 441
Trésor des États-Unis I/L, 0,125 %, échéance le 15/02/2052	17 874	Towd Point Mortgage Trust 2016-2, série 2016 2, catégorie B2, 144A, 3,401 %, échéance le 25/08/2055	14 246
Obligation de l'État français, 0,750 %, échéance le 25/05/2052	17 189	Oaktown Re V Ltd, série 2020 2A, catégorie M1B, 144A, 8,106 %, échéance le 25/10/2030	13 109

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]

	COÛT (en milliers) USD	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers) USD
PRINCIPAUX ACHATS			
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	41 335	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	41 044
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 2,046 %, échéance le 30/04/2024	9 420	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 2,046 %, échéance le 30/04/2024	9 035
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 0,120 %, échéance le 31/10/2023	4 827	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 0,120 %, échéance le 31/10/2023	7 564
Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, échéance le 01/12/2052	2 567	American Credit Acceptance Receivables Trust 2019-3, série 2019 3, catégorie F, 144A, 5,420 %, échéance le 12/05/2026	2 416
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7, série 2021 DNA7, catégorie M1, 144A, 5,334 %, échéance le 25/11/2041	1 958	STACR Trust 2018-HRP1, série 2018 HRP1, catégorie B1, 144A, 3,937 %, échéance le 25/04/2043	2 003
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R06, série 2019 R06, catégorie 2B1, 144A, 8,367 %, échéance le 25/09/2039	1 906	Westlake Automobile Receivables Trust 2020-3, série 2020 3A, catégorie D, 144A, 1,650 %, échéance le 17/02/2026	1 899
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, série 2021 DNA3, catégorie M2, 144A, 6,584 %, échéance le 25/10/2033	1 884	Santander Drive Auto Receivables, 1,640 %, échéance le 16/11/2026	1 751
STACR Trust 2018-HRP2, série 2018 HRP2, catégorie B1, 144A, 8,817 %, échéance le 25/02/2047	1 852	FREMF 2013-K31 Mortgage Trust VAR, 3,743 %, échéance le 25/07/2046	1 436
Santander Drive Auto Receivables, 1,640 %, échéance le 16/11/2026	1 761	Freddie Mac STACR Trust, 2019-HRP1, 6,500 %, échéance le 25/02/2049	1 409
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R04, série 2019 R04, catégorie 2B1, 144A, 9,867 %, échéance le 25/06/2039	1 714	China Government Bond, Series INBK, 3,810 %, arrivant à échéance le 14/09/2050	1 353
GC Pastor Hipotecario 5 FTA 5, catégorie A2, 2,233 %, échéance le 21/06/2046	1 703	Atrium XIV LLC 14A, catégorie E, 144A, 5,891 %, échéance le 23/08/2030	1 239
Fannie Mae Pool 'MA4876', 6,000 %, échéance le 01/12/2052	1 568	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, série 2019 R05, catégorie 1B1, 144A, 0,000 %, échéance le 25/03/2042	1 210
Freddie Mac Pool 'SD8278', 6,000 %, échéance le 12/01/2052	1 558	BlueMountain CLO XXII Ltd, 2,189 %, échéance le 15/07/2031	1 179
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2016 C07, catégorie 2M2, 8,967 %, échéance le 25/05/2029	1 460	Octagon Investment Partners 37 Ltd, série 2018 2A, catégorie D, 144A, 5,658 %, échéance le 25/07/2030	1 080
FREMF 2013-K31 Mortgage Trust VAR, 3,743 %, échéance le 25/07/2046	1 448	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2017-5, série 2017 5, catégorie D, 144A, 4,676 %, échéance le 10/03/2050	1 063
Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, échéance le 15/05/2025	1 399	FREMF 2013-K29 Mortgage Trust VAR, 3,471 %, échéance le 25/05/2046	1 009
Freddie Mac STACR Trust, 2019-HRP1, 6,500 %, échéance le 25/02/2049	1 399	Barings CLO Ltd 2018-II, série 2018 2X, catégorie D, 5,791 %, échéance le 15/04/2030	996
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2018 C01, catégorie 1B1, 8,167 %, échéance le 25/07/2030	1 339	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14, série 2014 LC14, catégorie D, 144A, 4,586 %, échéance le 15/03/2047	948
BlueMountain CLO XXII Ltd, 2,189 %, échéance le 15/07/2031	1 290	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, série 2018 C01, catégorie 1M2, 6,867 %, échéance le 25/07/2030	898
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA4, série 2020 DNA4, catégorie B1, 144A, 10,617 %, échéance le 25/08/2050	1 281	FREMF 2013-K31 Mortgage Trust VAR, 5,500 %, échéance le 25/07/2046	869
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, série 2019 R05, catégorie 1B1, 144A, 0,000 %, échéance le 25/03/2042	1 190		
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, série 2019 R05, catégorie 1B1, 144A, 8,717 %, échéance le 25/07/2039	1 056		

FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]

	COÛT (en milliers) USD	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers) USD
PRINCIPAUX ACHATS			
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	5 227	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	5 698
Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, échéance le 01/03/2025	431	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, échéance le 01/03/2025	358
Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625 %, échéance le 01/09/2028	412	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, échéance le 30/09/2026	260
Uber Technologies Inc, 144A, 7,500 %, échéance le 15/05/2025	364	Petroleos Mexicanos, 5,350 %, arrivant à échéance le 02/12/2028	207
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, échéance le 21/07/2023	338	Imperial Brands Finance Plc, 6,125 %, échéance le 27/07/2027	201
Playtika Holding Corp, 144A, 4,250 %, échéance le 15/03/2029	330	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125 %, échéance le 31/01/2025	200

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^ – (suite)

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT (en milliers)	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers)
	USD		USD
TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, échéance le 15/03/2026	325	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTNf, 10,000 %, échéance le 01/01/2027	199
Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, échéance le 15/12/2027	290	Station Casinos LLC, 4,625 %, échéance le 12/01/2031	195
LCPR Senior Secured Financing DAC, 144A, 6,750 %, échéance le 15/10/2027	270	Elastic NV, 144A, 4,125 %, échéance le 15/07/2029	186
Arko Corp, 144A, 5,125 %, échéance le 15/11/2029	247	Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, échéance le 01/08/2026	185
United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, échéance le 15/04/2029	243	Geopark Ltd, 144A, 5,500 %, échéance le 17/01/2027	181
MercadoLibre Inc, 3,125 %, échéance le 14/01/2031	240	Amaggi Luxembourg International Sarl, 5,250 %, échéance le 28/01/2028	179
Turning Point Brands Inc, 144A, 5,625 %, échéance le 15/02/2026	240	Alcoa Nederland Holding BV, 4,125 %, échéance le 31/03/2029	179
Horizon Therapeutics USA Inc, 144A, 5,500 %, échéance le 01/08/2027	230	First Quantum Minerals Ltd, 6,875 %, échéance le 15/10/2027	179
Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, échéance le 01/10/2026	219	ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, échéance le 27/04/2026	176
ANGI Group SA, 144A, 3,875 %, échéance le 15/08/2028	214	XP Inc, 144A, 3,250 %, échéance le 01/07/2026	174
Freedom Mortgage Corp, 144A, 7,625 %, échéance le 01/05/2026	213	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 4,125 %, échéance le 15/08/2026	170
Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, échéance le 30/06/2030	210	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp, 6,250 %, échéance le 15/05/2026	168
Lenovo Group Ltd, 144A, 6,536 %, échéance le 27/07/2032	200	Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, échéance le 15/07/2031	166
New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, échéance le 15/09/2025	199	AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, échéance le 31/05/2030	165

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT (en milliers)	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers)
	USD		USD
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 4,260 %, échéance le 30/04/2024	17 051	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 0,120 %, échéance le 31/10/2023	23 656
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 4,370 %, échéance le 31/10/2023	15 660	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 4,260 %, échéance le 30/04/2024	17 039
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 3,334 %, échéance le 31/07/2024	12 711	Obligation de l'État polonais, série 0432, 1,750 %, échéance le 25/04/2032	8 053
Obligation de l'État français, OAT, 0,000 %, échéance le 25/05/2032	4 993	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 3,334 %, échéance le 31/07/2024	5 154
TES colombien, série B, 7,000 %, échéance le 30/06/2032	3 747	Obligation de l'État français, OAT, 0,000 %, échéance le 25/05/2032	4 646
Obligation fédérale russe – OFZ, Series 6228, 7,650 %, échéance le 10/04/2030	3 290	Obligation fédérale russe – OFZ, Series 6228, 7,650 %, échéance le 10/04/2030	3 290
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 4,320 %, échéance le 31/01/2024	2 606	Mexican Bonos, série M, 7,750 %, échéance le 13/11/2042	3 200
Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, échéance le 12/01/2052	2 595	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 4,320 %, échéance le 31/01/2024	2 604
Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, échéance le 01/12/2052	2 202	Obligation de l'État sud-africain, série 2048, 8,750 %, échéance le 28/02/2048	2 356
Obligation de l'État français, OAT, 0,750 %, échéance le 25/05/2052	1 890	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 0,449 %, échéance le 07/07/2025	2 153
Fannie Mae Pool 'MA4841', 5,000 %, échéance le 01/12/2052	1 713	Bank of Nova Scotia/The, 0,599 %, échéance le 15/09/2023	2 099
Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, échéance le 01/09/2052	1 570	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 0,064 %, échéance le 31/07/2023	2 063
Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,151 %, échéance le 14/03/2025	1 466	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTNf, 10,000 %, échéance le 01/01/2029	1 878
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/08/2052	1 428	Capital One Financial Corp, 0,740 %, échéance le 06/12/2024	1 864
Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207 %, échéance le 22/11/2024	1 370	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,849 %, échéance le 17/03/2023	1 831
Jackson National Life Global Funding, 144A, 5,613 %, échéance le 28/06/2024	1 340	Athene Global Funding, 144A, 0,750 %, échéance le 24/05/2024	1 746
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 4,936 %, échéance le 31/01/2025	1 281	National Australia Bank Ltd, 144A, 0,429 %, échéance le 12/01/2025	1 689
Goldman Sachs Group Inc/The, 5,700 %, échéance le 01/11/2024	1 269	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, échéance le 15/08/2052	1 614
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	1 197	Obligation de l'État malaisien, série 0117, 3,882 %, échéance le 10/03/2022	1 607
Mexican Bonos, série M, 7,750 %, échéance le 13/11/2042	1 064	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	1 574
Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, échéance le 09/01/2052	1 050	Obligation de l'État français, OAT, 0,750 %, échéance le 25/05/2052	1 561
		Bon du Trésor coréen, série 3106, 2,000 %, échéance le 10/06/2031	1 560
		Caterpillar Financial Services Corp, 0,200 %, échéance le 17/11/2022	1 397
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTNf, 10,000 %, échéance le 01/01/2031	1 319
		Metropolitan Life Global Funding I, 144A, 0,619 %, échéance le 13/01/2023	1 310
		Obligation de l'État tchèque, série 138, 1,750 %, échéance le 23/06/2032	1 186

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT (en milliers)	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers)
	USD		USD
Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 4,369 %, échéance le 31/07/2024	1 498	Obligation à taux flottant du Trésor des États-Unis – vendue avant l'émission, 4,354 %, échéance le 31/07/2024	1 498
Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, série 2022 HQA2, catégorie M1B, 144A, 8,484 %, échéance le 25/07/2042	592	Obligation à cinq ans de l'État japonais, série 137, 0,100 %, échéance le 20/09/2023	373
Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01, série 2022 R01, catégorie 1M2, 144A, 6,384 %, échéance le 25/12/2041	561	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, échéance le 15/08/2032	331
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7, série 2021 DNA7, catégorie M2, 144A, 6,284 %, échéance le 25/11/2041	560	Obligation de l'État français, 0,000 %, échéance le 25/05/2032	329
TES colombien, série B, 7,000 %, échéance le 26/03/2031	441	Obligation de l'État italien, 2,500 %, échéance le 01/12/2032	223
Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, échéance le 31/07/2053	429	Ford Motor Co, 6,100 %, échéance le 19/08/2032	183
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, série NTNf, 10,000 %, échéance le 01/01/2033	421	Verizon Communications Inc, 1,450 %, échéance le 20/03/2026	149
Obligation à cinq ans de l'État japonais, série 137, 0,100 %, échéance le 20/09/2023	373	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands, 3,150 %, échéance le 10/01/2026	149
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, échéance le 15/08/2032	343	Air Canada, 3,875 %, échéance le 15/08/2026	145
Obligation de l'État français, 0,000 %, échéance le 25/05/2032	341	CommScope Inc, 6,000 %, échéance le 01/03/2026	110
Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, échéance le 01/09/2052	333	Blackstone Private Credit Fund, 2,625 %, échéance le 15/12/2026	108
Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, série 2022 R04, catégorie 1M1, 144A, 6,484 %, échéance le 25/03/2042	259	Obligation de l'État péruvien, 5,350 %, échéance le 12/08/2040	69
Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, échéance le 09/01/2052	241	Obligation de l'État péruvien, 6,150 %, échéance le 12/08/2032	66
Obligation de l'État italien, 2,500 %, échéance le 01/12/2032	227	Playtika Holding Corp, 4,250 %, échéance le 15/03/2029	63
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, échéance le 15/10/2027	212	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, série 2022 R04, catégorie 1M1, 144A, 6,484 %, échéance le 25/03/2042	13
Var Energi ASA, 144A, 7,500 %, échéance le 15/01/2028	207	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, échéance le 20/06/2027	8
AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, échéance le 31/05/2030	204	Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust, 144A, 4,800 %, échéance le 15/08/2027	6
		Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, échéance le 01/09/2052	2
		Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, échéance le 09/01/2052	2

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ – (suite)

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
XP Inc, 144A, 3,250 %, échéance le 01/07/2026	202	Freddie Mac Pool 'SD8257', 4,500 %, échéance le 10/01/2052	1
Kenbourne Invest SA, 6,875 %, échéance le 26/11/2024	202		
UBS AG/Londres, 144A, 0,700 %, échéance le 09/08/2024	200		
Export-Import Bank of India, 144A, 5,500 %, échéance le 18/01/2033	200		
Stellantis NV, 5,250 %, échéance le 15/04/2023	200		
BRF SA, 144A, 3,950 %, échéance le 22/05/2023	199		
Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, échéance le 12/02/2026	198		
Arab Petroleum Investments Corp, 144A, 1,483 %, échéance le 06/10/2026	197		
NatWest Group Plc, 2,359 %, échéance le 22/05/2024	197		
FedEx Corp, 0,450 %, échéance le 04/05/2029	191		
Ford Motor Co, 6,100 %, échéance le 19/08/2032	191		
Volvo Car AB, 2,500 %, échéance le 07/10/2027	188		
Vestas Wind Systems Finance BV, 2,000 %, échéance le 15/06/2034	188		
BNP Paribas SA, 0,375 %, échéance le 14/10/2027	187		
International Bank for Reconstruction & Development, 5,000 %, échéance le 22/01/2026	187		
JPMorgan Chase & Co, 0,768 %, échéance le 09/08/2025	185		
General Motors Co, 5,600 %, échéance le 15/10/2032	185		
Micron Technologies Inc, 2,703 %, échéance le 15/04/2032	184		
International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, échéance le 22/01/2026	181		

FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	578	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	616
iShares Russell 1000 Value ETF – ETF	123	Cigna Corp	118
Cisco Systems Inc	116	Nucor Corp	107
Applied Materials Inc	97	Applied Materials Inc	106
3M Co	86	American Express Co	102
Union Pacific Corp	85	AT&T Inc	100
American Express Co	83	Bank of America Corp	96
Target Corp	82	Wells Fargo & Co	90
Chubb Ltd	80	Goldman Sachs Group Inc/The	86
AT&T Inc	78	Micron Technology Inc	84
Micron Technology Inc	77	US Bancorp	77
Wells Fargo & Co	72	Anthem Inc	73
Caterpillar Inc	71	iShares Russell 1000 Value ETF – ETF	72
Kroger Co/The	66	Morgan Stanley	68
Morgan Stanley	65	Steel Dynamics Inc	60
Travelers Cos Inc/The	64	JPMorgan Chase & Co	59
American International Group Inc	63	Dollar Tree Inc	56
Pioneer Natural Resources Co	58	Broadcom Inc	55
KLA Corp	56	Citigroup Inc	53
Laboratory Corp of America Holdings	55	MetLife Inc	50
Tyson Foods Inc, A	50	Allstate Corp/The	49
Cigna Group/The	49	DR Horton Inc	47
Aflac Inc	47	Quest Diagnostics Inc	43
Broadcom Inc	46	Mohawk Industries Inc	43
DR Horton Inc	46	Lennar Corp	39
Ameriprise Financial Inc	45		
FedEx Corp	44		

FTGF ClearBridge Value Fund

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
Meta Platforms Inc, A	30 292	Pioneer Natural Resources Co	31 815
American Electric Power Co Inc	23 539	Pfizer Inc	22 816
Pfizer Inc	22 532	Cigna Corp	22 435
Royal Gold Inc	21 896	Devon Energy Corp	21 233
Baker Hughes Co, A	19 499	DXC Technology Co	18 527
M&T Bank Corp	17 848	Charles Schwab Corp/The	16 441
Goldman Sachs Group Inc/The	17 121	General Electric Co	16 200
Noble Corp Plc	16 918	Medtronic Plc	15 908
Constellation Energy Corp	16 741	Intercontinental Exchange	15 791
Hess Corp	15 890	Enphase Energy Inc	15 280
CVS Health Corp	15 676	Synchrony Financial	14 838
Micron Technology Inc	15 327	EQT Corp	14 520
APA Corp	14 967	Bank of New York Mellon Corp/The	14 352
Intercontinental Exchange	14 432	Quanta Services Inc	13 980
Airbus SE	14 406	Alphabet Inc	13 700
Capital One Financial Corp	14 353	Cisco Systems Inc/Delaware	13 558
AstraZeneca Plc, ADR	13 157	Gilead Sciences Inc	13 370
Biogen Inc	13 030	Schlumberger Ltd	12 684
Mosaic Co/The	12 016	Safran SA	11 296
MGIC Investment Corp	10 965	Unum Group	11 275
Horizon Therapeutics Plc	10 561	AbbVie Inc	10 684
Sensata Technologies Holding Plc	10 445	Vertex Pharmaceuticals Inc	9 876
Black Knight Inc	9 564	Wells Fargo & Co	9 615
Expedia Group Inc	8 903	UnitedHealth Group Inc	9 451
Las Vegas Sands Corp	8 726	Alibaba Group Holdings	8 760

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

FTGF ClearBridge Value Fund – (suite)

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
Everest Re Group Ltd	8 673	American Electric Power Co Inc	8 534
Alcoa Corp	8 626	Splunk Inc	8 510
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd, ADR	8 580	Meta Platforms Inc, A	8 450
Alibaba Group Holdings	8 454	Horizon Therapeutics Plc	8 247
SolarEdge Technologies Inc	8 115	Simon Property Group Inc	8 073
Siemens AG	7 894	Sony Group Corp ADR	7 788
BioNTech SE ADR	7 833	Goldman Sachs Group Inc/The	7 323
Cigna Corp	7 663	Capri Holdings Ltd	6 995
Bank of America Corp	7 629	GXO Logistics Inc	6 339
United Airlines Holdings Inc	7 152	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	6 207
Tenet Healthcare Corp	6 686	Volkswagen AG	6 167
Haleon Plc	6 571	American International Group Inc	5 872
Schlumberger Ltd	6 316	OneMain Holdings Inc	5 714
Oracle Corp	6 109	XPO Logistics Inc	5 666

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
Walmart Inc	2 289	Apple Inc	2 315
Emerson Electric Co	1 701	Home Depot Inc/The	2 313
Stryker Corp	1 293	Microsoft Corp	2 105
Costco Wholesale Corp	1 134	Alphabet Inc	2 083
NVIDIA Corp	1 015	JPMorgan Chase & Co	1 877
Progressive Corp/The	831	Meta Platforms Inc, A	1 696
Becton Dickinson and Co	823	Alphabet Inc, A	1 685
AbbVie Inc	722	Cisco Systems Inc/Delaware	1 603
Alphabet Inc, A	636	Toll Brothers Inc	1 372
TJX Cos Inc/The	570	Fidelity National Information Services Inc	1 360
PayPal Holdings Inc	569	salesforce.com Inc	1 217
Sempra Energy	526	Travelers Cos Inc/The	1 155
Meta Platforms Inc, A	521	Enphase Energy Inc	1 115
Intercontinental Exchange Inc	517	Thermo Fisher Scientific Inc	951
Eaton Corp Plc	511	Comcast Corp	929
Amazon.com Inc	474	Amazon.com Inc	889
CME Group Inc	473	Medtronic Plc	821
Hartford Financial Services Group Inc/The	463	Texas Instruments Inc	803
Microsoft Corp	446	PPG Industries Inc	766
T-Mobile US Inc	427	Truist Financial Corp	677
NextEra Energy Inc	422	Arista Networks Inc	609
Berkshire Hathaway Inc	418	Hartford Financial Services Group Inc/The	598
Oracle Corp	408	SVB Financial Group	527
Adobe Inc	402	Adobe Inc	463
Marriott International Inc/MD	383	ASML Holding NV	446
McCormick & Co Inc/MD	380	UnitedHealth Group Inc	358
Kinder Morgan Inc	378		
Apple Inc	360		
Vulcan Materials Co	334		
American Tower Corp	278		
Truist Financial Corp	256		

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
Zoetis Inc	32 105	CVS Health Corp	36 298
Stryker Corp	25 838	Amazon.com Inc	35 292
Sherwin-Williams Co/The	24 536	Meta Platforms Inc, A	29 204
Marsh & McLennan Cos Inc	21 970	Palo Alto Networks Inc	28 381
Intel Corp	20 760	Tractor Supply Co	27 127
Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	20 174	Ulta Beauty Inc	26 219
Microsoft Corp	19 534	Adobe Inc	25 765
NextEra Energy Inc	14 474	UnitedHealth Group Inc	25 258
Netflix Inc	11 966	Microsoft Corp	22 983
PayPal Holdings Inc	9 115	Salesforce Inc	22 385
NIKE Inc	8 943	Booking Holdings Inc	21 810
Tesla Inc	7 304	Thermo Fisher Scientific Inc	21 231
Dexcom Inc	7 283	Walt Disney Co/The	19 501
Visa Inc, A	6 260	United Parcel Service Inc, B	18 853
ASML Holding NV	6 035	NVIDIA Corp	18 091
Alcon Inc	5 603	Apple Inc	17 885
S&P Global Inc	5 204	NXP Semiconductors NV	17 295
Intuitive Surgical Inc	5 131	Visa Inc, A	16 866
Monster Beverage Corp	4 293	Fidelity National Information Services Inc	15 662
Eaton Corp Plc	4 222	WW Grainger Inc	13 007
Amazon.com Inc	2 898	BioMarin Pharmaceutical Inc	10 468
Splunk Inc	2 896	Honeywell International Inc	9 625
		Netflix Inc	8 784
		S&P Global Inc	8 660
		Monster Beverage Corp	8 198
		Advance Auto Parts Inc	7 381
		Zoetis Inc	6 494

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
Airbnb Inc	6 532	Vertex Pharmaceuticals Inc	31 332
Diageo Plc, ADR	6 114	Twitter Inc	29 194
Snowflake Inc	3 696	UnitedHealth Group Inc	24 712
Doximity Inc	3 351	Broadcom Inc	18 491
Freeport-McMoRan Inc	3 184	Comcast Corp	17 097
HubSpot Inc	2 024	TE Connectivity Ltd	16 885
Autodesk Inc	2 007	Biogen Inc	14 034
AbbVie Inc	1 885	Wolfspeed Inc	13 770
CrowdStrike Holdings Inc	1 866	Warner Bros Discovery Inc	7 174
Accenture Plc, A	1 847	Autodesk Inc	6 791
Charles River Laboratories International Inc	1 725	Seagate Technology Holdings Plc	6 232
Etsy Inc	1 293	Johnson Controls International plc	6 184
Lyft Inc	471	Madison Square Garden Sports Corp	6 075
Match Group Inc	459	Meta Platforms Inc, A	5 913
Meta Platforms Inc, A	405	Ionis Pharmaceuticals Inc	4 945
		AMC Networks Inc	4 777
		Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	4 479
		Liberty Broadband Corp	4 375
		Dolby Laboratories Inc, A	4 165
		HubSpot Inc	3 719
		CrowdStrike Holdings Inc	3 669
		Madison Square Garden Entertainment Corp	3 576
		Etsy Inc	3 401
		Match Group Inc	3 252
		Western Digital Corp	3 195
		Insulet Corp	3 074
		AbbVie Inc	3 051

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
Williams Cos Inc/The	406	Apple Inc	826
AGNC Investment Corp	399	Diamondback Energy	478
Healthcare trust of America	394	TriplePoint Venture Growth BDC Corp	403
Chord Energy Corporation	382	NortonLifeLock Inc	331
Rio Tinto Plc	331	Healthcare Realty Trust	328
Rocket Cos Inc	326	Chord Energy Corp	304
L3Harris Technologies Inc	205	Broadcom Inc, série A	301
PPL Corp	202	Intel Corp	294
ConocoPhillips	198	Rio Tinto Plc	289
Union Pacific Corp	189	Rocket Cos Inc	289
Blackstone Inc	183	Progressive Corp/The	284
Trinity Capital Inc	179	South Jersey Industries Inc	265
Pfizer Inc	149	QUALCOMM Inc	264
Intel Corp	141	Stanley Black & Decker Inc	242
Ares Capital Corp	130	Trinity Capital Inc	194
TE Connectivity Ltd	129	NXP Semiconductors NV	168
Gaming and Leisure Properties Inc	125	Royal Caribbean Cruises Ltd, 4,250 %, échéance le 15/06/2023	161
Otis Worldwide Corp	111	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd, ADR	144
Global Medical REIT Inc	105	Cisco Systems Inc/Delaware	140
Oracle Corp	97	TE Connectivity Ltd	124
United Parcel Service Inc, B	90	Duke Realty Corp	71
Texas Instruments Inc	84	Brookfield Renewable Corporation	70
Brookfield Renewable Corp	70		
Huntsman Corp	60		
Bank of America Corp	60		
NXP Semiconductors NV	52		

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
Alphabet Inc, A	47 498	Marriott International Inc/MD	37 035
Johnson & Johnson	34 788	Amazon.com Inc	34 550
Prologis Inc	28 174	NextEra Energy Inc	32 218
Brookfield Renewable Corp	27 843	Brookfield Renewable Corporation	28 818
NextEra Energy Partners LP	27 079	Hasbro Inc	25 840
ASML Holding NV	25 761	Workday Inc, A	20 812
Novo Nordisk A/S ADR	24 425	Gilead Sciences Inc	19 906
Microsoft Corp	24 118	Intel Corp	18 720
Accenture Plc, A	24 024	Hain Celestial Group Inc/The	18 697
Apple Inc	20 164	Enphase Energy Inc	17 379
Shoals Technologies Group Inc 'A'	19 551	Microsoft Corp	17 120
Etsy Inc	17 480	UnitedHealth Group Inc	14 703
Bloom Energy Corp, A	15 955	Apple Inc	14 332
UnitedHealth Group Inc	12 659	Progressive Corp/The	14 095
Bank of America Corp	12 155	Comcast Corp	13 779
Deere & Co	11 306	Lam Research Corp	12 266
First Republic Bank/CA	10 928	CVS Health Corp	11 803
Costco Wholesale Corp	9 923	Synopsis Inc	11 560
CVS Health Corp	9 845	McCormick & Co Inc/MD	7 742
Amazon.com Inc	9 658	Home Depot Inc/The	7 736

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^ – (suite)

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
Hartford Financial Services Group Inc/The	9 212	Danaher Corp	7 638
Morgan Stanley	9 105	Williams-Sonoma Inc	7 277
Ecolab Inc	8 983	Hartford Financial Services Group Inc/The	7 024
Visa Inc, A	8 674	BioMarin Pharmaceutical Inc	6 970
Regal Rexnord Corp	8 552	Costco Wholesale Corp	6 894
McCormick & Co Inc/MD	8 474	Thermo Fisher Scientific Inc	6 617
Progressive Corp/The	8 463	Bank of America Corp	6 357
Gilead Sciences Inc	8 372	SolarEdge Technologies Inc	5 692
Eaton Corp Plc	8 342		
Home Depot Inc/The	8 207		
Salesforce Inc	8 101		
Trex Co Inc	7 870		
Danaher Corp	7 755		
SolarEdge Technologies Inc	7 731		
Cisco Systems Inc	7 670		
TE Connectivity Ltd	7 555		
Progyny Inc	7 454		
Williams-Sonoma Inc	7 350		
Ball Corp	7 316		
Thermo Fisher Scientific Inc	7 128		
Booking Holdings Inc	7 001		

FTGF ClearBridge Global Growth Fund^

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
Schlumberger Ltd	392	Schlumberger Ltd	483
Eli Lilly & Co	330	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd, ADR	343
Deutsche Telekom AG	229	United Rentals Inc	246
NextEra Energy Inc	212	Air Liquide SA	240
Target Corp	195	Apple Inc	240
Deere & Co	171	Waste Management Inc	223
Daiichi Sankyo Co Ltd	168	TE Connectivity Ltd	207
Alibaba Group Holding Ltd	165	Progressive Corp/The	199
SAP SE	163	L'Oreal SA	177
Tencent Holdings Ltd	161	ICON Plc	174
Haleon Plc	161	Insulet Corp	174
Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	159	Canadian Pacific Railway Ltd	173
Stryker Corp	158	Marriott International Inc/MD	170
Iberdrola SA, ADR	146	Ulta Beauty Inc	169
United Rentals Inc	145	United Parcel Service Inc, B	166
Sony Group Corp	142	AIA Group Ltd	162
Sysco Corp	136	Old Dominion Freight Line Inc	159
AbbVie Inc	133	Atlas Copco AB	140
Olympus Corp	130	Union Pacific Corp	139
Loblaw Cos Ltd	130	Diageo Plc, ADR	137
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	128	TJX Cos Inc/The	136
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	126	Bank of America Corp	127
RELX Plc	124	Intesa Sanpaolo SpA	120
Computershare Ltd	122	T-Mobile US Inc	119
Brambles Ltd	121	Canadian Imperial Bank of Commerce	118
Intercontinental Exchange Inc	121	Avantor Inc	115
Microsoft Corp	120	Amadeus IT Group SA	113
SolarEdge Technologies Inc	117	Thomson Reuters Corp	102
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd, ADR	116	Recruit Holdings Co Ltd	101
Vertex Pharmaceuticals Inc	111	Elastic NV	91
Straumann Holding AG	107	Amazon.com Inc	90
TravelSky Technology Ltd	104	adidas AG	89
AIA Group Ltd	102	Samsung Electronics Co Ltd	86
Aflac Inc	96	Alphabet Inc, A	86
Zai Lab Ltd, ADR	86	MonotaRO Co Ltd	83
Netflix Inc	84	London Stock Exchange Group Plc	82
Union Pacific Corp	84	Ansell Ltd	76
Kroger Co/The	75	Marvell Technology Inc	75

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) Euro		(en milliers) Euro
NextEra Energy Inc	58 120	Enbridge Inc	45 466
American Tower Corp	50 978	Exelon Corp	40 475
TC Energy Corp	44 386	Sempra Energy	39 613
PPL Corp	43 009	Getlink SE	31 717
CSX Corp	40 056	Clearway Energy Inc, C	30 326
Public Service Enterprise Group Inc	39 293	Hydro One Ltd	29 601
Union Pacific Corp	38 993	CMS Energy Corp	25 310
Getlink SE	38 562	CSX Corp	25 185
Transurban Group	38 082	Union Pacific Corp	24 798
United Utilities Group Plc	36 644	CenterPoint Energy Inc	23 779
Southwest Gas Holdings Inc	36 447	Cheniere Energy Inc	23 133
Severn Trent Plc	35 411	CMS Energy Corp	22 600
Sempra Energy	35 062	SBA Communications Corp, A	22 237
American Water Works Co Inc	34 931	Public Service Enterprise Group Inc	22 094

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – (suite)

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) Euro		(en milliers) Euro
PG&E Corp	32 774	American Tower Corp	20 963
OGE Energy Corp	29 739	Constellation Energy Corp	19 754
Central Japan Railway Co	29 152	NextEra Energy Inc	18 986
Cheniere Energy Inc	29 034	Dominion Energy Inc	18 204
Hydro One Ltd	28 583	NextEra Energy Inc	16 876
Enbridge Inc	28 244	Crown Castle International Corp	15 732
Centrais Eletricas Brasileiras SA	26 898	Aena SME SA, 144A	15 251
Clearway Energy Inc, C	26 280	Eiffage SA	14 018
Constellation Energy Corp	25 928	National Grid Plc	13 959
SSE Plc	24 595	Ferrovial SA	13 924
East Japan Railway Co	22 356	CenterPoint Energy Inc	13 345
Aena SME SA, 144A	21 842	Southern Co/The	13 336
CenterPoint Energy Inc	21 116	Transurban Group	12 469
CMS Energy Corp	21 101	American Water Works Co Inc	12 132
Cellnex Telecom SA, 144A	21 045	United Utilities Group Plc	11 979
Terna – Rete Elettrica Nazionale	19 925	Crown Castle International Corp	11 779
Crown Castle International Corp	19 518	Cheniere Energy Inc	11 512
Atlas Arteria Ltd	18 127	PG&E Corp	10 705
Entergy Corp	17 688	CSX Corp	9 660
EDP – Energias de Portugal SA	17 379	Vinci SA	8 980
Gibson Energy Inc	17 287	Williams Cos Inc/The	8 728
Iberdrola SA	16 501	Southern Co/The	7 911
Pembina Pipeline Corp	13 104		
Ferrovial SA	12 749		
Exelon Corp	12 220		

Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
China Merchants Port Holdings Co Ltd	54	Power Grid Corp of India Ltd	73
Centrais Eletricas Brasileiras SA	50	Metro Pacific Investments Corp	56
Perusahaan Gas Negara Tbk PT	41	Gujarat State Petronet Ltd	55
Aboitiz Power Corp	39	Shanghai International Port 'A'	51
Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV, B	32	Gujarat Gas Ltd	44
Indraprastha Gas Ltd	29	Container Corp Of India Ltd	38
EcoRodovias Infraestrutura e Logistica SA	26	GMexico Transportes SAB de CV, 144A	37
NTPC Ltd	24	Operadora De Sites Mexicanos SAB de CV	28
Cia Energetica de Sao Paulo	15	Jiangsu Expressway Co Ltd	23
IHS Holding Ltd	15	Shenzhen Expressway Corp Ltd	22
Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV	15	Jasa Marga Persero Tbk PT	17
ENN Energy Holdings Ltd	12	International Container Terminal Services Inc	17
China Longyuan Power Group Corp Ltd	11	China Resources Power Holdings Co Ltd	15
Airports of Thailand PCL	11	China Power International Development Ltd	13
Neoenergia SA	10	Malaysia Airports Holdings Bhd	7
Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV, B	10	Indraprastha Gas Ltd	6
China Power International Development Ltd	8	Neoenergia SA	6
Guangdong Investment Ltd	8	CCR SA	6
China Resources Power Holdings Co Ltd	4	CFE Capital S de RL de CV	5
		CPFL Energia SA	5

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
Enbridge Inc	43 293	Enbridge Inc	39 273
Williams Cos Inc/The	33 244	Williams Cos Inc/The	27 292
Crown Castle Inc	29 964	Crown Castle Inc	17 104
TC Energy Corp	26 137	Emera Inc	13 886
EDP – Energias de Portugal SA	23 699	Atlas Arteria Ltd	12 697
SSE Plc	23 686	Snam SpA	12 131
National Grid Plc	22 223	Red Electrica Corp SA	11 797
Iberdrola SA	21 402	United Utilities Group Plc	11 577
United Utilities Group Plc	21 242	National Grid Plc	11 539
Snam SpA	19 766	Brookfield Renewable Corporation	10 811
Public Service Enterprise Group Inc	18 438	SSE Plc	10 317
Red Electrica Corp SA	15 707	Getlink SE	10 090
Southern Co/The	15 636	Vinci SA	9 808
Atlas Arteria Ltd	15 497	Aena SME SA, 144A	9 451
West Japan Railway Co	15 257	Iberdrola SA	9 137
Emera Inc	14 920	Clearway Energy Inc, C	8 286
APA Group	13 995	FirstEnergy Corp	8 183
OGE Energy Corp	13 978	Constellation Energy Corp	8 142
American Tower Corp	12 986	NextEra Energy Partners LP	8 110
Transurban Group	12 981	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV	7 239
Brookfield Renewable Corp	12 690	EDP – Energias de Portugal SA	6 858
NextEra Energy Partners LP	11 752	Southern Co/The	6 785
Pennon Group Plc	11 567	TC Energy Corp	6 741
Entergy Corp	11 511	Public Service Enterprise Group Inc	5 783
Enagas SA	11 411	Pembina Pipeline Corp	5 564
Pembina Pipeline Corp	10 724	Entergy Corp	4 841
Constellation Energy Corp	10 423	Transurban Group	4 559
Ferrovial SA	9 041	Engie Brasil Energia SA	3 999

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – (suite)

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
Engie Brasil Energia SA	8 884	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV, B	3 635
Clearway Energy Inc, C	8 865	Brookfield Renewable Corp	3 553
CPFL Energia SA	8 353	Atlas Arteria Ltd	3 434
Vinci SA	8 072		
Centrais Eletricas Brasileiras SA	7 994		
Italgas SpA	7 881		
Southwest Gas Holdings Inc	7 824		
Gibson Energy Inc	6 887		
Union Pacific Corp	6 775		
CCR SA	6 652		

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	190 962	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	200 330
TTEC Holdings Inc	6 545	Sierra Wireless Inc	6 924
Artivion Inc	4 502	Digi International Inc	6 832
nLight Inc	4 374	LSB Industries Inc	6 428
Resources Connection Inc	3 994	IntriCon Corp	6 109
IAA Inc	3 690	Scorpio Tankers Inc	5 386
Healthcare Services Group Inc	3 673	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	5 025
Allegiant Voyage Co	3 600	Allegheny Technologies Inc	4 901
BWX Technologies Inc	3 540	Cross Country Healthcare Inc	4 777
Summit Materials Inc, A	3 448	Intrepid Potash Inc	4 650
IAC Inc	3 429	Arcosa Inc	4 571
First Bancshares Inc/The	3 208	Aerojet Rocketdyne Holdings Inc	4 528
MRC Global Inc	3 164	Univar Solutions Inc	4 339
Adient Plc	3 104	Owens & Minor Inc	4 209
Magnite Inc	3 081	Modine Manufacturing Co	4 174
Overstock.com Inc	3 056	AdvanSix Inc	4 153
Coherent Corp	2 845	Old Republic International Corp	4 116
NeoGenomics Inc	2 829	WESCO International Inc	4 066
TPI Composites Inc	2 770	JetBlue Airways Corp	4 007
Hub Group Inc 'A'	2 708	IAA Inc	3 874

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	21 425	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	21 804
iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	2 519	Meridian Bioscience Inc	2 619
FormFactor Inc	2 091	RLI Corp	2 506
RLI Corp	1 723	iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	2 377
MKS Instruments Inc	1 670	Catalyst Pharmaceuticals Inc	1 937
Bio-Techne Corp	1 623	Kulicke & Soffa Industries Inc	1 727
Enovis Corp	1 515	MasterCraft Boat Holdings Inc	1 647
IAA Inc	1 466	Cohu Inc	1 606
Forward Air Corp	1 206	Patrick Industries Inc	1 472
Skyline Champion Corp	1 201	Simulations Plus Inc	1 429
Brunswick Corp/DE	1 171	ChannelAdvisor Corp	1 415
Avid Technology Inc	1 164	Heidrick & Struggles International Inc	1 372
Ziff Davis Inc	1 154	Harmony Biosciences Holdings Inc	1 315
Carter's Inc	1 132	Arcosa Inc	1 293
Houlihan Lokey Inc 'A'	1 086	Inter Parfums Inc	1 292
Dun & Bradstreet Holdings Inc	1 046	Meritor Inc	1 264
Brady Corp 'A'	1 017	Vectrus Inc	1 127
Harmony Biosciences Holdings Inc	1 016	Natus Medical Inc	1 104
Louisiana-Pacific Corp	899	Innospec Inc	1 088
Hudson Technologies Inc	898	Gibraltar Industries Inc	1 066
Forrester Research Inc	846	Vishay Intertechnology Inc	935
Air Lease Corp, A	771	MKS Instruments Inc	902
Ironwood Pharmaceuticals Inc 'A'	761	Pason Systems Inc	873
LCI Industries	755	Avid Technology Inc	861
Leonardo DRS Inc	748	Air Lease Corp, A	861
FARO Technologies Inc	738	Insight Enterprises Inc	858
Heritage-Crystal Clean Inc	698	Great Lakes Dredge & Dock Corp	805
AMN Healthcare Services Inc	694	Ziff Davis Inc	797
Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	688	IAA Inc	774
Inter Parfums Inc	677	Lazard Ltd 'A'	757
Kennedy-Wilson Holdings Inc	660	CMC Materials Inc	754

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^A

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	781	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Class WA (Distributing)	741
JCU Corp	96	Boa Vista Servicos SA	85
NICE Information Service Co Ltd	91	Kulicke & Soffa Industries Inc	71
Marlowe Plc	63	Bravura Solutions Ltd	69
Boa Vista Servicos SA	60	Alimak Group AB, 144A	65

^A Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^] – (suite)

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
IAA Inc	54	Technology One Ltd	55
FormFactor Inc	48	Morningstar Inc	53
BML Inc	47	Avid Technology Inc	47
Zuken Inc	46	Meridian Bioscience Inc	45
Enovis Corp	46	IPH Ltd	42
Intertek Group Plc	43	Dolby Laboratories Inc, A	40
Douzone Bizon Co Ltd	42	Meitec Corp	39
Esab Corp	40	UFP Industries Inc	39
FirstService Corporation	39	Hansen Technologies Ltd	36
DiscoverIE Group Plc	39	Comture Corp	36
OBIC Business Consultants Co Ltd	38	Arcosa Inc	35
LCI Industries	37	Landstar System Inc	35
Restore Plc	37	Innospec Inc	34
Learning Technologies Group Plc	34	Carel Industries SpA, 144A	34
XP Power Ltd	33	Altus Group Ltd/Canada	31
IPH Ltd	32	Odontoprev SA	30
UFP Industries Inc	31	Valmont Industries Inc	29
Dorman Products Inc	30	LCI Industries	27
TechTarget Inc	29	Quaker Chemical Corp	27
Quaker Chemical Corp	29	FormFactor Inc	27
MKS Instruments Inc	27	CMC Materials Inc	26
Colliers International Group Inc	25	Lincoln Electric Holdings Inc	26
Forrester Research Inc	25	Asseco Poland SA	26

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^]

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) Euro		(en milliers) Euro
Zurich Insurance Group AG	392	Roche Holding AG	1 017
		Novo Nordisk A/S	977
		Nestlé SA	901
		Novartis AG	892
		Sanofi	737
		GlaxoSmithKline Plc	660
		BHP Group Ltd	567
		SAP SE	538
		BAE Systems Plc	514
		Allianz SE	487
		Rio Tinto Plc	486
		Unilever Plc	462
		Wolters Kluwer NV	426
		British American Tobacco Plc	425
		Galenica AG, 144A	424
		Bunzl Plc	423
		Orange SA	422
		Koninklijke Ahold Delhaize NV	420
		Red Electrica Corp SA	413
		Enagas SA	401
		Swiss Re AG	399
		Carrefour SA	398
		Vodafone Group Plc	393
		Skandinaviska Enskilda Banken AB	385
		Zurich Insurance Group AG	377
		BP Plc	352
		SGS SA	351
		Koninklijke KPN NV	350
		Imperial Brands Plc	349
		Banque Cantonale Vaudoise	348
		NN Group NV	331
		Deutsche Post AG	329
		Direct Line Insurance Group Plc	327
		Telenor ASA	325
		Telefonica Deutschland Holding AG	313
		Kuehne + Nagel International AG	306
		PSP Swiss Property AG	303
		IG Group Holdings Plc	302
		Telefonica SA	302
		Vinci SA	300
		Yara International ASA	300
		Sage Group Plc/The	296
		Orion Oyj	293
		Ageas SA/NV	289
		Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG/Munich	279
		Admiral Group plc	277
		Eutelsat Communications SA	276
		Kingfisher Plc	276
		Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	269

[^] Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

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

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
BHP Group Ltd	454	Dali Foods Group Co Ltd, 144A	358
Coles Group Ltd	330	Yuexiu Property Co Ltd	339
Jardine Matheson Holdings Ltd	290	CLP Holdings Ltd	330
Petronas Chemicals Group Bhd	279	RHB Bank Bhd	289
Astra International Tbk PT	231	CTBC Financial Holding Co Ltd	262
United Tractors Tbk PT	228	CITIC Ltd	210
China Tower Corp Ltd, 144A	222	CGN Power Co Ltd, 144A	202
Woodside Energy Group Ltd	209	Fortune Real Estate Investment Trust	168
Kia Corp	190	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	167
United Microelectronics Corp	162	Infosys Ltd	148
CSPC Pharmaceutical Group Ltd	113	KT Corp, ADR	137
Adaro Energy Indonesia Tbk PT	112	China Shenhua Energy Co Ltd	135
		Longfor Group Holdings Ltd, 144A	132
		Telkom Indonesia Persero Tbk PT	126
		KT&G Corp	122
		AIA Group Ltd	121
		Jardine Cycle & Carriage Ltd	120
		Asustek Computer Inc	115
		China Construction Bank Corp	111
		NHPC Ltd	107
		Fu Shou Yuan International Group Ltd	97
		SK Hynix Inc	84
		PICC Property & Casualty Co Ltd	81
		Power Grid Corp of India Ltd	76
		CITIC Telecom International Holdings Ltd	71
		China Railway Group Ltd	70
		Indofood Sukses Makmur Tbk PT	70
		Astro Malaysia Holdings Bhd	64
		China Medical System Holdings Ltd	64
		Asia Cement Corp	62

Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
UnitedHealth Group Inc	247	iShares MSCI ACWI ETF – ETF	582
Philip Morris International Inc	181	UnitedHealth Group Inc	270
McDonald's Corp	158	AbbVie Inc	238
Loblaw Companies Ltd	156	Johnson & Johnson	220
PPL Corp	155	iShares MSCI EAFE ETF – ETF	219
Western Union Co	120	SPDR S&P 500 ETF Trust – ETF	216
		Kroger Co/The	214
		Lockheed Martin Corp	201
		Broadcom Inc	200
		Amgen Inc	196
		Bristol-Myers Squibb Co	195
		Hershey Co/The	188
		Northrop Grumman Corp	186
		Philip Morris International Inc	183
		Sanofi	183
		Loblaw Companies Ltd	182
		Pfizer Inc	182
		Roche Holding AG	180
		Walmart Inc	180
		Cisco Systems Inc/Delaware	179
		Marubeni Corp	179
		PPL Corp	178
		Merck & Co Inc	177
		Cardinal Health Inc	176
		H&R Block Inc	174
		Home Depot Inc/The	172
		International Business Machines Corp	172
		KDDI Corp	172
		Nippon Telegraph & Telephone Corp	170
		CVS Health Corp	167
		HP Inc	167
		Intel Corp	167
		Rio Tinto Ltd	165
		Microsoft Corp	164
		Gilead Sciences Inc	163
		Target Corp	163
		McDonald's Corp	162
		Orange SA	158
		American Financial Group Inc/OH	156
		Altria Group Inc	153
		GlaxoSmithKline Plc	149
		Caterpillar Inc	148
		Postal Savings Bank of China Co Ltd, 144A	148
		Texas Instruments Inc	148
		Koninklijke Ahold Delhaize NV	147
		Nintendo Co Ltd	147
		Red Electrica Corp SA	145

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^ – (suite)

PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers)
USD	USD
Simplo Technology Co Ltd	142
J M Smucker Co/The	141
Radiant Opto-Electronics Corp	141
King Yuan Electronics Co Ltd	140
Flowers Foods Inc	139
Juniper Networks Inc	139
Walgreens Boots Alliance Inc	139

FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT (en milliers)	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers)
USD	USD	USD	USD
Singapore Telecommunications Ltd	635	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1 111
Samsung Electronics Co Ltd	572	Tencent Holdings Ltd	981
JD.com Inc	401	Samsung Electronics Co Ltd	931
Hansol Chemical Co Ltd	379	United Overseas Bank Ltd	765
Accton Technology Corp	349	HDFC Bank Ltd	643
Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	274	AIA Group Ltd	606
LEENO Industrial Inc	250	Alibaba Group Holding Ltd	583
Tencent Holdings Ltd	219	Hero MotoCorp Ltd	554
JD.com Inc	200	Jardine Matheson Holdings Ltd	525
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	182	JD.com Inc	520
iShares Core MSCI Asia ex Japan ETF – ETF	147	Singapore Telecommunications Ltd	486
Alibaba Group Holding Ltd	131	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	452
CSPC Pharmaceutical Group Ltd	91	Venture Corp Ltd	449
LG Chem Ltd	63	Tata Consultancy Services Ltd	445
Venture Corp Ltd	62	Singapore Technologies Engineering Ltd	420
Feng TAY Enterprise Co Ltd	48	ENN Energy Holdings Ltd	400
Hero MotoCorp Ltd	43	LG Chem Ltd	382
LG Energy Solution Ltd	41	Feng TAY Enterprise Co Ltd	346
Jardine Matheson Holdings Ltd	38	TravelSky Technology Ltd	337
Singapore Technologies Engineering Ltd	37	LG Energy Solution Ltd	321
		Ping An Insurance Group Co of China Ltd	319
		Orion Corp/République de Corée	319
		Techtronic Industries Co Ltd	318
		Minth Group Ltd	317
		Tongcheng Travel Holdings Ltd	317
		Hansol Chemical Co Ltd	310
		Guangdong Investment Ltd	295
		Accton Technology Corp	254
		LEENO Industrial Inc	241
		Telkom Indonesia Persero Tbk PT	238
		LG H&H Co Ltd	236
		Shenzhen International Group Holdings Ltd	233
		Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	230

FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT (en milliers)	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers)
USD	USD	USD	USD
ASML Holding NV	12 104	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	9 708
Pernod Ricard SA	4 461	Microsoft Corp	3 848
NIKE Inc	4 120	Linde Plc	3 369
Zoetis Inc	3 692	ResMed Inc	3 296
Coloplast A/S	3 647	ASML Holding NV	3 210
Croda International Plc	3 128	NVIDIA Corp	3 137
Microsoft Corp	2 993	Tencent Holdings Ltd	3 035
Linde Plc	2 577	Kingspan Group Plc	2 750
NVIDIA Corp	2 577	Mastercard Inc	2 743
ResMed Inc	2 477	L'Oreal SA	2 557
Kingspan Group Plc	2 274	Coloplast A/S	2 377
Mastercard Inc	2 141	Moncler SpA	2 352
L'Oreal SA	2 140	Hexagon AB	2 337
Moncler SpA	2 057	CSL Ltd	2 335
Hexagon AB	1 881	Ferrari NV	2 266
Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	1 876	adidas AG	2 236
Ferrari NV	1 837	Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	2 150
CSL Ltd	1 785	Atlas Copco AB	2 067
Veeva Systems Inc 'A'	1 608	AIA Group Ltd	2 060
Assa Abloy AB	1 596	Assa Abloy AB	2 021

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT (en milliers)	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS (en milliers)
USD	USD	USD	USD
Chorus Ltd	878	NHPC Ltd	787
Fortune Real Estate Investment Trust	467	Vicinity Ltd	645
China Merchants Port Holdings Co Ltd	441	Manila Electric Co	628
Scentre Group	396	Fraser's Centrepont Trust	467
Aurizon Holdings Ltd	377	Digital Telecommunications Infrastructure Fund	359
China Tower Corp Ltd, 144A	311	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	357
Transurban Group	253	Keppel DC REIT	310
Kiwi Property Group Ltd	250	Transurban Group	261
Link REIT	209	Waypoint REIT Ltd	252

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – (suite)

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
Guangdong Investment Ltd	174	APA Group	232
CLP Holdings Ltd	166	China Tower Corp Ltd, 144A	208
NHPC Ltd	149	Charter Hall Long Wale REIT	156
Capitaland India Trust	134	Chorus Ltd	141
Wharf Real Estate Investment Co Ltd	130	Contact Energy Ltd	90
HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd	117	CapitaLand Integrated Commercial Trust	88
GPT Group/The	113	NETLINK NBN TRUST	54
Stockland	108	Power Grid Corp of India Ltd	40
Vicinity Ltd	78	Stockland	39
NETLINK NBN TRUST	78	CLP Holdings Ltd	39
Charter Hall Retail REIT	77	Scentre Group	38
Shopping Centres Australasia Property Group	77		
AGL Energy Ltd	71		
Contact Energy Ltd	65		

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) USD		(en milliers) USD
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	783	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1 156
Grupo Financiero Banorte SAB de CV	715	Samsung Electronics Co Ltd	1 149
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	706	Tencent Holdings Ltd	993
Samsung Electronics Co Ltd	658	OTP Bank Nyrt	819
ENN Energy Holdings Ltd	585	Titan Co Ltd	628
Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	556	Maruti Suzuki India Ltd	555
Tencent Holdings Ltd	499	Asian Paints Ltd	503
Globant SA	444	Alibaba Group Holding Ltd ADR	478
Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	424	Meituan 'B', 144A	433
China Merchants Bank Co Ltd	411	UltraTech Cement Ltd	384
Alibaba Group Holding Ltd ADR	279	ICICI Bank Ltd	383
ICICI Bank Ltd	263	LG Chem Ltd	374
Al Rajhi Bank	257	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	369
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	252	Reliance Industries Ltd	368
SK Hynix Inc	248	SK Hynix Inc	368
Reliance Industries Ltd	235	Prosus NV	355
WEG SA	222	Credicorp Ltd	341
Titan Co Ltd	212	Samsung SDI Co Ltd	334
Credicorp Ltd	207	AIA Group Ltd	320
B3 SA – Brasil Bolsa Balcao	200	NAVER Corp	282
AIA Group Ltd	199	EPAM Systems Inc	268
Meituan 'B', 144A	183	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	264
HDFC Bank Ltd	183	HDFC Bank Ltd	264
JD.com Inc ADR	176	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	255
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	158	Al Rajhi Bank	249
Antofagasta Plc	156	JD.com Inc ADR	247
Cosan SA	155	Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	226
Asian Paints Ltd	151	Cosan SA	224
Contemporary Amperex Technology Co Ltd	143	Antofagasta Plc	207
Ping An Bank Co Ltd	141	Kotak Mahindra Bank Ltd	199
Maruti Suzuki India Ltd	133	Globalwafers Co Ltd	196
Kotak Mahindra Bank Ltd	132	China Merchants Bank Co Ltd	191
JD.com Inc	131	Delivery Hero SE, 144A	181
EPAM Systems Inc	120	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	170
		WEG SA	170
		B3 SA – Brasil Bolsa Balcao	160

FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) Euro		(en milliers) Euro
Pernod Ricard SA	6 040	ASML Holding NV	12 286
Croda International Plc	5 107	Linde Plc	7 985
Oxford Nanopore Technologies Plc	3 604	Ferrari NV	7 786
Coloplast A/S	3 152	Kering SA	7 577
Sartorius Stedim Biotech	1 889	Infineon Technologies AG	6 445
ASML Holding NV	1 485	Hexagon AB	6 328
Ferrari NV	1 198	adidas AG	6 315
Kingspan Group Plc	1 186	Mettler-Toledo International Inc.	6 083
Dassault Systemes SE	1 099	Sartorius Stedim Biotech	5 362
L'Oreal SA	1 086	L'Oreal SA	5 349
Kering SA	972	Atlas Copco AB	5 207
Partners Group Holding AG	968	Moncler SpA	4 884
Linde Plc	922	Assa Abloy AB	4 810
Mettler-Toledo International Inc.	916	Kingspan Group Plc	4 796
Nemetschek SE	889	Dassault Systemes SE	4 172
Hexagon AB	836	Partners Group Holding AG	3 555
Kerry Group Plc	778	Ambu A/S 'B'	3 505
Moncler SpA	756	Nemetschek SE	3 427
Assa Abloy AB	751	Coloplast A/S	3 038
Infineon Technologies AG	705	Kerry Group Plc	2 833
Allfunds Group Plc	628	Oxford Nanopore Technologies Plc	2 502
Atlas Copco AB	617	Allfunds Group Plc	2 259
adidas AG	529	Dr Martens Plc	1 203
		Farfetch Ltd	1 201

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

État des principales évolutions du portefeuille (non audité) – (suite)

Franklin Responsible Income 2028 Fund^

PRINCIPAUX ACHATS	COÛT	PRINCIPALES VENTES	PRODUITS
	(en milliers) Euro		(en milliers) Euro
Morgan Stanley, 4,813 %, échéance le 25/10/2028	836	Lloyds Banking Group Plc	493
Caixa Geral de Depositos SA, 5,750 %, échéance le 31/10/2028	836	CNP Assurances SA	410
JPMorgan Chase & Co, 1,638 %, échéance le 18/05/2028	825	Microsoft Corp	399
Crelan SA, 5,750 %, échéance le 26/01/2028	815	Santander Consumer Finance SA	353
ABN AMRO Bank NV, 4,000 %, échéance le 16/01/2028	807	Apple Inc, 2,000 %, échéance le 17/09/2027	192
BPCE SA, 4,375 %, échéance le 13/07/2028	804	JPMorgan Chase & Co, 1,638 %, échéance le 18/05/2028	182
Obligation internationale de l'État roumain, 2,125 %, échéance le 07/03/2028	775	International Business Machines Corp, 0,300 %, échéance le 11/02/2028	172
Orano SA, 2,750 %, échéance le 08/03/2028	748	Prosus NV, 1,539 %, échéance le 03/08/2028	168
Engie SA, 1,750 %, échéance le 27/03/2028	742	Autostrade per l'Italia SpA	91
AIB Group Plc, 2,250 %, échéance le 04/04/2028	734		
Intesa Sanpaolo SpA, 1,750 %, échéance le 20/03/2028	713		
Abanca Corp Bancaria SA, 5,250 %, échéance le 14/09/2028	711		
Commerzbank AG, 4,625 %, échéance le 21/03/2028	704		
UNITE Group Plc/The, 3,820 %, échéance le 15/02/2028	703		
Barclays Plc, 0,877 %, échéance le 28/01/2028	702		
La Banque Postale SA, 1,000 %, échéance le 09/02/2028	702		
Banco de Sabadell SA, 5,250 %, échéance le 07/02/2029	701		
International Business Machines Corp, 0,300 %, échéance le 11/02/2028	696		
Atlantia SpA, 1,875 %, échéance le 12/02/2028	693		
CaixaBank SA, 0,750 %, échéance le 26/05/2028	691		
Thames Water Utilities Finance Plc, 0,875 %, échéance le 31/01/2028	689		
Prosus NV, 1,539 %, échéance le 03/08/2028	684		
Apple Inc, 2,000 %, échéance le 17/09/2027	678		
CEZ AS, 3,000 %, échéance le 05/06/2028	665		
Nationwide Building Society, 0,250 %, échéance le 14/09/2028	665		
Vonovia Finance BV, 1,500 %, échéance le 14/01/2028	616		
Unicaja Banco SA, 7,250 %, échéance le 15/11/2027	616		
RCI Banque SA, 4,875 %, échéance le 21/09/2028	610		
NatWest Markets Plc, 4,250 %, échéance le 13/01/2028	606		
easyJet FinCo BV, 1,875 %, échéance le 03/03/2028	601		
Banco Santander SA, 3,875 %, échéance le 16/01/2028	600		
Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000 %, échéance le 22/03/2028	597		
Nykredit Realkredit AS, 0,375 %, échéance le 17/01/2028	586		
OP Corporate Bank plc, 0,375 %, échéance le 16/06/2028	581		
Berry Global Inc, 1,500 %, échéance le 15/01/2027	575		
Credit Suisse Group AG, 0,650 %, échéance le 14/01/2028	561		
Avantor Funding Inc, 3,875 %, échéance le 15/07/2028	560		
PVH Corp, 3,125 %, échéance le 15/12/2027	514		
Société Générale SA, 0,125 %, échéance le 18/02/2028	509		
National Grid Plc, 0,163 %, échéance le 20/01/2028	507		
Macquarie Group Ltd, 0,350 %, échéance le 03/03/2028	500		
Lloyds Banking Group Plc	494		
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,000 %, échéance le 04/05/2028	470		
Matterhorn Telecom SA, 4,000 %, échéance le 15/11/2027	465		
IQVIA Inc, 2,250 %, arrivant à échéance le 15/01/2028	443		
Rexel SA, 2,125 %, échéance le 15/12/2028	440		
Autostrade per l'Italia SpA, 1,625 %, échéance le 25/01/2028	437		
CNP Assurances SA	415		
Svenska Handelsbanken AB, 3,750 %, échéance le 01/11/2027	408		
Bank of Ireland Group Plc, 4,875 %, échéance le 16/07/2028	408		
Microsoft Corp	398		
Cloverie Plc for Zurich Insurance Co Ltd, 1,500 %, échéance le 15/12/2028	389		
Santander UK Group Holdings Plc, 3,530 %, échéance le 25/08/2028	388		
DXC Capital Funding DAC, 0,450 %, échéance le 15/09/2027	383		

^ Non autorisé à la vente au public à Hong Kong.

Politique de rémunération OPCVM V (non auditée)

Rémunération

Franklin Templeton International Services S.à.r.l. (« FTIS »), en tant que société de gestion d'OPCVM agréée (la « société de gestion »), a mis en place une politique de rémunération (la « Politique ») qui s'applique à tous les fonds OPCVM (individuellement un « OPCVM » et ensemble les « OPCVM ») qu'elle gère. La Politique a été conçue pour décourager une prise de risque excessive, en intégrant dans ses systèmes de gestion des performances des critères de risque spécifiques aux divisions concernées. La Politique prévoit une structure de gouvernance qui vise à prévenir les conflits d'intérêts internes.

Des procédures précises ont été mises en place pour la création, la mise à jour, l'examen et l'approbation de la politique ainsi que pour sa communication et sa mise en œuvre. La direction, les ressources humaines, la conformité et d'autres fonctions sont impliquées dans ce processus et la politique est approuvée par la direction et le conseil d'administration de la société de gestion.

La rémunération fixe est définie comme étant le salaire de base plus les autres avantages comme les cotisations de retraite, les primes d'assurance-vie ou d'assurance médicale privée. Les niveaux des rémunérations fixes sont fixés par référence à la complexité du poste, au niveau de responsabilité, à la performance et aux données comparatives du marché. Ces niveaux sont révisés sur une base régulière.

La rémunération variable est définie comme étant les primes annuelles, les récompenses à long terme sous la forme d'attributions d'actions en fonctions des performances ou de paiements de primes de vente. Les niveaux des rémunérations variables sont fixés par référence à la performance de l'ensemble de l'entreprise et à celle des divisions, ainsi qu'à la performance de la personne.

La Politique complète est disponible au siège social de la société de gestion. Des informations quantitatives concernant les compartiments sont fournies ci-dessous :

Montant total de la rémunération fixe payée par FTIS et ses délégués au cours de l'exercice clos le 30 septembre 2022*, **, ***	10 479 456 €
Montant total de la rémunération variable payée par FTIS et ses délégués au cours de l'exercice clos le 30 septembre 2022*, **, ***	7 036 351 €
Effectifs de FTIS et de ses délégués au 30 septembre 2022	549
Montant total des rémunérations versées par FTIS et ses délégués aux cadres supérieurs au cours de l'exercice clos le 30 septembre 2022*, **, ***	5 321 053 €
Montant total payé par FTIS et ses délégués à d'autres membres du personnel qui ont un impact significatif sur le profil de l'OPCVM au cours de l'exercice clos le 30 septembre 2022*, **, ***	1 108 336 €

* Le montant total de la rémunération payée par FTIS a été attribué à chaque OPCVM proportionnellement à sa part de l'actif net total moyen en fin de mois de FTIS pour l'exercice clos le 30 septembre 2022.

** Le montant total de la rémunération payée par les délégués de FTIS a été attribué à chaque OPCVM proportionnellement à sa part de l'actif net total moyen en fin de mois des délégués de FTIS pour l'exercice clos le 30 septembre 2022.

*** Les délégués sont des entités de gestion d'investissement soumises à des obligations réglementaires comparables à celles prévues à l'article 69 (3) (a) de la directive OPCVM.

Annexe : Réglementation relative aux opérations de financement sur titres (SFTR) (non auditée)

Les tableaux suivants indiquent la valeur notionnelle cumulée brute des contrats de prise en pension ainsi que la juste valeur absolue en pourcentage de la valeur liquidative du compartiment, détaillée par contrepartie au 28 février 2023 :

Contrats de prise en pension

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

Contrepartie	Pays de constitution	Valeur notionnelle globale brute (en milliers) USD	Juste valeur absolue (en milliers) USD	% de la valeur liquidative
Canadian Imperial Bank of Commerce	Canada	35 000	35 000	4,20
HSBC Bank (USA)	Royaume-Uni	55 000	55 000	6,60
JP Morgan Securities LLC	États-Unis	75 000	75 000	8,99
Royal Bank of Canada	Canada	50 000	50 000	6,00
TD Securities (USA) LLC	Canada	29 848	29 848	3,58
		244 848	244 848	29,37

Le tableau ci-dessous présente la liste des dix plus grands émetteurs en valeur des garanties non numéraires reçues et la devise desdites garanties non numéraires au 28 février 2023 :

Fonds	Émetteur de la garantie*	Devise	Valeur totale des sûretés détenues (en milliers)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	États-Unis**	Dollar US	249 766 \$

* Lorsqu'il y a moins de dix émetteurs de garanties au 28 février 2023, ceux-ci sont tous inclus.

** Les obligations et bons sous-jacents détenus à titre de garantie sont émis par le Trésor des États-Unis.

Le tableau suivant présente une analyse du type et de la qualité des garanties non numéraires reçues au 28 février 2023 :

Fonds	Type de garantie	Qualité de la garantie	Valeur totale des sûretés détenues (en milliers)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	Obligations et billets d'État	Investment grade	249 766 \$

L'analyse des échéances de garanties présentée ci-dessous est basée sur la date d'échéance contractuelle des Contrats de prise en pension et des garanties reçues/(données) associées au 28 février 2023 :

Fonds	Type de dérivé/garantie	Moins de 1 jour (en milliers)	1 jour à 1 semaine (en milliers)	1 semaine à 1 mois (en milliers)	1 mois à 3 mois (en milliers)	3 mois à 1 an (en milliers)	Plus de 1 an (en milliers)	Échéance ouverte (en milliers)	Total (en milliers)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	Contrats de prise en pension	–	244 848 \$	–	–	–	–	–	244 848 \$
	Garantie non numéraire reçue	–	5 \$	76 515 \$	–	3 267 \$	169 979 \$	–	249 766 \$

Les Contrats de prise en pension détenus sur FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund sont des contrats tripartites. Les garanties reçues par le Fonds au titre de contrats de prise en pension ouverts au 28 février 2023 sont détenues par le dépositaire sur des comptes séparés au nom de la Société. Les garanties reçues ne sont pas réutilisées.

Tous les coûts et rendements découlant des contrats de prise en pension sont intégralement attribuables aux compartiments.

Annexe : Informations sur les personnes liées (non auditées)

Au cours de l'exercice clos le 28 février 2023, Pershing Limited, une filiale de The Bank of New York Mellon Corporation et une personne liée au dépositaire, a fourni des services de courtage en rapport avec la négociation de titres aux fonds enregistrés à Hong Kong, par l'intermédiaire des gestionnaires délégués des fonds respectifs. La valeur totale des transactions avec les personnes liées au dépositaire en ce qui concerne la négociation de titres s'est élevée à 193 millions de dollars américains, ce qui représente 0,11 % de la valeur totale des transactions de ce type effectuées par ces fonds. Les frais de courtage et les commissions payés par les Fonds à Pershing Limited dans le cadre de ces opérations sur titres pour l'exercice clos le 28 février 2023 se sont élevés à 141 301 USD, avec un taux de commission moyen de 7 points de base. Ils ont été inclus dans les coûts de transaction sur les achats et les ventes des titres concernés et sont présentés dans la note 4 de ces états financiers.

Au cours de l'exercice clos le 28 février 2023, The Bank of New York Mellon (banque institutionnelle) et The Bank of New York Mellon SA/NV, toutes deux personnes liées au dépositaire, ont effectué des opérations de change en dépôt et des programmes d'administration et de couverture des devises, respectivement, pour les fonds enregistrés à Hong Kong. Le montant total des commissions versées dans le cadre de ces transactions s'est élevé à 833 647 dollars, avec un taux de commission moyen de 0,20 point de base. La valeur totale des transactions avec les personnes liées au dépositaire à cet égard s'est élevée à 40 718 millions de dollars américains, ce qui représente 2,08 % de la valeur totale des transactions de ce type conclues par les Fonds.

Toutes les opérations exécutées avec les personnes liées du dépositaire ont été effectuées dans le cadre normal de son activité et à des conditions commerciales normales.

Annexe révisée: Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (non audité)

Le règlement « Disclosure », ou relatif à la divulgation d'informations en matière de finance durable (UE) 2019/2088, (le « SFDR ») exige de la part de la Société d'inclure dans ses rapports périodiques une description de la mesure dans laquelle tout fonds classé article 8 du SFDR (un« fonds de l'article 8 ») a satisfait à ses caractéristiques environnementales ou sociales. Le SFDR habilite également l'Autorité bancaire européenne, l'Autorité européenne des assurances et des pensions professionnelles et l'Autorité européenne des marchés financiers (collectivement les « AES ») à élaborer des projets de normes techniques réglementaires (« RTS ») pour préciser le format d'information et de présentation des rapports périodiques.

L'annexe suivante comprend les informations périodiques de chaque fonds de l'article 8 du SFDR, qui ont été préparées à l'aide de l'ensemble commun d'informations sur le développement durable ou d'exigences de déclaration des RTS qui sont entrées en vigueur le 1er janvier 2023. Les classifications des actifs dans les informations suivantes sont basées sur MSCI et peuvent différer de la classification des titres dans les portefeuilles d'investissement.

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

LEI de l'entité : 549300WRHLJECFCSP797



FRANKLIN TEMPLETON

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

☐ ☐ **OUI**

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif environnemental** : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif social** : ____%

☒ ☒ **NON**

☒ Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 3,30% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Fonds privilégiait les caractéristiques environnementales et/ou sociales suivantes :

- alignement sur au moins un objectif de développement durable des Nations Unies (ODD) par rapport à l'indice de référence du Compartiment, par voie d'investissement dans des obligations vertes, sociales, durables ou apparentées, et dans des investissements de premier ordre ;
- alignement sur les indicateurs de PAI :
 - intensité de gaz à effet de serre (incidences 3 et 15) ;
 - questions sociales et relatives au personnel (incidence 10) ;
 - armes controversées (incidence 14).

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds étaient les suivants :

- Les indicateurs PIN mentionnés dans la réponse ci-dessus. Veuillez vous référer aux valeurs affichées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » qui représentent la performance des indicateurs pendant la période de référence.
- l'allocation en obligations vertes, sociales, durables ou apparentées s'établissait à 3,30 %.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Les investissements durables du Fonds ont été réalisés dans des obligations vertes, sociales, durables et liées à la durabilité, grâce à une allocation minimale aux émetteurs alignés sur les ODD par rapport à l'indice de référence du Fonds et aux émetteurs qui ont atteint des résultats de premier ordre selon les seuils déterminés par le Gestionnaire d'investissement. Ces obligations étaient assorties d'indicateurs clés de performance liés au développement durable, ou leur produit était utilisé pour des projets incluant, mais sans s'y limiter, les éléments suivants :

- Projets verts : énergies renouvelables, efficacité énergétique, prévention et contrôle de la pollution, gestion écologiquement durable des ressources naturelles vivantes et de l'usage des sols, biodiversité, transports propres, gestion durable de l'eau et de l'assainissement, adaptation au changement climatique, économie circulaire et bâtiments écologiques ;
- Projets sociaux : logements abordables, infrastructures abordables (eau potable, assainissement), programmes d'emploi et progrès socio-économiques, notamment en matière d'éducation, de diversité, d'égalité et d'inclusion.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Le Gestionnaire de portefeuille a utilisé la recherche interne et des indicateurs PIN exclusifs pour s'assurer que les investissements durables ne portent pas préjudice à certains objectifs d'investissement durable sociaux ou environnementaux.

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé des outils exclusifs de suivi des PAI qui exploitent des données de sources diversifiées (fournisseurs externes tels que MSCI ESG, ISSS, Banque mondiale, BloombergNEF, S&P Trucost, Transition Pathway Initiative, ONG, établissements universitaires), ainsi que des recherches exclusives, contribuait à déterminer les émetteurs qui présentaient des caractéristiques de durabilité insuffisantes ou des incidences négatives au sens des indicateurs PAI. Ces contrôles permettaient au Gestionnaire de portefeuille d'investir dans des émetteurs alignés sur les indicateurs PAI et d'éviter les émetteurs non alignés. En matière d'investissements dans les obligations vertes, sociales, durables ou apparentées, le Gestionnaire de portefeuille a appliqué cette approche pour déterminer si une obligation respectait les critères de durabilité.

Par ailleurs, les émetteurs souverains ont été soumis à des tests évaluant leur niveau en matière de libertés politiques et/ou de corruption.

Pour sélectionner les investissements durables, en particulier la part de 1 % du portefeuille visant des objectifs environnementaux éventuels, le Gestionnaire de portefeuille a appliqué des évaluations qualitatives complémentaires (fondées sur la recherche interne ou des opinions externes) aux émetteurs et aux projets, pour déterminer leur admissibilité en fonction du principe de « ne pas causer de préjudice important ».

De plus, certaines exclusions ont été mises en œuvre pour éliminer les émetteurs susceptibles d'être à l'origine de préjudices importants, tel que précisé plus loin.

----- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Le Gestionnaire de portefeuille a développé un outil interne de suivi des PIN qui prend en compte les PIN majeures, et qui a contribué à mesurer l'alignement du Compartiment sur les indicateurs PIN considérés comme significatifs. Cet outil a identifié les émetteurs qui étaient en retard sur leurs pairs en ce qui concerne les PIN, et a permis au Gestionnaire de portefeuille d'évaluer l'exposition du Compartiment aux PIN par rapport à l'indice de référence.

Les PAI ont constitué une jauge utile pour déterminer les cibles d'investissement : Plus précisément, la PIN 3 mesurait l'intensité des GES des entreprises et l'incidence 15 mesurait l'intensité des GES des États ; la PIN 10 identifiait la violation des principes directeurs de l'UNGC et de l'OCDE, et la PIN 14 mesurait les activités liées aux armes controversées justifiant certaines exclusions par comparaison avec l'ensemble de l'univers d'investissement. Outre les composantes des PIN, l'outil d'analyse des PIN comprenait également l'évaluation des pays bénéficiaires d'investissements estimés inéligibles selon l'évaluation du Gestionnaire d'investissement et les données de tiers. En raison de la nature exhaustive des points de données incorporés, l'outil a permis d'identifier les mesures prises à l'égard des émetteurs, et notamment les engagements et les désinvestissements.

Même si le Compartiment ne s'est pas engagé à faire mieux, en moyenne, que son indice de référence en matière de PIN, l'écart de mesure entre les deux a été un indicateur utile pour évaluer la performance en matière de gestion des incidences négatives.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le Compartiment a respecté les principes directeurs en matière d'exclusion des émetteurs qui ne respectaient pas les principes de l'UNGC et de l'OCDE. L'engagement du Gestionnaire de portefeuille vis-à-vis des émetteurs s'est fondé sur les principes de l'UNGC et de l'OCDE. Les émetteurs qui ne respectaient pas les principes de l'UNGC et de l'OCDE ont été ajoutés à la liste rouge ESG du Gestionnaire de portefeuille et sont dès lors devenus inéligibles à l'investissement. Le cas échéant, le Gestionnaire de portefeuille a cherché à s'engager auprès des émetteurs problématiques, qu'ils aient ou non déjà dérogé de manière explicite aux principes directeurs sous-jacents.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

La manière dont les PIN ont été prises en compte est exposée plus en détail ci-dessus.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Intensité des GES en USD	121,00	95,90%
Intensité GES des pays en portefeuille en USD	235,40	100,00%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	95,00%
Exposition à des armes controversées	0,00%	95,00%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	1,95%	États-Unis
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	1,64%	États-Unis
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	1,37%	États-Unis
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	0,67%	États-Unis
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	0,59%	États-Unis
FANNIE MAE POOL	Obligations d'État	0,57%	États-Unis
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	0,52%	États-Unis
CREDIT SUISSE MORTGAGE CAPITAL CERTIFICATES	Finance	0,51%	États-Unis
ÉTATS-UNIS MEXICAINS	Obligations d'État	0,50%	Mexique
FEDERAL HOME LOAN MORTGAGE CORP	Obligations d'État	0,49%	États-Unis
BHMS MORTGAGE TRUST	Finance	0,49%	États-Unis
HOME EQUITY ASSET TRUST	Finance	0,49%	États-Unis
ABBVIE INC	Santé	0,46%	États-Unis
ISRAEL FIXED BOND	Obligations d'État	0,42%	Israël
LONG BEACH MORTGAGE LOAN TRUST	Finance	0,41%	États-Unis

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

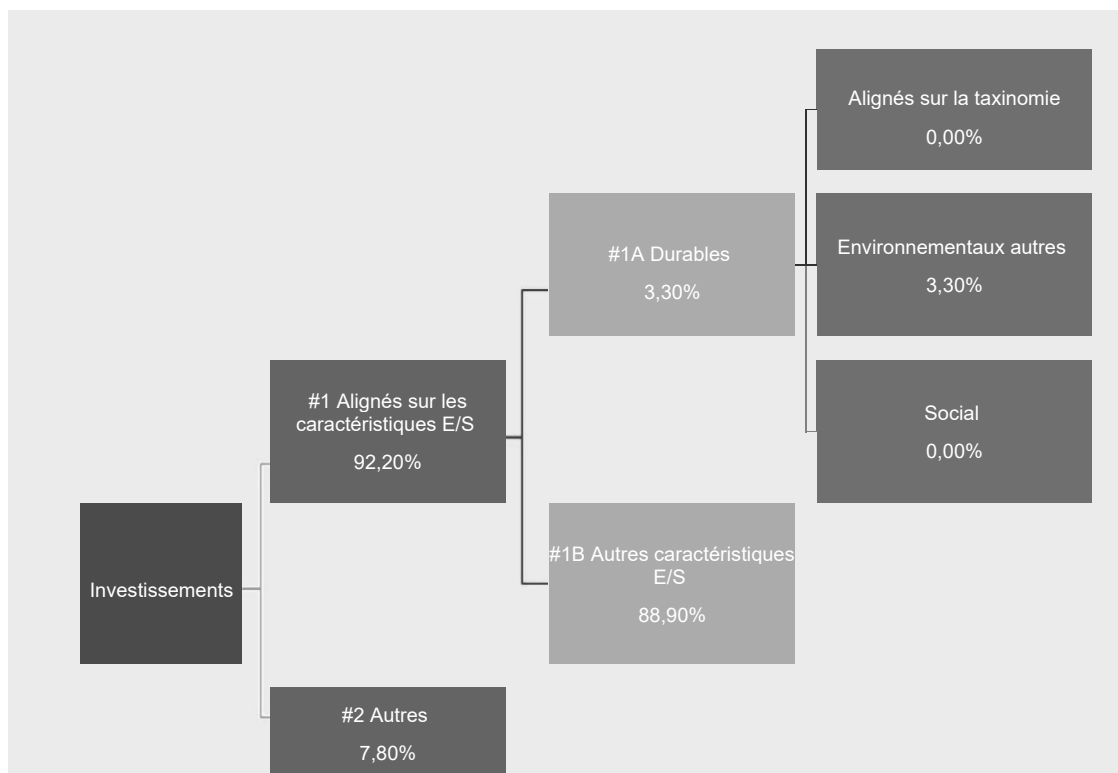
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 3,30 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

92,20 % du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (7,80 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides ou d'émetteurs pour lesquels aucune notation ESG n'était disponible.

Le Fonds a investi dans des placements durables 3,30 % du segment de son portefeuille qui était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Obligations d'État	40,47%
Finance	38,44%
Énergie	4,54%
Services de communication	3,78%
Santé	2,57%
Technologies de l'information	1,97%
Biens de consommation discrétionnaire	1,87%
Industrie	1,57%
Matériaux	1,35%
Services aux collectivités	0,93%
Biens de consommation courante	0,86%
commercial	0,40%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Obligations d'État	40,70%
Services financiers	25,41%
Banques	8,94%
Pétrole, gaz et combustibles	4,24%
Marchés financiers	2,11%
Services de télécommunications diversifiés	1,55%
Médias	1,38%
Prestataires et services de soins de santé	1,30%
Métaux et exploitations minières	0,91%
Internet et marketing direct de détail	0,84%
Assurances	0,71%
Biotechnologie	0,68%
Semi-conducteurs et équipements semi-conducteurs	0,68%
Logiciels	0,62%
REIT hypothécaire	0,60%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

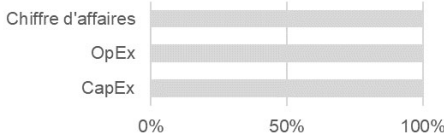
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

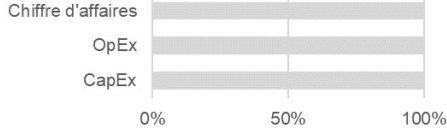
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Sans objet.

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

En accord avec sa stratégie d'investissement, à savoir l'engagement du Fonds à réaliser une proportion minimale d'« investissements durables » ayant un objectif environnemental conformément à l'article 2 paragraphe 17 du SFDR, 3,30 % du Fonds étaient constitués d'« investissements durables » ayant un objectif environnemental mais qui ne sont pas considérés comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Sans objet.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 7,80 % et comprenait des liquidités et des instruments dérivés ou d'autres émetteurs pour lesquels il n'y avait pas de garanties environnementales ou sociales minimales.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Western Asset estime que les facteurs ESG peuvent affecter la solvabilité des titres des émetteurs d'obligations et, par conséquent, la performance des portefeuilles obligataires. Ces facteurs sont entièrement compatibles avec la philosophie d'investissement à long terme de la Société, qui repose sur la valeur fondamentale. Les analystes de recherche de Western Asset étaient chargés de fournir une analyse fondamentale au niveau du secteur et de l'émetteur et d'émettre une opinion sur les ratios rendement/risque du secteur et de l'émetteur en intégrant des considérations ESG importantes. Soutenu par cette approche plus large, le Fonds a cherché à atteindre ses caractéristiques environnementales et sociales en investissant dans des émetteurs de manière à ce que l'ensemble du portefeuille respecte les notations ESG minimales, atteigne son objectif de décarbonation et d'alignement sur les ODD, et évite les émetteurs identifiés par l'application d'exclusions ISR, alloués à des secteurs et investis dans des émetteurs ciblant des secteurs spécifiques.

Pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence, le Fonds a pris les mesures suivantes :

- A. Le Fonds a cherché à maintenir une notation MSCI ESG moyenne égale ou supérieure à BBB.
- B. Le Fonds a cherché à atteindre une intensité carbone moyenne pondérée (Weighted Average Carbon Intensity, « WACI ») inférieure d'au moins 20 % à celle de l'indice de référence. Cela a permis au Fonds de s'aligner sur les PIN 3 et 15 (intensité des émissions de gaz à effet de serre).
- C. Le Fonds s'est efforcé de parvenir à un meilleur alignement que l'Indice de référence pour ce qui concerne les investissements dans des titres d'émetteurs dont les activités contribuaient à la réalisation d'au moins 1 des 8 ODD sélectionnés.
- D. Le Fonds a exclu les émetteurs qui n'ont pas atteint une série d'objectifs en matière d'ISR, tels que décrits ci-dessous :
 - a. Émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production et/ou de la distribution du tabac ou de la production d'armes nucléaires ;
 - b. Émetteurs qui tirent plus de 10 % de leur chiffre d'affaires de la production ou de la distribution d'armes à feu civiles, d'armes conventionnelles ou de charbon thermique ;
 - c. Émetteurs qui produisent des armes controversées (mines antipersonnel, armes chimiques, armes à laser aveuglantes, uranium appauvri, armes incendiaires et éclats non localisables), qui détiennent une société active dans les armes controversées ou qui sont détenues par une telle société, conformément à l'indicateur 14 (armes controversées) ;
 - d. Émetteurs « non conformes » aux principes directeurs de l'UNGC et de l'OCDE selon les résultats des recherches internes visant à déterminer les écarts par rapport aux objectifs, conformément à l'indicateur de PIN 10 (questions sociales et liées aux conditions de travail).

Dans le cadre de l'investissement minimum de 1 % dans des investissements durables (définis comme des obligations vertes, sociales, durables et liées à la durabilité), le Fonds était investi dans des investissements durables à hauteur de 3,3 %, en valeur de marché au 31 décembre 2022.

Le Fonds a promu l'environnement et/ou le développement durable en appliquant les lignes directrices susmentionnées, comme souligné ci-dessous :

- A. Le fonds a reçu la note A selon MSCI ESG.
- B. La WACI globale du Fonds représentait 63,6 % de celle de l'indice de référence.
- C. L'allocation du Fonds aux émetteurs et aux émissions alignés sur les ODD était de 26,0 % contre 17,4 % pour l'indice de référence.
- D. Au 31 décembre 2022, le Fonds avait investi 3,3 % en valeur de marché dans des investissements durables.

E. Le Fonds n'a détenu aucun émetteur ne respectant pas les lignes directrices de l'ISR.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Sans objet.

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

LEI de l'entité : 472PNIHDHJOEBNUD0P21



FRANKLIN TEMPLETON

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

☐ ☐ **OUI**

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif environnemental** : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif social** : ____%

☒ ☒ **NON**

☒ Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 3,30% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Fonds privilégiait les caractéristiques environnementales et/ou sociales suivantes :

- alignement sur au moins un objectif de développement durable des Nations Unies (ODD) par rapport à l'indice de référence du Compartiment, par voie d'investissement dans des obligations vertes, sociales, durables ou apparentées, et dans des investissements de premier ordre ;
- alignement sur les indicateurs de PAI :
 - intensité de gaz à effet de serre (incidences 3 et 15) ;
 - questions sociales et relatives au personnel (incidence 10) ;
 - armes controversées (incidence 14).

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds étaient les suivants :

- Les indicateurs PIN mentionnés dans la réponse ci-dessus. Veuillez vous référer aux valeurs affichées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » qui représentent la performance des indicateurs pendant la période de référence.
- l'allocation en obligations vertes, sociales, durables ou apparentées s'établissait à 3,30 %.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Les investissements durables du Fonds ont été réalisés dans des obligations vertes, sociales, durables et liées à la durabilité, grâce à une allocation minimale aux émetteurs alignés sur les ODD par rapport à l'indice de référence du Fonds et aux émetteurs qui ont atteint des résultats de premier ordre selon les seuils déterminés par le Gestionnaire d'investissement. Ces obligations étaient assorties d'indicateurs clés de performance liés au développement durable, ou leur produit était utilisé pour des projets incluant, mais sans s'y limiter, les éléments suivants :

- Projets verts : énergies renouvelables, efficacité énergétique, prévention et contrôle de la pollution, gestion écologiquement durable des ressources naturelles vivantes et de l'usage des sols, biodiversité, transports propres, gestion durable de l'eau et de l'assainissement, adaptation au changement climatique, économie circulaire et bâtiments écologiques ;
- Projets sociaux : logements abordables, infrastructures abordables (eau potable, assainissement), programmes d'emploi et progrès socio-économiques, notamment en matière d'éducation, de diversité, d'égalité et d'inclusion.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Le Gestionnaire de portefeuille a utilisé la recherche interne et des indicateurs PIN exclusifs pour s'assurer que les investissements durables ne portent pas préjudice à certains objectifs d'investissement durable sociaux ou environnementaux.

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé des outils exclusifs de suivi des PAI qui exploitent des données de sources diversifiées (fournisseurs externes tels que MSCI ESG, ISSS, Banque mondiale, BloombergNEF, S&P Trucost, Transition Pathway Initiative, ONG, établissements universitaires), ainsi que des recherches exclusives, contribuaient à déterminer les émetteurs qui présentaient des caractéristiques de durabilité insuffisantes ou des incidences négatives au sens des indicateurs PAI. Ces contrôles permettaient au Gestionnaire de portefeuille d'investir dans des émetteurs alignés sur les indicateurs PAI et d'éviter les émetteurs non alignés. En matière d'investissements dans les obligations vertes, sociales, durables ou apparentées, le Gestionnaire de portefeuille a appliqué cette approche pour déterminer si une obligation respectait les critères de durabilité.

Par ailleurs, les émetteurs souverains ont été soumis à des tests évaluant leur niveau en matière de libertés politiques et/ou de corruption.

Pour sélectionner les investissements durables, en particulier la part de 1 % du portefeuille visant des objectifs environnementaux éventuels, le Gestionnaire de portefeuille a appliqué des évaluations qualitatives complémentaires (fondées sur la recherche interne ou des opinions externes) aux émetteurs et aux projets, pour déterminer leur admissibilité en fonction du principe de « ne pas causer de préjudice important ».

De plus, certaines exclusions ont été mises en œuvre pour éliminer les émetteurs susceptibles d'être à l'origine de préjudices importants, tel que précisé plus loin.

-----**Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Le Gestionnaire de portefeuille a développé un outil interne de suivi des PIN qui prend en compte les PIN majeures, et qui a contribué à mesurer l'alignement du Compartiment sur les indicateurs PIN considérés comme significatifs. Cet outil a identifié les émetteurs qui étaient en retard sur leurs pairs en ce qui concerne les PIN, et a permis au Gestionnaire de portefeuille d'évaluer l'exposition du Compartiment aux PIN par rapport à l'indice de référence.

Les PAI ont constitué une jauge utile pour déterminer les cibles d'investissement : Plus précisément, la PIN 3 mesurait l'intensité des GES des entreprises et l'incidence 15 mesurait l'intensité des GES des États ; la PIN 10 identifiait la violation des principes directeurs de l'UNG et de l'OCDE, et la PIN 14 mesurait les activités liées aux armes controversées justifiant certaines exclusions par comparaison avec l'ensemble de l'univers d'investissement. Outre les composantes des PIN, l'outil d'analyse des PIN comprenait également l'évaluation des pays bénéficiaires d'investissements estimés inéligibles selon l'évaluation du Gestionnaire d'investissement et les données de tiers. En raison de la nature exhaustive des points de données incorporés, l'outil a permis d'identifier les mesures prises à l'égard des émetteurs, et notamment les engagements et les désinvestissements.

Même si le Compartiment ne s'est pas engagé à faire mieux, en moyenne, que son indice de référence en matière de PIN, l'écart de mesure entre les deux a été un indicateur utile pour évaluer la performance en matière de gestion des incidences négatives.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le Compartiment a respecté les principes directeurs en matière d'exclusion des émetteurs qui ne respectaient pas les principes de l'UNGC et de l'OCDE. L'engagement du Gestionnaire de portefeuille vis-à-vis des émetteurs s'est fondé sur les principes de l'UNGC et de l'OCDE. Les émetteurs qui ne respectaient pas les principes de l'UNGC et de l'OCDE ont été ajoutés à la liste rouge ESG du Gestionnaire de portefeuille et sont dès lors devenus inéligibles à l'investissement. Le cas échéant, le Gestionnaire de portefeuille a cherché à s'engager auprès des émetteurs problématiques, qu'ils aient ou non déjà dérogé de manière explicite aux principes directeurs sous-jacents.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

La manière dont les PIN ont été prises en compte est exposée plus en détail ci-dessus.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Intensité des GES en USD	149,90	93,20%
Intensité GES des pays en portefeuille en USD	232,10	100,00%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	92,00%
Exposition à des armes controversées	0,00%	92,00%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	1,87%	États-Unis
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	1,55%	États-Unis
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	1,54%	États-Unis
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	1,17%	États-Unis
ÉTATS-UNIS MEXICAINS	Obligations d'État	0,85%	Mexique
RÉPUBLIQUE D'INDONÉSIE	Obligations d'État	0,78%	Indonésie
ÉTATS-UNIS MEXICAINS	Obligations d'État	0,75%	Mexique
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	0,71%	États-Unis
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	0,71%	États-Unis
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	0,69%	États-Unis
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	0,61%	États-Unis
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	0,60%	États-Unis
FIELDSTONE MORTGAGE INVESTMENT CORP	Finance	0,57%	États-Unis
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	0,51%	États-Unis
ÉTATS-UNIS MEXICAINS	Obligations d'État	0,50%	Mexique

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

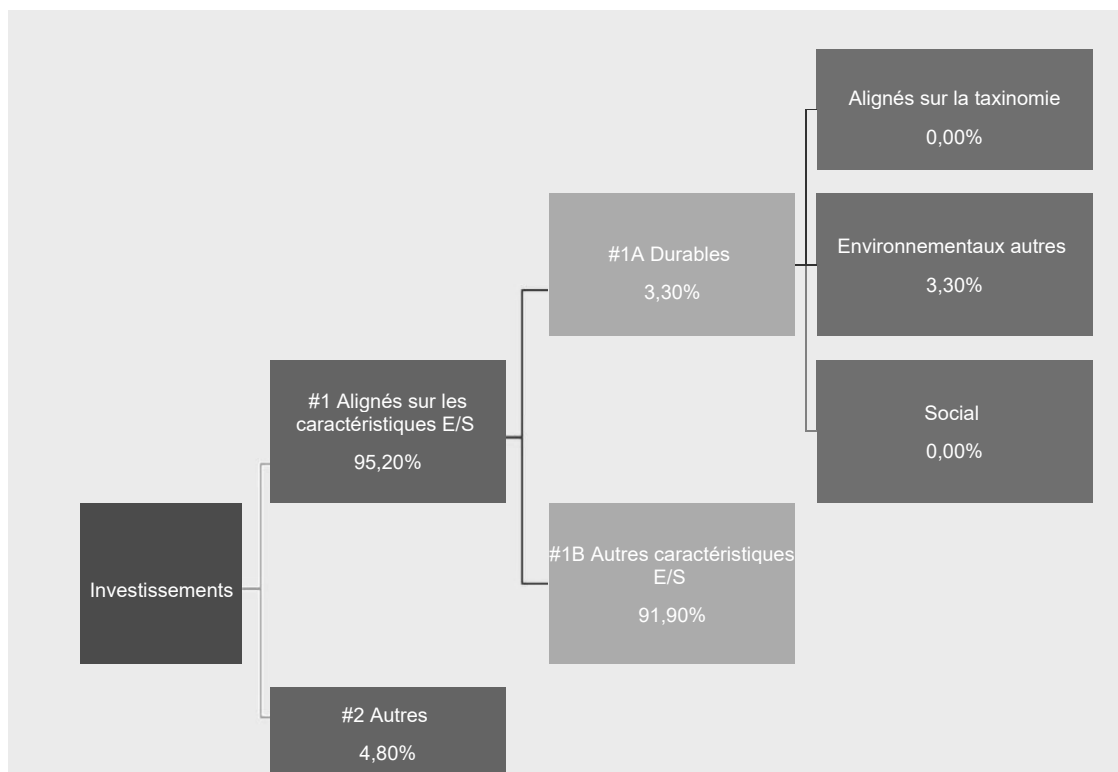
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 3,30 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

95,20 % du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (4,80 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides ou d'émetteurs dépourvus de notation ESG.

Le Fonds a investi dans des placements durables 3,30 % du segment de son portefeuille qui était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Obligations d'État	46,13%
Finance	27,14%
Services de communication	4,45%
Énergie	4,37%
Santé	3,79%
Biens de consommation discrétionnaire	3,27%
Industrie	1,79%
Technologies de l'information	1,71%
Biens de consommation courante	1,09%
Matériaux	0,73%
Services aux collectivités	0,66%
commercial	0,55%
Actifs privés	0,00%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Obligations d'État	46,33%
Services financiers	14,51%
Banques	7,90%
Pétrole, gaz et combustibles	4,24%
Marchés financiers	3,40%
Prestataires et services de soins de santé	2,08%
Médias	1,92%
Services de télécommunications diversifiés	1,61%
Hôtels, restaurants et loisirs	1,04%
Internet et marketing direct de détail	0,84%
Produits pharmaceutiques	0,83%
Automobiles	0,83%
Équivalents de trésorerie	0,70%
Compagnies aériennes	0,66%
REIT hypothécaire	0,65%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

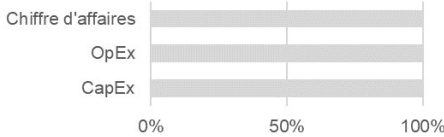
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

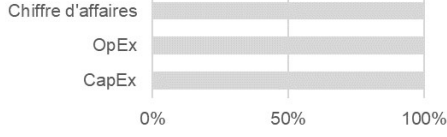
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Sans objet.

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

En accord avec sa stratégie d'investissement, à savoir l'engagement du Fonds à réaliser une proportion minimale d'« investissements durables » ayant un objectif environnemental conformément à l'article 2 paragraphe 17 du SFDR, 3,30 % du Fonds étaient constitués d'« investissements durables » ayant un objectif environnemental mais qui ne sont pas considérés comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Sans objet.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 4,80 % et comprenait des liquidités et des instruments dérivés ou des émetteurs dépourvus de notation ESG et pour lesquels il n'y avait pas de garanties environnementales ou sociales minimales.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Western Asset estime que les facteurs ESG peuvent affecter la solvabilité des titres des émetteurs d'obligations et, par conséquent, la performance des portefeuilles obligataires. Ces facteurs sont entièrement compatibles avec la philosophie d'investissement à long terme de la Société, qui repose sur la valeur fondamentale. Les analystes de recherche de Western Asset étaient chargés de fournir une analyse fondamentale au niveau du secteur et de l'émetteur et d'émettre une opinion sur les ratios rendement/risque du secteur et de l'émetteur en intégrant des considérations ESG importantes. Soutenu par cette approche plus large, le Fonds a cherché à atteindre ses caractéristiques environnementales et sociales en investissant dans des émetteurs de manière à ce que l'ensemble du portefeuille respecte les notations ESG minimales, atteigne son objectif de décarbonation et d'alignement sur les ODD, et évite les émetteurs identifiés par l'application d'exclusions ISR, alloués à des secteurs et investis dans des émetteurs ciblant des secteurs spécifiques.

Pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence, le Fonds a pris les mesures suivantes :

A. Le Fonds a cherché à maintenir une notation MSCI ESG moyenne égale ou supérieure à BBB.

B. Le Fonds a cherché à atteindre une intensité carbone moyenne pondérée (Weighted Average Carbon Intensity, « WACI ») inférieure d'au moins 20 % à celle de l'indice de référence. Cela a permis au Fonds de s'aligner sur les PIN 3 et 15 (intensité des émissions de gaz à effet de serre).

C. Le Fonds s'est efforcé de parvenir à un meilleur alignement que l'Indice de référence pour ce qui concerne les investissements dans des titres d'émetteurs dont les activités contribuent à la réalisation d'au moins 1 des 8 ODD sélectionnés.

D. Le Fonds a exclu les émetteurs qui n'ont pas atteint une série d'objectifs en matière d'ISR, tels que décrits ci-dessous :

a. Émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production et/ou de la distribution du tabac ou de la production d'armes nucléaires ;

b. Émetteurs qui tirent plus de 10 % de leur chiffre d'affaires de la production ou de la distribution d'armes à feu civiles, d'armes conventionnelles ou de charbon thermique ;

c. Émetteurs qui produisent des armes controversées (mines antipersonnel, armes chimiques, armes à laser aveuglantes, uranium appauvri, armes incendiaires et éclats non localisables), qui détiennent une société active dans les armes controversées ou qui sont détenues par une telle société, conformément à l'indicateur 14 (armes controversées) ;

d. Émetteurs « non conformes » aux principes directeurs de l'UNGC et de l'OCDE selon les résultats des recherches internes visant à déterminer les écarts par rapport aux objectifs, conformément à l'indicateur de PIN 10 (questions sociales et liées aux conditions de travail).

Dans le cadre de l'investissement minimum de 1 % dans des investissements durables (définis comme des obligations vertes, sociales, durables et liées à la durabilité), le Fonds était investi dans des investissements durables à hauteur de 3,3 %, en valeur de marché au 31 décembre 2022.

Le Fonds a promu l'environnement et/ou le développement durable en appliquant les lignes directrices susmentionnées, comme souligné ci-dessous :

A. Le fonds a reçu la note A selon MSCI ESG.

B. La WACI globale du Fonds représentait 70,0 % de celle de l'indice de référence.

C. L'allocation du Fonds aux émetteurs et aux émissions alignés sur les ODD était de 27,2 % contre 17,4 % pour l'indice de référence.

D. Au 31 décembre 2022, le Fonds avait investi 3,3 % en valeur de marché dans des investissements durables.

E. Le Fonds n'a détenu aucun émetteur ne respectant pas les lignes directrices de l'ISR.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Sans objet.

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund



FRANKLIN TEMPLETON

LEI de l'entité : 5493004ZO0T2R3JB1A61

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ ☐ **OUI**

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif environnemental** : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif social** : ____%

☒ ☒ **NON**

☒ Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 2,20% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Fonds privilégiait les caractéristiques environnementales et/ou sociales suivantes :

- alignement sur au moins un objectif de développement durable des Nations Unies (ODD) par rapport à l'indice de référence du Compartiment, par voie d'investissement dans des obligations vertes, sociales, durables ou apparentées, et dans des investissements de premier ordre ;
- alignement sur les indicateurs de PAI :
 - intensité de gaz à effet de serre (incidences 3 et 15) ;
 - questions sociales et relatives au personnel (incidence 10) ;
 - armes controversées (incidence 14).

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds étaient les suivants :

- Les indicateurs PIN mentionnés dans la réponse ci-dessus. Veuillez vous référer aux valeurs affichées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » qui représentent la performance des indicateurs pendant la période de référence.
- L'allocation en obligations vertes, sociales, durables ou apparentées s'établissait à 2,20 %.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Les investissements durables du Fonds ont été réalisés dans des obligations vertes, sociales, durables et liées à la durabilité, grâce à une allocation minimale aux émetteurs alignés sur les ODD par rapport à l'indice de référence du Fonds et aux émetteurs qui ont atteint des résultats de premier ordre selon les seuils déterminés par le Gestionnaire d'investissement. Ces obligations étaient assorties d'indicateurs clés de performance liés au développement durable, ou leur produit était utilisé pour des projets incluant, mais sans s'y limiter, les éléments suivants :

- Projets verts : énergies renouvelables, efficacité énergétique, prévention et contrôle de la pollution, gestion écologiquement durable des ressources naturelles vivantes et de l'usage des sols, biodiversité, transports propres, gestion durable de l'eau et de l'assainissement, adaptation au changement climatique, économie circulaire et bâtiments écologiques ;
- Projets sociaux : logements abordables, infrastructures abordables (eau potable, assainissement), programmes d'emploi et progrès socio-économiques, notamment en matière d'éducation, de diversité, d'égalité et d'inclusion.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Le Gestionnaire de portefeuille a utilisé la recherche interne et des indicateurs PIN exclusifs pour s'assurer que les investissements durables ne portent pas préjudice à certains objectifs d'investissement durable sociaux ou environnementaux.

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé des outils exclusifs de suivi des PAI qui exploitent des données de sources diversifiées (fournisseurs externes tels que MSCI ESG, ISSS, Banque mondiale, BloombergNEF, S&P Trucost, Transition Pathway Initiative, ONG, établissements universitaires), ainsi que des recherches exclusives, contribuaient à déterminer les émetteurs qui présentaient des caractéristiques de durabilité insuffisantes ou des incidences négatives au sens des indicateurs PAI. Ces contrôles permettaient au Gestionnaire de portefeuille d'investir dans des émetteurs alignés sur les indicateurs PAI et d'éviter les émetteurs non alignés. En matière d'investissements dans les obligations vertes, sociales, durables ou apparentées, le Gestionnaire de portefeuille a appliqué cette approche pour déterminer si une obligation respectait les critères de durabilité.

Par ailleurs, les émetteurs souverains ont été soumis à des tests évaluant leur niveau en matière de libertés politiques et/ou de corruption.

Pour sélectionner les investissements durables, en particulier la part de 1 % du portefeuille visant des objectifs environnementaux éventuels, le Gestionnaire de portefeuille a appliqué des évaluations qualitatives complémentaires (fondées sur la recherche interne ou des opinions externes) aux émetteurs et aux projets, pour déterminer leur admissibilité en fonction du principe de « ne pas causer de préjudice important ».

De plus, certaines exclusions ont été mises en œuvre pour éliminer les émetteurs susceptibles d'être à l'origine de préjudices importants, tel que précisé plus loin.

----- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Le Gestionnaire de portefeuille a développé un outil interne de suivi des PIN qui prend en compte les PIN majeures, et qui a contribué à mesurer l'alignement du Compartiment sur les indicateurs PIN considérés comme significatifs. Cet outil a identifié les émetteurs qui étaient en retard sur leurs pairs en ce qui concerne les PIN, et a permis au Gestionnaire de portefeuille d'évaluer l'exposition du Compartiment aux PIN par rapport à l'indice de référence.

Les PAI ont constitué une jauge utile pour déterminer les cibles d'investissement : Plus précisément, la PIN 3 mesurait l'intensité des GES des entreprises et l'incidence 15 mesurait l'intensité des GES des États ; la PIN 10 identifiait la violation des principes directeurs de l'UNGC et de l'OCDE, et la PIN 14 mesurait les activités liées aux armes controversées justifiant certaines exclusions par comparaison avec l'ensemble de l'univers d'investissement. Outre les composantes des PIN, l'outil d'analyse des PIN comprenait également l'évaluation des pays bénéficiaires d'investissements estimés inéligibles selon l'évaluation du Gestionnaire d'investissement et les données de tiers. En raison de la nature exhaustive des points de données incorporés, l'outil a permis d'identifier les mesures prises à l'égard des émetteurs, et notamment les engagements et les désinvestissements.

Même si le Compartiment ne s'est pas engagé à faire mieux, en moyenne, que son indice de référence en matière de PIN, l'écart de mesure entre les deux a été un indicateur utile pour évaluer la performance en matière de gestion des incidences négatives.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le Compartiment a respecté les principes directeurs en matière d'exclusion des émetteurs qui ne respectaient pas les principes de l'UNGC et de l'OCDE. L'engagement du Gestionnaire de portefeuille vis-à-vis des émetteurs s'est fondé sur les principes de l'UNGC et de l'OCDE. Les émetteurs qui ne respectaient pas les principes de l'UNGC et de l'OCDE ont été ajoutés à la liste rouge ESG du Gestionnaire de portefeuille et sont dès lors devenus inéligibles à l'investissement. Le cas échéant, le Gestionnaire de portefeuille a cherché à s'engager auprès des émetteurs problématiques, qu'ils aient ou non déjà dérogé de manière explicite aux principes directeurs sous-jacents.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

La manière dont les PIN ont été prises en compte est exposée plus en détail ci-dessus.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Intensité des GES en USD	184,30	80,40%
Intensité GES des pays en portefeuille en USD	245,00	100,00%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	83,00%
Exposition à des armes controversées	0,00%	83,00%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
ÉTATS-UNIS MEXICAINS	Obligations d'État	2,67%	Mexique
FRANKLIN TEMPLETON QUALIFIED INVESTOR FUNDS II PLC - WESTERN ASSET EUROPEAN LOAN	Finance	2,59%	Irlande
FRANKLIN TEMPLETON QUALIFIED INVESTOR FUNDS II PLC- WESTERN ASSET INDIA BOND FUND	Finance	1,91%	Irlande
RÉPUBLIQUE D'INDONÉSIE	Obligations d'État	1,64%	Indonésie
RÉPUBLIQUE D'INDONÉSIE	Obligations d'État	1,36%	Indonésie
RÉPUBLIQUE D'AFRIQUE DU SUD	Obligations d'État	1,22%	Afrique du Sud
RÉPUBLIQUE DE POLOGNE	Obligations d'État	1,08%	Pologne
T-MOBILE US INC	Services de communication	0,99%	États-Unis
RÉPUBLIQUE FÉDÉRATIVE DU BRÉSIL	Obligations d'État	0,93%	Brésil
ALLIANZ SE	Finance	0,91%	Allemagne
RANGE RESOURCES CORP	Énergie	0,90%	États-Unis
LM-WA EURO HI YIELD-LMA	Finance	0,84%	Irlande
UBS GROUP AG	Finance	0,82%	Suisse
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	0,80%	États-Unis
GRUPO MEXICO SAB DE CV	Matériaux	0,79%	Mexique

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

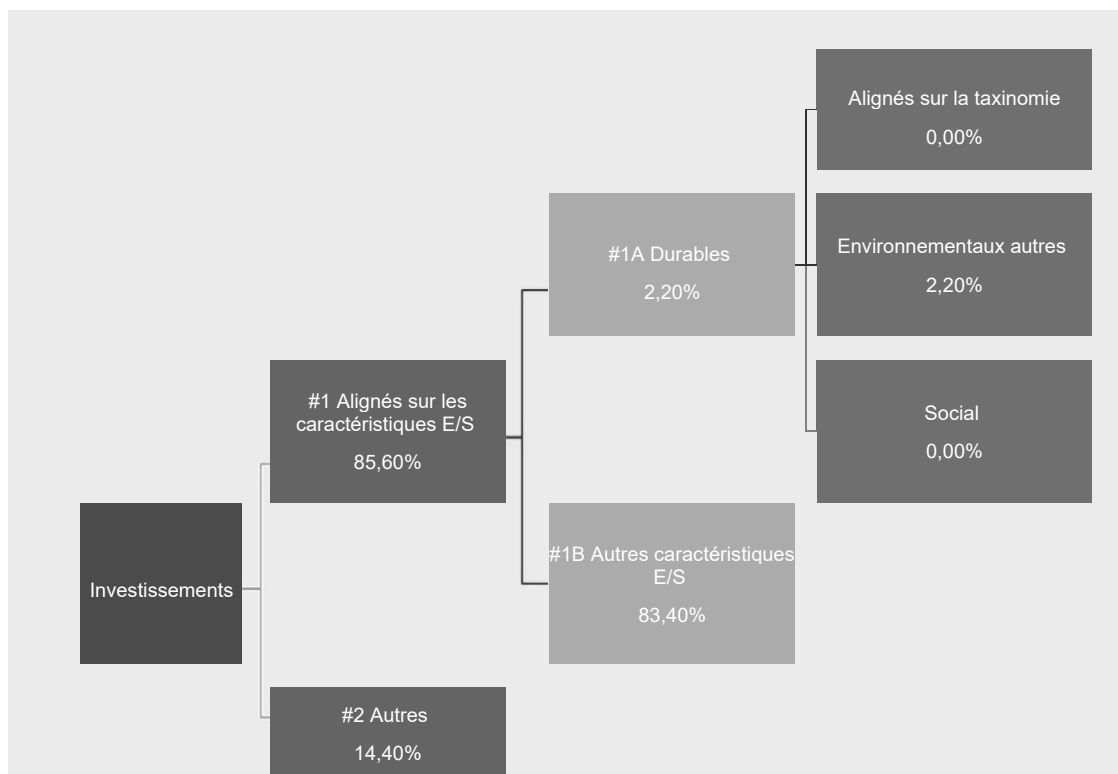
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 2,20 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

85,60 % du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (14,40 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides d'émetteurs dépourvus de notation ESG.

Le Fonds a investi dans des placements durables 2,20 % du segment de son portefeuille qui était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Finance	26,16%
Obligations d'État	25,41%
Services de communication	8,65%
Biens de consommation discrétionnaire	6,89%
Énergie	5,86%
Matériaux	4,98%
Industrie	4,90%
Santé	3,37%
Technologies de l'information	1,56%
commercial	1,39%
Biens de consommation courante	1,17%
Services aux collectivités	0,11%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Obligations d'État	25,32%
Services financiers	12,15%
Banques	8,24%
Pétrole, gaz et combustibles	4,72%
Médias	4,02%
Hôtels, restaurants et loisirs	4,01%
Marchés financiers	3,67%
Services de télécommunications diversifiés	2,59%
Compagnies aériennes	2,10%
Métaux et exploitations minières	1,88%
Produits pharmaceutiques	1,66%
Assurances	1,60%
Emballages et conditionnement	1,37%
Automobiles	1,23%
Chimie	1,20%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

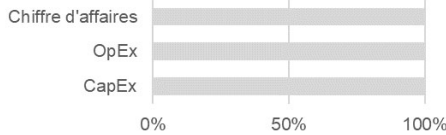
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

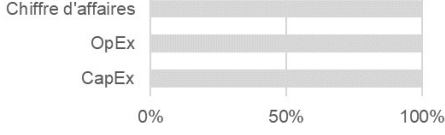
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Sans objet.

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

En accord avec sa stratégie d'investissement, à savoir l'engagement du Fonds à réaliser une proportion minimale d'« investissements durables » ayant un objectif environnemental conformément à l'article 2 paragraphe 17 du SFDR, 2,20 % du Fonds étaient constitués d'« investissements durables » ayant un objectif environnemental mais qui ne sont pas considérés comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Sans objet.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 14,40 % et comprenait des liquidités et des instruments dérivés ou d'autres émetteurs dépourvus de notation ESG et non soumis à un objectif social ou environnemental minimum.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Western Asset estime que les facteurs ESG peuvent affecter la solvabilité des titres des émetteurs d'obligations et, par conséquent, la performance des portefeuilles obligataires. Ces facteurs sont entièrement compatibles avec la philosophie d'investissement à long terme de la Société, qui repose sur la valeur fondamentale. Les analystes de recherche de Western Asset étaient chargés de fournir une analyse fondamentale au niveau du secteur et de l'émetteur et d'émettre une opinion sur les ratios rendement/risque du secteur et de l'émetteur en intégrant des considérations ESG importantes. Soutenu par cette approche plus large, le Fonds a cherché à atteindre ses caractéristiques environnementales et sociales en investissant dans des émetteurs de manière à ce que l'ensemble du portefeuille respecte les notations ESG minimales, atteigne son objectif de décarbonation et d'alignement sur les ODD, et évite les émetteurs identifiés par l'application d'exclusions ISR, alloués à des secteurs et investis dans des émetteurs ciblant des secteurs spécifiques.

Pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence, le Fonds a pris les mesures suivantes :

A. Le Fonds a cherché à maintenir une notation MSCI ESG moyenne égale ou supérieure à BBB.

B. Le Fonds a cherché à atteindre une intensité carbone moyenne pondérée (Weighted Average Carbon Intensity, « WACI ») inférieure d'au moins 20 % à celle de l'indice de référence de remplacement. Cela a permis au Fonds de s'aligner sur les PIN 3 et 15 (intensité des émissions de gaz à effet de serre).

C. Le Fonds a cherché à investir un minimum de 20 % dans des titres d'émetteurs dont les activités contribuent à la réalisation d'au moins 1 des 8 ODD sélectionnés.

D. Le Fonds a exclu les émetteurs qui n'ont pas atteint une série d'objectifs en matière d'ISR, tels que décrits ci-dessous :

a. Émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production et/ou de la distribution du tabac ou de la production d'armes nucléaires ;

b. Émetteurs qui tirent plus de 10 % de leur chiffre d'affaires de la production ou de la distribution d'armes à feu civiles, d'armes conventionnelles ou de charbon thermique ;

c. Émetteurs qui produisent des armes controversées (mines antipersonnel, armes chimiques, armes à laser aveuglantes, uranium appauvri, armes incendiaires et éclats non localisables), qui détiennent une société active dans les armes controversées ou qui sont détenues par une telle société, conformément à l'indicateur 14 (armes controversées) ;

d. Émetteurs « non conformes » aux principes directeurs de l'UNGC et de l'OCDE selon les résultats des recherches internes visant à déterminer les écarts par rapport aux objectifs, conformément à l'indicateur de PIN 10 (questions sociales et liées aux conditions de travail).

Dans le cadre de l'investissement minimum de 1 % dans des investissements durables (définis comme des obligations vertes, sociales, durables et liées à la durabilité), le Fonds était investi dans des investissements durables à hauteur de 2,2 %, en valeur de marché au 31 décembre 2022.

Le Fonds a promu l'environnement et/ou le développement durable en appliquant les lignes directrices susmentionnées, comme souligné ci-dessous :

A. Le fonds a reçu la note BBB selon MSCI ESG.

B. La WACI globale du Fonds représentait 69,7 % de celle de l'indice de référence.

C. L'allocation du Fonds aux émetteurs et aux émissions alignés sur les ODD était de 31,8 %.

D. Le Fonds n'a détenu aucun émetteur ne respectant pas les lignes directrices de l'ISR.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Sans objet.

FTGF Western Asset US High Yield Fund

LEI de l'entité : 5493005YY2WWVLYH2080



FRANKLIN TEMPLETON

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ ☐ OUI

☐ Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ____%

☒ ☒ NON

☒ Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 5,30% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Compartiment promouvait les caractéristiques environnementales et/ou sociales suivantes :

- alignement sur au moins un objectif de développement durable des Nations Unies (ODD) par rapport à l'indice de référence du Compartiment, par voie d'investissement dans des obligations vertes, sociales, durables ou apparentées, et dans des investissements de premier ordre ;
- alignement sur les indicateurs de PIN :
 - intensité de gaz à effet de serre (PIN 3 et 15) ;
 - questions sociales ou relatives au personnel (PIN 10) ;
 - armes controversées (PIN 14) ; et
 - pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (PIN 16).

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds étaient les suivants :

- Les indicateurs PIN mentionnés dans la réponse ci-dessus. Veuillez vous référer aux valeurs affichées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » qui représentent la performance des indicateurs pendant la période de référence.
- L'allocation en obligations vertes, sociales, durables ou apparentées s'établissait à 5,30 %.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Les investissements durables du Fonds ont été réalisés dans des obligations vertes, sociales, durables et liées à la durabilité, grâce à une allocation minimale aux émetteurs alignés sur les ODD par rapport à l'indice de référence du Fonds et aux émetteurs qui ont atteint des résultats de premier ordre selon les seuils déterminés par le Gestionnaire d'investissement. Ces obligations étaient assorties d'indicateurs clés de performance liés au développement durable, ou leur produit était utilisé pour des projets incluant, mais sans s'y limiter, les éléments suivants :

- Projets verts : énergies renouvelables, efficacité énergétique, prévention et contrôle de la pollution, gestion écologiquement durable des ressources naturelles vivantes et de l'usage des sols, biodiversité, transports propres, gestion durable de l'eau et de l'assainissement, adaptation au changement climatique, économie circulaire et bâtiments écologiques ;
- Projets sociaux : logements abordables, infrastructures abordables (eau potable, assainissement), programmes d'emploi et progrès socio-économiques, notamment en matière d'éducation, de diversité, d'égalité et d'inclusion.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Gestionnaire de portefeuille a utilisé la recherche interne et des indicateurs PIN exclusifs pour s'assurer que les investissements durables ne portent pas préjudice à certains objectifs d'investissement durable sociaux ou environnementaux.

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé des outils exclusifs de suivi des PAI qui exploient des données de sources diversifiées (fournisseurs externes tels que MSCI ESG, ISSS, Banque mondiale, BloombergNEF, S&P Trucost, Transition Pathway Initiative, ONG, établissements universitaires), ainsi que des recherches exclusives, contribuaient à déterminer les émetteurs qui présentaient des caractéristiques de durabilité insuffisantes ou des incidences négatives au sens des indicateurs PAI. Ces contrôles permettaient au Gestionnaire de portefeuille d'investir dans des émetteurs alignés sur les indicateurs PAI et d'éviter les émetteurs non alignés. En matière d'investissements dans les obligations vertes, sociales, durables ou apparentées, le Gestionnaire de portefeuille a appliqué cette approche pour déterminer si une obligation respectait les critères de durabilité.

Par ailleurs, les émetteurs souverains ont été soumis à des tests évaluant leur niveau en matière de libertés politiques et/ou de corruption.

Pour sélectionner les investissements durables, en particulier la part de 1 % du portefeuille visant des objectifs environnementaux éventuels, le Gestionnaire de portefeuille a appliqué des évaluations qualitatives complémentaires (fondées sur la recherche interne ou des opinions externes) aux émetteurs et aux projets, pour déterminer leur admissibilité en fonction du principe de « ne pas causer de préjudice important ».

De plus, certaines exclusions ont été mises en œuvre pour éliminer les émetteurs susceptibles d'être à l'origine de préjudices importants, tel que précisé plus loin.

-----**Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Le Gestionnaire de portefeuille a développé un outil interne de suivi des PIN qui prend en compte les PIN majeures, et qui a contribué à mesurer l'alignement du Compartiment sur les indicateurs PIN considérés comme significatifs. Cet outil a identifié les émetteurs qui étaient en retard sur leurs pairs en ce qui concerne les PIN, et a permis au Gestionnaire de portefeuille d'évaluer l'exposition du Compartiment aux PIN par rapport à l'indice de référence.

Les PAI ont constitué une jauge utile pour déterminer les cibles d'investissement : Plus précisément, la PIN 3 mesurait l'intensité des GES des entreprises et l'incidence 15 mesurait l'intensité des GES des États ; la PIN 10 identifiait la violation des principes de l'UNGC et de l'OCDE ; la PIN 14 mesurait les activités liées aux armes controversées, justifiant certaines exclusions par comparaison avec l'ensemble de l'univers d'investissement ; et la PIN 16 a été utilisée pour déterminer les pays n'étant pas considérés comme libres par la Freedom House. En raison de la nature exhaustive des points de données incorporés, l'outil a permis d'identifier les mesures prises à l'égard des émetteurs, et notamment les engagements et les désinvestissements.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Même si le Compartiment ne s'est pas engagé à faire mieux, en moyenne, que son indice de référence en matière de PIN, l'écart de mesure entre les deux a été un indicateur utile pour évaluer la performance en matière de gestion des incidences négatives.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le Compartiment a respecté les principes directeurs en matière d'exclusion des émetteurs qui ne respectaient pas les principes de l'UNGC et de l'OCDE. L'engagement du Gestionnaire de portefeuille vis-à-vis des émetteurs s'est fondé sur les principes de l'UNGC et de l'OCDE. Les émetteurs qui ne respectaient pas les principes de l'UNGC et de l'OCDE ont été ajoutés à la liste rouge ESG du Gestionnaire de portefeuille et sont dès lors devenus inéligibles à l'investissement. Le cas échéant, le Gestionnaire de portefeuille a cherché à s'engager auprès des émetteurs problématiques, qu'ils aient ou non déjà dérogé de manière explicite aux principes directeurs sous-jacents.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

La manière dont les PIN ont été prises en compte est exposée plus en détail ci-dessus.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Intensité des GES en USD	230,20	72,90%
Intensité GES des pays en portefeuille en USD	175,30	100,00%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	72,00%
Exposition à des armes controversées	0,00%	73,00%
Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales	0,00	100,00%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	Santé	0,98%	Israël
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	Matériaux	0,94%	Canada
BOHAI LEASING CO LTD	Finance	0,88%	Îles Caïmans
DISH NETWORK CORP	Services de communication	0,72%	États-Unis
DISH NETWORK CORP	Services de communication	0,71%	États-Unis
UNITED RENTALS INC	Industrie	0,70%	États-Unis
FORD MOTOR CO	Biens de consommation discrétionnaire	0,68%	États-Unis
FREEPORT-MCMORAN INC	Matériaux	0,67%	États-Unis
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	commercial	0,65%	États-Unis
ALLEN MEDIA LLC	Services de communication	0,63%	États-Unis
CHORD ENERGY CORP	Énergie	0,62%	États-Unis
VIKING HOLDINGS LTD	Biens de consommation discrétionnaire	0,61%	États-Unis
WYNN RESORTS LTD	Biens de consommation discrétionnaire	0,60%	MACAO
JUNIPER CAPITAL ADVISORS LP	Énergie	0,60%	États-Unis
FULL HOUSE RESORTS INC	Biens de consommation discrétionnaire	0,57%	États-Unis

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

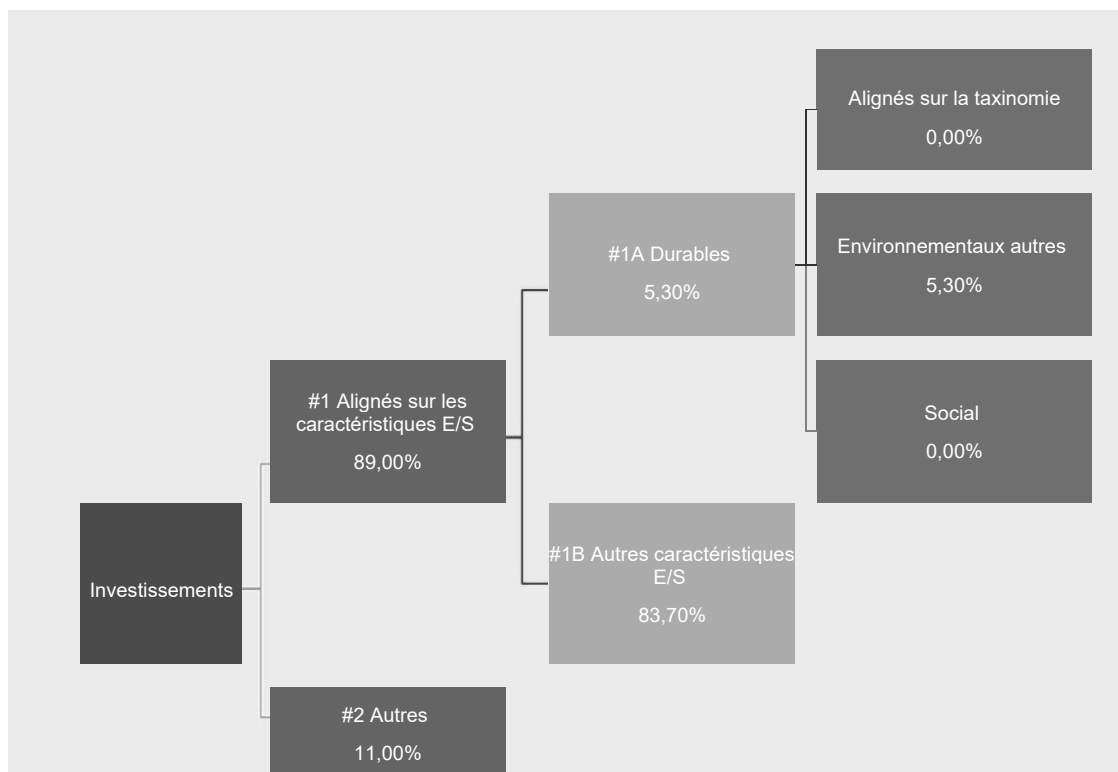
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'est établie à 5,30 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

89,00 % du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (11,00 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides ou d'émetteurs dépourvus de notation ESG.

Le Fonds a investi dans des placements durables 5,30 % du segment de son portefeuille qui était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Finance	22,86%
Biens de consommation discrétionnaire	19,98%
Industrie	12,09%
Services de communication	11,25%
Énergie	9,53%
Santé	6,08%
Matériaux	5,07%
Technologies de l'information	4,70%
commercial	3,56%
Services aux collectivités	1,73%
Biens de consommation courante	1,33%
Obligations d'État	0,18%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Services financiers	15,97%
Hôtels, restaurants et loisirs	8,79%
Pétrole, gaz et combustibles	7,95%
Médias	7,58%
Produits pharmaceutiques	3,44%
Services de consommation diversifiés	3,08%
Marchés financiers	2,91%
Fonds de placements immobiliers	2,85%
Métaux et exploitations minières	2,79%
Distribution spécialisée	2,78%
Automobiles	2,74%
Machines	2,59%
Services et approvisionnements commerciaux	2,41%
Compagnies aériennes	2,29%
Prestataires et services de soins de santé	2,26%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

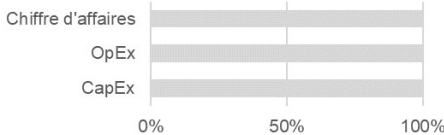
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

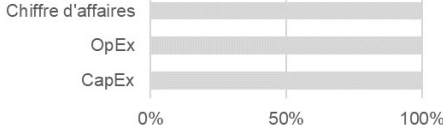
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Sans objet.

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

En accord avec sa stratégie d'investissement, à savoir l'engagement du Fonds à réaliser une proportion minimale d'« investissements durables » ayant un objectif environnemental conformément à l'article 2 paragraphe 17 du SFDR, 5,30 % du Fonds étaient constitués d'« investissements durables » ayant un objectif environnemental mais qui ne sont pas considérés comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Sans objet.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 11,00 % et comprenait des liquidités et des instruments dérivés ou d'autres émetteurs pour lesquels il n'y avait pas de garanties environnementales ou sociales minimales.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Western Asset estime que les facteurs ESG peuvent affecter la solvabilité des titres des émetteurs d'obligations et, par conséquent, la performance des portefeuilles obligataires. Ces facteurs sont entièrement compatibles avec la philosophie d'investissement à long terme de la Société, qui repose sur la valeur fondamentale. Les analystes de recherche de Western Asset étaient chargés de fournir une analyse fondamentale au niveau du secteur et de l'émetteur et d'émettre une opinion sur les ratios rendement/risque du secteur et de l'émetteur en intégrant des considérations ESG importantes. Soutenu par cette approche plus large, le Fonds a cherché à atteindre ses caractéristiques environnementales et sociales en investissant dans des émetteurs de manière à ce que l'ensemble du portefeuille respecte les notations ESG minimales, atteigne son objectif de décarbonation et d'alignement sur les ODD, et évite les émetteurs identifiés par l'application d'exclusions ISR, alloués à des secteurs et investis dans des émetteurs ciblant des secteurs spécifiques.

Pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence, le Fonds a pris les mesures suivantes :

A. Le Fonds a cherché à atteindre une intensité carbone moyenne pondérée (Weighted Average Carbon Intensity, « WACI ») inférieure d'au moins 20 % à celle de l'indice de référence. Cela a permis au Fonds de s'aligner sur les PIN 3 et 15 (intensité des émissions de gaz à effet de serre).

B. Le Fonds s'est efforcé de parvenir à un meilleur alignement que l'Indice de référence pour ce qui concerne les investissements dans des titres d'émetteurs dont les activités contribuaient à la réalisation d'au moins 1 des 8 ODD sélectionnés.

C. Le Fonds a exclu les émetteurs qui n'ont pas atteint une série d'objectifs en matière d'ISR, tels que décrits ci-dessous :

a. Émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production et/ou de la distribution du tabac ou de la production d'armes nucléaires ;

b. Émetteurs qui tirent plus de 10 % de leur chiffre d'affaires de la production ou de la distribution d'armes à feu civiles, d'armes conventionnelles ou de charbon thermique ;

c. Émetteurs qui produisent des armes controversées (mines antipersonnel, armes chimiques, armes à laser aveuglantes, uranium appauvri, armes incendiaires et éclats non localisables), qui détiennent une société active dans les armes controversées ou qui sont détenues par une telle société, conformément à l'indicateur PIN 14 (armes controversées) ;

d. Émetteurs « non conformes » aux principes directeurs de l'UNGC et de l'OCDE selon les résultats des recherches internes visant à déterminer les écarts par rapport aux objectifs, conformément à l'indicateur de PIN 10 (questions sociales et liées aux conditions de travail).

e. Entreprises ou États émetteurs non considérés comme « libres » par l'indice Freedom House, conformément à l'indicateur de PIN 16 (Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales) ;

Dans le cadre de l'investissement minimum de 1 % dans des investissements durables (définis comme des obligations vertes, sociales, durables et liées à la durabilité), le Fonds était investi dans des investissements durables à hauteur de 5,3 %, en valeur de marché au 31 décembre 2022.

Le Fonds a promu l'environnement et/ou le développement durable en appliquant les lignes directrices susmentionnées, comme souligné ci-dessous :

A. La WACI globale du Fonds représentait 82,8 % de celle de l'indice de référence.

B. L'allocation du Fonds aux émetteurs et aux émissions alignés sur les ODD était de 33,0 % contre 31,8 % pour l'indice de référence.

C. Au 31 décembre 2022, le Fonds avait investi 5,3 % en valeur de marché dans des investissements durables.

D. Le Fonds n'a pas investi dans un émetteur ne respectant pas les lignes directrices de l'ISR.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Sans objet.



Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

☐ ☐ **OUI**

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif environnemental** : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif social** : ____%

☒ ☒ **NON**

☒ Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 6,90% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Fonds privilégiait les caractéristiques environnementales et/ou sociales suivantes :

- alignement sur au moins un objectif de développement durable des Nations Unies (ODD) par rapport à l'indice de référence du Compartiment, par voie d'investissement dans des obligations vertes, sociales, durables ou apparentées, et dans des investissements de premier ordre ;
- alignement sur les indicateurs de PAI :
 - intensité de gaz à effet de serre (incidences 3 et 15) ;
 - questions sociales et relatives au personnel (incidence 10) ;
 - armes controversées (incidence 14).

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds étaient les suivants :

- Les indicateurs PIN mentionnés dans la réponse ci-dessus. Veuillez vous référer aux valeurs affichées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » qui représentent la performance des indicateurs pendant la période de référence.
- L'allocation en obligations vertes, sociales, durables ou apparentées s'établissait à 6,90 %.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Les investissements durables du Fonds ont été réalisés dans des obligations vertes, sociales, durables et liées à la durabilité, grâce à une allocation minimale aux émetteurs alignés sur les ODD par rapport à l'indice de référence du Fonds et aux émetteurs qui ont atteint des résultats de premier ordre selon les seuils déterminés par le Gestionnaire d'investissement. Ces obligations étaient assorties d'indicateurs clés de performance liés au développement durable, ou leur produit était utilisé pour des projets incluant, mais sans s'y limiter, les éléments suivants :

- Projets verts : énergies renouvelables, efficacité énergétique, prévention et contrôle de la pollution, gestion écologiquement durable des ressources naturelles vivantes et de l'usage des sols, biodiversité, transports propres, gestion durable de l'eau et de l'assainissement, adaptation au changement climatique, économie circulaire et bâtiments écologiques ;
- Projets sociaux : logements abordables, infrastructures abordables (eau potable, assainissement), programmes d'emploi et progrès socio-économiques, notamment en matière d'éducation, de diversité, d'égalité et d'inclusion.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Le Gestionnaire de portefeuille a utilisé la recherche interne et des indicateurs PIN exclusifs pour s'assurer que les investissements durables ne portent pas préjudice à certains objectifs d'investissement durable sociaux ou environnementaux.

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé des outils exclusifs de suivi des PAI qui exploient des données de sources diversifiées (fournisseurs externes tels que MSCI ESG, ISSS, Banque mondiale, BloombergNEF, S&P Trucost, Transition Pathway Initiative, ONG, établissements universitaires), ainsi que des recherches exclusives, contribuait à déterminer les émetteurs qui présentaient des caractéristiques de durabilité insuffisantes ou des incidences négatives au sens des indicateurs PAI. Ces contrôles permettaient au Gestionnaire de portefeuille d'investir dans des émetteurs alignés sur les indicateurs PAI et d'éviter les émetteurs non alignés. En matière d'investissements dans les obligations vertes, sociales, durables ou apparentées, le Gestionnaire de portefeuille a appliqué cette approche pour déterminer si une obligation respectait les critères de durabilité.

Par ailleurs, les émetteurs souverains ont été soumis à des tests évaluant leur niveau en matière de libertés politiques et/ou de corruption.

Pour sélectionner les investissements durables, en particulier la part de 1 % du portefeuille visant des objectifs environnementaux éventuels, le Gestionnaire de portefeuille a appliqué des évaluations qualitatives complémentaires (fondées sur la recherche interne ou des opinions externes) aux émetteurs et aux projets, pour déterminer leur admissibilité en fonction du principe de « ne pas causer de préjudice important ».

De plus, certaines exclusions ont été mises en œuvre pour éliminer les émetteurs susceptibles d'être à l'origine de préjudices importants, tel que précisé plus loin.

----- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Le Gestionnaire de portefeuille a développé un outil interne de suivi des PIN qui prend en compte les PIN majeures, et qui a contribué à mesurer l'alignement du Compartiment sur les indicateurs PIN considérés comme significatifs. Cet outil a identifié les émetteurs qui étaient en retard sur leurs pairs en ce qui concerne les PIN, et a permis au Gestionnaire de portefeuille d'évaluer l'exposition du Compartiment aux PIN par rapport à l'indice de référence.

Les PAI ont constitué une jauge utile pour déterminer les cibles d'investissement : Plus précisément, la PIN 3 mesurait l'intensité des GES des entreprises et l'incidence 15 mesurait l'intensité des GES des États ; la PIN 10 identifiait la violation des principes directeurs de l'UNG et de l'OCDE, et la PIN 14 mesurait les activités liées aux armes controversées justifiant certaines exclusions par comparaison avec l'ensemble de l'univers d'investissement. Outre les composantes des PIN, l'outil d'analyse des PIN comprenait également l'évaluation des pays bénéficiaires d'investissements estimés inéligibles selon l'évaluation du Gestionnaire d'investissement et les données de tiers. En raison de la nature exhaustive des points de données incorporés, l'outil a permis d'identifier les mesures prises à l'égard des émetteurs, et notamment les engagements et les désinvestissements.

Même si le Compartiment ne s'est pas engagé à faire mieux, en moyenne, que son indice de référence en matière de PIN, l'écart de mesure entre les deux a été un indicateur utile pour évaluer la performance en matière de gestion des incidences négatives.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le Compartiment a respecté les principes directeurs en matière d'exclusion des émetteurs qui ne respectaient pas les principes de l'UNGC et de l'OCDE. L'engagement du Gestionnaire de portefeuille vis-à-vis des émetteurs s'est fondé sur les principes de l'UNGC et de l'OCDE. Les émetteurs qui ne respectaient pas les principes de l'UNGC et de l'OCDE ont été ajoutés à la liste rouge ESG du Gestionnaire de portefeuille et sont dès lors devenus inéligibles à l'investissement. Le cas échéant, le Gestionnaire de portefeuille a cherché à s'engager auprès des émetteurs problématiques, qu'ils aient ou non déjà dérogé de manière explicite aux principes directeurs sous-jacents.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

La manière dont les PIN ont été prises en compte est exposée plus en détail ci-dessus.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Intensité des GES en USD	287,10	83,60%
Intensité GES des pays en portefeuille en USD	221,40	95,50%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,02%	82,00%
Exposition à des armes controversées	0,00%	83,00%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	Santé	3,52%	Israël
SAGA PLC	Finance	2,24%	Royaume-Uni
CHARTER COMMUNICATIONS INC	Services de communication	2,13%	États-Unis
FORD MOTOR CO	Biens de consommation discrétionnaire	2,09%	États-Unis
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	Industrie	1,65%	États-Unis
RÉPUBLIQUE DE TURQUIE	Obligations d'État	1,56%	Turquie
MERCADOLIBRE INC	Biens de consommation discrétionnaire	1,41%	Brésil
FORD MOTOR CO	Biens de consommation discrétionnaire	1,39%	États-Unis
BOHAI LEASING CO LTD	Finance	1,28%	Îles Caïmans
J B POINDEXTER & CO	Biens de consommation discrétionnaire	1,26%	États-Unis
LM-WA EURO HI YIELD-LMA	Finance	1,21%	Irlande
FRANKLIN TEMPLETON QUALIFIED INVESTOR FUNDS II PLC - WESTERN ASSET EUROPEAN LOAN	Finance	1,08%	Irlande
H&E EQUIPMENT SERVICES INC	Industrie	1,06%	États-Unis
VODAFONEZIGGO GROUP HOLDING BV	Finance	1,04%	Pays-Bas
DISH NETWORK CORP	Services de communication	1,00%	États-Unis

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

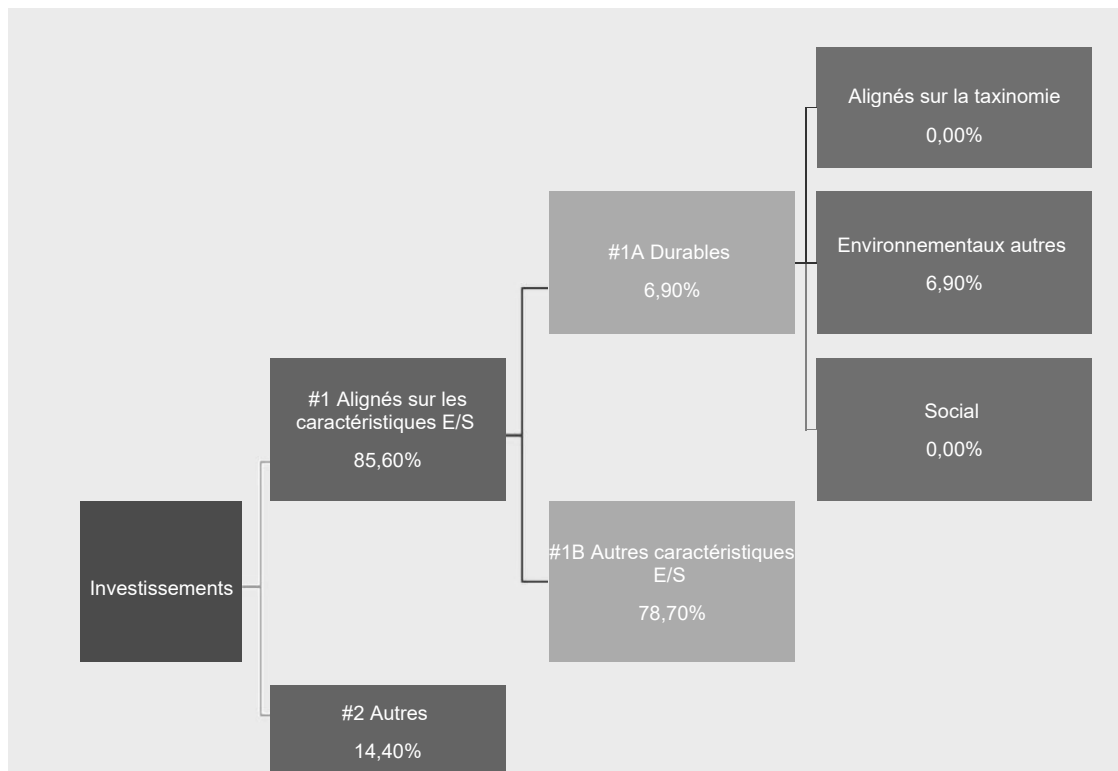
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 6,90 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

85,60 % du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (14,40 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides ou de'émetteurs pour lesquels aucune notation ESG n'était disponible.

Le Fonds a investi dans des placements durables 6,90 % du segment de son portefeuille qui était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Biens de consommation discrétionnaire	21,02%
Obligations d'État	18,95%
Finance	15,51%
Services de communication	15,35%
Industrie	6,82%
Santé	4,83%
Matériaux	3,85%
Énergie	3,68%
commercial	1,94%
Biens de consommation courante	1,62%
Services aux collectivités	1,11%
Technologies de l'information	0,55%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Obligations d'État	18,95%
Hôtels, restaurants et loisirs	10,96%
Médias	9,45%
Services financiers	7,19%
Automobiles	5,04%
Produits pharmaceutiques	4,13%
Compagnies aériennes	3,99%
Marchés financiers	3,40%
Banques	3,27%
Services de télécommunications diversifiés	2,84%
Emballages et conditionnement	2,79%
Pétrole, gaz et combustibles	2,66%
Services de consommation diversifiés	2,11%
Services de télécommunications sans fil	2,06%
Sociétés de négoce et distributeurs	1,77%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

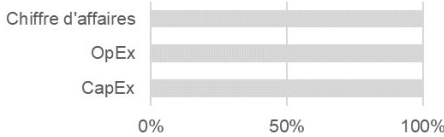
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

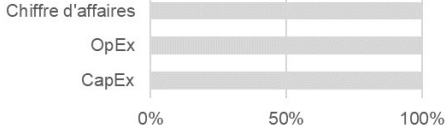
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Sans objet.

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

En accord avec sa stratégie d'investissement, à savoir l'engagement du Fonds à réaliser une proportion minimale d'« investissements durables » ayant un objectif environnemental conformément à l'article 2 paragraphe 17 du SFDR, 6,90 % du Fonds étaient constitués d'« investissements durables » ayant un objectif environnemental mais qui ne sont pas considérés comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Sans objet.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 14,40 % et comprenait des liquidités et des instruments dérivés ou des émetteurs pour lesquels il n'y avait pas de garanties environnementales ou sociales minimales.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Western Asset estime que les facteurs ESG peuvent affecter la solvabilité des titres des émetteurs d'obligations et, par conséquent, la performance des portefeuilles obligataires. Ces facteurs sont entièrement compatibles avec la philosophie d'investissement à long terme de la Société, qui repose sur la valeur fondamentale. Les analystes de recherche de Western Asset étaient chargés de fournir une analyse fondamentale au niveau du secteur et de l'émetteur et d'émettre une opinion sur les ratios rendement/risque du secteur et de l'émetteur en intégrant des considérations ESG importantes. Soutenu par cette approche plus large, le Fonds a cherché à atteindre ses caractéristiques environnementales et sociales en investissant dans des émetteurs de manière à ce que l'ensemble du portefeuille respecte les notations ESG minimales, atteigne son objectif de décarbonation et d'alignement sur les ODD des Nations Unies, et évite les émetteurs identifiés par l'application d'exclusions ISR, alloués à des secteurs et investis dans des émetteurs ciblant des secteurs spécifiques.

Pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence, le Fonds a pris les mesures suivantes :

A. Le Fonds a cherché à atteindre une intensité carbone moyenne pondérée (Weighted Average Carbon Intensity, « WACI ») inférieure d'au moins 20 % à celle de l'indice de référence. Cela a permis au Fonds de s'aligner sur les PIN 3 et 15 (intensité des émissions de gaz à effet de serre).

B. Le Fonds s'est efforcé de parvenir à un meilleur alignement que l'Indice de référence pour ce qui concerne les investissements dans des titres d'émetteurs dont les activités contribuaient à la réalisation d'au moins 1 des 8 ODD sélectionnés.

C. Le Fonds a exclu les émetteurs qui n'ont pas atteint une série d'objectifs en matière d'ISR, tels que décrits ci-dessous :

a. Émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production et/ou de la distribution du tabac ou de la production d'armes nucléaires ;

b. Émetteurs qui tirent plus de 10 % de leur chiffre d'affaires de la production ou de la distribution d'armes à feu civiles, d'armes conventionnelles ou de charbon thermique ;

c. Émetteurs qui produisent des armes controversées (mines antipersonnel, armes chimiques, armes à laser aveuglantes, uranium appauvri, armes incendiaires et éclats non localisables), qui détiennent une société active dans les armes controversées ou qui sont détenues par une telle société, conformément à l'indicateur 14 (armes controversées) ;

d. Émetteurs « non conformes » aux principes directeurs de l'UNGC et de l'OCDE selon les résultats des recherches internes visant à déterminer les écarts par rapport aux objectifs, conformément à l'indicateur de PIN 10 (questions sociales et liées aux conditions de travail).

Dans le cadre de l'investissement minimum de 1 % dans des investissements durables (définis comme des obligations vertes, sociales, durables et liées à la durabilité), le Fonds était investi dans des investissements durables à hauteur de 6,9 %, en valeur de marché au 31 décembre 2022.

Le Fonds a promu l'environnement et/ou le développement durable en appliquant les lignes directrices susmentionnées, comme souligné ci-dessous :

A. La WACI globale du Fonds représentait 82,8 % de celle de l'indice de référence.

B. L'allocation du Fonds aux émetteurs et aux émissions alignés sur les ODD était de 31,9 % contre 30,5 % pour l'indice de référence.

C. Au 31 décembre 2022, le Fonds avait investi 6,9 % en valeur de marché dans des investissements durables.

D. Le Fonds détenait une position dans un seul émetteur qui s'est avéré ne pas respecter les lignes directrices ISR, à la suite d'une transition du statut de fonds relevant de l'Article 6 à celui de l'Article 8. Dès que cela a été découvert, l'exposition à cet émetteur a été liquidée.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Sans objet.

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund



**FRANKLIN
TEMPLETON**

LEI de l'entité : 5493000382HJNRHILX42

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ ☐ **OUI**

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif environnemental** : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif social** : ____%

☒ ☒ **NON**

☒ Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 12,30% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Fonds privilégiait les caractéristiques environnementales et/ou sociales suivantes :

- alignement sur au moins un objectif de développement durable des Nations Unies (ODD) par rapport à l'indice de référence du Compartiment, par voie d'investissement dans des obligations vertes, sociales, durables ou apparentées, et dans des investissements de premier ordre ;
- alignement sur les indicateurs de PAI :
 - intensité de gaz à effet de serre (incidences 3 et 15) ;
 - questions sociales ou relatives au personnel (incidence 10) ;
 - armes controversées (incidence 14) ; et
 - pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (indicateur n° 16).

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds étaient les suivants :

- Les indicateurs PIN mentionnés dans la réponse ci-dessus. Veuillez vous référer aux valeurs affichées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » qui représentent la performance des indicateurs pendant la période de référence.
- L'allocation en obligations vertes, sociales, durables ou apparentées s'établissait à 12,30 %.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Les investissements durables du Fonds ont été réalisés dans des obligations vertes, sociales, durables et liées à la durabilité, grâce à une allocation minimale aux émetteurs alignés sur les ODD par rapport à l'indice de référence du Fonds et aux émetteurs qui ont atteint des résultats de premier ordre. Les produits de ces obligations ont été utilisés pour financer des projets spécifiques ou dotés d'indicateurs liés à la durabilité, notamment :

- Projets verts : énergies renouvelables, efficacité énergétique, prévention et contrôle de la pollution, gestion écologiquement durable des ressources naturelles vivantes et de l'usage des sols, biodiversité, transports propres, gestion durable de l'eau et de l'assainissement, adaptation au changement climatique, économie circulaire et bâtiments écologiques ;
- Projets sociaux : logements abordables, infrastructures abordables (eau potable, assainissement), programmes d'emploi et progrès socio-économiques, notamment en matière d'éducation, de diversité, d'égalité et d'inclusion.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Le Gestionnaire de portefeuille a utilisé la recherche interne et des indicateurs PIN exclusifs pour s'assurer que les investissements durables ne portent pas préjudice à certains objectifs d'investissement durable sociaux ou environnementaux.

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé des outils exclusifs de suivi des PAI qui exploitent des données de sources diversifiées (fournisseurs externes tels que MSCI ESG, ISSS, Banque mondiale, BloombergNEF, S&P Trucost, Transition Pathway Initiative, ONG, établissements universitaires), ainsi que des recherches exclusives, contribuait à déterminer les émetteurs qui présentaient des caractéristiques de durabilité insuffisantes ou des incidences négatives au sens des indicateurs PAI. Ces contrôles permettaient au Gestionnaire de portefeuille d'investir dans des émetteurs alignés sur les indicateurs PAI et d'éviter les émetteurs non alignés. En matière d'investissements dans les obligations vertes, sociales, durables ou apparentées, le Gestionnaire de portefeuille a appliqué cette approche pour déterminer si une obligation respectait les critères de durabilité.

Par ailleurs, les émetteurs souverains ont été soumis à des tests évaluant leur niveau en matière de libertés politiques et/ou de corruption.

Pour sélectionner les investissements durables, en particulier la part de 1 % du portefeuille visant des objectifs environnementaux éventuels, le Gestionnaire de portefeuille a appliqué des évaluations qualitatives complémentaires (fondées sur la recherche interne ou des opinions externes) aux émetteurs et aux projets, pour déterminer leur admissibilité en fonction du principe de « ne pas causer de préjudice important ».

De plus, certaines exclusions ont été mises en œuvre pour éliminer les émetteurs susceptibles d'être à l'origine de préjudices importants, tel que précisé plus loin.

----- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Le Gestionnaire de portefeuille a développé un outil interne de suivi des PIN qui prend en compte les PIN majeures, et qui a contribué à mesurer l'alignement du Compartiment sur les indicateurs PIN considérés comme significatifs. Cet outil a identifié les émetteurs qui étaient en retard sur leurs pairs en ce qui concerne les PIN, et a permis au Gestionnaire de portefeuille d'évaluer l'exposition du Compartiment aux PIN par rapport à l'indice de référence.

Les PAI ont constitué une jauge utile pour déterminer les cibles d'investissement : Plus précisément, la PIN 3 mesurait l'intensité des GES des entreprises et l'incidence 15 mesurait l'intensité des GES des États ; la PIN 10 identifiait la violation des principes de l'UNGC et de l'OCDE ; la PIN 14 mesurait les activités liées aux armes controversées, justifiant certaines exclusions par comparaison avec l'ensemble de l'univers d'investissement ; et la PIN 16 a été utilisée pour déterminer les pays n'étant pas considérés comme libres par la Freedom House. En raison de la nature exhaustive des points de données incorporés, l'outil a permis d'identifier les mesures prises à l'égard des émetteurs, et notamment les engagements et les désinvestissements.

Même si le Compartiment ne s'est pas engagé à faire mieux, en moyenne, que son indice de référence en matière de PIN, l'écart de mesure entre les deux a été un indicateur utile pour évaluer la performance en matière de gestion des incidences négatives.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le Compartiment a respecté les principes directeurs en matière d'exclusion des émetteurs qui ne respectaient pas les principes de l'UNGC et de l'OCDE. L'engagement du Gestionnaire de portefeuille vis-à-vis des émetteurs s'est fondé sur les principes de l'UNGC et de l'OCDE. Les émetteurs qui ne respectaient pas les principes de l'UNGC et de l'OCDE ont été ajoutés à la liste rouge ESG du Gestionnaire de portefeuille et sont dès lors devenus inéligibles à l'investissement. Le cas échéant, le Gestionnaire de portefeuille a cherché à s'engager auprès des émetteurs problématiques, qu'ils aient ou non déjà dérogé de manière explicite aux principes directeurs sous-jacents.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

La manière dont les PIN ont été prises en compte est exposée plus en détail ci-dessus.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Intensité des GES en USD	63,20	94,60%
Intensité GES des pays en portefeuille en USD	247,50	100,00%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	95,00%
Exposition à des armes controversées	0,00%	95,00%
Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales	0,00	100,00%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	3,34%	États-Unis
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	1,77%	États-Unis
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU	Obligations d'État	1,76%	Allemagne
INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK	Obligations d'État	1,73%	Supranational
MERCK & CO INC	Santé	1,60%	États-Unis
ROCHE HOLDING AG	Santé	1,56%	États-Unis
CHARLES SCHWAB CORP	Finance	1,54%	États-Unis
CITIGROUP INC	Finance	1,52%	États-Unis
EXXON MOBIL CORP	Énergie	1,50%	États-Unis
ECOLAB INC	Matériaux	1,49%	États-Unis
GROUPE CRÉDIT AGRICOLE	Finance	1,48%	France
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	1,45%	États-Unis
FORENINGEN NYKREDIT	Finance	1,37%	Danemark
NIKE INC	Biens de consommation discrétionnaire	1,33%	États-Unis
NATWEST GROUP PLC	Finance	1,16%	Royaume-Uni

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

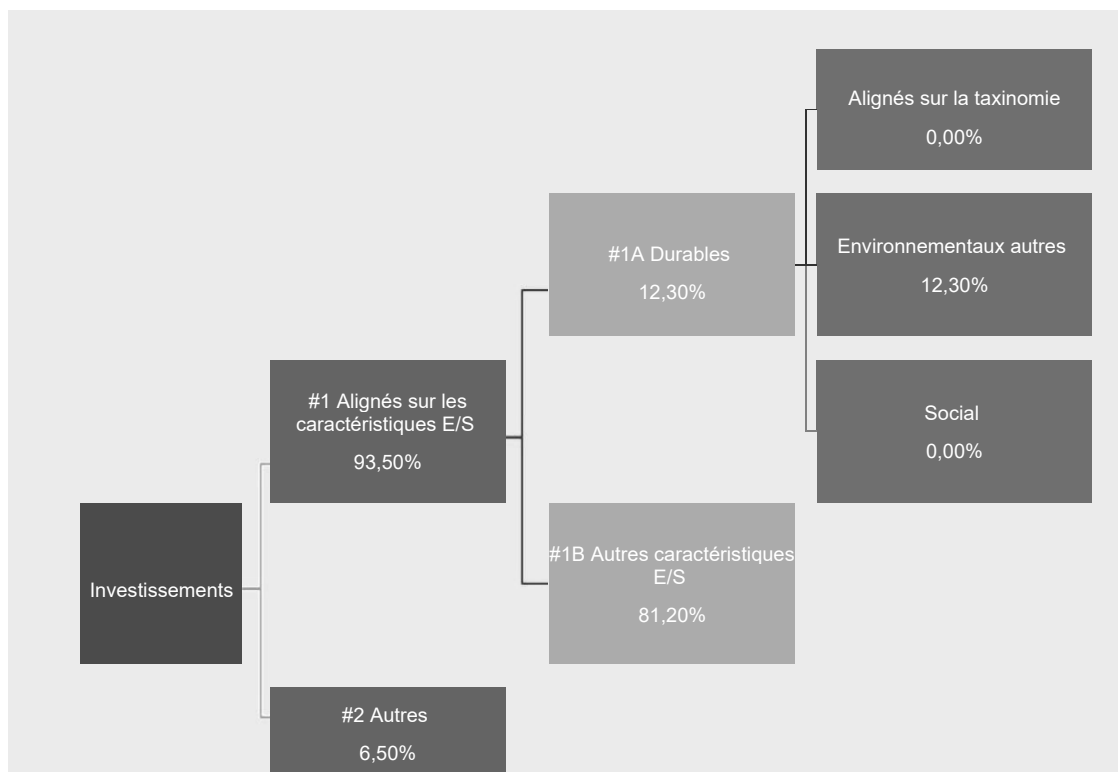
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 12,30 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

93,50 % du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (6,50 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides ou d'émetteurs dépourvus de notation ESG.

Le Fonds a investi dans des placements durables 12,30 % du segment de son portefeuille qui était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Finance	39,40%
Obligations d'État	15,60%
Santé	8,72%
Industrie	6,45%
Biens de consommation courante	5,02%
Technologies de l'information	4,59%
Biens de consommation discrétionnaire	4,54%
commercial	3,56%
Énergie	3,41%
Services de communication	2,22%
Services aux collectivités	2,10%
Matériaux	1,65%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Banques	19,36%
Obligations d'État	14,63%
Services financiers	10,68%
Produits pharmaceutiques	6,46%
Marchés financiers	5,76%
Pétrole, gaz et combustibles	3,20%
Gestion et promotion immobilières	2,22%
Boissons	2,08%
Services financiers aux particuliers	1,99%
Services publics d'électricité	1,77%
Équivalents de trésorerie	1,65%
Chimie	1,65%
Conglomérats industriels	1,61%
Textiles, confection et produits de luxe	1,46%
Semi-conducteurs et équipements semi-conducteurs	1,37%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

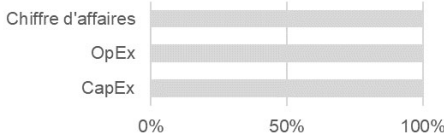
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

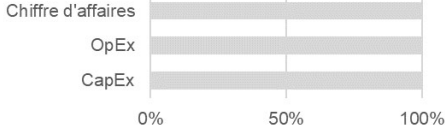
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Sans objet.

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

En accord avec sa stratégie d'investissement, à savoir l'engagement du Fonds à réaliser une proportion minimale d'« investissements durables » ayant un objectif environnemental conformément à l'article 2 paragraphe 17 du SFDR, 12,00 % du Fonds étaient constitués d'« investissements durables » ayant un objectif environnemental mais qui ne sont pas considérés comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Sans objet.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 6,50 % et comprenait des liquidités et des instruments dérivés pour lesquels il n'y avait pas de garanties environnementales ou sociales minimales. Ce chiffre incluait également les émetteurs dépourvus de notation ESG.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Western Asset estime que les facteurs ESG peuvent affecter la solvabilité des titres des émetteurs d'obligations et, par conséquent, la performance des portefeuilles obligataires. Ces facteurs sont entièrement compatibles avec la philosophie d'investissement à long terme de la Société, qui repose sur la valeur fondamentale. Les analystes de recherche de Western Asset étaient chargés de fournir une analyse fondamentale au niveau du secteur et de l'émetteur et d'émettre une opinion sur les ratios rendement/risque du secteur et de l'émetteur en intégrant des considérations ESG importantes. Soutenu par cette approche plus large, le Fonds a cherché à atteindre ses caractéristiques environnementales et sociales en investissant dans des émetteurs de manière à ce que l'ensemble du portefeuille respecte les notations ESG minimales, atteigne son objectif de décarbonation et d'alignement sur les ODD, et évite les émetteurs identifiés par l'application d'exclusions ISR, alloués à des secteurs et investis dans des émetteurs ciblant des secteurs spécifiques.

Pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence :

A. Le Fonds a cherché à maintenir une notation MSCI ESG moyenne égale ou supérieure à BBB.

B. Le Fonds a cherché à atteindre une intensité carbone moyenne pondérée (Weighted Average Carbon Intensity, « WACI ») inférieure d'au moins 20 % à celle de l'indice de référence de remplacement. Cela a permis au Fonds de s'aligner sur les PIN 3 et 15 (intensité des émissions de gaz à effet de serre).

C. Le Fonds a cherché à investir un minimum de 20 % dans des titres d'émetteurs dont les activités contribuent à la réalisation d'au moins 1 des 8 ODD sélectionnés.

D. Le Fonds a exclu les émetteurs qui n'ont pas atteint une série d'objectifs en matière d'ISR, tels que décrits ci-dessous :

a. Émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production et/ou de la distribution du tabac ou de la production d'armes nucléaires ;

b. Émetteurs qui tirent plus de 10 % de leur chiffre d'affaires de la production ou de la distribution d'armes à feu civiles, d'armes conventionnelles ou de charbon thermique ;

c. Émetteurs qui produisent des armes controversées (mines antipersonnel, armes chimiques, armes à laser aveuglantes, uranium appauvri, armes incendiaires et éclats non localisables), qui détiennent une société active dans les armes controversées ou qui sont détenues par une telle société, conformément à l'indicateur 14 (armes controversées) ;

d. Émetteurs « non conformes » aux principes directeurs de l'UNGC et de l'OCDE selon les résultats des recherches internes visant à déterminer les écarts par rapport aux objectifs, conformément à l'indicateur de PIN 10 (questions sociales et liées aux conditions de travail).

e. Entreprises ou États émetteurs non considérés comme « libres » par l'indice Freedom House, conformément à l'indicateur de PIN 16 (Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales) ;

Dans le cadre de l'investissement minimum de 1 % dans des investissements durables (définis comme des obligations vertes, sociales, durables et liées à la durabilité), le Fonds était investi dans des investissements durables à hauteur de 12,3 %, en valeur de marché au 31 décembre 2022.

Le Fonds a promu l'environnement et/ou le développement durable en appliquant les lignes directrices susmentionnées, comme souligné ci-dessous :

A. Le fonds a reçu la note AA selon MSCI ESG.

B. La WACI globale du Fonds représentait 47,1 % de celle de l'indice de référence.

- C. L'allocation du Fonds aux émetteurs et aux émissions alignés sur les ODD était de 61,5 %.
- D. Au 31 décembre 2022, le Fonds avait investi 12,3 % en VM.
- E. Le Fonds n'a détenu aucun émetteur ne respectant pas les lignes directrices de l'ISR.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Sans objet.

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund



FRANKLIN TEMPLETON

LEI de l'entité : 54930030VHR7UP4BBZ30

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ ☐ **OUI**

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif environnemental** : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif social** : ____%

☒ ☒ **NON**

☒ Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 1,60% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Fonds privilégiait les caractéristiques environnementales et/ou sociales suivantes :

- alignement sur au moins un objectif de développement durable des Nations Unies (ODD) par rapport à l'indice de référence du Compartiment, par voie d'investissement dans des obligations vertes, sociales, durables ou apparentées, et dans des investissements de premier ordre ;
- alignement sur les indicateurs de PAI :
 - intensité de gaz à effet de serre (incidences 3 et 15) ;
 - questions sociales et relatives au personnel (incidence 10) ;
 - armes controversées (incidence 14).

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds étaient les suivants :

- Les indicateurs PIN mentionnés dans la réponse ci-dessus. Veuillez vous référer aux valeurs affichées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » qui représentent la performance des indicateurs pendant la période de référence.
- L'allocation en obligations vertes, sociales, durables ou apparentées s'établissait à 1,60 %.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

L'objectif du fonds en matière d'investissement durable consistait à réduire les émissions de GES tels que mesurées par leurs intensité de carbone moyenne pondérée. Les investissements durables du Fonds ont été réalisés dans des obligations vertes, sociales, durables et liées à la durabilité, grâce à une allocation minimale aux émetteurs alignés sur les ODD par rapport à l'indice de référence du Fonds et aux émetteurs qui ont atteint des résultats de premier ordre selon les seuils déterminés par le Gestionnaire d'investissement. Ces obligations étaient assorties d'indicateurs clés de performance liés au développement durable, ou leur produit était utilisé pour des projets incluant, mais sans s'y limiter, les éléments suivants :

- Projets verts : énergies renouvelables, efficacité énergétique, prévention et contrôle de la pollution, gestion écologiquement durable des ressources naturelles vivantes et de l'usage des sols, biodiversité, transports propres, gestion durable de l'eau et de l'assainissement, adaptation au changement climatique, économie circulaire et bâtiments écologiques ;
- Projets sociaux : logements abordables, infrastructures abordables (eau potable, assainissement), programmes d'emploi et progrès socio-économiques, notamment dans les domaines de l'éducation, de la diversité, de l'égalité et de l'inclusion, pour n'en citer que quelques-uns.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Gestionnaire de portefeuille a utilisé la recherche interne et des indicateurs PIN exclusifs pour s'assurer que les investissements durables ne portent pas préjudice à certains objectifs d'investissement durable sociaux ou environnementaux.

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé des outils exclusifs de suivi des PAI qui exploitent des données de sources diversifiées (fournisseurs externes tels que MSCI ESG, ISSS, Banque mondiale, BloombergNEF, S&P Trucost, Transition Pathway Initiative, ONG, établissements universitaires), ainsi que des recherches exclusives, contribuait à déterminer les émetteurs qui présentaient des caractéristiques de durabilité insuffisantes ou des incidences négatives au sens des indicateurs PAI. Ces contrôles permettaient au Gestionnaire de portefeuille d'investir dans des émetteurs alignés sur les indicateurs PAI et d'éviter les émetteurs non alignés. En matière d'investissements dans les obligations vertes, sociales, durables ou apparentées, le Gestionnaire de portefeuille a appliqué cette approche pour déterminer si une obligation respectait les critères de durabilité.

Par ailleurs, les émetteurs souverains ont été soumis à des tests évaluant leur niveau en matière de libertés politiques et/ou de corruption.

Pour sélectionner les investissements durables, en particulier la part de 1 % du portefeuille visant des objectifs environnementaux éventuels, le Gestionnaire de portefeuille a appliqué des évaluations qualitatives complémentaires (fondées sur la recherche interne ou des opinions externes) aux émetteurs et aux projets, pour déterminer leur admissibilité en fonction du principe de « ne pas causer de préjudice important ».

De plus, certaines exclusions ont été mises en œuvre pour éliminer les émetteurs susceptibles d'être à l'origine de préjudices importants, tel que précisé plus loin.

-----**Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Le Gestionnaire de portefeuille a développé un outil interne de suivi des PIN qui prend en compte les PIN majeures, et qui a contribué à mesurer l'alignement du Compartiment sur les indicateurs PIN considérés comme significatifs. Cet outil a identifié les émetteurs qui étaient en retard sur leurs pairs en ce qui concerne les PIN, et a permis au Gestionnaire de portefeuille d'évaluer l'exposition du Compartiment aux PIN par rapport à l'indice de référence.

Les PAI ont constitué une jauge utile pour déterminer les cibles d'investissement : Plus précisément, la PIN 3 mesurait l'intensité des GES des entreprises et l'incidence 15 mesurait l'intensité des GES des États ; la PIN 10 identifiait la violation des principes directeurs de l'UNG et de l'OCDE, et la PIN 14 mesurait les activités liées aux armes controversées justifiant certaines exclusions par comparaison avec l'ensemble de l'univers d'investissement. Outre les composantes des PIN, l'outil d'analyse des PIN comprenait également l'évaluation des pays bénéficiaires d'investissements estimés inéligibles selon l'évaluation du Gestionnaire d'investissement et les données de tiers. En raison de la nature exhaustive des points de données incorporés, l'outil a permis d'identifier les mesures prises à l'égard des émetteurs, et notamment les engagements et les désinvestissements.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Même si le Compartiment ne s'est pas engagé à faire mieux, en moyenne, que son indice de référence en matière de PIN, l'écart de mesure entre les deux a été un indicateur utile pour évaluer la performance en matière de gestion des incidences négatives.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le Compartiment a respecté les principes directeurs en matière d'exclusion des émetteurs qui ne respectaient pas les principes de l'UNGC et de l'OCDE. L'engagement du Gestionnaire de portefeuille vis-à-vis des émetteurs s'est fondé sur les principes de l'UNGC et de l'OCDE. Les émetteurs qui ne respectaient pas les principes de l'UNGC et de l'OCDE ont été ajoutés à la liste rouge ESG du Gestionnaire de portefeuille et sont dès lors devenus inéligibles à l'investissement. Le cas échéant, le Gestionnaire de portefeuille a cherché à s'engager auprès des émetteurs problématiques, qu'ils aient ou non déjà dérogé de manière explicite aux principes directeurs sous-jacents.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

La manière dont les PIN ont été prises en compte est exposée plus en détail ci-dessus.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Intensité des GES en USD	67,50	88,80%
Intensité GES des pays en portefeuille en USD	231,40	100,00%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	87,00%
Exposition à des armes controversées	0,00%	87,00%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	9,18%	États-Unis
JAPON	Obligations d'État	3,26%	Japon
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN AND NORTHERN IRELAND	Obligations d'État	2,94%	Royaume-Uni
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	2,56%	États-Unis
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	2,39%	États-Unis
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	2,21%	États-Unis
ÉTATS-UNIS MEXICAINS	Obligations d'État	2,20%	Mexique
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	1,76%	États-Unis
JAPON	Obligations d'État	1,72%	Japon
RÉPUBLIQUE D'AFRIQUE DU SUD	Obligations d'État	1,66%	Afrique du Sud
JAPON	Obligations d'État	1,38%	Japon
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	1,30%	États-Unis
ITALIE, RÉPUBLIQUE D'	Obligations d'État	1,26%	Italie
OBLIGATION D'ÉTAT AUSTRALIENNE	Obligations d'État	1,23%	Australie
ROYAUME D'ESPAGNE	Obligations d'État	1,15%	Espagne

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

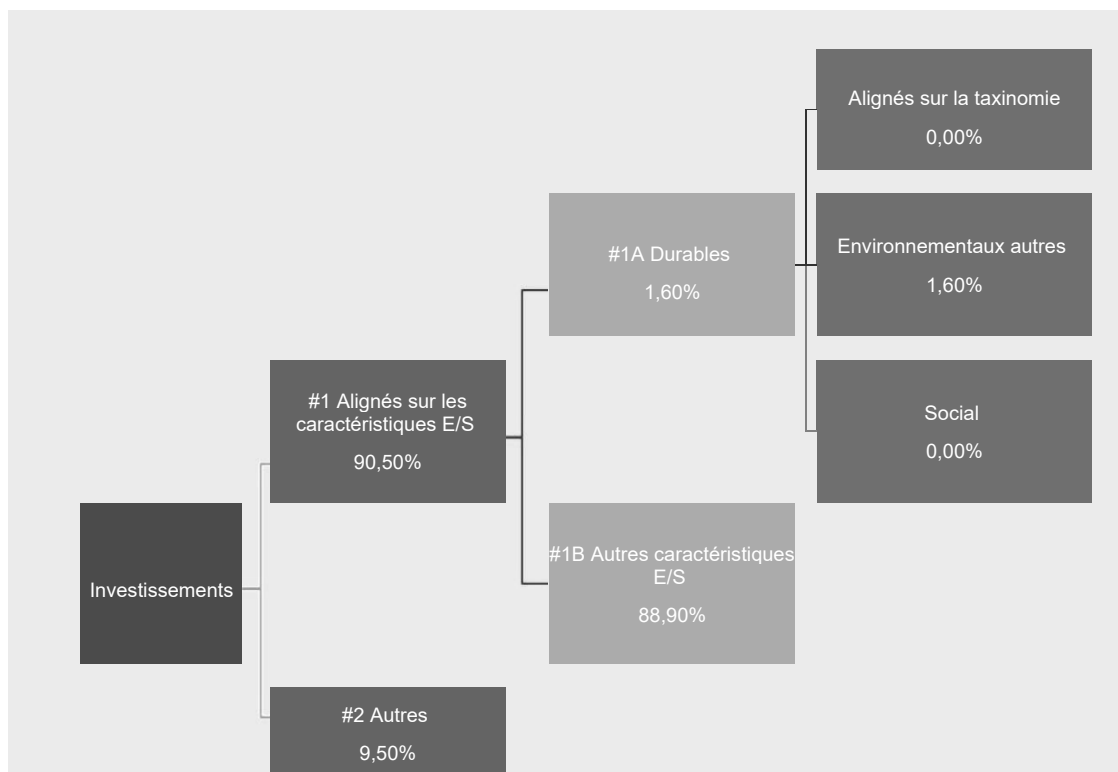
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 1,60 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

90,45 % du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (9,55 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides d'émetteurs dépourvus de notation ESG.

Le Fonds a investi dans des placements durables 1,60 % du segment de son portefeuille qui était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Obligations d'État	63,15%
Finance	20,94%
Services de communication	3,43%
Santé	3,02%
Biens de consommation discrétionnaire	2,15%
Énergie	1,21%
Industrie	0,96%
Matériaux	0,84%
commercial	0,54%
Biens de consommation courante	0,29%
Technologies de l'information	0,19%
Services aux collectivités	0,03%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Obligations d'État	63,33%
Banques	8,95%
Services financiers	8,06%
Marchés financiers	2,57%
Prestataires et services de soins de santé	1,94%
Médias	1,60%
Équivalents de trésorerie	1,47%
Automobiles	1,38%
Pétrole, gaz et combustibles	1,21%
Assurances	1,15%
Services de télécommunications diversifiés	0,73%
Divertissement	0,69%
Métaux et exploitations minières	0,56%
Produits pharmaceutiques	0,53%
Biotechnologie	0,51%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

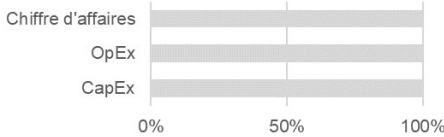
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

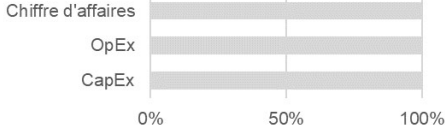
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Sans objet.

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

En accord avec sa stratégie d'investissement, à savoir l'engagement du Fonds à réaliser une proportion minimale d'« investissements durables » ayant un objectif environnemental conformément à l'article 2 paragraphe 17 du SFDR, 1,60 % du Fonds étaient constitués d'« investissements durables » ayant un objectif environnemental mais qui ne sont pas considérés comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Sans objet.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 9,55 % et comprenait les liquidités et des instruments dérivés ou des émetteurs dépourvus de notation ESG et pour lesquels il n'y avait pas de garanties environnementales ou sociales minimales.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Western Asset estime que les facteurs ESG peuvent affecter la solvabilité des titres des émetteurs d'obligations et, par conséquent, la performance des portefeuilles obligataires. Ces facteurs sont entièrement compatibles avec la philosophie d'investissement à long terme de la Société, qui repose sur la valeur fondamentale. Les analystes de recherche de Western Asset étaient chargés de fournir une analyse fondamentale au niveau du secteur et de l'émetteur et d'émettre une opinion sur les ratios rendement/risque du secteur et de l'émetteur en intégrant des considérations ESG importantes. Soutenu par cette approche plus large, le Fonds a cherché à atteindre ses caractéristiques environnementales et sociales en investissant dans des émetteurs de manière à ce que l'ensemble du portefeuille respecte les notations ESG minimales, atteigne son objectif de décarbonation et d'alignement sur les ODD, et évite les émetteurs identifiés par l'application d'exclusions ISR, alloués à des secteurs et investis dans des émetteurs ciblant des secteurs spécifiques.

Pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence, le Fonds a pris les mesures suivantes :

A. Le Fonds a cherché à maintenir une notation MSCI ESG moyenne égale ou supérieure à BBB.

B. Le Fonds a cherché à atteindre une intensité carbone moyenne pondérée (Weighted Average Carbon Intensity, « WACI ») inférieure d'au moins 20 % à celle de l'indice de référence. Cela a permis au Fonds de s'aligner sur les PIN 3 et 15 (intensité des émissions de gaz à effet de serre).

C. Le Fonds s'est efforcé de parvenir à un meilleur alignement que l'Indice de référence pour ce qui concerne les investissements dans des titres d'émetteurs dont les activités contribuent à la réalisation d'au moins 1 des 8 ODD sélectionnés.

D. Le Fonds a exclu les émetteurs qui n'atteignaient pas une série d'objectifs en matière d'ISR, tels que décrits ci-dessous :

a. Émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production et/ou de la distribution du tabac ou de la production d'armes nucléaires ;

b. Émetteurs qui tirent plus de 10 % de leur chiffre d'affaires de la production ou de la distribution d'armes à feu civiles, d'armes conventionnelles ou de charbon thermique ;

c. Émetteurs qui produisent des armes controversées (mines antipersonnel, armes chimiques, armes à laser aveuglantes, uranium appauvri, armes incendiaires et éclats non localisables), qui détiennent une société active dans les armes controversées ou qui sont détenues par une telle société, conformément à l'indicateur 14 (armes controversées) ;

d. Émetteurs « non conformes » aux principes directeurs de l'UNGC et de l'OCDE selon les résultats des recherches internes visant à déterminer les écarts par rapport aux objectifs, conformément à l'indicateur de PIN 10 (questions sociales et liées aux conditions de travail).

Dans le cadre de l'investissement minimum de 1 % dans des investissements durables (définis comme des obligations vertes, sociales, durables et liées à la durabilité), le Fonds était investi dans des investissements durables à hauteur de 1,6 %, en valeur de marché au 31 décembre 2022.

Le Fonds a promu l'environnement et/ou le développement durable en appliquant les lignes directrices susmentionnées, comme souligné ci-dessous :

A. Le fonds a reçu la note A selon MSCI ESG.

B. La WACI globale du Fonds représentait 79,5 % de celle de l'indice de référence.

C. L'allocation du Fonds aux émetteurs et aux émissions alignés sur les ODD était de 21,1 % contre 14,6 % pour l'indice de référence.

D. Au 31 décembre 2022, le Fonds avait investi 1,6 % en VM.

E. Le Fonds n'a détenu aucun émetteur ne respectant pas les lignes directrices de l'ISR.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Sans objet.

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund



FRANKLIN TEMPLETON

LEI de l'entité : 549300XEBUFPR86JA985

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ ☐ **OUI**

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif environnemental** : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif social** : ____%

☒ ☒ **NON**

☒ Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 8,80% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Fonds privilégiait les caractéristiques environnementales et/ou sociales suivantes :

- alignement sur au moins un objectif de développement durable des Nations Unies (ODD) par rapport à l'indice de référence du Compartiment, par voie d'investissement dans des obligations vertes, sociales, durables ou apparentées, et dans des investissements de premier ordre ;
- alignement sur les indicateurs de PAI :
 - intensité de gaz à effet de serre (incidences 3 et 15) ;
 - questions sociales et relatives au personnel (incidence 10) ;
 - armes controversées (incidence 14).

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds étaient les suivants :

- Les indicateurs PIN mentionnés dans la réponse ci-dessus. Veuillez vous référer aux valeurs affichées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » qui représentent la performance des indicateurs pendant la période de référence.
- L'allocation en obligations vertes, sociales, durables ou apparentées s'établissait à 8,80 %.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Les investissements durables du Fonds ont été réalisés dans des obligations vertes, sociales, durables et liées à la durabilité, grâce à une allocation minimale aux émetteurs alignés sur les ODD par rapport à l'indice de référence du Fonds et aux émetteurs qui ont atteint des résultats de premier ordre selon les seuils déterminés par le Gestionnaire d'investissement. Ces obligations étaient assorties d'indicateurs clés de performance liés au développement durable, ou leur produit était utilisé pour des projets incluant, mais sans s'y limiter, les éléments suivants :

- Projets verts : énergies renouvelables, efficacité énergétique, prévention et contrôle de la pollution, gestion écologiquement durable des ressources naturelles vivantes et de l'usage des sols, biodiversité, transports propres, gestion durable de l'eau et de l'assainissement, adaptation au changement climatique, économie circulaire et bâtiments écologiques ;
- Projets sociaux : logements abordables, infrastructures abordables (eau potable, assainissement), programmes d'emploi et progrès socio-économiques, notamment en matière d'éducation, de diversité, d'égalité et d'inclusion.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Le Gestionnaire de portefeuille a utilisé la recherche interne et des indicateurs PIN exclusifs pour s'assurer que les investissements durables ne portent pas préjudice à certains objectifs d'investissement durable sociaux ou environnementaux.

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé des outils exclusifs de suivi des PAI qui exploitent des données de sources diversifiées (fournisseurs externes tels que MSCI ESG, ISSS, Banque mondiale, BloombergNEF, S&P Trucost, Transition Pathway Initiative, ONG, établissements universitaires), ainsi que des recherches exclusives, contribuaient à déterminer les émetteurs qui présentaient des caractéristiques de durabilité insuffisantes ou des incidences négatives au sens des indicateurs PAI. Ces contrôles permettaient au Gestionnaire de portefeuille d'investir dans des émetteurs alignés sur les indicateurs PAI et d'éviter les émetteurs non alignés. En matière d'investissements dans les obligations vertes, sociales, durables ou apparentées, le Gestionnaire de portefeuille a appliqué cette approche pour déterminer si une obligation respectait les critères de durabilité.

Par ailleurs, les émetteurs souverains ont été soumis à des tests évaluant leur niveau en matière de libertés politiques et/ou de corruption.

Pour sélectionner les investissements durables, en particulier la part de 1 % du portefeuille visant des objectifs environnementaux éventuels, le Gestionnaire de portefeuille a appliqué des évaluations qualitatives complémentaires (fondées sur la recherche interne ou des opinions externes) aux émetteurs et aux projets, pour déterminer leur admissibilité en fonction du principe de « ne pas causer de préjudice important ».

De plus, certaines exclusions ont été mises en œuvre pour éliminer les émetteurs susceptibles d'être à l'origine de préjudices importants, tel que précisé plus loin.

----- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Le Gestionnaire de portefeuille a développé un outil interne de suivi des PIN qui prend en compte les PIN majeures, et qui a contribué à mesurer l'alignement du Compartiment sur les indicateurs PIN considérés comme significatifs. Cet outil a identifié les émetteurs qui étaient en retard sur leurs pairs en ce qui concerne les PIN, et a permis au Gestionnaire de portefeuille d'évaluer l'exposition du Compartiment aux PIN par rapport à l'indice de référence.

Les PAI ont constitué une jauge utile pour déterminer les cibles d'investissement : Plus précisément, la PIN 3 mesurait l'intensité des GES des entreprises et l'incidence 15 mesurait l'intensité des GES des États ; la PIN 10 identifiait la violation des principes directeurs de l'UNG et de l'OCDE, et la PIN 14 mesurait les activités liées aux armes controversées justifiant certaines exclusions par comparaison avec l'ensemble de l'univers d'investissement. Outre les composantes des PIN, l'outil d'analyse des PIN comprenait également l'évaluation des pays bénéficiaires d'investissements estimés inéligibles selon l'évaluation du Gestionnaire d'investissement et les données de tiers. En raison de la nature exhaustive des points de données incorporés, l'outil a permis d'identifier les mesures prises à l'égard des émetteurs, et notamment les engagements et les désinvestissements.

Même si le Compartiment ne s'est pas engagé à faire mieux, en moyenne, que son indice de référence en matière de PIN, l'écart de mesure entre les deux a été un indicateur utile pour évaluer la performance en matière de gestion des incidences négatives.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le Compartiment a respecté les principes directeurs en matière d'exclusion des émetteurs qui ne respectaient pas les principes de l'UNGC et de l'OCDE. L'engagement du Gestionnaire de portefeuille vis-à-vis des émetteurs s'est fondé sur les principes de l'UNGC et de l'OCDE. Les émetteurs qui ne respectaient pas les principes de l'UNGC et de l'OCDE ont été ajoutés à la liste rouge ESG du Gestionnaire de portefeuille et sont dès lors devenus inéligibles à l'investissement. Le cas échéant, le Gestionnaire de portefeuille a cherché à s'engager auprès des émetteurs problématiques, qu'ils aient ou non déjà dérogé de manière explicite aux principes directeurs sous-jacents.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

La manière dont les PIN ont été prises en compte est exposée plus en détail ci-dessus.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Intensité des GES en USD	67,60	95,50%
Intensité GES des pays en portefeuille en USD	159,20	100,00%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	95,00%
Exposition à des armes controversées	0,00%	95,00%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
UNITED KINGDOM OF GREAT BRITAIN AND NORTHERN IRELAND	Obligations d'État	2,01%	Royaume-Uni
BANQUE EUROPÉENNE D'INVESTISSEMENT	Obligations d'État	1,85%	Supranational
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU	Obligations d'État	1,77%	Allemagne
BANQUE EUROPÉENNE D'INVESTISSEMENT	Obligations d'État	1,32%	Supranational
WELLS FARGO & CO	Finance	1,27%	États-Unis
UBS GROUP AG	Finance	1,21%	Suisse
BANCO SANTANDER SA	Finance	1,12%	Espagne
BRITISH LAND COMPANY PLC	commercial	1,05%	Royaume-Uni
CITIGROUP INC	Finance	1,04%	États-Unis
LEEDS BUILDING SOCIETY	Finance	1,03%	Royaume-Uni
E.ON SE	Industrie	0,95%	Allemagne
LLOYDS BANKING GROUP PLC	Finance	0,93%	Royaume-Uni
DERWENT LONDON PLC	commercial	0,90%	Royaume-Uni
COOPERATIEVE RABOBANK UA	Finance	0,87%	Pays-Bas
VERIZON COMMUNICATIONS INC	Services de communication	0,83%	États-Unis



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

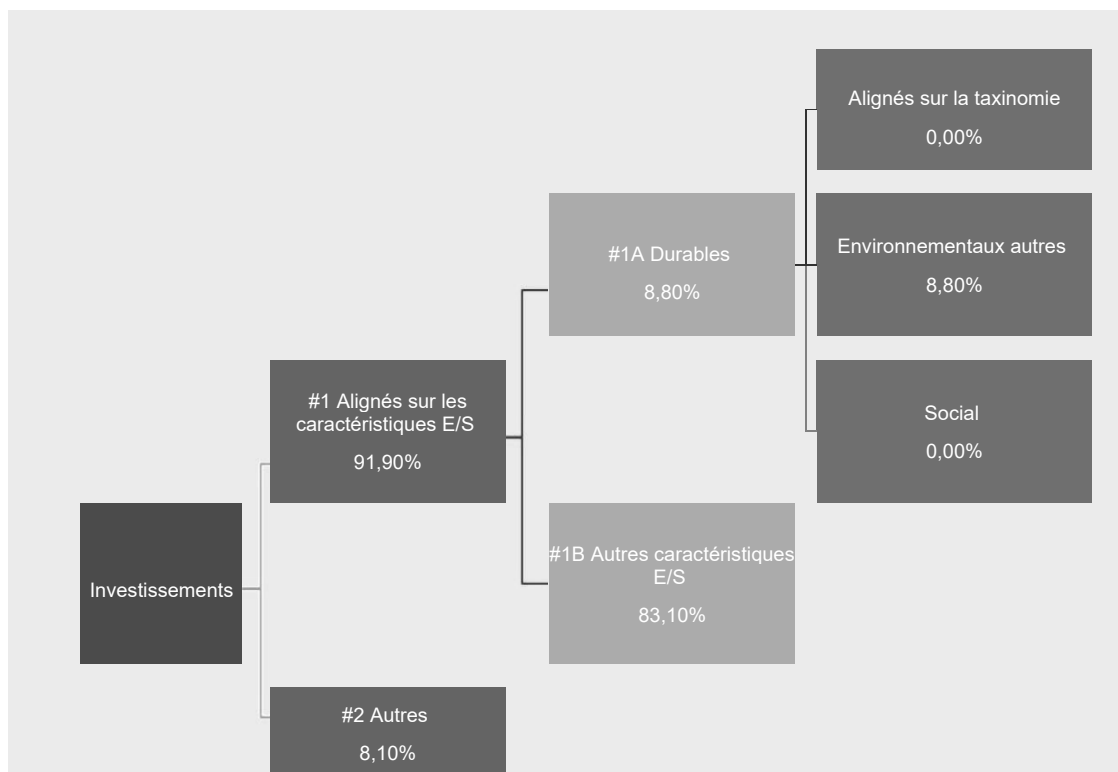
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 8,80 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

91,90 % du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (8,10 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides.

Le Fonds a investi dans des placements durables 8,80 % du segment de son portefeuille qui était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Finance	46,01%
commercial	11,39%
Obligations d'État	9,37%
Services aux collectivités	7,52%
Services de communication	6,90%
Industrie	4,64%
Biens de consommation discrétionnaire	3,96%
Biens de consommation courante	2,71%
Santé	2,17%
Énergie	1,86%
Matériaux	0,33%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Banques	28,02%
Obligations d'État	9,61%
Gestion et promotion immobilières	6,71%
Services financiers	6,35%
Marchés financiers	6,05%
Fonds de placements immobiliers	4,68%
Services publics d'électricité	4,64%
Services de télécommunications diversifiés	4,60%
Assurances	3,22%
Automobiles	2,07%
Services publics d'eau	1,48%
Équivalents de trésorerie	1,48%
Hôtels, restaurants et loisirs	1,41%
REIT hypothécaire	1,40%
Médias	1,35%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

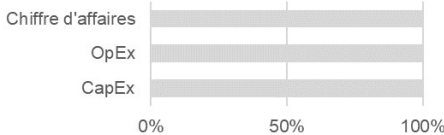
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

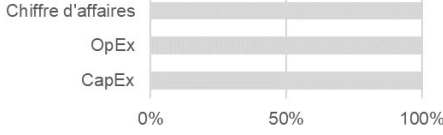
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Sans objet.

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

En accord avec sa stratégie d'investissement, à savoir l'engagement du Fonds à réaliser une proportion minimale d'« investissements durables » ayant un objectif environnemental conformément à l'article 2 paragraphe 17 du SFDR, 8,80 % du Fonds étaient constitués d'« investissements durables » ayant un objectif environnemental mais qui ne sont pas considérés comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Sans objet.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 8,10 % et comprenait des liquidités et des instruments dérivés ou des émetteurs dépourvus de notation ESG et non soumis à un objectif social ou environnemental minimum.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Western Asset estime que les facteurs ESG peuvent affecter la solvabilité des titres des émetteurs d'obligations et, par conséquent, la performance des portefeuilles obligataires. Ces facteurs sont entièrement compatibles avec la philosophie d'investissement à long terme de la Société, qui repose sur la valeur fondamentale. Les analystes de recherche de Western Asset étaient chargés de fournir une analyse fondamentale au niveau du secteur et de l'émetteur et d'émettre une opinion sur les ratios rendement/risque du secteur et de l'émetteur en intégrant des considérations ESG importantes. Soutenu par cette approche plus large, le Fonds a cherché à atteindre ses caractéristiques environnementales et sociales en investissant dans des émetteurs de manière à ce que l'ensemble du portefeuille respecte les notations ESG minimales, atteigne son objectif de décarbonation et d'alignement sur les ODD, et évite les émetteurs identifiés par l'application d'exclusions ISR, alloués à des secteurs et investis dans des émetteurs ciblant des secteurs spécifiques.

Pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence :

- A. Le Fonds a cherché à maintenir une notation MSCI ESG moyenne égale ou supérieure à BBB.
- B. Le Fonds a cherché à atteindre une intensité carbone moyenne pondérée (Weighted Average Carbon Intensity, « WACI ») inférieure d'au moins 20 % à celle de l'indice de référence.
- C. Le Fonds s'est efforcé de parvenir à un meilleur alignement que l'Indice de référence pour ce qui concerne les investissements dans des titres d'émetteurs dont les activités contribuent à la réalisation d'au moins 1 des 8 ODD sélectionnés.
- D. Le Fonds exclut les émetteurs qui n'atteignent pas une série d'objectifs en matière d'ISR, tels que décrits ci-dessous :
 - Émetteurs qui ne respectaient pas les bonnes pratiques de gouvernance telles que déterminées par Western Asset.
 - Émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production et/ou de la distribution de tabac ou de la production d'armes nucléaires ;
 - B. Émetteurs qui tirent plus de 10 % de leur chiffre d'affaires de leur implication dans la production ou la distribution d'armes à feu civiles, d'armes conventionnelles ou de charbon thermique ;

Dans le cadre de l'investissement minimum de 1 % dans des investissements durables (définis comme des obligations vertes, sociales, durables et liées à la durabilité), le Fonds était investi dans des investissements durables à hauteur de 8,8 %, en valeur de marché au 31 décembre 2022.

Le Fonds a promu l'environnement et/ou le développement durable en appliquant les lignes directrices susmentionnées, comme souligné ci-dessous :

- A. Le fonds a reçu la note AA selon MSCI ESG.
- B. La WACI globale du Fonds représentait 73,2 % de celle de l'indice de référence.
- C. L'allocation du Fonds aux émetteurs et aux émissions alignés sur les ODD était de 63,7 % contre 50,9 % pour l'indice de référence.
- D. Au 31 décembre 2022, le Fonds avait investi 8,8 % en valeur de marché dans des investissements durables.
- E. Le Fonds n'a détenu aucun émetteur ne respectant pas les lignes directrices de l'ISR.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Sans objet.

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund

LEI de l'entité : 54930043RW07LP60LD92



FRANKLIN TEMPLETON

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ ☐ OUI

☐ Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ____%

☒ ☒ NON

☒ Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 6,90% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Fonds privilégiait les caractéristiques environnementales et/ou sociales suivantes :

- alignement sur au moins un objectif de développement durable des Nations Unies (ODD) par rapport à l'indice de référence du Compartiment, par voie d'investissement dans des obligations vertes, sociales, durables ou apparentées, et dans des investissements de premier ordre ;
- alignement sur les indicateurs de PAI :
 - intensité de gaz à effet de serre (incidences 3 et 15) ;
 - questions sociales ou relatives au personnel (incidence 10) ;
 - armes controversées (incidence 14) ; et
 - pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (indicateur n° 16).

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds étaient les suivants :

- Les indicateurs PIN mentionnés dans la réponse ci-dessus. Veuillez vous référer aux valeurs affichées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » qui représentent la performance des indicateurs pendant la période de référence.
- L'allocation en obligations vertes, sociales, durables ou apparentées s'établissait à 6,90 %.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Les investissements durables du Fonds ont été réalisés dans des obligations vertes, sociales, durables et liées à la durabilité, grâce à une allocation minimale aux émetteurs alignés sur les ODD par rapport à l'indice de référence du Fonds et aux émetteurs qui ont atteint des résultats de premier ordre selon les seuils déterminés par le Gestionnaire d'investissement. Ces obligations étaient assorties d'indicateurs clés de performance liés au développement durable, ou leur produit était utilisé pour des projets incluant, mais sans s'y limiter, les éléments suivants :

- Projets verts : énergies renouvelables, efficacité énergétique, prévention et contrôle de la pollution, gestion écologiquement durable des ressources naturelles vivantes et de l'usage des sols, biodiversité, transports propres, gestion durable de l'eau et de l'assainissement, adaptation au changement climatique, économie circulaire et bâtiments écologiques ;
- Projets sociaux : logements abordables, infrastructures abordables (eau potable, assainissement), programmes d'emploi et progrès socio-économiques, notamment en matière d'éducation, de diversité, d'égalité et d'inclusion.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Gestionnaire de portefeuille a utilisé la recherche interne et des indicateurs PIN exclusifs pour s'assurer que les investissements durables ne portent pas préjudice à certains objectifs d'investissement durable sociaux ou environnementaux.

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé des outils exclusifs de suivi des PAI qui exploitent des données de sources diversifiées (fournisseurs externes tels que MSCI ESG, ISSS, Banque mondiale, BloombergNEF, S&P Trucost, Transition Pathway Initiative, ONG, établissements universitaires), ainsi que des recherches exclusives, contribuaient à déterminer les émetteurs qui présentaient des caractéristiques de durabilité insuffisantes ou des incidences négatives au sens des indicateurs PAI. Ces contrôles permettaient au Gestionnaire de portefeuille d'investir dans des émetteurs alignés sur les indicateurs PAI et d'éviter les émetteurs non alignés. En matière d'investissements dans les obligations vertes, sociales, durables ou apparentées, le Gestionnaire de portefeuille a appliqué cette approche pour déterminer si une obligation respectait les critères de durabilité.

Par ailleurs, les émetteurs souverains ont été soumis à des tests évaluant leur niveau en matière de libertés politiques et/ou de corruption.

Pour sélectionner les investissements durables, en particulier la part de 1 % du portefeuille visant des objectifs environnementaux éventuels, le Gestionnaire de portefeuille a appliqué des évaluations qualitatives complémentaires (fondées sur la recherche interne ou des opinions externes) aux émetteurs et aux projets, pour déterminer leur admissibilité en fonction du principe de « ne pas causer de préjudice important ».

De plus, certaines exclusions ont été mises en œuvre pour éliminer les émetteurs susceptibles d'être à l'origine de préjudices importants, tel que précisé plus loin.

-----**Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Le Gestionnaire de portefeuille a développé un outil interne de suivi des PIN qui prend en compte les PIN majeures, et qui a contribué à mesurer l'alignement du Compartiment sur les indicateurs PIN considérés comme significatifs. Cet outil a identifié les émetteurs qui étaient en retard sur leurs pairs en ce qui concerne les PIN, et a permis au Gestionnaire de portefeuille d'évaluer l'exposition du Compartiment aux PIN par rapport à l'indice de référence.

Les PAI ont constitué une jauge utile pour déterminer les cibles d'investissement : Plus précisément, la PIN 3 mesurait l'intensité des GES des entreprises et l'incidence 15 mesurait l'intensité des GES des États ; la PIN 10 identifiait la violation des principes de l'UNGC et de l'OCDE ; la PIN 14 mesurait les activités liées aux armes controversées, justifiant certaines exclusions par comparaison avec l'ensemble de l'univers d'investissement ; et la PIN 16 a été utilisée pour déterminer les pays n'étant pas considérés comme libres par la Freedom House. En raison de la nature exhaustive des points de données incorporés, l'outil a permis d'identifier les mesures prises à l'égard des émetteurs, et notamment les engagements et les désinvestissements.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Même si le Compartiment ne s'est pas engagé à faire mieux, en moyenne, que son indice de référence en matière de PIN, l'écart de mesure entre les deux a été un indicateur utile pour évaluer la performance en matière de gestion des incidences négatives.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le Compartiment a respecté les principes directeurs en matière d'exclusion des émetteurs qui ne respectaient pas les principes de l'UNGC et de l'OCDE. L'engagement du Gestionnaire de portefeuille vis-à-vis des émetteurs s'est fondé sur les principes de l'UNGC et de l'OCDE. Les émetteurs qui ne respectaient pas les principes de l'UNGC et de l'OCDE ont été ajoutés à la liste rouge ESG du Gestionnaire de portefeuille et sont dès lors devenus inéligibles à l'investissement. Le cas échéant, le Gestionnaire de portefeuille a cherché à s'engager auprès des émetteurs problématiques, qu'ils aient ou non déjà dérogé de manière explicite aux principes directeurs sous-jacents.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

La manière dont les PIN ont été prises en compte est exposée plus en détail ci-dessus.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Intensité des GES en USD	166,90	97,80%
Intensité GES des pays en portefeuille en USD	214,20	100,00%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	96,00%
Exposition à des armes controversées	0,00%	97,00%
Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales	0,00	100,00%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
MORGAN STANLEY	Finance	0,99%	États-Unis
DANSKE BANK AS	Finance	0,88%	Danemark
GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE	Finance	0,76%	États-Unis
INTESA SANPAOLO SpA	Finance	0,62%	Italie
CREDIT SUISSE GROUP AG	Finance	0,62%	Suisse
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	0,59%	États-Unis
ÉTATS-UNIS MEXICAINS	Obligations d'État	0,58%	Mexique
ENERGY TRANSFER LP	Énergie	0,57%	États-Unis
NISSAN MOTOR CO LTD	Biens de consommation discrétionnaire	0,55%	Japon
CITIGROUP INC	Finance	0,53%	États-Unis
WARNER BROS DISCOVERY INC	Services de communication	0,53%	États-Unis
BOEING CO	Industrie	0,51%	États-Unis
LAS VEGAS SANDS CORP	Biens de consommation discrétionnaire	0,50%	États-Unis
BOEING CO	Industrie	0,47%	États-Unis
GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE	Finance	0,46%	États-Unis

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

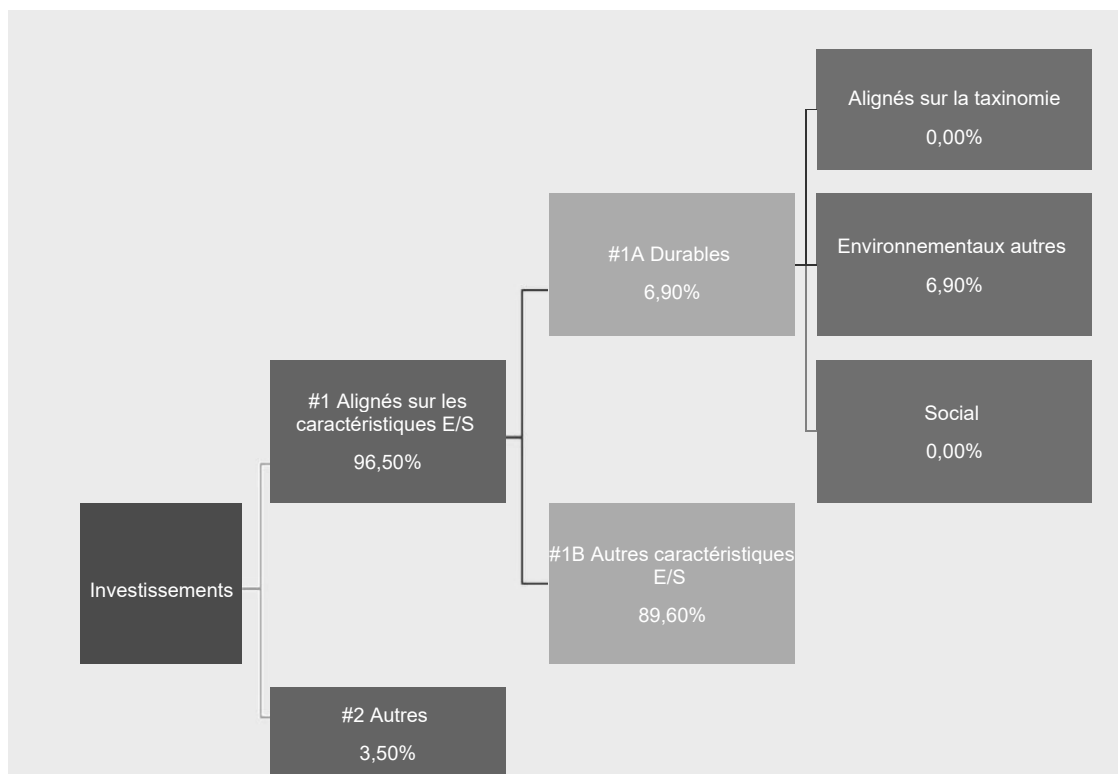
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 6,90 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

96,50 % du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (3,50 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides d'émetteurs dépourvus de notation ESG.

Le Fonds a investi dans des placements durables 6,90 % du segment de son portefeuille qui était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Finance	40,83%
Énergie	9,73%
Services de communication	6,99%
Industrie	6,78%
Biens de consommation discrétionnaire	6,60%
Santé	6,17%
Technologies de l'information	4,99%
Obligations d'État	4,62%
Services aux collectivités	4,18%
Matériaux	2,43%
commercial	1,75%
Biens de consommation courante	1,35%
Obligations municipales	0,76%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Banques	22,27%
Marchés financiers	9,52%
Pétrole, gaz et combustibles	9,18%
Services financiers	6,01%
Obligations d'État	4,76%
Prestataires et services de soins de santé	3,95%
Compagnies aériennes	3,33%
Services publics d'électricité	3,17%
Services de télécommunications diversifiés	2,93%
Hôtels, restaurants et loisirs	2,30%
Métaux et exploitations minières	2,27%
Médias	2,27%
Automobiles	2,10%
Assurances	1,90%
Biotechnologie	1,41%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

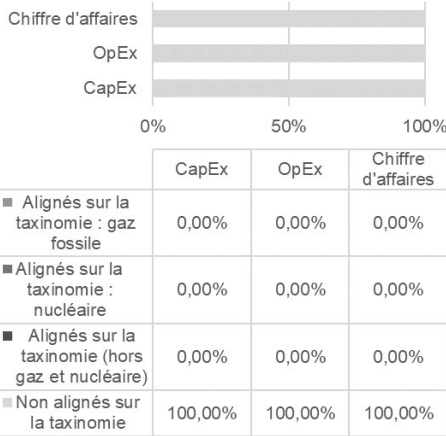
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

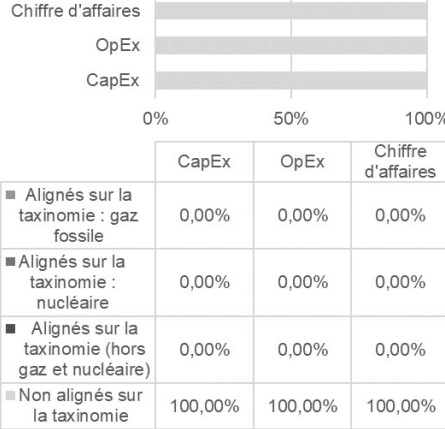
- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Sans objet.

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

En accord avec sa stratégie d'investissement, à savoir l'engagement du Fonds à réaliser une proportion minimale d'« investissements durables » ayant un objectif environnemental conformément à l'article 2 paragraphe 17 du SFDR, 6,90 % du Fonds étaient constitués d'« investissements durables » ayant un objectif environnemental mais qui ne sont pas considérés comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Sans objet.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 3,50 % et comprenait des liquidités et des instruments dérivés ou des émetteurs dépourvus de notation ESG et pour lesquels il n'y avait pas de garanties environnementales ou sociales minimales.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Western Asset estime que les facteurs ESG peuvent affecter la solvabilité des titres des émetteurs d'obligations et, par conséquent, la performance des portefeuilles obligataires. Ces facteurs sont entièrement compatibles avec la philosophie d'investissement à long terme de la Société, qui repose sur la valeur fondamentale. Les analystes de recherche de Western Asset étaient chargés de fournir une analyse fondamentale au niveau du secteur et de l'émetteur et d'émettre une opinion sur les ratios rendement/risque du secteur et de l'émetteur en intégrant des considérations ESG importantes. Soutenu par cette approche plus large, le Fonds a cherché à atteindre ses caractéristiques environnementales et sociales en investissant dans des émetteurs de manière à ce que l'ensemble du portefeuille respecte les notations ESG minimales, atteigne son objectif de décarbonation et d'alignement sur les ODD, et évite les émetteurs identifiés par l'application d'exclusions ISR, alloués à des secteurs et investis dans des émetteurs ciblant des secteurs spécifiques.

Pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence, le Fonds a pris les mesures suivantes :

A. Le Fonds cherchera à maintenir une notation MSCI ESG moyenne égale ou supérieure à BBB.

B. Le Fonds cherchera à atteindre une intensité carbone moyenne pondérée (Weighted Average Carbon Intensity, « WACI ») inférieure d'au moins 20 % à celle de l'indice de référence. Cela a permis au Fonds de s'aligner sur les PIN 3 et 15 (intensité des émissions de gaz à effet de serre).

C. Le Fonds s'efforcera de parvenir à un meilleur alignement que l'Indice de référence pour ce qui concerne les investissements dans des titres d'émetteurs dont les activités contribuent à la réalisation d'au moins 1 des 8 ODD sélectionnés.

D. Le Fonds exclut les émetteurs qui n'ont pas atteint une série d'objectifs en matière d'ISR, tels que décrits ci-dessous :

a. Émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production et/ou de la distribution du tabac ou de la production d'armes nucléaires ;

b. Émetteurs qui tirent plus de 10 % de leur chiffre d'affaires de la production ou de la distribution d'armes à feu civiles, d'armes conventionnelles ou de charbon thermique ;

c. Émetteurs qui produisent des armes controversées (mines antipersonnel, armes chimiques, armes à laser aveuglantes, uranium appauvri, armes incendiaires et éclats non localisables), qui détiennent une société active dans les armes controversées ou qui sont détenues par une telle société, conformément à l'indicateur 14 (armes controversées) ;

d. Émetteurs « non conformes » aux principes directeurs de l'UNGC et de l'OCDE selon les résultats des recherches internes visant à déterminer les écarts par rapport aux objectifs, conformément à l'indicateur de PIN 10 (questions sociales et liées aux conditions de travail).

e. Entreprises ou États émetteurs non considérés comme « libres » par l'indice Freedom House, conformément à l'indicateur de PIN 16 (Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales) ;

Dans le cadre de l'investissement minimum de 1 % dans des investissements durables (définis comme des obligations vertes, sociales, durables et liées à la durabilité), le Fonds était investi dans des investissements durables à hauteur de 6,9 %, en valeur de marché au 31 décembre 2022.

Le Fonds a promu l'environnement et/ou le développement durable en appliquant les lignes directrices susmentionnées, comme souligné ci-dessous :

A. Le fonds a reçu la note A selon MSCI ESG.

- B. La WACI globale du Fonds représentait 69,1 % de celle de l'indice de référence.
- C. L'allocation du Fonds aux émetteurs et aux émissions alignés sur les ODD était de 59,8 % contre 61,8 % pour l'indice de référence.
- D. Au 31 décembre 2022, le Fonds avait investi 6,9 % en valeur de marché.
- E. Le Fonds n'a détenu aucun émetteur ne respectant pas les lignes directrices de l'ISR.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Sans objet.

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund



FRANKLIN TEMPLETON

LEI de l'entité : 254900H2PG4695EB6Y14

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ ☐ **OUI**

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif environnemental** : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif social** : ____%

☒ ☒ **NON**

☒ Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 8,38% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Fonds privilégiait les caractéristiques environnementales et/ou sociales suivantes :

- alignement sur au moins un objectif de développement durable des Nations Unies (ODD) par rapport à l'indice de référence du Compartiment, par voie d'investissement dans des obligations vertes, sociales, durables ou apparentées, et dans des investissements de premier ordre ;
- alignement sur les indicateurs de PAI :
 - intensité de gaz à effet de serre (incidences 3 et 15) ;
 - questions sociales ou relatives au personnel (incidence 10) ;
 - armes controversées (incidence 14) ; et
 - pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales (indicateur n° 16).

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds étaient les suivants :

- Les indicateurs PIN mentionnés dans la réponse ci-dessus. Veuillez vous référer aux valeurs affichées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » qui représentent la performance des indicateurs pendant la période de référence.
- L'allocation en obligations vertes, sociales, durables ou apparentées s'établissait à 8,38 %.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Les investissements durables du Fonds ont été réalisés dans des obligations vertes, sociales, durables et liées à la durabilité, grâce à une allocation minimale aux émetteurs alignés sur les ODD par rapport à l'indice de référence du Fonds et aux émetteurs qui ont atteint des résultats de premier ordre. Les produits de ces obligations ont été utilisés pour financer des projets spécifiques ou dotés d'indicateurs liés à la durabilité, notamment :

- Projets verts : énergies renouvelables, efficacité énergétique, prévention et contrôle de la pollution, gestion écologiquement durable des ressources naturelles vivantes et de l'usage des sols, biodiversité, transports propres, gestion durable de l'eau et de l'assainissement, adaptation au changement climatique, économie circulaire et bâtiments écologiques ;
- Projets sociaux : logements abordables, infrastructures abordables (eau potable, assainissement), programmes d'emploi et progrès socio-économiques, notamment en matière d'éducation, de diversité, d'égalité et d'inclusion.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Le Gestionnaire de portefeuille a utilisé la recherche interne et des indicateurs PIN exclusifs pour s'assurer que les investissements durables ne portent pas préjudice à certains objectifs d'investissement durable sociaux ou environnementaux.

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé des outils exclusifs de suivi des PAI qui exploitent des données de sources diversifiées (fournisseurs externes tels que MSCI ESG, ISSS, Banque mondiale, BloombergNEF, S&P Trucost, Transition Pathway Initiative, ONG, établissements universitaires), ainsi que des recherches exclusives, contribuait à déterminer les émetteurs qui présentaient des caractéristiques de durabilité insuffisantes ou des incidences négatives au sens des indicateurs PAI. Ces contrôles permettaient au Gestionnaire de portefeuille d'investir dans des émetteurs alignés sur les indicateurs PAI et d'éviter les émetteurs non alignés. En matière d'investissements dans les obligations vertes, sociales, durables ou apparentées, le Gestionnaire de portefeuille a appliqué cette approche pour déterminer si une obligation respectait les critères de durabilité.

Par ailleurs, les émetteurs souverains ont été soumis à des tests évaluant leur niveau en matière de libertés politiques et/ou de corruption.

Pour sélectionner les investissements durables, en particulier la part de 1 % du portefeuille visant des objectifs environnementaux éventuels, le Gestionnaire de portefeuille a appliqué des évaluations qualitatives complémentaires (fondées sur la recherche interne ou des opinions externes) aux émetteurs et aux projets, pour déterminer leur admissibilité en fonction du principe de « ne pas causer de préjudice important ».

De plus, certaines exclusions ont été mises en œuvre pour éliminer les émetteurs susceptibles d'être à l'origine de préjudices importants, tel que précisé plus loin.

-----**Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Le Gestionnaire de portefeuille a développé un outil interne de suivi des PIN qui prend en compte les PIN majeures, et qui a contribué à mesurer l'alignement du Compartiment sur les indicateurs PIN considérés comme significatifs. Cet outil a identifié les émetteurs qui étaient en retard sur leurs pairs en ce qui concerne les PIN, et a permis au Gestionnaire de portefeuille d'évaluer l'exposition du Compartiment aux PIN par rapport à l'indice de référence.

Les PAI ont constitué une jauge utile pour déterminer les cibles d'investissement : Plus précisément, la PIN 3 mesurait l'intensité des GES des entreprises et l'incidence 15 mesurait l'intensité des GES des États ; la PIN 10 identifiait la violation des principes de l'UNGC et de l'OCDE ; la PIN 14 mesurait les activités liées aux armes controversées, justifiant certaines exclusions par comparaison avec l'ensemble de l'univers d'investissement ; et la PIN 16 a été utilisée pour déterminer les pays n'étant pas considérés comme libres par la Freedom House. En raison de la nature exhaustive des points de données incorporés, l'outil a permis d'identifier les mesures prises à l'égard des émetteurs, et notamment les engagements et les désinvestissements.

Même si le Compartiment ne s'est pas engagé à faire mieux, en moyenne, que son indice de référence en matière de PIN, l'écart de mesure entre les deux a été un indicateur utile pour évaluer la performance en matière de gestion des incidences négatives.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le Compartiment a respecté les principes directeurs en matière d'exclusion des émetteurs qui ne respectaient pas les principes de l'UNGC et de l'OCDE. L'engagement du Gestionnaire de portefeuille vis-à-vis des émetteurs s'est fondé sur les principes de l'UNGC et de l'OCDE. Les émetteurs qui ne respectaient pas les principes de l'UNGC et de l'OCDE ont été ajoutés à la liste rouge ESG du Gestionnaire de portefeuille et sont dès lors devenus inéligibles à l'investissement. Le cas échéant, le Gestionnaire de portefeuille a cherché à s'engager auprès des émetteurs problématiques, qu'ils aient ou non déjà dérogé de manière explicite aux principes directeurs sous-jacents.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

La manière dont les PIN ont été prises en compte est exposée plus en détail ci-dessus.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Intensité des GES en USD	136,80	98,10%
Intensité GES des pays en portefeuille en USD	192,50	100,00%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	98,00%
Exposition à des armes controversées	0,00%	98,00%
Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales	0,00	100,00%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
UBS GROUP AG	Finance	2,32%	Suisse
DANSKE BANK AS	Finance	2,25%	Danemark
ANGLO AMERICAN PLC	Matériaux	2,20%	Afrique du Sud
HSBC HOLDINGS PLC	Finance	2,19%	Royaume-Uni
BNP PARIBAS SA	Finance	2,18%	France
COOPERATIEVE RABOBANK UA	Finance	2,01%	Pays-Bas
STANDARD CHARTERED PLC	Finance	1,98%	Royaume-Uni
GOODMAN EUROPEAN LOGISTICS FUND	commercial	1,91%	France
CREDIT SUISSE GROUP AG	Finance	1,80%	Suisse
INTESA SANPAOLO SPA	Finance	1,70%	Italie
ALLIANZ SE	Finance	1,68%	Allemagne
ENEL SPA	Services aux collectivités	1,65%	Italie
ÉTATS-UNIS D'AMÉRIQUE	Obligations d'État	1,51%	États-Unis
VERIZON COMMUNICATIONS INC	Services de communication	1,49%	États-Unis
VOLKSWAGEN AG	Biens de consommation discrétionnaire	1,37%	Allemagne

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

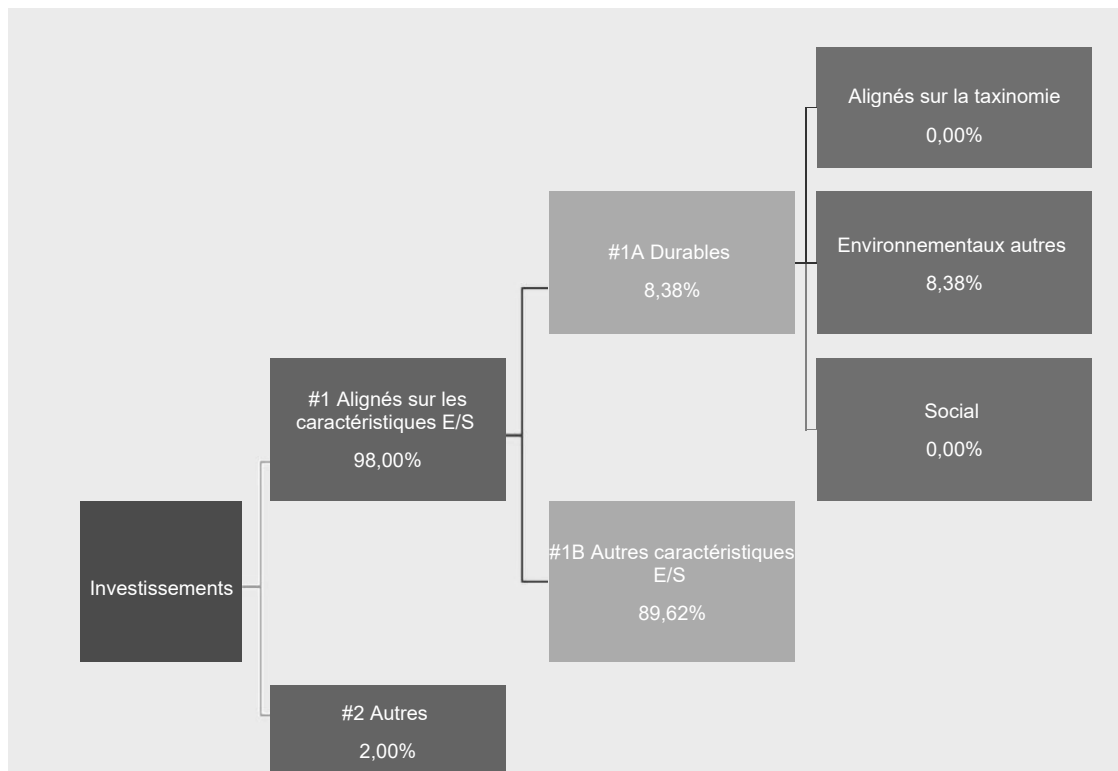
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 8,38 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

98,00 % du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (2,00 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides ou d'émetteurs pour lesquels aucune notation ESG n'était disponible.

Au sein du segment du Fonds aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues, le Fonds a respecté son investissement minimum de 1 % dans des investissements durables.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Finance	41,32%
Obligations d'État	11,23%
Services aux collectivités	9,02%
Santé	7,69%
commercial	6,64%
Services de communication	6,49%
Énergie	3,99%
Technologies de l'information	2,91%
Biens de consommation courante	2,68%
Biens de consommation discrétionnaire	2,49%
Matériaux	2,16%
Industrie	0,97%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Banques	24,83%
Obligations d'État	10,73%
Services publics d'électricité	7,14%
Marchés financiers	6,55%
Services de télécommunications diversifiés	5,11%
Assurances	5,11%
Services financiers	4,83%
Prestataires et services de soins de santé	4,72%
Pétrole, gaz et combustibles	3,99%
Fonds de placements immobiliers	3,77%
Gestion et promotion immobilières	2,87%
Métaux et exploitations minières	2,16%
Biotechnologie	1,82%
Équivalents de trésorerie	1,63%
Automobiles	1,37%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

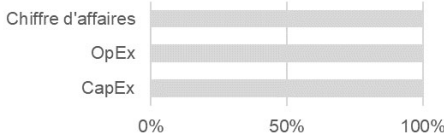
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

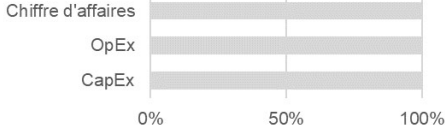
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Sans objet.

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

En accord avec sa stratégie d'investissement, à savoir l'engagement du Fonds à réaliser une proportion minimale d'« investissements durables » ayant un objectif environnemental conformément à l'article 2 paragraphe 17 du SFDR, 8,38 % du Fonds étaient constitués d'« investissements durables » ayant un objectif environnemental mais qui ne sont pas considérés comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Sans objet.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 2,00 % et comprenait des liquidités et des instruments dérivés pour lesquels il n'y avait pas de garanties environnementales ou sociales minimales. Ce chiffre incluait également les émetteurs pour lesquels aucune notation ESG n'était disponible.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Western Asset estime que les facteurs ESG peuvent affecter la solvabilité des titres des émetteurs d'obligations et, par conséquent, la performance des portefeuilles obligataires. Ces facteurs sont entièrement compatibles avec la philosophie d'investissement à long terme de la Société, qui repose sur la valeur fondamentale. Les analystes de recherche de Western Asset étaient chargés de fournir une analyse fondamentale au niveau du secteur et de l'émetteur et d'émettre une opinion sur les ratios rendement/risque du secteur et de l'émetteur en intégrant des considérations ESG importantes. Soutenu par cette approche plus large, le Fonds a cherché à atteindre ses caractéristiques environnementales et sociales en investissant dans des émetteurs de manière à ce que l'ensemble du portefeuille respecte les notations ESG minimales, atteigne son objectif de décarbonation et d'alignement sur les ODD, et évite les émetteurs identifiés par l'application d'exclusions ISR, alloués à des secteurs et investis dans des émetteurs ciblant des secteurs spécifiques.

Pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence :

A. Le Fonds a cherché à maintenir une notation MSCI ESG moyenne égale ou supérieure à BBB ; le Fonds a obtenu la note AA.

B. Le Fonds a cherché à atteindre une intensité carbone moyenne pondérée (Weighted Average Carbon Intensity, « WACI ») inférieure d'au moins 20 % à celle de l'indice de référence ; la WACI globale du Fonds représentait 62,9 % de celle de l'indice de référence. Cela a permis au Fonds de s'aligner sur les PIN 3 et 15 (intensité des émissions de gaz à effet de serre).

C. Le Fonds s'est efforcé de parvenir à un meilleur alignement que l'Indice de référence pour ce qui concerne les investissements dans des titres d'émetteurs dont les activités contribuaient à la réalisation d'au moins 1 des 8 ODD sélectionnés ; l'allocation du Fonds aux émetteurs et aux émissions alignés sur les ODD était de 68,2 % contre 68,4 % pour l'indice de référence.

D. Le Fonds a exclu les émetteurs qui n'ont pas atteint une série d'objectifs en matière d'ISR, tels que décrits ci-dessous :

a. Émetteurs qui tirent plus de 5 % de leur chiffre d'affaires de la production et/ou de la distribution du tabac ou de la production d'armes nucléaires ;

b. Émetteurs qui tirent plus de 10 % de leur chiffre d'affaires de la production ou de la distribution d'armes à feu civiles, d'armes conventionnelles ou de charbon thermique ;

c. Émetteurs qui produisent des armes controversées (mines antipersonnel, armes chimiques, armes à laser aveuglantes, uranium appauvri, armes incendiaires et éclats non localisables), qui détiennent une société active dans les armes controversées ou qui sont détenues par une telle société, conformément à l'indicateur 14 (armes controversées) ;

d. Émetteurs « non conformes » aux principes directeurs de l'UNGC et de l'OCDE selon les résultats des recherches internes visant à déterminer les écarts par rapport aux objectifs, conformément à l'indicateur de PIN 10 (questions sociales et liées aux conditions de travail) et

e. Entreprises ou États émetteurs non considérés comme « libres » par l'indice Freedom House, conformément à l'indicateur de PIN 16 (Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales) ;

Le Fonds n'a investi dans aucun émetteur ne respectant pas les lignes directrices susmentionnées.

F. Dans le cadre de l'investissement minimum de 1 % dans des investissements durables (définis comme des obligations vertes, sociales, durables et liées à la durabilité), le Fonds était investi dans des investissements durables à hauteur de 8,4 %, en valeur de marché au 31 décembre 2022.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Sans objet.

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

LEI de l'entité : 549300TFZOEP7EEQG432



FRANKLIN TEMPLETON

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

☐ ☐ **OUI**

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif environnemental** : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif social** : ____%

☒ ☒ **NON**

☐ Il **promouvait** des **caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 0,00% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ ayant un objectif social

☒ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Toutes les caractéristiques environnementales et/ou sociales énoncées ci-dessous n'ont pas été promues à tout moment par chaque investissement ou par le Fonds.

Les caractéristiques environnementales promues étaient :

- Qualité de l'air
- Biodiversité et zones protégées (marines)
- Biodiversité et zones protégées (terrestres)
- Capacité d'adaptation au changement climatique
- Exposition au changement climatique
- Sensibilité au changement climatique
- Vulnérabilité au changement climatique
- Émissions de CO2 liées à la production d'énergie
- Émissions de CO2 liées à la réaffectation des terres et à l'exploitation forestière
- Politique carbone – Souverain
- Dépendance aux exportations de combustibles fossiles
- Déforestation
- Risques de sécheresse
- Sécurité énergétique
- Pression environnementale
- Émissions de gaz à effet de serre (GES) totales
- Réduction des émissions de GES : Progression vers les objectifs
- Économie à faible intensité de carbone
- Sécurité des ressources
- Gestion des déchets
- Pollution de l'eau
- Sécurité des approvisionnements en eau

Les caractéristiques sociales promues étaient :

- Voies de recours
- Travail des enfants
- Troubles civils
- Discrimination au travail
- Salaires décents
- Éducation

- Liberté d'association et de négociations collectives
- Sécurité alimentaire
- Accès aux soins de santé
- Capital humain
- Droits des peuples autochtones
- Travail informel
- Travailleurs migrants
- Droits des minorités
- Esclavage moderne
- Santé et sécurité au travail
- Pauvreté
- Minorités sexuelles
- Évolution de la population active
- Droit des femmes et des filles
- Jeunes travailleurs

Les émetteurs classés dans les 10 % les moins bien notés (le décile inférieur) ont été exclus de l'univers d'investissement au cours de la période sous revue.

Les émetteurs classés dans la fourchette de notation de 10 % à 20 % (l'avant-dernier décile) n'ont pas été exclus, mais ont été traités comme des candidats à l'engagement au cours de la période sous revue.

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Fonds.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales ou sociales privilégiées par le Fonds étaient les suivants :

A. Alignement des données d'entrée spécifiques des méthodes de notation ESG retenues par le gestionnaire de portefeuille avec les caractéristiques sociales et environnementales privilégiées par le Fonds ; Ces contributions ont découlé de :

1. L'application des exclusions ESG.

Le Fonds s'engage à exclure les émetteurs du décile le moins bien noté de l'univers d'investissement. Aucun désinvestissement n'a été effectué car aucune valeur détenue n'est passée dans le décile inférieur. Le décile inférieur est resté exclu.

2. Le Fonds considère les émetteurs se situant dans l'avant-dernier décile comme des candidats à l'engagement. De ce fait, nous avons engagé le dialogue avec les émetteurs suivants : Malaisie.

B. Suivi des indicateurs des principales incidences négatives obligatoires (PIN). Veuillez vous reporter aux valeurs affichées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? »

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Sans objet. Le compartiment ne s'engage pas à procéder à des investissements durables.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Sans objet. Le compartiment ne s'engage pas à procéder à des investissements durables.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Sans objet. Le compartiment ne s'engage pas à procéder à des investissements durables.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Sans objet. Le compartiment ne s'engage pas à procéder à des investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les PAI obligatoires pour les souverains ont été suivies, mesurées et rapportées ; le gestionnaire de portefeuille a également exploité les évolutions des PIN et des indicateurs associés pour évaluer les opportunités et optimiser les portefeuilles, ce qui a permis de déterminer les investissements et la taille des positions. Pour prendre ses décisions d'investissement, le gestionnaire de portefeuille a évalué les seuils visant à « ne pas causer de préjudice important » au niveau fondamental, du secteur/de l'industrie, du pays et du portefeuille. Les deux PIN concernant les États (PIN 15 (Intensité de GES) et PIN 16 (Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales)) ont été incluses dans la méthodologie de notation ESG exclusive du gestionnaire de portefeuille.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Intensité GES des pays en portefeuille en USD	488,87	86,14%
Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales	0,00	86,14%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
US TREASURY N/B 1.875% 11/15/51	Obligations d'État	10,62%	États-Unis
KOREA TRSY BD 2.75% 12/10/44	Obligations d'État	4,95%	Corée du Sud
UK TSY GILT 0.25% 07/31/31	Obligations d'État	4,87%	Royaume-Uni
COLOMBIA TES 6% 04/28/28	Obligations d'État	4,35%	Colombie
BRAZIL NTN-F 10% 01/01/25	Obligations d'État	3,96%	Brésil
FRANCE O.A.T. 0% 05/25/32	Obligations d'État	3,83%	France
MEXICAN BONOS 7.75% 11/13/42	Obligations d'État	3,57%	Mexique
MEXICAN BONOS 8.5% 11/18/38	Obligations d'État	3,10%	Mexique
MEXICAN BONOS 8.5% 05/31/29	Obligations d'État	2,80%	Mexique
INT BK RECON&DEV 4.25% 01/22/26	Obligations d'État	2,77%	Supranational
MEXICAN BONOS 8% 11/07/47	Obligations d'État	2,22%	Mexique
INT BK RECON&DEV 7.25% 01/21/27	Obligations d'État	2,15%	Supranational
REP SOUTH AFRICA 8.75% 02/28/48	Obligations d'État	2,11%	Afrique du Sud
US TREASURY N/B 2.25% 02/15/52	Obligations d'État	2,10%	États-Unis
REP SOUTH AFRICA 6.5% 02/28/41	Obligations d'État	2,08%	Afrique du Sud

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

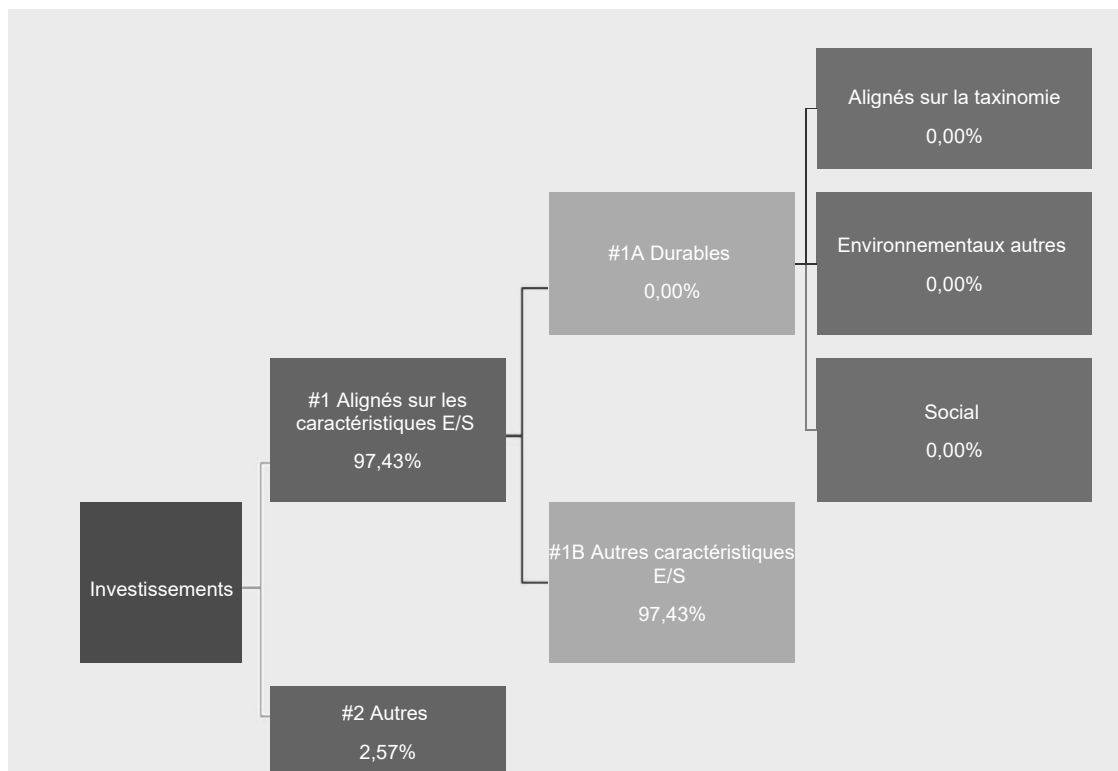
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 0 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

97,43 % du portefeuille étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (2,57 %), non alignée sur les caractéristiques privilégiées, se composait principalement d'actifs liquides.

Le Fonds n'a pas réalisé d'investissements durables.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Obligations d'État	96,35%
Dérivés	0,89%

Principal sous-secteur	% d'actifs
SOUVERAINS	84,56%
BANQUE SUPRANATIONALE	9,14%
AGENCES RÉGIONALES	2,65%
DERIVIS	0,89%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

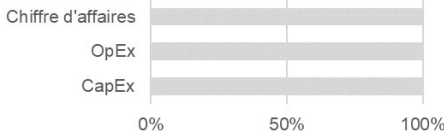
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

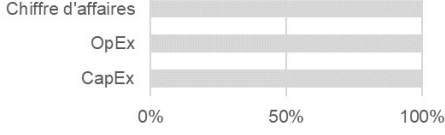
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Sans objet.



Le symbole représente des investissements durables ayant

un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

0% des investissements du Fonds n'ont été réalisés dans des investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

0 % des investissements du Fonds n'ont été consacrés à des investissements socialement durables.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 2,57 % et comprenait les liquidités conservées en dépôt ou dans des instruments dérivés utilisés en couverture, non soumises à un objectif social ou environnemental minimum.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

1. Le Fonds s'engage à exclure les émetteurs du décile le moins bien noté de l'univers d'investissement. Aucun désinvestissement n'a été effectué car aucune valeur détenue n'est passée dans le décile inférieur. Le décile inférieur est resté exclu.
2. Le Fonds considère les émetteurs se situant dans l'avant-dernier décile comme des candidats à l'engagement. De ce fait, nous avons engagé le dialogue avec les émetteurs suivants : Malaisie
3. Jusqu'à 90 % des investissements ont fait l'objet d'un suivi et d'une surveillance, visant à détecter une dégradation ou une amélioration des facteurs environnementaux et sociaux.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Non applicable

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

LEI de l'entité : 549300373IZ316KVU890



**FRANKLIN
TEMPLETON**

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

☐ **OUI**

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif environnemental** : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif social** : ____%

☒ **NON**

☒ Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 1,18% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Ce Fonds a suivi une stratégie sans contraintes ; les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il a privilégiées ont recouvert différents secteurs obligataires et sont comptabilisées par pays, par fondamentaux ou par secteur. Toutes les caractéristiques environnementales et/ou sociales énoncées ci-dessous n'ont pas été promues à tout moment par chaque investissement ou par le Fonds.

Le Fonds a privilégié les caractéristiques environnementales suivantes sur le segment des obligations souveraines :

- Qualité de l'air
- Biodiversité et zones protégées (marines)
- Biodiversité et zones protégées (terrestres)
- Capacité d'adaptation au changement climatique
- Exposition au changement climatique
- Sensibilité au changement climatique
- Vulnérabilité au changement climatique
- Émissions de CO2 liées à la production d'énergie
- Émissions de CO2 liées à la réaffectation des terres et à l'exploitation forestière
- Politique carbone – Souverain
- Dépendance aux exportations de combustibles fossiles
- Déforestation
- Risques de sécheresse
- Sécurité énergétique
- Pression environnementale
- Émissions de GES totales
- Réduction des émissions de GES : Progression vers les objectifs
- Économie à faible intensité de carbone
- Sécurité des ressources
- Gestion des déchets
- Pollution de l'eau
- Sécurité des approvisionnements en eau

Le Fonds a privilégié les caractéristiques sociales suivantes sur le segment des obligations souveraines :

- Voies de recours
- Travail des enfants
- Troubles civils
- Discrimination au travail

- Salaires décents
- Éducation
- Liberté d'association et de négociations collectives
- Sécurité alimentaire
- Accès aux soins de santé
- Capital humain
- Droits des peuples autochtones
- Travail informel
- Travailleurs migrants
- Droits des minorités
- Esclavage moderne
- Santé et sécurité au travail
- Pauvreté
- Minorités sexuelles
- Évolution de la population active
- Droit des femmes et des filles
- Jeunes travailleurs

Le Fonds a privilégié les caractéristiques environnementales et sociales suivantes sur le segment des obligations d'entreprise :

- Émissions de GES
- Empreinte carbone
- Intensité GES des sociétés bénéficiaires
- Exposition au secteur des combustibles fossiles
- Part de la consommation et de la production d'énergie non renouvelable
- Intensité de consommation d'énergie par secteur à impact climatique élevé
- Activités affectant la biodiversité dans les secteurs sensibles
- Rejets dans l'eau
- Ratio de déchets dangereux
- Infraction aux principes du Pacte mondial des Nations Unies (UNGC) et aux principes directeurs de l'Organisation de coopération et de développement économiques (OCDE) à l'intention des entreprises multinationales
- Processus et mécanismes de conformité déficients pour garantir le respect des principes du Pacte mondial des Nations Unies (UNGC) et les principes directeurs de l'Organisation de coopération et de développement économiques (OCDE) à l'intention des entreprises multinationales
- Écart de rémunération non ajusté entre hommes et femmes
- Mixité du conseil d'administration
- Exposition à des armes controversées (mines antipersonnel, munitions à fragmentation, armes chimiques et biologiques)

Les émetteurs classés dans les 10 % les moins bien notés (le décile inférieur) ont été exclus de l'univers d'investissement au cours de la période sous revue.

Les émetteurs classés dans la fourchette de notation de 10 % à 20 % (l'avant-dernier décile) n'ont pas été exclus, mais ont été traités comme des candidats à l'engagement au cours de la période sous revue.

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Fonds.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales ou sociales privilégiées par le Fonds étaient les suivants :

A. Alignement des données d'entrée spécifiques des méthodes de notation ESG retenues par le gestionnaire de portefeuille avec les caractéristiques sociales et environnementales privilégiées par le Fonds ; Ces contributions ont découlé de :

1. L'application des exclusions ESG.

Le Fonds s'engage à exclure les émetteurs du décile le moins bien noté de l'univers d'investissement. De ce fait, les désinvestissements suivants ont été effectués : Hercules Capital, Weibo Corp, Meta Platforms.

2. Le Fonds considère les émetteurs se situant dans l'avant-dernier décile comme des candidats à l'engagement. De ce fait, nous avons engagé le dialogue avec les émetteurs suivants : Carnival Cruise Corp., Dish Network Corp., Taseko Mines Ltd., Owl Rock Capital Corporation et le Brésil.

B. Suivi des indicateurs des principales incidences négatives obligatoires (PIN) applicables à chaque émetteur. Veuillez vous reporter aux valeurs affichées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? »

C. L'exposition aux obligations vertes, sociales et liées au développement durable était de 1,18 %. L'utilisation des produits a été définie par l'émetteur (et vérifiée par un tiers ou par le gestionnaire de portefeuille), et a soutenu des projets environnementaux et sociaux, notamment :

- Réduction des émissions de GES
- Disponibilité accrue des produits dans les pays à revenus faibles ou moyens
- Création de villes et de communautés durables grâce au financement de transports, d'énergie, d'eau et d'assainissement propres
- Initiatives en matière de diversité, d'équité et d'inclusion

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Le Fonds a investi au moins 1 % de ses actifs nets dans des obligations vertes et/ou sociales considérées comme durables. Le Fonds a investi uniquement dans des obligations dont l'utilisation des produits a été définie par l'émetteur (et vérifiée par un tiers ou par le gestionnaire de portefeuille), et qui soutenaient des projets environnementaux et sociaux, notamment :

- Réduction des émissions de GES
- Disponibilité accrue des produits dans les pays à revenus faibles ou moyens
- Création de villes et de communautés durables grâce au financement de transports, d'énergie, d'eau et d'assainissement propres
- Initiatives en matière de diversité, d'équité et d'inclusion

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Dans l'évaluation du principe DNSH (« Do no significant Harm » - ne pas causer de préjudice important), le gestionnaire de portefeuille s'est appuyé sur une combinaison de recherche fondamentale, d'analyses de marché, de revues de presse, d'indicateurs PIN et de données de performances ESG fournis par des tiers.

Il a analysé les éventuelles sanctions publiques répertoriées par des tiers relatives aux manquements aux principes du Pacte mondial des Nations unies, ainsi que les mesures et ICP liés aux PIN obligatoires, tant pour les entreprises que pour les États. S'agissant des investissements durables dans les titres d'entreprises, le gestionnaire de portefeuille a évalué la conformité de l'entreprise émettrice au principe DNSH. S'agissant des investissements durables dans des obligations souveraines ou d'organismes supranationaux (dans l'éventualité où la mission de ces organismes ne garantit pas la durabilité de toutes leurs activités ou tous les projets financés), le gestionnaire de portefeuille a évalué la conformité de l'utilisation des produits au principe DNSH.

Le Fonds a effectué un suivi des PIN afin de détecter une exposition à certains impacts négatifs.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Les PIN obligatoires pour les obligations souveraines et les obligations d'entreprises ont été suivies, mesurées et rapportées. Le Gestionnaire de portefeuille a fondé ses décisions d'investissement sur des seuils DNSH définis pour les fondamentaux, les secteurs, les pays. La stratégie du gestionnaire de portefeuille consiste à obtenir un engagement des émetteurs et à n'envisager un désinvestissement qu'en dernier ressort. Le gestionnaire de portefeuille a désinvesti immédiatement si un risque important à court terme était mis au jour.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le Gestionnaire de portefeuille a effectué un suivi des infractions et dérogations aux principes de l'OCDE/UNGC (signalés automatiquement par des tiers depuis janvier 2022) ; les entreprises déficientes ont été exclues du portefeuille et de l'univers d'investissement.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les PIN obligatoires pour les obligations souveraines et les obligations d'entreprises ont été suivies, mesurées et rapportées. Le Gestionnaire de portefeuille a également exploité les évolutions des PIN et des indicateurs associés pour évaluer les opportunités et optimiser les portefeuilles, ce qui a permis de déterminer les investissements et la taille des positions.

Le Gestionnaire de portefeuille a fondé ses décisions d'investissement sur des seuils DNSH définis pour les fondamentaux, les secteurs, les pays.

Les PIN obligatoires n'ont pas forcément été intégrées dans les notations ESG exclusives de ce Fonds. Toutefois, le gestionnaire d'investissement a assuré le suivi et la surveillance de ces incidences.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Émission de GES : Scope 1 en USD	47 610,47	60,85%
Émission de GES : Scope 2 en USD	9 505,59	60,85%
Émission de GES : Scope 3 en USD	195 058,19	59,70%
Émission de GES : Émissions totales en USD	252 174,25	60,85%
Empreinte carbone en USD	353,95	60,85%
Intensité carbone en USD	960,36	63,67%
Exposition à des entreprises actives dans le secteur des combustibles fossiles.	4,57%	56,49%
Part de la consommation et de la production d'énergie non renouvelable	74,19%	26,47%
Intensité de consommation énergétique : Agriculture en USD	0,00	22,03%
Intensité de consommation énergétique : Industrie minière en USD	2,21	22,03%
Intensité de consommation énergétique : Secteur manufacturier en USD	0,50	22,03%
Intensité de consommation énergétique : Électricité en USD	6,02	22,03%
Intensité de consommation énergétique : Eau en USD	0,66	22,03%
Intensité de consommation énergétique : Construction en USD	0,00	22,03%
Intensité de consommation énergétique : Négoce et véhicules en USD	0,04	22,03%
Intensité de consommation énergétique : Transports et entreposage en USD	3,12	22,03%
Intensité de consommation énergétique : Immobilier en USD	0,00	22,03%
Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité	0,00%	56,49%
Rejets dans l'eau en USD	210,48	1,86%
Déchets dangereux en USD	433,96	9,94%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	59,25%
Processus et mécanismes de conformité déficients pour garantir le respect des principes du Pacte mondial des Nations Unies (UNGC) et les principes directeurs de l'Organisation de coopération et de développement économiques (OCDE) à l'intention des entreprises multinationales.	44,00%	54,74%
Écart de rémunération non ajusté entre hommes et femmes	18,47%	5,64%
Mixité du conseil d'administration	29,84%	56,02%
Exposition à des armes controversées	0,00%	56,49%
Intensité GES des pays en portefeuille en USD	481,49	10,54%
Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales	0,00	10,54%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
US TREASURY N/B 2.25% 02/15/52	Gouvernement	1,79%	États-Unis
DISH NETWORK 3.375% 08/15/26	Communications	1,59%	États-Unis
STACR 2021-DNA2 M2 FLT 08/25/33 144A	Titres adossés à des dettes hypothécaires	1,44%	États-Unis
TPMT 2018-2 B1 VAR 03/25/58 144A	Titres adossés à des dettes hypothécaires	1,21%	États-Unis
FIRST QUANTUM 6.875% 10/15/27 144A	Matériaux de base	1,17%	Canada
NEW FORTRESS 6.75% 09/15/25 144A	Énergie	1,14%	États-Unis
WFRBS 2014-LC14 D VAR 03/15/47 144A	Titres adossés à des dettes hypothécaires	1,08%	États-Unis
MILEAGE PLUS HLD 6.5% 06/20/27 144A	Biens de consommation cycliques	1,06%	États-Unis
XP INC 3.25% 07/01/26 144A	Secteur financier	0,95%	Brésil
SPRINT SPECTRUM 5.152% 03/20/28 144A	Communications	0,95%	États-Unis
GRAHAM PKG CO IN 7.125% 08/15/28 144A	Industrie	0,92%	États-Unis
CAS 2020-SBT1 2M2 FLT 02/25/40 144A	Titres adossés à des dettes hypothécaires	0,91%	États-Unis
TMIR 2021-3 M1A FLT 02/25/34 144A	Titres adossés à des dettes hypothécaires	0,86%	États-Unis
ATHENE GLOBAL FU 0.914% 08/19/24 144A	Secteur financier	0,85%	États-Unis
VALERO ENERGY 3.65% 12/01/51	Énergie	0,84%	États-Unis



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

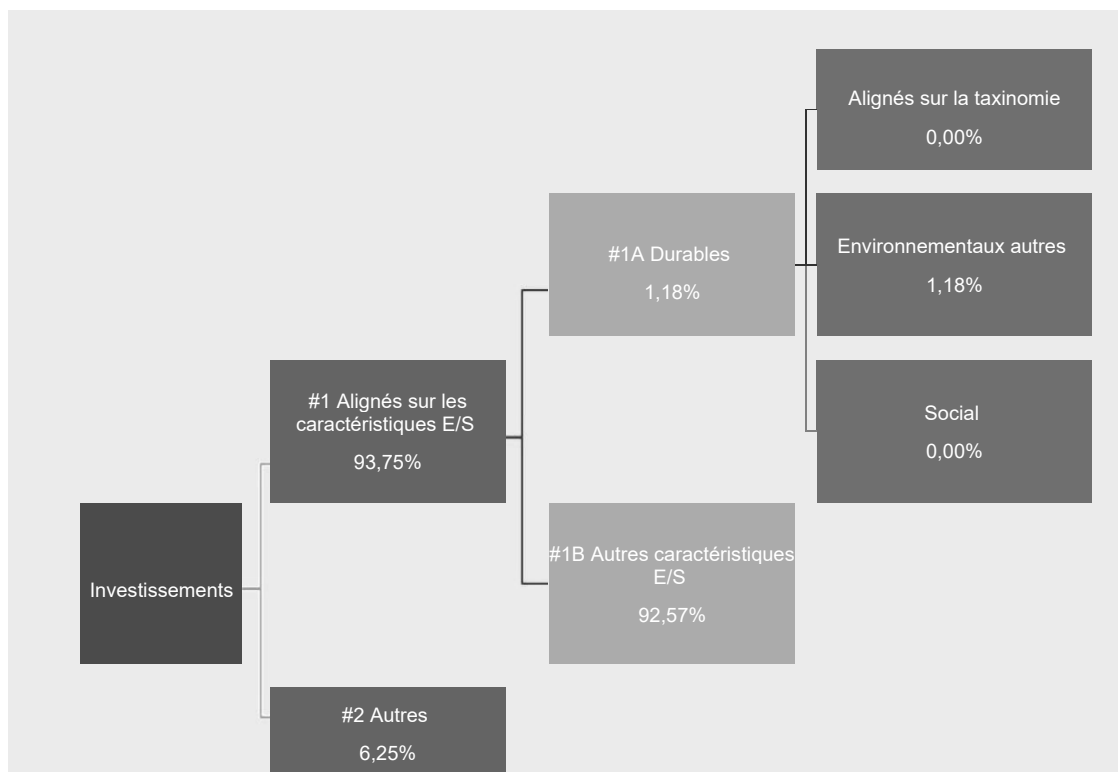
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 1,18 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

93,75 % du portefeuille étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (6,25 %), non alignée sur les caractéristiques privilégiées, se composait principalement d'actifs liquides.

En plus du segment aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales privilégiées, le Fonds a investi 1,18 % de son portefeuille dans des placements durables.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
TITRES HYPOTHÉCAIRES	18,79%
FINANCE	16,64%
ÉTAT	11,90%
COMMUNICATIONS	11,23%
BIENS DE CONSOMMATION CYCLIQUES	8,85%
ÉNERGIE	6,57%
INDUSTRIE	6,12%
MATÉRIAUX DE BASE	2,80%
TECHNOLOGIE	2,45%
BIENS DE CONSOMMATION NON CYCLIQUES	1,90%
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	0,80%
DÉRIVÉS	-0,38%

Principal sous-secteur	% d'actifs
SOUVERAINS	10,76%
ENTREPRISES D'INVESTISSEMENT	9,12%
WL COLLAT CMO MEZZANINE	7,30%
WL COLLAT CMO SUBORDONNÉE	5,18%
UMBS LOGEMENTS MONOPARENTAUX 30ANS	4,88%
COMPAGNIES AÉRIENNES	3,26%
CIES PÉTROLIÈRES-EXPLOR&PROD	2,92%
MÉTAL-CUIVRE	2,54%
TÉLÉPHONIE-INTÉGRÉE	2,49%
PIPELINES	2,38%
CONTENANTS-PAPIER/PLASTIQUE	2,31%
TÉLÉPHONIE MOBILE	1,77%
SECTEUR BANCAIRE INSTIT DIVERSIFIÉ	1,71%
TV CABLE/SATELLITE	1,68%
AUTOMOBILES/UTILITAIRES LÉGERS	1,37%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

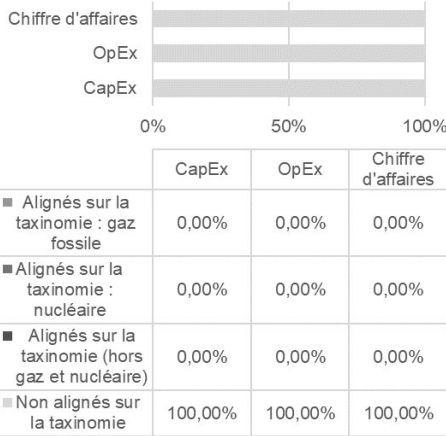
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

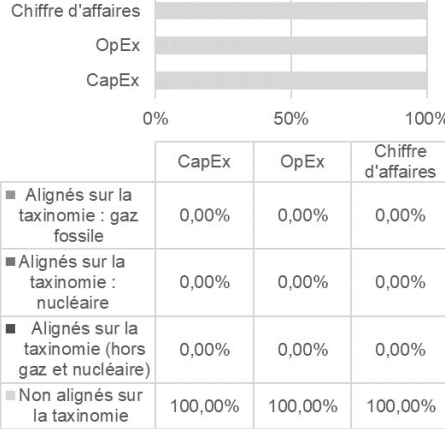
- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Non applicable

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

En raison de sa stratégie d'investissement, le Fonds n'a pas réalisé d'investissements durables ayant un objectif environnemental aligné avec la taxinomie de l'UE ; par conséquent, à la fin du mois de février 2023, 1,18 % du portefeuille du Fonds était composé d'investissements ayant un objectif environnemental non aligné avec la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

0 % des investissements du Fonds n'ont été consacrés à des investissements socialement durables.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 6,25 % et comprenait les liquidités conservées en dépôt ou dans des instruments dérivés utilisés en couverture, non soumises à un objectif social ou environnemental minimum.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

1. Le Fonds s'engage à exclure les émetteurs du décile le moins bien noté de l'univers d'investissement. De ce fait, les désinvestissements suivants ont été effectués : Hercules Capital, Weibo Corp, Meta Platforms.
2. Le Fonds considère les émetteurs se situant dans l'avant-dernier décile comme des candidats à l'engagement. De ce fait, nous avons engagé le dialogue avec les émetteurs suivants : Carnival Cruise Corp., Dish Network Corp., Taseko Mines Ltd., Owl Rock Capital Corporation et le Brésil.
3. Jusqu'à 80 % des investissements ont fait l'objet d'un suivi et d'une surveillance, visant à détecter une dégradation ou une amélioration des facteurs environnementaux et sociaux.
4. Le Fonds a investi au moins 1 % de ses actifs nets dans des investissements durables ayant des objectifs environnementaux/sociaux, comme indiqué ci-dessus.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Non applicable

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund

LEI de l'entité : 254900QDA77XG4LVMI92



FRANKLIN TEMPLETON

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ ☐ OUI

☐ Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ____%

☒ ☒ NON

☒ Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 18,30% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Fonds privilégiait les caractéristiques environnementales et/ou sociales suivantes :

Sur le plan environnemental :

- Atténuation du changement climatique ;
- Adaptation au changement climatique ;
- Eau ; et
- Biodiversité.

Sur le plan social :

- Actions.

Les émetteurs classés dans les 10 % les moins bien notés (le décile inférieur) ont été exclus de l'univers d'investissement au cours de la période sous revue.

Les émetteurs classés dans la fourchette de notation de 10 % à 20 % (l'avant-dernier décile) n'ont pas été exclus, mais ont été traités comme des candidats à l'engagement au cours de la période sous revue.

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Fonds.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales ou sociales privilégiées par le Fonds étaient les suivants :

A. Alignement des données d'entrée spécifiques des méthodes de notation ESG retenues par le gestionnaire de portefeuille avec les caractéristiques sociales et environnementales privilégiées par le Fonds ; Ces contributions ont découlé de :

1. L'application des exclusions ESG.

Le Fonds s'engage à exclure les émetteurs du décile le moins bien noté de l'univers d'investissement. Aucun désinvestissement n'a été effectué car aucune valeur détenue n'est passée dans le décile inférieur. Le décile inférieur est resté exclu.

2. Le Fonds considère les émetteurs se situant dans l'avant-dernier décile comme des candidats à l'engagement. De ce fait, nous avons engagé le dialogue avec les émetteurs suivants : Taseko Mines Ltd., Owl Rock Capital Corporation et le Brésil.

B. Suivi des indicateurs des principales incidences négatives obligatoires (PIN). Veuillez vous reporter aux valeurs affichées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? »

C. En outre, le gestionnaire d'investissement a mesuré la part du portefeuille alignée sur les indicateurs clés de performance (ICP) de durabilité pertinents pour les émetteurs, comme indiqué dans le tableau suivant :

Nom de l'ICP de durabilité	Valeur
Émissions de CO2 de Scope 1 -> inférieures	1,21%
Électricité utilisée -> inférieure	1,22%
Énergie par unité de production -> inférieure	2,38%
Implémentation / Politique de rémunération équitable (O/N)	0,95%
Implémentation / Répartition des écarts de rémunération entre hommes et femmes (O/N)	2,33%
Émissions de GES en fonction du CA -> inférieures	11,16%
Émissions de GES par véhicule -> inférieures	1,25%
Émissions de GES de scope 1 -> inférieures	9,44%
Émissions de GES de scope 3 -> inférieures	1,99%
Implémentation / Politique en matière de droits de l'homme (O/N)	0,76%
Investissements dans la durabilité -> supérieurs	2,30%
Écarts, en %, des rémunérations des employés, y compris la direction -> inférieurs	1,24%
% du management issu de minorités -> supérieur	0,97%
% de matériaux recyclés -> supérieur	1,00%
Implementation / Politique en matière de lutte contre le travail des enfants (O/N)	0,78%
Utilisation d'énergies renouvelables -> supérieure	4,15%
Actifs ESG durables sous gestion -> supérieur	2,57%
Score des prêts ESG durables sur le terrain -> supérieur	1,32%
Consommation totale d'eau -> inférieure	0,97%
Déchets recyclés -> supérieurs	1,01%
Implémentation / Politique de gestion de l'eau (O/N)	0,75%

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Le Fonds a investi au moins 15 % de ses actifs nets dans des obligations vertes/sociales/durables/liées à la durabilité qui sont des investissements durables, ainsi que dans certains émetteurs identifiés comme des investissements durables par le gestionnaire. Le Fonds a investi uniquement dans des obligations dont l'utilisation des produits a été définie par l'émetteur (et vérifiée par un tiers ou par le gestionnaire de portefeuille), et qui soutenaient des projets environnementaux et sociaux, notamment :

- Sur le plan environnemental :
 - Atténuation du changement climatique
 - Adaptation au changement climatique
 - Conservation de l'eau
 - Conservation/utilisation/recyclage
 - Suivi et protection de la biodiversité

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Dans l'évaluation du principe consistant à ne pas causer de préjudice important (« DNSH », pour « do no significant harm »), le gestionnaire de portefeuille s'est appuyé sur une combinaison de recherches fondamentales, d'analyses de marché, de revues de presse, d'indicateurs PIN et de données de performances ESG fournis par des tiers. S'agissant des investissements durables dans les titres d'entreprises, le gestionnaire de portefeuille a évalué la conformité de l'entreprise émettrice au principe DNSH. S'agissant des investissements durables dans des obligations souveraines ou d'organismes supranationaux (dans l'éventualité où la mission de ces organismes ne garantit pas la durabilité de toutes leurs activités ou tous les projets financés), le gestionnaire de portefeuille a évalué la conformité de l'utilisation des produits au principe DNSH.

Le gestionnaire de portefeuille a analysé les éventuelles sanctions publiques répertoriées par des tiers relatives aux manquements aux principes du Pacte mondial des Nations unies, ainsi que les mesures et indicateurs clés de performance (ICP) liés aux PIN obligatoires, tant pour les entreprises que pour les États.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Les PIN obligatoires pour les obligations souveraines et les obligations d'entreprises ont été suivies, mesurées et rapportées. Le gestionnaire de portefeuille a également exploité les évolutions des PIN et des ICP associés pour évaluer les opportunités d'amélioration et d'impact, ce qui a permis de déterminer les investissements et la taille des positions.

Les PIN obligatoires ont été prises en compte dans le cadre de l'identification des investissements durables ou lorsque des améliorations du profil de durabilité étaient nécessaires. À l'exception des PIN 10 (violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales) et 14 (exposition à des armes controversées), les indicateurs PIN ont été utilisés comme ICP pour suivre et contrôler les progrès des émetteurs bénéficiaires d'investissements, comme décrits plus loin dans cette annexe. La détérioration ou l'absence d'amélioration des indicateurs PIN entraîne systématiquement l'ouverture de discussions et, si nécessaire, le désinvestissement et/ou l'exclusion de l'univers d'investissement.

Les entreprises qui n'ont pas passé le filtrage relatif aux PIN 10 ou 14, ainsi que les États en violation des normes sociales (PIN 16), ont été exclus de l'univers d'investissement.

Le Gestionnaire de portefeuille a fondé ses décisions d'investissement sur des seuils DNSH définis pour les fondamentaux, les secteurs, les pays. Des PNI facultatifs et des données liées à la taxinomie de l'UE ont été inclus dans l'évaluation DNSH au fur et à mesure que ces paramètres devenaient disponibles avec une couverture adéquate.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le gestionnaire de portefeuille a effectué un suivi des infractions et dérogations aux principes de l'OCDE/UNGC (signalés automatiquement par des tiers) ; les entreprises déficientes ont été exclues du portefeuille et de l'univers de placement.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les PIN obligatoires pour les obligations souveraines et les obligations d'entreprises ont été suivies, mesurées et rapportées.

Le Gestionnaire de portefeuille a fondé ses décisions d'investissement sur des seuils DNSH définis pour les fondamentaux, les secteurs, les pays.

Les PIN obligatoires n'ont pas forcément été intégrées dans les notations ESG exclusives de ce Fonds. Toutefois, le gestionnaire d'investissement a assuré le suivi et la surveillance de ces incidences.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Émissions de GES : Scope 1 en USD	736,47	66,42%
Émissions de GES : Scope 2 en USD	141,25	66,42%
Émissions de GES : Scope 3 en USD	4 911,81	66,42%
Émissions de GES : Émissions totales en USD	5 789,53	66,42%
Empreinte carbone en USD	600,19	66,42%
Intensité des GES en USD	1 311,56	72,02%
Exposition à des entreprises actives dans le secteur des combustibles fossiles.	6,82%	68,33%
Part de la consommation et de la production d'énergie non renouvelable	69,14%	36,63%
Intensité de consommation énergétique : Agriculture en USD	0,00	35,55%
Intensité de consommation énergétique : Industrie minière en USD	2,22	35,55%
Intensité de consommation énergétique : Secteur manufacturier en USD	0,27	35,55%
Intensité de consommation énergétique : Électricité en USD	6,02	35,55%
Intensité de consommation énergétique : Eau en USD	0,00	35,55%
Intensité de consommation énergétique : Construction en USD	0,00	35,55%
Intensité de consommation énergétique : Négoce et véhicules en USD	0,08	35,55%
Intensité de consommation énergétique : Transports et entreposage en USD	1,68	35,55%
Intensité de consommation énergétique : Immobilier en USD	0,00	35,55%
Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité	0,00%	68,33%
Rejets dans l'eau en USD	0,23	1,03%
Déchets dangereux en USD	0,79	16,57%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	70,21%
Processus et mécanismes de conformité déficients pour garantir le respect des principes du Pacte mondial des Nations Unies (UNGC) et les principes directeurs de l'Organisation de coopération et de développement économiques (OCDE) à l'intention des entreprises multinationales.	47,75%	67,29%
Écart de rémunération non ajusté entre hommes et femmes	24,63%	8,16%
Mixité du conseil d'administration	33,83%	65,83%
Exposition à des armes controversées	0,00%	68,33%
Intensité GES des pays en portefeuille en USD	369,41	12,58%
Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales	0,00	12,58%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
STACR 2022-HQA2 M1B FLT 07/25/42 144A	TITRES HYPOTHÉCAIRES	4,14%	États-Unis
CAS 2022-R01 1M2 FLT 12/25/41 144A	TITRES HYPOTHÉCAIRES	3,90%	États-Unis
STACR 2021-DNA7 M2 FLT 11/25/41 144A	TITRES HYPOTHÉCAIRES	3,86%	États-Unis
BRAZIL NTN-F 10% 01/01/33	ÉTAT	2,42%	Brésil
FNCL MA4733 4.5% 09/01/52	TITRES HYPOTHÉCAIRES	2,27%	États-Unis
DEUTSCHLAND REP 1.7% 08/15/32	ÉTAT	2,25%	Allemagne
FRANCE O.A.T. 0% 05/25/32	ÉTAT	2,20%	France
CAS 2022-R04 1M1 FLT 03/25/42 144A	TITRES HYPOTHÉCAIRES	1,75%	États-Unis
FNCL SD8245 4.5% 09/01/52	TITRES HYPOTHÉCAIRES	1,62%	États-Unis
BTPS 2.5% 12/01/32	ÉTAT	1,46%	Italie
AES PANAMA GENER 4.375% 05/31/30	SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	1,43%	Panama
FIRST QUANTUM 6.875% 10/15/27 144A	MATÉRIAUX DE BASE	1,42%	Canada
VAR ENERGI ASA 7.5% 01/15/28 144A	ÉNERGIE	1,41%	Norvège
XP INC 3.25% 07/01/26 144A	FINANCE	1,41%	Brésil
KENBOURNE INVEST 6.875% 11/26/24	COMMUNICATIONS	1,40%	Luxembourg

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

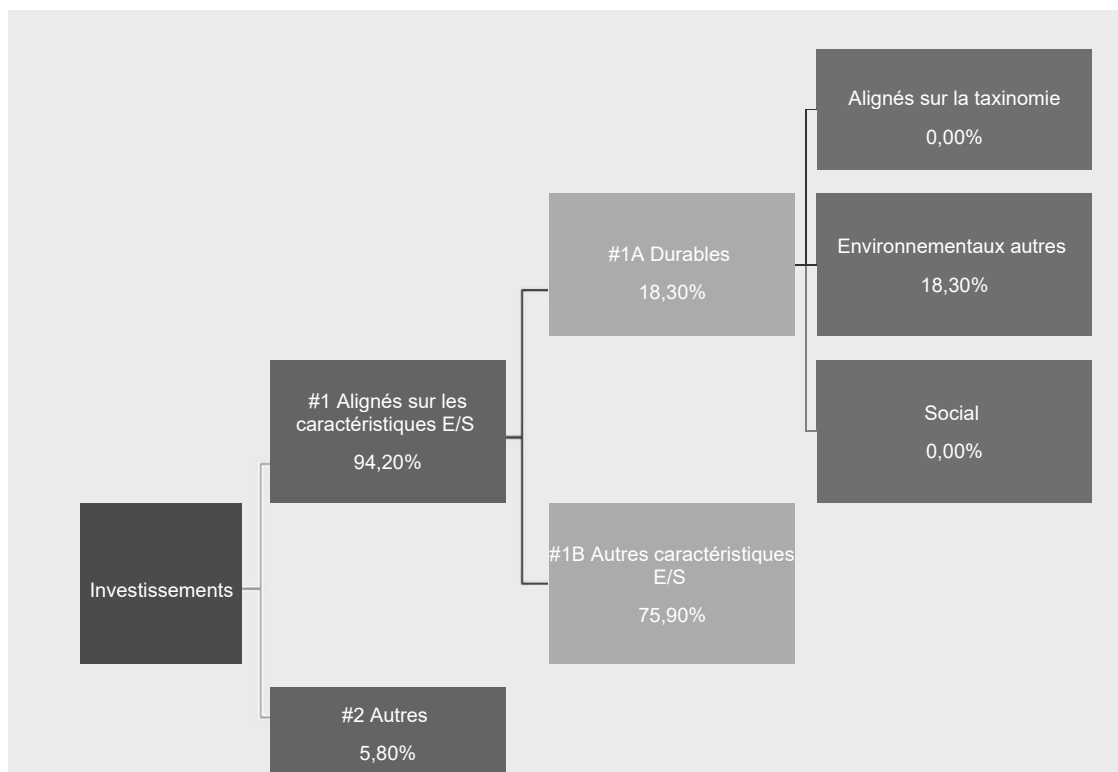
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 18,30 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

94,20 % du portefeuille étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La proportion restante (5,80 %), non alignée sur les caractéristiques privilégiées, se composait principalement d'actifs liquides.

En plus du segment aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales privilégiées, le Fonds a investi 18,30 % de son portefeuille dans des placements durables.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
TITRES HYPOTHÉCAIRES	18,64%
ÉTAT	16,61%
FINANCE	14,89%
ÉNERGIE	11,63%
BIENS DE CONSOMMATION CYCLIQUES	8,06%
INDUSTRIE	6,20%
BIENS DE CONSOMMATION NON CYCLIQUES	5,46%
MATÉRIAUX DE BASE	3,52%
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	3,47%
COMMUNICATIONS	3,45%
TECHNOLOGIE	2,27%
Dérivés	-1,41%

Principal sous-secteur	% d'actifs
SOUVERAINS	12,67%
WL COLLAT CMO MEZZANINE	9,79%
SECTEUR BANCAIRE INSTIT DIVERSIFIÉ	7,63%
CIES PÉTROLIÈRES-EXPLOR&PROD	7,35%
AUTOMOBILES/UTILITAIRES LÉGERS	5,89%
UMBS LOGEMENTS MONOPARENTAUX 30ANS	4,99%
BANQUE SUPRANATIONALE	3,95%
WL COLLAT CMO SUBORDONNÉE	3,86%
ENTREPRISES D'INVESTISSEMENT	2,80%
MÉTAL-CUIVRE	2,51%
ALIMENTATION-VIANDE	2,39%
COMPAGNIES AÉRIENNES	2,17%
CONTENANTS-PAPIER/PLASTIQUE	2,09%
TÉLÉPHONIE-INTÉGRÉE	2,05%
MÉDICAL-HÔPITAUX	2,01%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

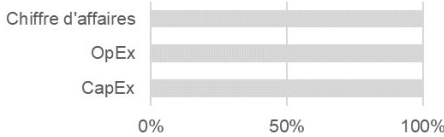
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

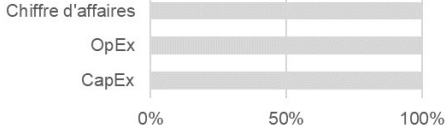
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Non applicable



Le symbole représente des investissements durables ayant

un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

En raison de sa stratégie d'investissement, le Fonds n'a pas réalisé d'investissements durables ayant un objectif environnemental aligné avec la taxinomie de l'UE ; par conséquent, à la fin de la période de référence, 18,30 % du portefeuille du Fonds était composé d'investissements ayant un objectif environnemental non aligné avec la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

0 % des investissements du Fonds n'ont été consacrés à des investissements socialement durables.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 5,80 % et comprenait les liquidités conservées en dépôt ou dans des instruments dérivés utilisés en couverture, non soumises à un objectif social ou environnemental minimum.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

1. Le Fonds s'est engagé à exclure les émetteurs du décile le moins bien noté de l'univers d'investissement. Aucun désinvestissement n'a été effectué car aucune valeur détenue n'est passée dans le décile inférieur. Le décile inférieur est resté exclu.
2. Le Fonds considère les émetteurs se situant dans l'avant-dernier décile comme des candidats à l'engagement. De ce fait, nous avons engagé le dialogue avec les émetteurs suivants : Taseko Mines Ltd., Owl Rock Capital Corporation et le Brésil.
3. Une proportion minimale de 90 % des émissions de dette et/ou des émissions liées à des dettes a fait l'objet d'un suivi et d'une surveillance, visant à détecter une dégradation ou une amélioration des facteurs environnementaux et sociaux.
4. Le Fonds a investi au moins 15 % de ses actifs nets dans des investissements durables ayant des objectifs environnementaux/sociaux, comme indiqué ci-dessus.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Non applicable



Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ ☐ OUI

☐ Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ____%

☒ ☒ NON

☒ Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 29,00% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Pour sélectionner les titres du compartiment dans la période sous rubrique, le gestionnaire de portefeuille a utilisé un processus de recherche et d'engagement exclusif qui visait à déterminer le profil de la société sur le plan environnemental, social et de gouvernance (ESG). Ce processus exclusif a généré un système d'évaluation ESG utilisant une cartographie de matérialité pour identifier les caractéristiques ESG spécifiques de l'investissement.

Les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds sont les suivantes :

- Les facteurs environnementaux tels que les pratiques environnementales d'une entreprise, les émissions de gaz à effet de serre (GES) et les initiatives en matière d'efficacité énergétique ;
- Les facteurs sociaux tels que l'approche des relations avec les communautés, la santé et sécurité au travail, la fiabilité et le prix des services

Parmi ses investissements, le Fonds a respecté son engagement de 5 % minimum d'« investissement durable ».

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales ou sociales privilégiées par le Fonds étaient les suivants :

- tous les indicateurs de principales incidences négatives (PIN) significatives pour la société notée, particulièrement la PIN #1 (émissions de GES), la PIN #2 (empreinte carbone), la PIN #3 (intensité de GES), la PIN #10 (violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et de l'OCDE), la PIN #13 (mixité du conseil d'administration) et la PIN #14 (exposition aux armes controversées). Veuillez vous référer aux valeurs indiquées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ;
- le pourcentage du portefeuille noté B selon la notation ESG exclusive du gestionnaire de portefeuille qui était égal à 0 %
- les méthodologies exclusives pour évaluer l'avancement des réunions d'engagement ESG du Gestionnaire d'investissement. ClearBridge a mené des engagements ESG périodiques avec les sociétés de son portefeuille. Les opinions de l'équipe d'investissement sur les progrès discutés lors de ces réunions ont été reprises dans leurs propres notations ESG, leurs décisions de vote par procuration et leurs décisions d'investissement.
- Le fonds est considéré comme faisant partie du champ d'application de l'objectif Net Zero de ClearBridge et a été mesuré par rapport à la proportion d'entreprises qui ont fixé, ou qui se sont engagées à fixer, des objectifs scientifiques de réduction des émissions de gaz à effet de serre.

Nom de l'ICP de durabilité	Valeur
Alignées sur la neutralité carbone	20,65%
Engagées à fixer un objectif aligné sur la neutralité	16,06%

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Les investissements durables réalisés par le Fonds étaient des titres de participation émis par des sociétés qui contribuaient à l'un des objectifs suivants ou aux deux :

- Par le biais de leurs produits et services, à un ou plusieurs des objectifs environnementaux ou sociaux des objectifs de développement durables (ODD) et à leurs cibles et indicateurs sous-jacents déterminés par l'évaluation de la contribution du gestionnaire de portefeuille ; 22 % du portefeuille
- à des objectifs de réduction de l'intensité des GES et des émissions dans l'ensemble des activités économiques d'une entreprise, déterminés par un objectif de décarbonation contrôlé par un tiers et conforme à l'Accord de Paris. Dans le cadre de notre processus d'engagement, les progrès réalisés par les émetteurs ont fait l'objet d'un suivi par rapport aux objectifs. 20 % du portefeuille

En plus de contribuer à l'un des objectifs environnementaux ou sociaux énumérés ci-dessus, les entreprises ont été évaluées au moyen d'un filtre exclusif de bonne gouvernance et ont satisfait au principe de « ne pas causer de préjudice important », comme détaillé ci-dessous.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé une combinaison de scores de risque grave de controverse obtenus par des tiers, de vérifications basées sur des normes mondiales, y compris le respect du Pacte mondial des Nations unies, la prise en compte des principales incidences négatives* et d'autres facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance importants, qui ont été intégrés dans la recherche fondamentale du gestionnaire de portefeuille et dans son processus exclusif de notation ESG. Ce dernier comprenait une évaluation de la qualité de la gouvernance, afin de déterminer si les investissements portaient un préjudice important à un objectif d'investissement durable.

En outre, le gestionnaire de portefeuille utilise son processus d'engagement pour identifier les meilleurs titres de leur catégorie.

* Les PIN prises en compte ont été déterminées par la matérialité ESG par sous-secteur, évaluée par le gestionnaire de portefeuille via sa méthodologie exclusive au cours de son processus de notation ESG, ou à l'aide des données disponibles.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Toutes les PIN significatives pour la société évaluée ont été prises en compte dans l'évaluation ESG du gestionnaire de portefeuille appliquée dans le cadre du processus de sélection des titres, notamment :

La manière dont les PIN ont été prises en compte est exposée plus en détail ci-dessous.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

=====

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le gestionnaire de portefeuille soutient les principes du Pacte mondial des Nations unies. Par conséquent, le Fonds n'a pas investi dans des sociétés qui violaient l'un des dix principes dans chacun des quatre domaines (droits de l'homme, travail, environnement et lutte contre la corruption) du pacte.

Le gestionnaire de portefeuille a fait appel à un fournisseur de données tiers qui contrôlait le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies. En cas de divergence ou de désaccord entre les recherches du gestionnaire de portefeuille et l'évaluation d'une controverse spécifique par le prestataire, le gestionnaire de portefeuille, les membres de l'équipe chargée de la conformité et l'analyste sectoriel ou de portefeuille engageaient un dialogue avec l'entreprise sur la question. Si le gestionnaire de portefeuille parvenait à un consensus sur le fait que l'entreprise avait pris les mesures nécessaires pour répondre à la controverse, ou qu'elle avait effectivement remédié au problème, il devait fournir une explication détaillée des raisons pour lesquelles l'entreprise pouvait continuer à faire l'objet d'un investissement.

Pour s'assurer que les investissements durables étaient conformes aux lignes directrices de l'OCDE, le gestionnaire de portefeuille a fait appel à un prestataire externe afin de contrôler la conformité et les violations potentielles.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Toutes les PIN significatives pour la société évaluée étaient prises en compte dans l'évaluation ESG du gestionnaire de portefeuille appliquée dans le cadre du processus de sélection des titres, notamment :

PAI 1 (Émissions de GES), PAI 2 (Empreinte carbone), PAI 3 (Intensité des GES)

Le gestionnaire de portefeuille a évalué les risques et opportunités spécifiques liés au climat auxquels sont confrontées les entreprises individuelles dans le cadre de son processus de sélection des titres, qui a tenu compte de ces considérations, parmi d'autres considérations environnementales, sociales et de gouvernance.

Bien que le gestionnaire ait évalué chaque secteur sur la base d'un ensemble spécifique de critères pertinents pour ses activités commerciales, l'évaluation comprenait généralement un examen minutieux des facteurs liés au climat, tels que : le contexte réglementaire/politique ; l'emplacement géographique des actifs et des opérations ; la capacité à répercuter les coûts sur les clients ; les alternatives et les avancées technologiques ; l'évolution des préférences des clients ; les prix des matières premières ; les futures dépenses d'investissement et les plans de R&D ; la stratégie commerciale à long terme ; la qualité globale de l'équipe de direction ; et d'autres facteurs ;

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé l'outil MSCI Carbon Portfolio Analytics pour évaluer l'exposition aux entreprises possédant des réserves de combustibles fossiles. Le gestionnaire de portefeuille a effectué une analyse de l'intensité carbone sur l'ensemble des investissements de l'entreprise afin de comprendre l'intensité carbone des actifs totaux de l'entreprise par rapport aux marchés boursiers mondiaux. Le gestionnaire de portefeuille a également effectué une analyse de l'intensité carbone au niveau du portefeuille.

PIN #10 (violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales)

Veuillez consulter la rubrique « Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? »

PIN #13 (mixité au sein des organes de gouvernance)

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé des données provenant de tiers pour le suivi de la mixité au sein des conseils d'administration. En outre, le gestionnaire de portefeuille a prévu dans sa politique de vote par procuration de voter contre la nomination des membres et du président si le conseil d'administration de l'entreprise ne compte pas au moins une femme. La diversité, l'égalité et l'inclusion étaient aussi des composantes de l'analyse et de la notation ESG du gestionnaire de portefeuille, qui prévoyait également un engagement de l'ensemble de l'entreprise sur un thème.

PIN #14 (exposition à des armes controversées)

Le compartiment n'a investi dans aucune société qui génère du chiffre d'affaires dans les domaines suivants : (a) armes prohibées conformément (i) à la Convention sur l'interdiction de l'emploi, du stockage, de la production et du transfert des mines antipersonnel et sur leur destruction et (ii) à la Convention sur l'interdiction des armes à sous-munitions, et (b) armes de catégorie B ou C conformément à la Convention des Nations Unies sur l'interdiction des armes biologiques et à la Convention des Nations Unies sur l'interdiction des armes chimiques, respectivement.

Les chiffres relatifs aux Principales Incidences Négatives ci-dessous datent du 31 décembre 2022.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Émissions de GES : Émissions totales en USD	747 211,99	96,45%
Empreinte carbone en USD	877,12	96,45%
Intensité des GES en USD	1 977,90	98,96%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	98,96%
Mixité du conseil d'administration	34,34%	94,40%
Exposition à des armes controversées	0,00%	94,40%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
WELLS FARGO & CO	Secteur financier	3,23%	États-Unis
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC	Secteur financier	3,15%	États-Unis
BANK OF AMERICA CORP	Secteur financier	3,12%	États-Unis
EQT CORP	Énergie	3,05%	États-Unis
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	Énergie	2,90%	États-Unis
UNITEDHEALTH GROUP INC	Santé	2,58%	États-Unis
META PLATFORMS INC	Services de communication	2,53%	États-Unis
FREEMPORT-MCMORAN INC	Matériaux	2,43%	États-Unis
ORACLE CORP	Technologies de l'information	2,32%	États-Unis
PFIZER INC	Santé	2,28%	États-Unis
ABBVIE INC	Santé	2,25%	États-Unis
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	Services aux collectivités	2,24%	États-Unis
AES CORP/THE	Services aux collectivités	2,23%	États-Unis
ENBRIDGE INC	Énergie	2,15%	Canada
CIGNA CORP	Santé	2,14%	États-Unis

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

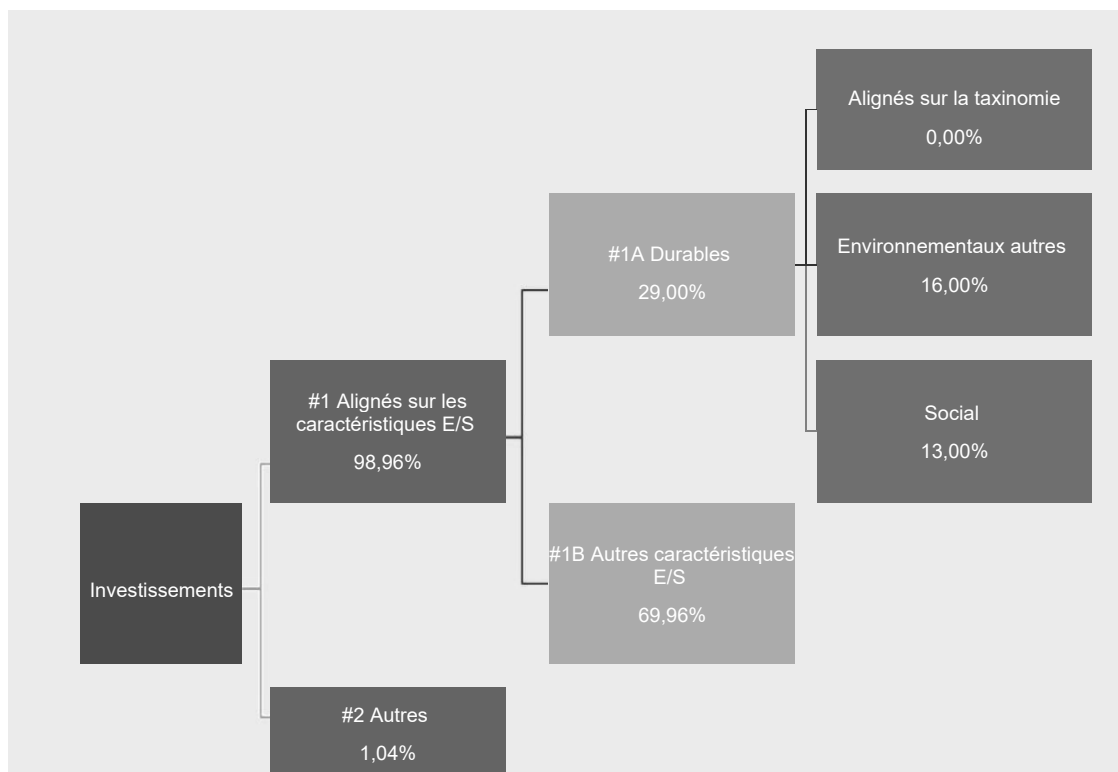
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 29,00 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

98,96 % du portefeuille du Fonds sont alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (1,98 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides.

Le Fonds a investi dans des placements durables 29,00 % du segment de son portefeuille qui est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Secteur financier	20,43%
Santé	17,74%
Énergie	17,48%
Services aux collectivités	7,67%
Industrie	7,59%
Matériaux	7,15%
Technologies de l'information	6,94%
Biens de consommation discrétionnaire	4,83%
Services de communication	4,63%
Biens de consommation courante	3,66%
commercial	0,84%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Pétrole, gaz et combustibles	11,73%
Banques	9,11%
Biotechnologie	6,53%
Prestataires et services de soins de santé	5,94%
Équipements et services énergétiques	5,74%
Métaux et exploitations minières	5,34%
Assurances	4,33%
Producteurs indépendants d'énergie et d'électricité renouvelable	4,11%
Hôtels, restaurants et loisirs	3,81%
Logiciels	3,56%
Services publics d'électricité	3,55%
Produits pharmaceutiques	3,28%
Marchés financiers	3,16%
Médias et services interactifs	2,95%
Produits personnels	2,39%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

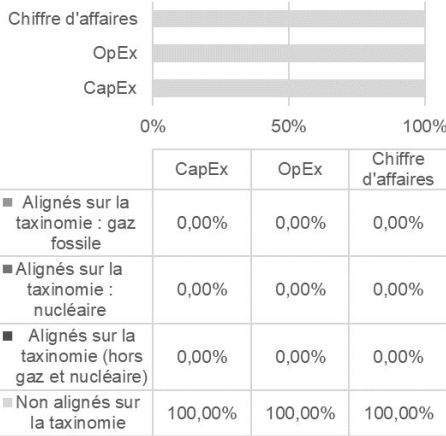
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

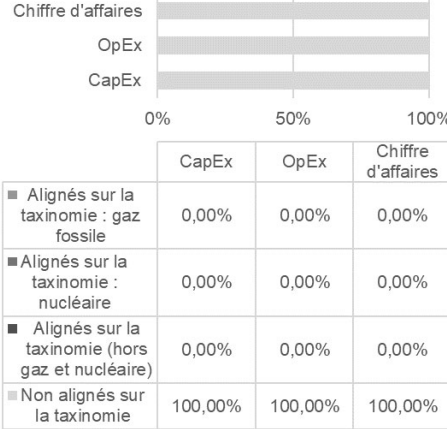
- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes telles que définies à l'article 16 et à l'article 10, paragraphe 2, du règlement de l'UE relatif à la taxonomie.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxonomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Non applicable

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxonomie de l'UE ?

En raison de sa stratégie d'investissement, le Fonds n'a pas réalisé d'investissements durables ayant un objectif environnemental aligné avec la taxonomie de l'UE et, par conséquent, à fin février 2023, 16,00 % du portefeuille du Fonds était composé d'investissements ayant un objectif environnemental non aligné avec la taxonomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

La proportion d'investissements durables sur le plan social s'établissait à 13,00 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 1,04 % et comprenait les liquidités conservées en dépôt ou dans des instruments dérivés utilisés en couverture, non soumises à un objectif social ou environnemental minimum.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

1. Le gestionnaire de portefeuille a utilisé son propre système de notation et sa recherche fondamentale pour déterminer comment une entreprise gérait ses risques et opportunités ESG, en incluant un critère de bonne gouvernance. Le système de notation comprenait quatre niveaux de notation : AAA, AA, A et B, ces notations étant attribuées aux entreprises sur la base de leur stratégie en matière de durabilité et de leurs performances sur les critères ESG. Toutes les entreprises du Fonds ont été évaluées. Au 31/12/2022, la répartition des notations pour ce Fonds était la suivante :

AAA : 13%

AA : 50%

R : 37%

B : 0%

2. Le gestionnaire de portefeuille a entretenu un dialogue permanent avec les entreprises de son portefeuille. L'engagement ESG de ClearBridge combinait généralement deux objectifs qui se recoupaient :

- Recherche : Mieux comprendre les questions ESG susceptibles de modifier notre thèse d'investissement
- L'impact : Encourager des changements spécifiques au sein de l'entreprise susceptibles d'avoir une incidence positive dans le monde réel.

De plus, le gestionnaire de portefeuille prenait un engagement direct avec les sociétés notées B qui faisaient l'objet d'un investissement, dans l'optique d'améliorer leurs caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance effectives.

Pour plus de détails sur notre approche de l'engagement, veuillez vous référer à notre politique d'engagement et de gestion qui se trouve à l'adresse suivante : <https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshipolicy.pdf>

3. Le Fonds n'a pas investi dans les seuils de revenus fixés repris dans le prospectus pour les secteurs suivants :

- Tabac
- Armes controversées

4. Le Fonds n'a pas investi dans des entreprises qui violent un ou plusieurs des dix principes dans les quatre domaines couverts par l'UNGC (droits de l'homme, normes internationales du travail, environnement et lutte contre la corruption).



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Non applicable

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

LEI de l'entité : 549300SQ18HYQNNQ20536



FRANKLIN TEMPLETON

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ ☐ OUI

☐ Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ____%

☒ ☒ NON

☒ Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 59,00% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Pour sélectionner les titres du compartiment dans la période sous rubrique, le gestionnaire de portefeuille utilisait un processus de recherche et d'engagement exclusif qui visait à déterminer le profil de la société sur le plan environnemental, social et de gouvernance (ESG). Ce processus exclusif a généré un système d'évaluation ESG utilisant une cartographie de matérialité pour identifier les caractéristiques ESG spécifiques de l'investissement. Les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds étaient des problématiques ESG essentielles jugées importantes pour l'entreprise en question et le secteur dans lequel elle opère, qui incluaient, sans s'y limiter, la santé et la sécurité, la mixité, le risque climatique, le risque de gouvernance d'entreprise et la sécurité des données.

En outre, le Fonds a respecté son engagement de 5 % minimum d'« investissement durable ».

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales ou sociales privilégiées par le Fonds étaient les suivants :

- la proportion du Fonds détenue dans des investissements durables tels que définis par la méthodologie exclusive du gestionnaire de portefeuille en matière d'investissements durables, qui comprend l'alignement des produits et/ou des services sur les objectifs de développement durable des Nations unies (ODD), qui était de 41 %, et la prise en compte de l'approche « ne pas causer de préjudice important » (Do No Significant Harm - DNSH) ;
- les indicateurs spécifiques des principales incidences négatives (PAI, pour Principal Adverse Impact), à savoir : La PIN 1 (émissions de GES), la PIN 2 (empreinte carbone), la PIN 3 (intensité des GES), la PIN 10 (violations des principes directeurs du Pacte mondial des Nations unies et de l'OCDE), la PIN 13 (mixité au sein des organes de gouvernance) et la PIN 14 (exposition à des armes controversées) ; Veuillez vous référer aux valeurs indiquées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ;
- les méthodologies exclusives pour évaluer l'avancement des réunions d'engagement ESG du Gestionnaire d'investissement. ClearBridge a mené des engagements ESG périodiques avec les sociétés de son portefeuille. Les opinions de l'équipe d'investissement sur les progrès discutés lors de ces réunions ont été reprises dans leurs propres notations ESG, leurs décisions de vote par procuration et leurs décisions d'investissement.
- l'exposition du portefeuille aux entreprises les meilleures de leur catégorie, selon la notation ESG exclusive du Gestionnaire de portefeuille. Au 31/12/2022, la répartition des notations pour ce fonds était la suivante :
 - AAA : 42%
 - AA : 41%
 - R : 17%
 - B : 0%

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Les investissements durables réalisés par le Fonds étaient des titres de participation émis par des sociétés qui contribuaient à au moins l'un des objectifs suivants ou aux deux :

- Par le biais de leurs produits et services, à un ou plusieurs des objectifs environnementaux ou sociaux des ODD et à leurs cibles et indicateurs sous-jacents déterminés par l'évaluation de la contribution du gestionnaire de portefeuille ; 41 % du portefeuille
- à des objectifs de réduction de l'intensité des GES et des émissions dans l'ensemble des activités économiques d'une entreprise, déterminés par un objectif de décarbonation contrôlé par un tiers et conforme à l'Accord de Paris. Dans le cadre de notre processus d'engagement, les progrès réalisés par les émetteurs font l'objet d'un suivi par rapport aux objectifs. 45 % du portefeuille

En plus de contribuer à l'un des objectifs environnementaux ou sociaux énumérés ci-dessus, les entreprises ont été évaluées au moyen d'un filtre exclusif de bonne gouvernance et ont satisfait au principe de « ne pas causer de préjudice important », comme détaillé ci-dessous.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé une combinaison de scores de risque grave de controverse obtenus par des tiers, de vérifications basées sur des normes mondiales, y compris le respect du Pacte mondial des Nations unies, la prise en compte des principales incidences négatives* et d'autres facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance importants, qui ont été intégrés dans la recherche fondamentale du gestionnaire de portefeuille et dans son processus exclusif de notation ESG. Ce dernier comprenait une évaluation de la qualité de la gouvernance, afin de déterminer si les investissements portent un préjudice important à un objectif d'investissement durable.

En outre, le gestionnaire de portefeuille utilise son processus d'engagement pour identifier les meilleurs titres de leur catégorie.

* Les PIN prises en compte ont été déterminées par la matérialité ESG par sous-secteur, évaluée par le gestionnaire de portefeuille via sa méthodologie exclusive au cours de son processus de notation ESG, ou à l'aide des données disponibles.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Toutes les PIN significatives pour la société évaluée ont été prises en compte dans l'évaluation ESG du gestionnaire de portefeuille appliquée dans le cadre du processus de sélection des titres, notamment :

La manière dont les PIN ont été prises en compte est exposée plus en détail ci-dessous.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le gestionnaire de portefeuille soutient les principes du Pacte mondial des Nations unies. Par conséquent, le Fonds n'a pas investi dans des sociétés qui violaient l'un des dix principes dans chacun des quatre domaines (droits de l'homme, travail, environnement et lutte contre la corruption) du pacte.

Le gestionnaire de portefeuille a fait appel à un fournisseur de données tiers qui contrôlait le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies. En cas de divergence ou de désaccord entre les recherches du gestionnaire de portefeuille et l'évaluation d'une controverse spécifique par le prestataire, le gestionnaire de portefeuille, les membres de l'équipe chargée de la conformité et l'analyste sectoriel ou de portefeuille engageaient un dialogue avec l'entreprise sur la question. Si le gestionnaire de portefeuille parvenait à un consensus sur le fait que l'entreprise avait pris les mesures nécessaires pour répondre à la controverse, ou qu'elle avait effectivement remédié au problème, il devait fournir une explication détaillée des raisons pour lesquelles l'entreprise pouvait continuer à faire l'objet d'un investissement.

Pour s'assurer que les investissements durables étaient conformes aux lignes directrices de l'OCDE, le gestionnaire de portefeuille a fait appel à un prestataire externe afin de contrôler la conformité et les violations potentielles.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Toutes les PIN significatives pour la société évaluée étaient prises en compte dans l'évaluation ESG du gestionnaire de portefeuille appliquée dans le cadre du processus de sélection des titres, notamment :

PAI 1 (Émissions de GES), PAI 2 (Empreinte carbone), PAI 3 (Intensité des GES)

Le gestionnaire de portefeuille a évalué les risques et opportunités spécifiques liés au climat auxquels sont confrontées les entreprises individuelles dans le cadre de son processus de sélection des titres, qui a tenu compte de ces considérations, parmi d'autres considérations environnementales, sociales et de gouvernance.

Bien que le gestionnaire ait évalué chaque secteur sur la base d'un ensemble spécifique de critères pertinents pour ses activités commerciales, l'évaluation comprenait généralement un examen minutieux des facteurs liés au climat, tels que : le contexte réglementaire/politique ; l'emplacement géographique des actifs et des opérations ; la capacité à répercuter les coûts sur les clients ; les alternatives et les avancées technologiques ; l'évolution des préférences des clients ; les prix des matières premières ; les futures dépenses d'investissement et les plans de R&D ; la stratégie commerciale à long terme ; la qualité globale de l'équipe de direction ; et d'autres facteurs ;

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé l'outil MSCI Carbon Portfolio Analytics pour évaluer l'exposition aux entreprises possédant des réserves de combustibles fossiles. Le gestionnaire de portefeuille a effectué une analyse de l'intensité carbone sur l'ensemble des investissements de l'entreprise afin de comprendre l'intensité carbone des actifs totaux de l'entreprise par rapport aux marchés boursiers mondiaux. Le Gestionnaire de portefeuille peut également effectuer une analyse de l'intensité carbone au niveau du portefeuille.

PIN #10 (violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales)

Veuillez consulter la rubrique « Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? »

PIN #13 (mixité au sein des organes de gouvernance)

Le gestionnaire de portefeuille utilise des données provenant de tiers pour le suivi de la mixité au sein des conseils d'administration. En outre, le gestionnaire de portefeuille a prévu dans sa politique de vote par procuration de voter contre la nomination des membres et du président si le conseil d'administration de l'entreprise ne compte pas au moins une femme. La diversité, l'égalité et l'inclusion étaient aussi des composantes de l'analyse et de la notation ESG du gestionnaire de portefeuille, qui prévoyait également un engagement de l'ensemble de l'entreprise sur un thème.

PIN #14 (exposition à des armes controversées)

Le Compartiment n'a pas investi dans des sociétés qui réalisent une partie de leur chiffre d'affaires dans la production et/ou la distribution d'armes controversées (p. ex. : mines antipersonnel, armes nucléaires, armes chimiques ou biologiques, armes à sous-munitions, phosphore blanc).

Les chiffres relatifs aux Principales Incidences Négatives ci-dessous datent du 31 décembre 2022.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Émissions de GES : Émissions totales en USD	67 906,15	95,72%
Empreinte carbone en USD	381,67	95,72%
Intensité des GES en USD	886,78	95,72%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	95,72%
Mixité du conseil d'administration	35,65%	95,72%
Exposition à des armes controversées	0,00%	95,72%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
MICROSOFT CORP	Technologies de l'information	7,57%	États-Unis
APPLE INC	Technologies de l'information	6,05%	États-Unis
UNITEDHEALTH GROUP INC	Santé	3,54%	États-Unis
BERKSHIRE HATHAWAY INC	Secteur financier	3,36%	États-Unis
AMAZON.COM INC	Biens de consommation discrétionnaire	3,15%	États-Unis
JPMORGAN CHASE & CO	Secteur financier	2,74%	États-Unis
JOHNSON & JOHNSON	Santé	2,71%	États-Unis
VISA INC	Technologies de l'information	2,69%	États-Unis
TRAVELERS COS INC	Secteur financier	2,57%	États-Unis
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Santé	2,53%	États-Unis
ALPHABET INC	Services de communication	2,51%	États-Unis
MERCK & CO INC	Santé	2,49%	États-Unis
ALPHABET INC	Services de communication	2,44%	États-Unis
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	Industrie	2,44%	États-Unis
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	Technologies de l'information	2,06%	États-Unis

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

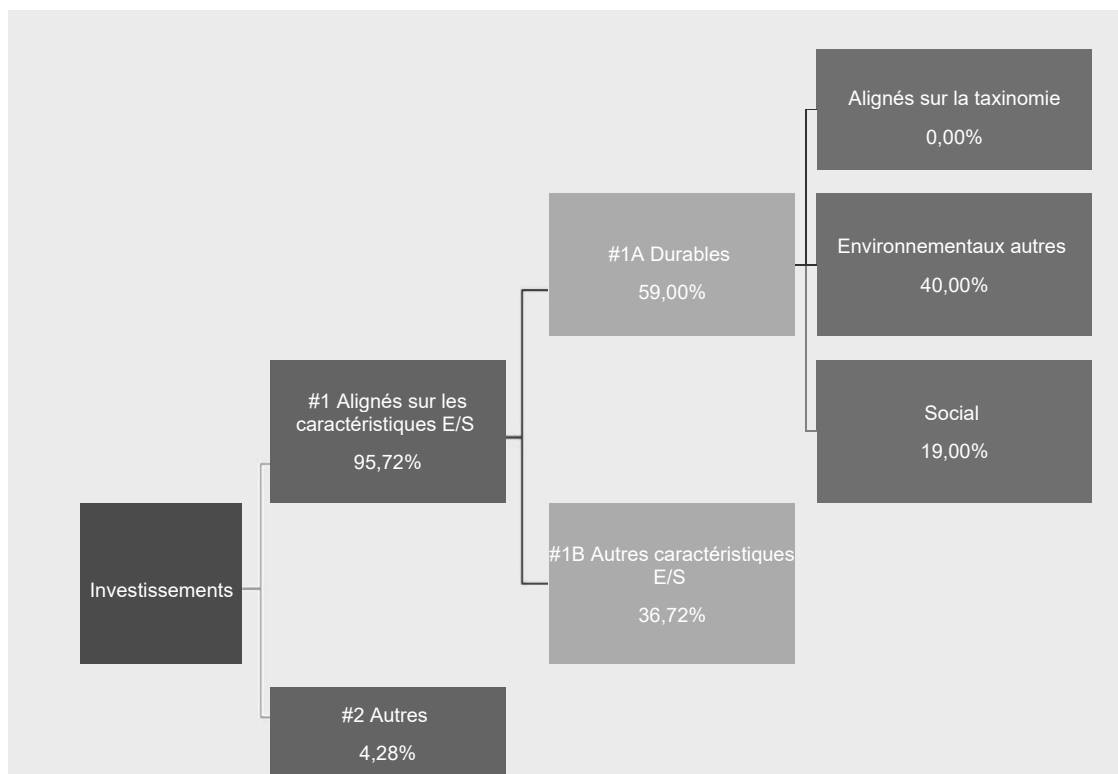
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 59,00 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

95,72 % du portefeuille du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (4,28 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides.

Le Fonds a investi dans des placements durables 59,00 % du segment de son portefeuille qui était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Technologies de l'information	21,54%
Santé	16,88%
Secteur financier	14,34%
Industrie	9,21%
Biens de consommation discrétionnaire	7,44%
Matériaux	7,30%
Biens de consommation courante	7,22%
Services de communication	7,11%
Énergie	2,39%
commercial	1,34%
Services aux collectivités	0,94%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Logiciels	9,19%
Produits pharmaceutiques	8,73%
Services informatiques	5,24%
Banques	5,08%
Chimie	4,89%
Matériel informatique, stockage et périphériques	4,86%
Assurances	4,35%
Distribution spécialisée	4,32%
Prestataires et services de soins de santé	3,64%
Services financiers	3,53%
Médias et services interactifs	3,21%
Boissons	3,07%
Conglomérats industriels	2,81%
Pétrole, gaz et combustibles	2,39%
Internet et marketing direct de détail	2,26%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

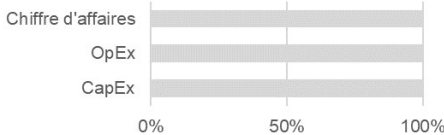
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

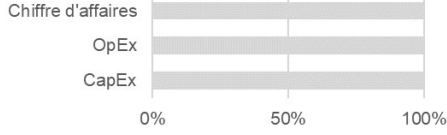
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes telles que définies à l'article 16 et à l'article 10, paragraphe 2, du règlement de l'UE relatif à la taxonomie.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxonomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Non applicable

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxonomie de l'UE ?

En raison de sa stratégie d'investissement, le Fonds n'a pas réalisé d'investissements durables ayant un objectif environnemental aligné avec la taxonomie de l'UE et, par conséquent, à fin février 2023, 40,00 % du portefeuille du Fonds était composé d'investissements ayant un objectif environnemental non aligné avec la taxonomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

La proportion d'investissements durables sur le plan social s'établissait à 19,00 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 4,28 % et comprenait les liquidités conservées en dépôt ou dans des instruments dérivés utilisés en couverture, non soumises à un objectif social ou environnemental minimum.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

1. Le Gestionnaire de portefeuille a utilisé son propre système de notation et sa recherche fondamentale pour déterminer comment une entreprise gérait ses risques et opportunités ESG, en incluant la bonne gouvernance. Le système de notation comprenait quatre niveaux de notation : AAA, AA, A et B, ces notations étant attribuées aux entreprises sur la base de leur stratégie en matière de durabilité et de leurs performances sur les critères ESG. Toutes les entreprises du Fonds ont été évaluées. Au 31/12/2022, la répartition des notations pour ce Fonds était la suivante :

AAA : 42%

AA : 41%

R : 17%

B : 0%

2. Le gestionnaire de portefeuille a entretenu un dialogue permanent avec les entreprises de son portefeuille. L'engagement ESG de ClearBridge combinait généralement deux objectifs qui se recoupaient :

- Recherche : Mieux comprendre les questions ESG susceptibles de modifier notre thèse d'investissement
- L'impact : Encourager des changements spécifiques au sein de l'entreprise susceptibles d'avoir une incidence positive dans le monde réel.

Pour plus de détails sur notre approche de l'engagement, veuillez vous référer à notre politique d'engagement et de gestion qui se trouve à l'adresse suivante : <https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshipolicy.pdf>

3. Le Fonds n'a pas investi dans les seuils de revenus fixés repris dans le prospectus pour les secteurs suivants :

- Tabac
- Armes controversées
- Jeux d'argent
- Divertissements pour adultes

4. Le Fonds n'a pas investi dans des entreprises qui violent un ou plusieurs des dix principes dans les quatre domaines couverts par l'UNGC (droits humains, normes internationales du travail, environnement et lutte contre la corruption)



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Non applicable

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund



FRANKLIN TEMPLETON

LEI de l'entité : 5493003YRBLHS9UVBW79

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

☐ ☐ **OUI**

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif environnemental** : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif social** : ____%

☒ ☒ **NON**

☒ Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 65,00% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Pour sélectionner les titres du compartiment dans la période sous rubrique, le gestionnaire de portefeuille utilisait un processus de recherche et d'engagement exclusif qui visait à déterminer le profil de la société sur le plan environnemental, social et de gouvernance (ESG). Ce processus exclusif a généré un système d'évaluation ESG utilisant une cartographie de matérialité pour identifier les caractéristiques ESG spécifiques de l'investissement. Les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds étaient des problématiques ESG essentielles jugées importantes pour l'entreprise en question et le secteur dans lequel elle opère, qui incluaient, sans s'y limiter, la santé et la sécurité, la mixité, le risque climatique, le risque de gouvernance d'entreprise et la sécurité des données.

En outre, le Fonds a respecté son engagement de 20 % minimum d'« investissement durable ».

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales ou sociales privilégiées par le Fonds étaient les suivants :

- la proportion du Fonds détenue dans des investissements durables tels que définis par la méthodologie exclusive du gestionnaire de portefeuille en matière d'investissements durables, qui comprend l'alignement des produits et/ou des services sur les objectifs de développement durable des Nations unies (ODD), qui était de 39 %, et la prise en compte de l'approche « ne pas causer de préjudice important » (Do No Significant Harm - DNSH) ;
- Les indicateurs spécifiques de principales incidences négatives (PIN) significatives pour la société notée, à savoir la PIN #1 (émissions de GES), la PIN #2 (empreinte carbone), la PIN #3 (intensité de GES), la PIN #10 (violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et de l'OCDE), la PIN #13 (mixité au sein des organes de gouvernance) et la PIN #14 (exposition aux armes controversées). Veuillez vous référer aux valeurs indiquées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ;
- des méthodologies exclusives pour évaluer les progrès des réunions d'engagement ESG du gestionnaire de portefeuille. ClearBridge a organisé des actions d'engagement ESG périodiques avec les sociétés de son portefeuille. Les opinions de l'équipe d'investissement sur les progrès discutés lors de ces réunions ont été reprises dans leurs propres notations ESG, leurs décisions de vote par procuration et leurs décisions d'investissement.
- l'exposition du portefeuille aux entreprises les meilleures de leur catégorie, selon la notation ESG exclusive du Gestionnaire de portefeuille. Au 31/12/2022, la répartition des notations pour ce Fonds était la suivante :
 - AAA : 48%
 - AA : 34%
 - R : 18%
 - B : 0%

Le Fonds est considéré comme faisant partie du champ d'application de l'objectif Net Zero de ClearBridge ; la proportion d'entreprises qui ont fixé, ou qui se sont engagées à fixer, des objectifs scientifiques de réduction des émissions de gaz à effet de serre, a donc été mesurée.

Nom de l'ICP de durabilité	Valeur
Alignées sur la neutralité carbone	44,24%
Engagées à fixer un objectif aligné sur la neutralité	23,62%

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Les investissements durables réalisés par le Fonds étaient des titres de participation émis par des sociétés qui contribuaient à au moins l'un des objectifs suivants ou aux deux :

- Par le biais de leurs produits et services, à un ou plusieurs des objectifs environnementaux ou sociaux des ODD et à leurs cibles et indicateurs sous-jacents déterminés par l'évaluation de la contribution du gestionnaire de portefeuille ; 39 % du portefeuille
- à des objectifs de réduction de l'intensité des GES et des émissions dans l'ensemble des activités économiques d'une entreprise, déterminés par un objectif de décarbonation contrôlé par un tiers et conforme à l'Accord de Paris. Dans le cadre de notre processus d'engagement, les progrès réalisés par les émetteurs ont fait l'objet d'un suivi par rapport aux objectifs. 44 % du portefeuille

En plus de contribuer à l'un des objectifs environnementaux ou sociaux énumérés ci-dessus, les entreprises ont été évaluées au moyen d'un filtre exclusif de bonne gouvernance et ont satisfait au principe de « ne pas causer de préjudice important », comme détaillé ci-dessous.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé une combinaison de scores de risque grave de controverse obtenus par des tiers, de vérifications basées sur des normes mondiales, y compris le respect du Pacte mondial des Nations unies, la prise en compte des principales incidences négatives* et d'autres facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance importants, qui ont été intégrés dans la recherche fondamentale du gestionnaire de portefeuille et dans son processus exclusif de notation ESG. Ce dernier comprenait une évaluation de la qualité de la gouvernance, afin de déterminer si les investissements portent un préjudice important à un objectif d'investissement durable.

En outre, le gestionnaire de portefeuille utilise son processus d'engagement pour identifier les meilleurs titres de leur catégorie.

* Les PIN prises en compte ont été déterminées par la matérialité ESG par sous-secteur, évaluée par le gestionnaire de portefeuille via sa méthodologie exclusive au cours de son processus de notation ESG, ou à l'aide des données disponibles.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Toutes les PIN significatives pour la société évaluée ont été prises en compte dans l'évaluation ESG du gestionnaire de portefeuille appliquée dans le cadre du processus de sélection des titres, notamment :

La manière dont les PIN ont été prises en compte est exposée plus en détail ci-dessous.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le gestionnaire de portefeuille soutient les principes du Pacte mondial des Nations unies. Par conséquent, le Fonds n'a pas investi dans des sociétés qui violaient l'un des dix principes dans chacun des quatre domaines (droits de l'homme, travail, environnement et lutte contre la corruption) du pacte.

Le gestionnaire de portefeuille a fait appel à un fournisseur de données tiers qui contrôlait le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies. En cas de divergence ou de désaccord entre les recherches du gestionnaire de portefeuille et l'évaluation d'une controverse spécifique par le prestataire, le gestionnaire de portefeuille, les membres de l'équipe chargée de la conformité et l'analyste sectoriel ou de portefeuille engageaient un dialogue avec l'entreprise sur la question. Si le gestionnaire de portefeuille parvenait à un consensus sur le fait que l'entreprise avait pris les mesures nécessaires pour répondre à la controverse, ou qu'elle avait effectivement remédié au problème, il devait fournir une explication détaillée des raisons pour lesquelles l'entreprise pouvait continuer à faire l'objet d'un investissement.

Pour s'assurer que les investissements durables étaient conformes aux lignes directrices de l'OCDE, le gestionnaire de portefeuille a fait appel à un prestataire externe afin de contrôler la conformité et les violations potentielles.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Toutes les PIN significatives pour la société évaluée étaient prises en compte dans l'évaluation ESG du gestionnaire de portefeuille appliquée dans le cadre du processus de sélection des titres, notamment :

PAI 1 (Émissions de GES), PAI 2 (Empreinte carbone), PAI 3 (Intensité des GES)

Le gestionnaire de portefeuille a évalué les risques et opportunités spécifiques liés au climat auxquels sont confrontées les entreprises individuelles dans le cadre de son processus de sélection des titres, qui a tenu compte de ces considérations, parmi d'autres considérations environnementales, sociales et de gouvernance.

Bien que le gestionnaire évalue chaque secteur sur la base d'un ensemble spécifique de critères pertinents pour ses activités commerciales, l'évaluation comprend généralement un examen minutieux des facteurs liés au climat, tels que : le contexte réglementaire/politique ; l'emplacement géographique des actifs et des opérations ; la capacité à répercuter les coûts sur les clients ; les alternatives et les avancées technologiques ; l'évolution des préférences des clients ; les prix des matières premières ; les futures dépenses d'investissement et les plans de R&D ; la stratégie commerciale à long terme ; la qualité globale de l'équipe de direction ; et d'autres facteurs ; et

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé l'outil MSCI Carbon Portfolio Analytics pour évaluer l'exposition aux entreprises possédant des réserves de combustibles fossiles. Le gestionnaire de portefeuille a effectué une analyse de l'intensité carbone sur l'ensemble des investissements de l'entreprise afin de comprendre l'intensité carbone des actifs totaux de l'entreprise par rapport aux marchés boursiers mondiaux. Le gestionnaire de portefeuille a également effectué une analyse de l'intensité carbone au niveau du portefeuille.

PIN #10 (violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales)

Veuillez consulter la rubrique « Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? »

PIN #13 (mixité au sein des organes de gouvernance)

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé des données provenant de tiers pour le suivi de la mixité au sein des conseils d'administration. En outre, le gestionnaire de portefeuille a prévu dans sa politique de vote par procuration de voter contre la nomination des membres et du président si le conseil d'administration de l'entreprise ne compte pas au moins une femme. La diversité, l'égalité et l'inclusion étaient aussi des composantes de l'analyse et de la notation ESG du gestionnaire de portefeuille, qui prévoyait également un engagement de l'ensemble de l'entreprise sur un thème.

PIN #14 (exposition à des armes controversées)

Le Compartiment n'a pas investi dans des sociétés qui réalisent une partie de leur chiffre d'affaires dans la production et/ou la distribution d'armes controversées (p. ex. : mines antipersonnel, armes nucléaires, armes chimiques ou biologiques, armes à sous-munitions, phosphore blanc).

Les chiffres relatifs aux Principales Incidences Négatives ci-dessous datent du 31 décembre 2022.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Émissions de GES : Émissions totales en USD	106 503,87	95,26%
Empreinte carbone en USD	97,02	95,26%
Intensité des GES en USD	465,22	95,26%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	95,26%
Mixité du conseil d'administration	34,89%	95,26%
Exposition à des armes controversées	0,00%	95,26%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
AMAZON.COM INC	Biens de consommation discrétionnaire	4,14%	États-Unis
MICROSOFT CORP	Technologies de l'information	3,62%	États-Unis
VISA INC	Technologies de l'information	2,61%	États-Unis
UNITEDHEALTH GROUP INC	Santé	2,38%	États-Unis
APPLE INC	Technologies de l'information	2,29%	États-Unis
NVIDIA CORP	Technologies de l'information	1,80%	États-Unis
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Santé	1,62%	États-Unis
PALO ALTO NETWORKS INC	Technologies de l'information	1,54%	États-Unis
NETFLIX INC	Services de communication	1,44%	États-Unis
META PLATFORMS INC	Services de communication	1,43%	États-Unis
S&P GLOBAL INC	Secteur financier	1,26%	États-Unis
SALESFORCE INC	Technologies de l'information	1,26%	États-Unis
WW GRAINGER INC	Industrie	1,18%	États-Unis
UNITED PARCEL SERVICE INC	Industrie	1,15%	États-Unis
EATON CORP PLC	Industrie	1,14%	États-Unis

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

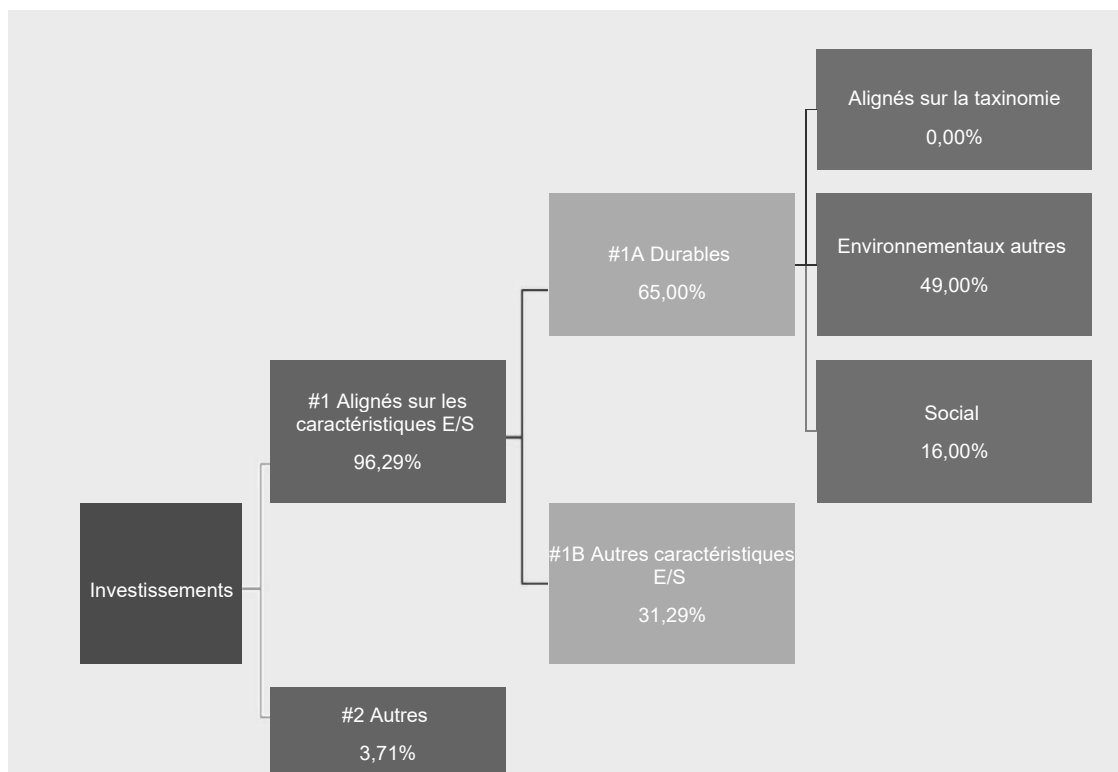
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 65,00 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

96,29 % du portefeuille du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (3,71 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides.

Le Fonds a investi dans des placements durables 65,00 % du segment de son portefeuille qui était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Technologies de l'information	35,09%
Santé	19,69%
Biens de consommation discrétionnaire	11,50%
Industrie	11,36%
Services de communication	5,36%
Biens de consommation courante	4,50%
Secteur financier	4,29%
commercial	1,73%
Matériaux	1,62%
Services aux collectivités	1,14%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Fabrication d'appareils ménagers	7,56%
Produits domestiques et de soins personnels	7,18%
Services financiers aux particuliers	7,04%
Produits pharmaceutiques et biotechnologies	6,90%
Équipements et fournitures de soins de santé	6,76%
Soins gérés	6,62%
Services publics et distributeurs de gaz	6,49%
commercial	6,36%
Biocarburants	6,23%
Piles à combustible et batteries industrielles	6,11%
Casinos et salles de Jeu	5,99%
Médias et divertissement	5,87%
Semi-conducteurs	5,75%
Logiciels et services informatiques	5,64%
Pièces automobiles	5,52%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

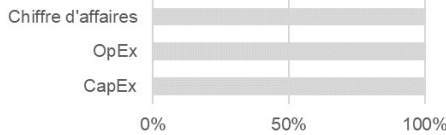
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

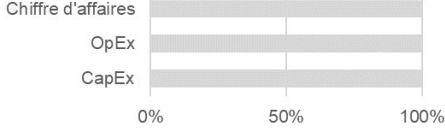
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes telles que définies à l'article 16 et à l'article 10, paragraphe 2, du règlement de l'UE relatif à la taxonomie.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxonomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Non applicable

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxonomie de l'UE ?

En raison de sa stratégie d'investissement, le Fonds n'a pas réalisé d'investissements durables ayant un objectif environnemental aligné avec la taxonomie de l'UE et, par conséquent, à fin février 2023, 49,00 % du portefeuille du Fonds était composé d'investissements ayant un objectif environnemental non aligné avec la taxonomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

La proportion d'investissements durables sur le plan social s'établissait à 16,00 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 3,71 % et comprenait les liquidités conservées en dépôt ou dans des instruments dérivés utilisés en couverture, non soumises à un objectif social ou environnemental minimum.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

1. Le gestionnaire de portefeuille a utilisé son propre système de notation et sa recherche fondamentale pour déterminer comment une entreprise gérait ses risques et opportunités ESG, en incluant un critère de bonne gouvernance. Le système de notation comprenait quatre niveaux de notation : AAA, AA, A et B, ces notations étant attribuées aux entreprises sur la base de leur stratégie en matière de durabilité et de leurs performances sur les critères ESG. Toutes les entreprises du Fonds ont été évaluées. Au 31/12/2022, la répartition des notations pour ce Fonds était la suivante :

AAA : 48%

AA : 34%

R : 18%

B : 0%

2. Le gestionnaire de portefeuille a entretenu un dialogue permanent avec les entreprises de son portefeuille. L'engagement ESG de ClearBridge combinait généralement deux objectifs qui se recoupaient :

- Recherche : Mieux comprendre les questions ESG susceptibles de modifier notre thèse d'investissement
- L'impact : Encourager des changements spécifiques au sein de l'entreprise susceptibles d'avoir une incidence positive dans le monde réel.

Pour plus de détails sur notre approche de l'engagement, veuillez vous référer à notre politique d'engagement et de gestion qui se trouve à l'adresse suivante : <https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshipolicy.pdf>

3. Le Fonds n'a pas investi dans les seuils de revenus fixés repris dans le prospectus pour les secteurs suivants :

- Tabac
- Armes controversées
- Divertissements pour adultes

4. Le Fonds n'a pas investi dans des entreprises qui violent un ou plusieurs des dix principes dans les quatre domaines couverts par l'UNGC (droits de l'homme, normes internationales du travail, environnement et lutte contre la corruption).



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Non applicable

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund



FRANKLIN TEMPLETON

LEI de l'entité : 5493007ZJMPVPNDQMY52

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ ☐ OUI

☐ Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ____%

☒ ☒ NON

☒ Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 46,00% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Pour sélectionner les titres du compartiment dans la période sous rubrique, le gestionnaire de portefeuille utilisait un processus de recherche et d'engagement exclusif qui visait à déterminer le profil de la société sur le plan environnemental, social et de gouvernance (ESG). Ce processus exclusif a généré un système d'évaluation ESG utilisant une cartographie de matérialité pour identifier les caractéristiques ESG spécifiques de l'investissement. Les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds étaient des problématiques ESG essentielles jugées importantes pour l'entreprise en question et le secteur dans lequel elle opère, qui incluaient, sans s'y limiter, la santé et la sécurité, la mixité, le risque climatique, le risque de gouvernance d'entreprise et la sécurité des données.

En outre, le Fonds a respecté son engagement de 5 % minimum d'« investissement durable ».

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales ou sociales privilégiées par le Fonds étaient les suivants :

- la proportion du Fonds détenue dans des investissements durables tels que définis par la méthodologie exclusive du gestionnaire de portefeuille en matière d'investissements durables, qui comprend l'alignement des produits et/ou des services sur les objectifs de développement durable des Nations unies (ODD), qui était de 35 %, et la prise en compte de l'approche « ne pas causer de préjudice important » (Do No Significant Harm - DNSH) ;
- les indicateurs spécifiques des principales incidences négatives (PAI, pour Principal Adverse Impact), à savoir : PIN 1 (émissions de GES), PIN 2 (empreinte carbone), PIN 3 (intensité des GES), PIN 10 (violations des principes directeurs du Pacte mondial des Nations unies et de l'OCDE), PIN 13 (mixité au sein des organes de gouvernance) et PIN 14 (exposition à des armes controversées) ; Veuillez vous référer aux valeurs indiquées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ;
- des méthodologies exclusives pour évaluer les progrès des réunions d'engagement ESG du gestionnaire de portefeuille. ClearBridge a organisé des actions d'engagement ESG périodiques avec les sociétés de son portefeuille. Les opinions de l'équipe d'investissement sur les progrès discutés lors de ces réunions ont été reprises dans leurs propres notations ESG, leurs décisions de vote par procuration et leurs décisions d'investissement.
- l'exposition du portefeuille aux entreprises les meilleures de leur catégorie, selon la notation ESG exclusive du Gestionnaire de portefeuille. Au 31/12/2022, la répartition des notations pour ce Fonds était la suivante :
 - AAA : 21%
 - AA : 59%
 - R : 20%
 - B : 0%

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Les investissements durables réalisés par le Fonds étaient des titres de participation émis par des sociétés qui contribuaient à au moins l'un des objectifs suivants ou aux deux :

- Par le biais de leurs produits et services, à un ou plusieurs des objectifs environnementaux ou sociaux des ODD et à leurs cibles et indicateurs sous-jacents déterminés par l'évaluation de la contribution du gestionnaire de portefeuille ; 35 % du portefeuille
- à des objectifs de réduction de l'intensité des GES et des émissions dans l'ensemble des activités économiques d'une entreprise, déterminés par un objectif de décarbonation contrôlé par un tiers et conforme à l'Accord de Paris. Dans le cadre de notre processus d'engagement, les progrès réalisés par les émetteurs font l'objet d'un suivi par rapport aux objectifs. 24 % du portefeuille

En plus de contribuer à l'un des objectifs environnementaux ou sociaux énumérés ci-dessus, les entreprises ont été évaluées au moyen d'un filtre exclusif de bonne gouvernance et ont satisfait au principe de « ne pas causer de préjudice important », comme détaillé ci-dessous.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé une combinaison de scores de risque grave de controverse obtenus par des tiers, de vérifications basées sur des normes mondiales, y compris le respect du Pacte mondial des Nations unies, la prise en compte des principales incidences négatives* et d'autres facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance importants, qui ont été intégrés dans la recherche fondamentale du gestionnaire de portefeuille et dans son processus exclusif de notation ESG. Ce dernier comprenait une évaluation de la qualité de la gouvernance, afin de déterminer si les investissements portent un préjudice important à un objectif d'investissement durable.

En outre, le gestionnaire de portefeuille utilise son processus d'engagement pour identifier les meilleurs titres de leur catégorie.

* Les PIN prises en compte ont été déterminées par la matérialité ESG par sous-secteur, évaluée par le gestionnaire de portefeuille via sa méthodologie exclusive au cours de son processus de notation ESG, ou à l'aide des données disponibles.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Toutes les PIN significatives pour la société évaluée ont été prises en compte dans l'évaluation ESG du gestionnaire de portefeuille appliquée dans le cadre du processus de sélection des titres, notamment :

La manière dont les PIN ont été prises en compte est exposée plus en détail ci-dessous.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le gestionnaire de portefeuille soutient les principes du Pacte mondial des Nations unies. Par conséquent, le Fonds n'a pas investi dans des sociétés qui violaient l'un des dix principes dans chacun des quatre domaines (droits de l'homme, travail, environnement et lutte contre la corruption) du pacte.

Le gestionnaire de portefeuille a fait appel à un fournisseur de données tiers qui contrôlait le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies. En cas de divergence ou de désaccord entre les recherches du gestionnaire de portefeuille et l'évaluation d'une controverse spécifique par le prestataire, le gestionnaire de portefeuille, les membres de l'équipe chargée de la conformité et l'analyste sectoriel ou de portefeuille engageaient un dialogue avec l'entreprise sur la question. Si le gestionnaire de portefeuille parvenait à un consensus sur le fait que l'entreprise avait pris les mesures nécessaires pour répondre à la controverse, ou qu'elle avait effectivement remédié au problème, il devait fournir une explication détaillée des raisons pour lesquelles l'entreprise pouvait continuer à faire l'objet d'un investissement.

Pour s'assurer que les investissements durables étaient conformes aux lignes directrices de l'OCDE, le gestionnaire de portefeuille a fait appel à un prestataire externe afin de contrôler la conformité et les violations potentielles.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Toutes les PIN significatives pour la société évaluée étaient prises en compte dans l'évaluation ESG du gestionnaire de portefeuille appliquée dans le cadre du processus de sélection des titres, notamment :

PAI 1 (Émissions de GES), PAI 2 (Empreinte carbone), PAI 3 (Intensité des GES)

Le gestionnaire de portefeuille a évalué les risques et opportunités spécifiques liés au climat auxquels sont confrontées les entreprises individuelles dans le cadre de son processus de sélection des titres, qui a tenu compte de ces considérations, parmi d'autres considérations environnementales, sociales et de gouvernance.

Bien que le gestionnaire ait évalué chaque secteur sur la base d'un ensemble spécifique de critères pertinents pour ses activités commerciales, l'évaluation comprenait généralement un examen minutieux des facteurs liés au climat, tels que : le contexte réglementaire/politique ; l'emplacement géographique des actifs et des opérations ; la capacité à répercuter les coûts sur les clients ; les alternatives et les avancées technologiques ; l'évolution des préférences des clients ; les prix des matières premières ; les futures dépenses d'investissement et les plans de R&D ; la stratégie commerciale à long terme ; la qualité globale de l'équipe de direction ; et d'autres facteurs ;

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé l'outil MSCI Carbon Portfolio Analytics pour évaluer l'exposition aux entreprises possédant des réserves de combustibles fossiles. Le gestionnaire de portefeuille a effectué une analyse de l'intensité carbone sur l'ensemble des investissements de l'entreprise afin de comprendre l'intensité carbone des actifs totaux de l'entreprise par rapport aux marchés boursiers mondiaux. Le gestionnaire de portefeuille a également effectué une analyse de l'intensité carbone au niveau du portefeuille.

PIN #10 (violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales)

Veuillez consulter la rubrique « Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? »

PIN #13 (mixité au sein des organes de gouvernance)

Le gestionnaire de portefeuille utilise des données provenant de tiers pour le suivi de la mixité au sein des conseils d'administration. En outre, le gestionnaire de portefeuille a prévu dans sa politique de vote par procuration de voter contre la nomination des membres et du président si le conseil d'administration de l'entreprise ne compte pas au moins une femme. La diversité, l'égalité et l'inclusion étaient aussi des composantes de l'analyse et de la notation ESG du gestionnaire de portefeuille, qui prévoyait également un engagement de l'ensemble de l'entreprise sur un thème.

PIN #14 (exposition à des armes controversées)

Le Compartiment n'a pas investi dans des sociétés qui réalisent une partie de leur chiffre d'affaires dans la production et/ou la distribution d'armes controversées (p. ex. : mines antipersonnel, armes nucléaires, armes chimiques ou biologiques, armes à sous-munitions, phosphore blanc).

Les chiffres relatifs aux Principales Incidences Négatives ci-dessous datent du 31 décembre 2022.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Émissions de GES : Émissions totales en USD	137 578,85	98,79%
Empreinte carbone en USD	667,17	98,79%
Intensité des GES en USD	9 124,64	98,79%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	98,79%
Mixité du conseil d'administration	31,64%	98,79%
Exposition à des armes controversées	0,00%	98,79%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
UNITEDHEALTH GROUP INC	Santé	8,53%	États-Unis
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	Santé	8,23%	États-Unis
BROADCOM INC	Technologies de l'information	7,73%	États-Unis
TE CONNECTIVITY LTD	Technologies de l'information	6,88%	États-Unis
COMCAST CORP	Services de communication	5,74%	États-Unis
WOLFSPEED INC	Technologies de l'information	4,54%	États-Unis
AUTODESK INC	Technologies de l'information	4,20%	États-Unis
BIOGEN INC	Santé	3,33%	États-Unis
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	Technologies de l'information	3,20%	États-Unis
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	Industrie	3,14%	États-Unis
MADISON SQUARE GARDEN SPORTS CORP	Services de communication	2,90%	États-Unis
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	Technologies de l'information	2,83%	États-Unis
HUBSPOT INC	Technologies de l'information	2,53%	États-Unis
TWITTER INC	Technologies de l'information	2,39%	États-Unis
IONIS PHARMACEUTICALS INC	Santé	2,16%	États-Unis

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

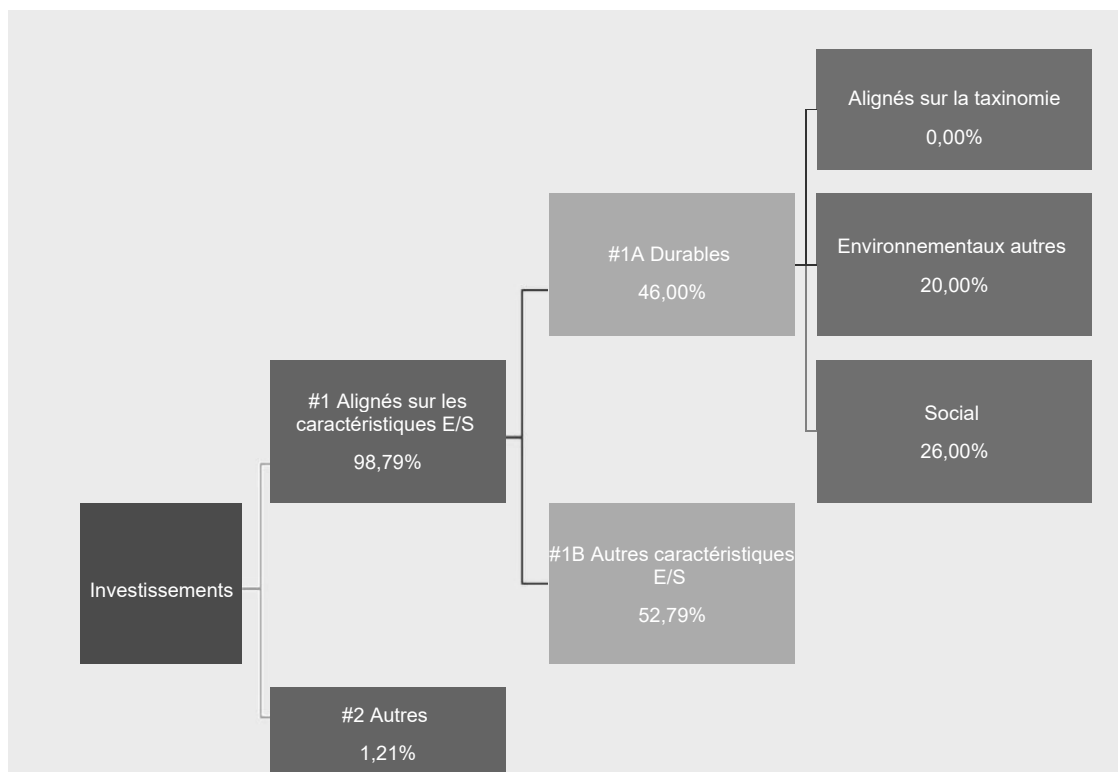
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 46,00 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

98,79 % du portefeuille du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (1,21 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides.

Le Fonds a investi dans des placements durables 46,00 % du segment de son portefeuille qui était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Technologies de l'information	37,58%
Santé	33,15%
Services de communication	16,29%
Industrie	4,87%
Biens de consommation discrétionnaire	3,78%
Biens de consommation courante	1,64%
Matériaux	0,84%
Secteur financier	0,64%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Biotechnologie	18,01%
Logiciels	13,24%
Semi-conducteurs et équipements pour semi-conducteurs	12,80%
Prestataires et services de soins de santé	9,32%
Médias	7,99%
Équipements, instruments et composants électroniques	7,65%
Divertissement	7,25%
Produits de construction	4,28%
Matériel informatique, stockage et périphériques	2,91%
Internet et marketing direct de détail	2,54%
Équipements et fournitures de soins de santé	2,41%
Outils et services de sciences de la vie	2,23%
Boissons	1,64%
Hôtels, restaurants et loisirs	1,24%
Technologies de soins de santé	1,19%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

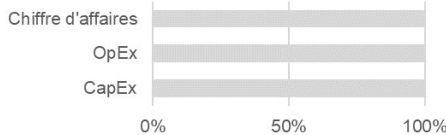
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

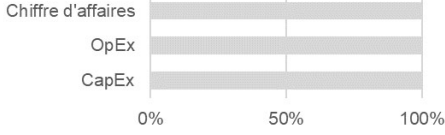
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes telles que définies à l'article 16 et à l'article 10, paragraphe 2, du règlement de l'UE relatif à la taxonomie.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxonomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Non applicable

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxonomie de l'UE ?

En raison de sa stratégie d'investissement, le Fonds n'a pas réalisé d'investissements durables ayant un objectif environnemental aligné avec la taxonomie de l'UE et, par conséquent, à fin février 2023, 20,00 % du portefeuille du Fonds était composé d'investissements ayant un objectif environnemental non aligné avec la taxonomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

La proportion d'investissements durables sur le plan social s'établissait à 26,00 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 1,21 % et comprenait les liquidités conservées en dépôt ou dans des instruments dérivés utilisés en couverture, non soumises à un objectif social ou environnemental minimum.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

1. Le gestionnaire de portefeuille a utilisé son propre système de notation et sa recherche fondamentale pour déterminer comment une entreprise gérait ses risques et opportunités ESG, en incluant un critère de bonne gouvernance. Le système de notation comprenait quatre niveaux de notation : AAA, AA, A et B, ces notations étant attribuées aux entreprises sur la base de leur stratégie en matière de durabilité et de leurs performances sur les critères ESG. Toutes les entreprises du Fonds ont été évaluées. Au 31/12/2022, la répartition des notations pour ce Fonds était la suivante :

AAA : 21%

AA : 59%

R : 20%

B : 0%

2. Le gestionnaire de portefeuille a entretenu un dialogue permanent avec les entreprises de son portefeuille. L'engagement ESG de ClearBridge combinait généralement deux objectifs qui se recoupaient :

- Recherche : Mieux comprendre les questions ESG susceptibles de modifier notre thèse d'investissement
- L'impact : Encourager des changements spécifiques au sein de l'entreprise susceptibles d'avoir une incidence positive dans le monde réel.

Pour plus de détails sur notre approche de l'engagement, veuillez vous référer à notre politique d'engagement et de gestion qui se trouve à l'adresse suivante : <https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshipolicy.pdf>

3. Le Fonds n'a pas investi dans les seuils de revenus fixés repris dans le prospectus pour les secteurs suivants :

- Tabac
- Armes controversées
- Jeux d'argent
- Divertissements pour adultes

4. Le Fonds n'a pas investi dans des entreprises qui violent un ou plusieurs des dix principes dans les quatre domaines couverts par l'UNGC (droits de l'homme, normes internationales du travail, environnement et lutte contre la corruption).



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Non applicable

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund



FRANKLIN TEMPLETON

LEI de l'entité : 549300RLIXEW79ZFOB12

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ ☐ **OUI**

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif environnemental** : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif social** : ____%

☒ ☒ **NON**

☒ Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 81,00% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Au cours de la période de référence, dans le cadre de sa politique d'investissement, le Gestionnaire d'investissement a investi dans des sociétés de toutes capitalisations présentant des caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance (ESG) solides ou en voie d'amélioration. Le Fonds a utilisé un processus de recherche et d'engagement exclusif établi pour déterminer si une société est un leader de la durabilité. Ce processus exclusif inclut la génération d'un système d'évaluation ESG utilisant une cartographie de matérialité pour identifier les caractéristiques ESG spécifiques de l'investissement. Ces caractéristiques incluaient, sans s'y limiter, les éléments suivants :

- l'efficacité énergétique ;
- une énergie propre ;
- les technologies permettant de réduire les émissions de carbone ;
- l'utilisation rationnelle de l'eau ;
- les processus de réduction des déchets matériels ;
- la diversité du personnel ;
- la santé et le bien-être ;
- des salaires équitables ;
- le contrôle de la chaîne d'approvisionnement ; et
- l'engagement envers la communauté.

En outre, le Fonds a respecté son engagement de 50 % minimum d'« investissement durable ».

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales ou sociales privilégiées par le Fonds étaient les suivants :

- la proportion du Fonds détenue dans des investissements durables tels que définis par la méthodologie exclusive du gestionnaire de portefeuille en matière d'investissements durables, qui comprend l'alignement des produits et/ou des services sur les objectifs de développement durable des Nations unies (ODD), qui était de 63 %, et la prise en compte de l'approche « ne pas causer de préjudice important » (Do No Significant Harm - DNSH) ;
- Les indicateurs spécifiques de principales incidences négatives (PIN), plus précisément la PIN 1 (émissions de GES), la PIN 2 (empreinte carbone), la PIN 3 (intensité des GES), la PIN 4 (exposition à des entreprises actives dans le secteur des combustibles fossiles), la PIN 7 (activités ayant un impact négatif sur les zones sensibles du point de vue de la biodiversité), la PIN 10 (violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et de l'OCDE), la PIN 13 (mixité au sein des organes de gouvernance) et la PIN 14 (exposition aux armes controversées) ont été calculés. Veuillez vous référer aux valeurs indiquées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ;
- les méthodologies exclusives pour évaluer l'avancement des réunions d'engagement ESG du Gestionnaire d'investissement. ClearBridge a mené des engagements ESG périodiques avec les sociétés de son portefeuille. Les opinions de l'équipe d'investissement sur les progrès discutés lors de ces réunions ont été reprises dans leurs propres notations ESG, leurs décisions de vote par procuration et leurs décisions d'investissement.
- L'exposition du portefeuille aux émetteurs les meilleurs de leur catégorie, tels que définis par les notations ESG exclusives ; La ventilation des notations pour ce fonds au 31/12/22 est la suivante :
 - AAA : 63%
 - AA : 35%
 - R : 2%
 - B : 0%
- Le fonds est considéré comme faisant partie du champ d'application de l'objectif Net Zero de ClearBridge et a donc été mesuré par rapport à la proportion d'entreprises qui ont fixé, ou qui se sont engagées à fixer, des objectifs scientifiques de réduction des émissions de gaz à effet de serre.

Nom de l'ICP de durabilité	Valeur
Alignées sur la neutralité carbone	50,51%
Engagées à fixer un objectif aligné sur la neutralité	12,07%

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Les investissements durables réalisés par le Fonds étaient des titres de participation émis par des sociétés qui contribuaient à l'un des objectifs suivants ou aux deux :

- par le biais de leurs produits et services, à un ou plusieurs des objectifs environnementaux ou sociaux des ODD et à leurs cibles et indicateurs sous-jacents déterminés par l'évaluation de la contribution du gestionnaire de portefeuille ; ou
- à des objectifs de réduction de l'intensité des GES et des émissions dans l'ensemble des activités économiques d'une entreprise, déterminés par un objectif de décarbonation contrôlé par un tiers et conforme à l'Accord de Paris. Dans le cadre de notre processus d'engagement, les progrès réalisés par les émetteurs font l'objet d'un suivi par rapport aux objectifs.

En plus de contribuer à l'un des objectifs environnementaux ou sociaux énumérés ci-dessus, les entreprises doivent passer par une évaluation exclusive de bonne gouvernance et satisfaire au principe de « ne pas causer de préjudice important », comme détaillé ci-dessous.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé une combinaison de scores de risque grave de controverse obtenus par des tiers, de vérifications basées sur des normes mondiales, y compris le respect du Pacte mondial des Nations unies, la prise en compte des principales incidences négatives* et d'autres facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance importants, qui ont été intégrés dans la recherche fondamentale du gestionnaire de portefeuille et dans son processus exclusif de notation ESG. Ce dernier comprenait une évaluation de la qualité de la gouvernance, afin de déterminer si les investissements portent un préjudice important à un objectif d'investissement durable.

En outre, le gestionnaire de portefeuille utilise son processus d'engagement pour identifier les meilleurs titres de leur catégorie.

* Les PIN prises en compte ont été déterminées par la matérialité ESG par sous-secteur, évaluée par le gestionnaire de portefeuille via sa méthodologie exclusive au cours de son processus de notation ESG, ou à l'aide des données disponibles.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Toutes les PIN significatives pour la société évaluée ont été prises en compte dans l'évaluation ESG du gestionnaire de portefeuille appliquée dans le cadre du processus de sélection des titres, notamment :

La manière dont les PIN ont été prises en compte est exposée plus en détail ci-dessous.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le gestionnaire de portefeuille soutient les principes du Pacte mondial des Nations unies. Par conséquent, le Fonds n'a pas investi dans des sociétés qui violaient l'un des dix principes dans chacun des quatre domaines (droits de l'homme, travail, environnement et lutte contre la corruption) du pacte.

Le gestionnaire de portefeuille a fait appel à un fournisseur de données tiers qui contrôlait le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies. En cas de divergence ou de désaccord entre les recherches du gestionnaire de portefeuille et l'évaluation d'une controverse spécifique par le prestataire, le gestionnaire de portefeuille, les membres de l'équipe chargée de la conformité et l'analyste sectoriel ou de portefeuille engageaient un dialogue avec l'entreprise sur la question. Si le gestionnaire de portefeuille parvenait à un consensus sur le fait que l'entreprise avait pris les mesures nécessaires pour répondre à la controverse, ou qu'elle avait effectivement remédié au problème, il devait fournir une explication détaillée des raisons pour lesquelles l'entreprise pouvait continuer à faire l'objet d'un investissement.

Pour s'assurer que les investissements durables étaient conformes aux lignes directrices de l'OCDE, le gestionnaire de portefeuille a fait appel à un prestataire externe afin de contrôler la conformité et les violations potentielles.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Toutes les PIN significatives pour la société évaluée étaient prises en compte dans l'évaluation ESG du gestionnaire de portefeuille appliquée dans le cadre du processus de sélection des titres, notamment :

PAI 1 (Émissions de GES), PAI 2 (Empreinte carbone), PAI 3 (Intensité des GES)

Le gestionnaire de portefeuille a évalué les risques et opportunités spécifiques liés au climat auxquels sont confrontées les entreprises individuelles dans le cadre de son processus de sélection des titres, qui a tenu compte de ces considérations, parmi d'autres considérations environnementales, sociales et de gouvernance.

Bien que le gestionnaire évalue chaque secteur sur la base d'un ensemble spécifique de critères pertinents pour ses activités commerciales, l'évaluation comprenait généralement un examen minutieux des facteurs liés au climat, tels que : le contexte réglementaire/politique ; l'emplacement géographique des actifs et des opérations ; la capacité à répercuter les coûts sur les clients ; les alternatives et les avancées technologiques ; l'évolution des préférences des clients ; les prix des matières premières ; les futures dépenses d'investissement et les plans de R&D ; la stratégie commerciale à long terme ; la qualité globale de l'équipe de direction ; et d'autres facteurs ; et

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé l'outil MSCI Carbon Portfolio Analytics pour évaluer l'exposition aux entreprises possédant des réserves de combustibles fossiles. Le gestionnaire de portefeuille a effectué une analyse de l'intensité carbone sur l'ensemble des investissements de l'entreprise afin de comprendre l'intensité carbone des actifs totaux de l'entreprise par rapport aux marchés boursiers mondiaux. Le gestionnaire de portefeuille a également effectué une analyse de l'intensité carbone au niveau du portefeuille.

PIN n° 4 (exposition à des sociétés actives dans le secteur des combustibles fossiles)

Le Compartiment n'a pas investi dans une société dont l'activité principale consistait à extraire des combustibles fossiles.

PIN n° 7 (activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité)

Bien que le Compartiment ne dispose pas actuellement de seuils formels concernant les exclusions liées aux questions de biodiversité, celles-ci ont été prises en compte dans le cadre de l'évaluation plus large de l'impact environnemental et climatique des investissements et des investissements potentiels du compartiment. Le Compartiment s'attend à ce que toutes les entreprises dans lesquelles il investit aient un profil de biodiversité positif et toute transgression pourrait entraîner l'exclusion de l'investissement.

PIN #10 (violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales)

Veuillez consulter la rubrique « Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? »

PIN #13 (mixité au sein des organes de gouvernance)

Le gestionnaire de portefeuille utilise des données provenant de tiers pour le suivi de la mixité au sein des conseils d'administration. En outre, le gestionnaire de portefeuille a prévu dans sa politique de vote par procuration de voter contre la nomination des membres et du président si le conseil d'administration de l'entreprise ne compte pas au moins une femme. La diversité, l'égalité et l'inclusion étaient des composantes de l'analyse et de la notation ESG du gestionnaire de portefeuille, qui prévoyait également un engagement de l'ensemble de l'entreprise sur un thème.

PIN #14 (exposition à des armes controversées)

Le Fond a investi dans des sociétés qui réalisent une partie de leur chiffre d'affaires dans la production et/ou la distribution d'armes controversées (p. ex. : mines antipersonnel, armes nucléaires, armes chimiques ou biologiques, armes à sous-munitions, phosphore blanc).

Les chiffres relatifs aux Principales Incidences Négatives ci-dessous datent du 31 décembre 2022.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Émissions de GES : Émissions totales en USD	1 514 149,99	98,66%
Empreinte carbone en USD	973,99	98,66%
Intensité des GES en USD	1 881,15	98,66%
Exposition à des entreprises actives dans le secteur des combustibles fossiles.	3,78%	98,66%
Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité	0,00%	98,66%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	98,66%
Mixité du conseil d'administration	34,46%	98,66%
Exposition à des armes controversées	0,00%	98,66%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
MICROSOFT CORP	Technologies de l'information	6,40%	États-Unis
APPLE INC	Technologies de l'information	5,11%	États-Unis
UNITEDHEALTH GROUP INC	Santé	3,20%	États-Unis
COSTCO WHOLESALE CORP	Biens de consommation courante	2,59%	États-Unis
CVS HEALTH CORP	Santé	2,44%	États-Unis
BANK OF AMERICA CORP	Secteur financier	2,42%	États-Unis
PROGRESSIVE CORP	Secteur financier	2,34%	États-Unis
HOME DEPOT INC/THE	Biens de consommation discrétionnaire	2,13%	États-Unis
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	Secteur financier	2,12%	États-Unis
DANAHER CORP	Santé	2,06%	États-Unis
GILEAD SCIENCES INC	Santé	2,05%	États-Unis
MORGAN STANLEY	Secteur financier	2,05%	États-Unis
MCCORMICK & CO INC	Biens de consommation courante	2,02%	États-Unis
AMAZON.COM INC	Biens de consommation discrétionnaire	1,98%	États-Unis
REGAL REXNORD CORP	Industrie	1,95%	États-Unis



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

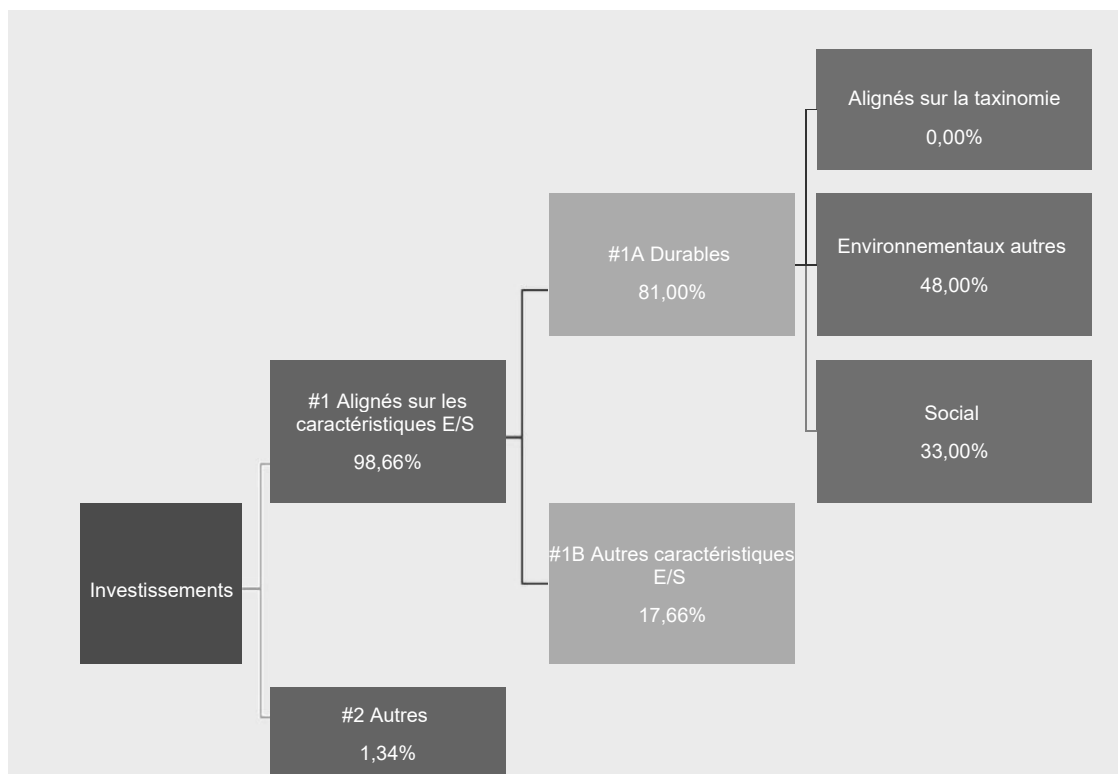
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 81,00 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

98,66 % du portefeuille du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (1,34 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides.

Le Fonds a investi dans des placements durables 81,00 % du segment de son portefeuille qui était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Technologies de l'information	27,91%
Santé	19,46%
Secteur financier	14,41%
Industrie	11,17%
Biens de consommation discrétionnaire	9,60%
Biens de consommation courante	4,35%
Services de communication	3,41%
commercial	2,92%
Matériaux	2,76%
Services aux collectivités	2,68%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Logiciels	8,52%
Prestataires et services de soins de santé	6,40%
Équipements électriques	5,88%
Marchés financiers	5,77%
Semi-conducteurs et équipements pour semi-conducteurs	5,46%
Matériel informatique, stockage et périphériques	4,62%
Assurances	4,41%
Banques	4,22%
Outils et services de sciences de la vie	3,97%
Équipements, instruments et composants électroniques	3,86%
Produits pharmaceutiques	3,79%
Biotechnologie	3,76%
Services informatiques	3,56%
Distribution spécialisée	3,48%
Produits de construction	2,97%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

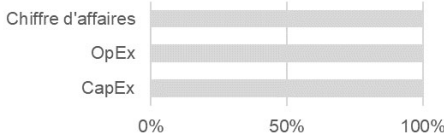
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

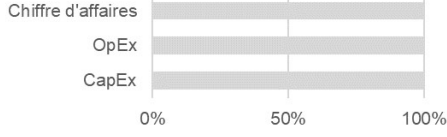
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes telles que définies à l'article 16 et à l'article 10, paragraphe 2, du règlement de l'UE relatif à la taxonomie.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxonomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Non applicable

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxonomie de l'UE ?

En raison de sa stratégie d'investissement, le Fonds n'a pas réalisé d'investissements durables ayant un objectif environnemental aligné avec la taxonomie de l'UE et, par conséquent, à fin février 2023, 48,00 % du portefeuille du Fonds était composé d'investissements ayant un objectif environnemental non aligné avec la taxonomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

La proportion d'investissements durables sur le plan social s'établissait à 33,00 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 1,34 % et comprenait les liquidités conservées en dépôt ou dans des instruments dérivés utilisés en couverture, non soumises à un objectif social ou environnemental minimum.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

1. Le gestionnaire de portefeuille a utilisé son propre système de notation et sa recherche fondamentale pour déterminer les leaders du développement durable, en incluant un critère de bonne gouvernance. Le système de notation comprenait quatre niveaux de notation : AAA, AA, A et B, ces notations étant attribuées aux entreprises sur la base de leur stratégie en matière de durabilité et de leurs performances sur les critères ESG. Toutes les entreprises du Fonds ont été évaluées. Le gestionnaire de portefeuille considère que les notes AAA et AA sont « les meilleures de leur catégorie ». Au 31/12/2022, la répartition des notations pour ce Fonds était la suivante :

AAA : 63%

AA : 35%

R : 2%

B : 0%

2. Le gestionnaire de portefeuille a entretenu un dialogue permanent avec les entreprises de son portefeuille. L'engagement ESG de ClearBridge combinait généralement deux objectifs qui se recoupaient :

- Recherche : Mieux comprendre les questions ESG susceptibles de modifier notre thèse d'investissement
- L'impact : Encourager des changements spécifiques au sein de l'entreprise susceptibles d'avoir une incidence positive dans le monde réel.

Pour plus de détails sur notre approche de l'engagement, veuillez vous référer à notre politique d'engagement et de gestion qui se trouve à l'adresse suivante : <https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshipolicy.pdf>

3. Le Fonds n'a pas investi dans les seuils de revenus fixés repris dans le prospectus pour les secteurs suivants :

- Combustibles fossiles
- Tabac
- Armes controversées
- Armes conventionnelles
- Énergie nucléaire
- Jeux d'argent
- Divertissements pour adultes

4. Le Fonds n'a pas investi dans des entreprises qui violent un ou plusieurs des dix principes dans les quatre domaines couverts par l'UNG (droits de l'homme, normes internationales du travail, environnement et lutte contre la corruption).



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Non applicable

FTGF ClearBridge Global Growth Fund

LEI de l'entité : 549300S2ND6DHQ60NF78



FRANKLIN TEMPLETON

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ ☐ OUI

☐ Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ____%

☒ ☒ NON

☒ Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 59,00% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Pour sélectionner les titres du compartiment dans la période sous rubrique, le gestionnaire de portefeuille utilisait un processus de recherche et d'engagement exclusif qui visait à déterminer le profil de la société sur le plan environnemental, social et de gouvernance (ESG). Ce processus exclusif a généré un système d'évaluation ESG utilisant une cartographie de matérialité pour identifier les caractéristiques ESG spécifiques de l'investissement. Les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Compartiment sont des problématiques ESG essentielles jugées importantes pour l'entreprise en question et le secteur dans lequel elle opère, qui incluaient, sans s'y limiter, la santé et la sécurité, la mixité, le risque climatique, le risque de gouvernance d'entreprise et la sécurité des données.

En outre, le Fonds a respecté son engagement de 5 % minimum d'« investissement durable ».

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer l'atteinte des caractéristiques environnementales ou sociales privilégiées par le Fonds étaient les suivants :

- la proportion du Fonds détenue dans des investissements durables tels que définis par la méthodologie exclusive du gestionnaire de portefeuille en matière d'investissements durables, qui comprend l'alignement des produits et/ou des services sur les objectifs de développement durable des Nations unies (ODD), qui était de 35 %, et la prise en compte de l'approche « ne pas causer de préjudice important » (Do No Significant Harm - DNSH) ;
- les indicateurs spécifiques des principales incidences négatives (PAI, pour Principal Adverse Impact), à savoir : La PIN 1 (émissions de GES), la PIN 2 (empreinte carbone), la PIN 3 (intensité des GES), la PIN 10 (violations des principes directeurs du Pacte mondial des Nations unies et de l'OCDE), la PIN 13 (mixité au sein des organes de gouvernance) et la PIN 14 (exposition à des armes controversées) ; Veuillez vous référer aux valeurs indiquées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ;
- les méthodologies exclusives pour évaluer l'avancement des réunions d'engagement ESG du Gestionnaire d'investissement. ClearBridge a mené des engagements ESG périodiques avec les sociétés de son portefeuille. Les opinions de l'équipe d'investissement sur les progrès discutés lors de ces réunions ont été reprises dans leurs propres notations ESG, leurs décisions de vote par procuration et leurs décisions d'investissement
- l'exposition du portefeuille aux entreprises les meilleures de leur catégorie, selon la notation ESG exclusive du Gestionnaire de portefeuille. Au 31/12/2022, la répartition des notations pour ce fonds était la suivante :
 - AAA : 38%
 - AA : 44%
 - R : 18%
 - B : 0%

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Les investissements durables réalisés par le Fonds étaient des titres de participation émis par des sociétés qui contribuaient à au moins l'un des objectifs suivants ou aux deux :

•

Par le biais de leurs produits et services, à un ou plusieurs des objectifs environnementaux ou sociaux des ODD et à leurs cibles et indicateurs sous-jacents déterminés par l'évaluation de la contribution du gestionnaire de portefeuille ; 35 % du portefeuille

et/ou

- à des objectifs de réduction de l'intensité des GES et des émissions dans l'ensemble des activités économiques d'une entreprise, déterminés par un objectif de décarbonation contrôlé par un tiers et conforme à l'Accord de Paris. Dans le cadre de notre processus d'engagement, les progrès réalisés par les émetteurs ont fait l'objet d'un suivi par rapport aux objectifs. 48 % du portefeuille

En plus de contribuer à l'un des objectifs environnementaux ou sociaux énumérés ci-dessus, les entreprises ont été évaluées au moyen d'un filtre exclusif de bonne gouvernance et ont satisfait au principe de « ne pas causer de préjudice important », comme détaillé ci-dessous.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Le Gestionnaire de portefeuille a utilisé une combinaison de scores de risque grave de controverse obtenus par des tiers, de vérifications basées sur des normes mondiales, y compris le respect du Pacte mondial des Nations unies, la prise en compte des principales incidences négatives* et d'autres facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance importants, qui ont été intégrés dans la recherche fondamentale du gestionnaire de portefeuille et dans son processus exclusif de notation ESG. Ce dernier comprenait une évaluation de la qualité de la gouvernance, afin de déterminer si les investissements portaient un préjudice important à un objectif d'investissement durable.

En outre, le gestionnaire de portefeuille utilise son processus d'engagement pour identifier les meilleurs titres de leur catégorie.

* Les PIN prises en compte ont été déterminées par la matérialité ESG par sous-secteur, évaluée par le gestionnaire de portefeuille via sa méthodologie exclusive au cours de son processus de notation ESG, ou à l'aide des données disponibles.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Toutes les PIN significatives pour la société évaluée ont été prises en compte dans l'évaluation ESG du gestionnaire de portefeuille appliquée dans le cadre du processus de sélection des titres, notamment :

La manière dont les PIN ont été prises en compte est exposée plus en détail ci-dessous.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le gestionnaire de portefeuille soutient les principes du Pacte mondial des Nations unies. Par conséquent, le Fonds n'a pas investi dans des sociétés qui violaient l'un des dix principes dans chacun des quatre domaines (droits de l'homme, travail, environnement et lutte contre la corruption) du pacte.

Le gestionnaire de portefeuille a fait appel à un fournisseur de données tiers qui contrôlait le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies. En cas de divergence ou de désaccord entre les recherches du gestionnaire de portefeuille et l'évaluation d'une controverse spécifique par le prestataire, le gestionnaire de portefeuille, les membres de l'équipe chargée de la conformité et l'analyste sectoriel ou de portefeuille engageaient un dialogue avec l'entreprise sur la question. Si le gestionnaire de portefeuille parvenait à un consensus sur le fait que l'entreprise avait pris les mesures nécessaires pour répondre à la controverse, ou qu'elle avait effectivement remédié au problème, il devait fournir une explication détaillée des raisons pour lesquelles l'entreprise pouvait continuer à faire l'objet d'un investissement.

Pour s'assurer que les investissements durables étaient conformes aux lignes directrices de l'OCDE, le gestionnaire de portefeuille a fait appel à un prestataire externe afin de contrôler la conformité et les violations potentielles.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Toutes les PIN significatives pour la société évaluée étaient prises en compte dans l'évaluation ESG du gestionnaire de portefeuille appliquée dans le cadre du processus de sélection des titres, notamment :

PAI 1 (Émissions de GES), PAI 2 (Empreinte carbone), PAI 3 (Intensité des GES)

Le gestionnaire de portefeuille a évalué les risques et opportunités spécifiques liés au climat auxquels sont confrontées les entreprises individuelles dans le cadre de son processus de sélection des titres, qui a tenu compte de ces considérations, parmi d'autres considérations environnementales, sociales et de gouvernance.

Bien que le gestionnaire ait évalué chaque secteur sur la base d'un ensemble spécifique de critères pertinents pour ses activités commerciales, l'évaluation comprenait généralement un examen minutieux des facteurs liés au climat, tels que : le contexte réglementaire/politique ; l'emplacement géographique des actifs et des opérations ; la capacité à répercuter les coûts sur les clients ; les alternatives et les avancées technologiques ; l'évolution des préférences des clients ; les prix des matières premières ; les futures dépenses d'investissement et les plans de R&D ; la stratégie commerciale à long terme ; la qualité globale de l'équipe de direction ; et d'autres facteurs ;

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé l'outil MSCI Carbon Portfolio Analytics pour évaluer l'exposition aux entreprises possédant des réserves de combustibles fossiles. Le gestionnaire de portefeuille a effectué une analyse de l'intensité carbone sur l'ensemble des investissements de l'entreprise afin de comprendre l'intensité carbone des actifs totaux de l'entreprise par rapport aux marchés boursiers mondiaux. Le Gestionnaire de portefeuille peut également effectuer une analyse de l'intensité carbone au niveau du portefeuille.

PIN #10 (violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales)

Veuillez consulter la rubrique « Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? »

PIN #13 (mixité au sein des organes de gouvernance)

Le gestionnaire de portefeuille utilise des données provenant de tiers pour le suivi de la mixité au sein des conseils d'administration. En outre, le gestionnaire de portefeuille a prévu dans sa politique de vote par procuration de voter contre la nomination des membres et du président si le conseil d'administration de l'entreprise ne compte pas au moins une femme. La diversité, l'égalité et l'inclusion étaient aussi des composantes de l'analyse et de la notation ESG du gestionnaire de portefeuille, qui prévoyait également un engagement de l'ensemble de l'entreprise sur un thème.

PIN #14 (exposition à des armes controversées)

Le Compartiment n'a pas investi dans des sociétés qui réalisent une partie de leur chiffre d'affaires dans la production et/ou la distribution d'armes controversées (p. ex. : mines antipersonnel, armes nucléaires, armes chimiques ou biologiques, armes à sous-munitions, phosphore blanc).

Les chiffres relatifs aux Principales Incidences Négatives ci-dessous datent du 31 décembre 2022.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Émissions de GES : Émissions totales en USD	1 295,82	96,85%
Empreinte carbone en USD	104,70	96,85%
Intensité des GES en USD	486,01	98,22%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	98,22%
Mixité du conseil d'administration	36,36%	95,59%
Exposition à des armes controversées	0,00%	95,59%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
MICROSOFT CORP	Technologies de l'information	4,22%	États-Unis
APPLE INC	Technologies de l'information	3,58%	États-Unis
ALPHABET INC	Services de communication	2,63%	États-Unis
UNION PACIFIC CORP	Industrie	2,42%	États-Unis
AMAZON.COM INC	Biens de consommation discrétionnaire	2,31%	États-Unis
DIAGEO PLC	Biens de consommation courante	2,30%	Royaume-Uni
AIA GROUP LTD	Finance	2,22%	Hong Kong
UNITEDHEALTH GROUP INC	Santé	2,11%	États-Unis
KROGER CO	Biens de consommation courante	2,04%	États-Unis
NESTLE SA	Biens de consommation courante	1,93%	États-Unis
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Santé	1,79%	États-Unis
AIR LIQUIDE SA	Matériaux	1,63%	France
S&P GLOBAL INC	Secteur financier	1,61%	États-Unis
EDP- ENERGIAS DE PORTUGAL SA	Services aux collectivités	1,59%	Portugal
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	Secteur financier	1,58%	États-Unis

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

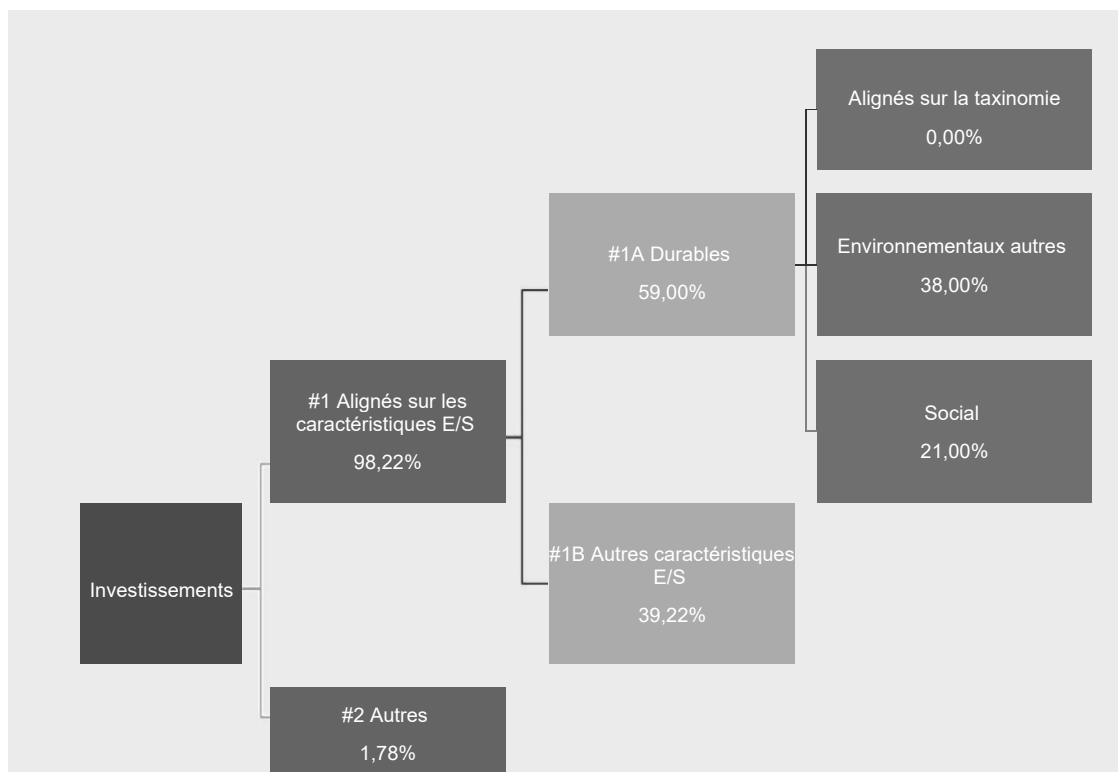
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 59,00 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

98,22 % du portefeuille du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (1,78 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides.

Le Fonds a investi dans des placements durables 59,00 % du segment de son portefeuille qui était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Santé	20,17%
Technologies de l'information	18,86%
Secteur financier	13,96%
Biens de consommation courante	13,92%
Industrie	11,13%
Biens de consommation discrétionnaire	7,76%
Services aux collectivités	4,60%
Services de communication	4,16%
Matériaux	3,66%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Marchés financiers	8,98%
Logiciels	7,61%
Équipements et fournitures de soins de santé	7,39%
Services publics d'électricité	4,60%
Outils et services de sciences de la vie	4,59%
Distribution de produits alimentaires et de consommation courante	4,22%
Produits personnels	4,07%
Semi-conducteurs et équipements pour semi-conducteurs	3,55%
Assurances	3,39%
Produits pharmaceutiques	3,30%
Matériel informatique, stockage et périphériques	2,91%
Transports terrestres	2,88%
Chimie	2,85%
Équipements, instruments et composants électroniques	2,69%
Biotechnologie	2,61%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

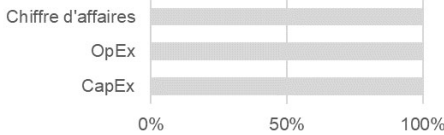
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

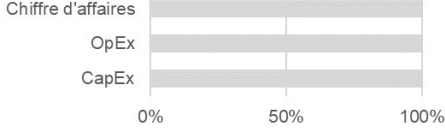
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes telles que définies à l'article 16 et à l'article 10, paragraphe 2, du règlement de l'UE relatif à la taxonomie.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxonomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Non applicable

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxonomie de l'UE ?

En raison de sa stratégie d'investissement, le Fonds n'a pas réalisé d'investissements durables ayant un objectif environnemental aligné avec la taxonomie de l'UE ; par conséquent, à fin février 2023, 38,00 % du portefeuille du Fonds était composé d'investissements ayant un objectif environnemental non aligné avec la taxonomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

La proportion d'investissements durables sur le plan social s'établissait à 21,00 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « #2 Autres » s'établissait à 1,78 % et comprenait les liquidités conservées en dépôt ou dans des instruments dérivés utilisés en couverture, non soumises à un objectif social ou environnemental minimum.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

1. Le Gestionnaire de portefeuille a utilisé son propre système de notation et sa recherche fondamentale pour déterminer comment une entreprise gère ses risques et opportunités ESG, en incluant un critère de bonne gouvernance. Le système de notation comprenait quatre niveaux de notation : AAA, AA, A et B, ces notations étant attribuées aux entreprises sur la base de leur stratégie en matière de durabilité et de leurs performances sur les critères ESG. Toutes les entreprises du Fonds ont été évaluées. Au 31/12/2022, la répartition des notations pour ce Fonds était la suivante :

AAA : 38%

AA : 44%

R : 18%

B : 0%

2. Le gestionnaire de portefeuille a entretenu un dialogue permanent avec les entreprises de son portefeuille. L'engagement ESG de ClearBridge combinait généralement deux objectifs qui se recoupaient :

- Recherche : Mieux comprendre les questions ESG susceptibles de modifier notre thèse d'investissement
- L'impact : Encourager des changements spécifiques au sein de l'entreprise susceptibles d'avoir une incidence positive dans le monde réel.

Pour plus de détails sur notre approche de l'engagement, veuillez vous référer à notre politique d'engagement et de gestion qui se trouve à l'adresse suivante : <https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshipolicy.pdf>

3. Le Fonds n'a pas investi dans les seuils de revenus fixés repris dans le prospectus pour les secteurs suivants :

- Tabac
- Armes controversées
- Jeux d'argent
- Divertissements pour adultes

4. Le Fonds n'a pas investi dans des entreprises qui violent un ou plusieurs des dix principes dans les quatre domaines couverts par l'UNGC (droits de l'homme, normes internationales du travail, environnement et lutte contre la corruption).



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Non applicable



Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

☐ ☐ **OUI**

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif environnemental** : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif social** : ____%

☒ ☒ **NON**

☒ Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 57,35% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Pour sélectionner les titres du compartiment dans la période sous rubrique, le gestionnaire de portefeuille utilisait un processus de recherche et d'engagement exclusif qui visait à déterminer le profil de la société sur le plan environnemental, social et de gouvernance (ESG). Ce processus exclusif inclut un système d'évaluation ESG utilisant une cartographie de matérialité pour identifier les caractéristiques ESG spécifiques de l'investissement.

Les caractéristiques ESG identifiées incluent notamment :

- Les facteurs environnementaux tels que les pratiques environnementales d'une entreprise, les émissions de gaz à effet de serre (GES) et les mesures d'atténuation du changement climatique telles que les plans de décarbonation et les investissements favorisant la transition vers une économie à plus faibles émissions de carbone ;
- Les facteurs sociaux tels que l'approche d'une entreprise en matière de relations communautaires, de sécurité et de santé au travail et de fourniture d'un accès équitable aux services essentiels.

Le Gestionnaire de portefeuille a appliqué sa méthodologie ESG à la totalité des investissements au cours de la période. En outre, le Fonds a respecté son engagement de 15 % minimum d'« investissement durable ».

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer l'atteinte de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds étaient les suivants :

- la proportion du Fonds détenue dans des investissements durables tels que définis par la méthodologie exclusive du gestionnaire de portefeuille en matière d'investissements durables, qui était de 57 % ; et
- et la note ESG du portefeuille du Fonds (7,31) par rapport à celle de l'univers d'investissement (6,45), comme le montre le tableau ci-dessous ;

Lorsque les notes ESG sont basées sur les données MSCI, elles sont à pondération égale pour la « note ESG de l'univers investissable » et à pondération du portefeuille pour la « note ESG du Fonds ». En outre, nous constatons que la performance du Fonds est supérieure à celle de l'Univers investissable évaluée par d'autres fournisseurs externes de notation ESG. L'Univers investissable du Fonds comprend 200 actions d'infrastructures, collectivement appelées RARE200, qui sont passées en revue trimestriellement dans le cadre du processus d'investissement.

Nom de l'ICP de durabilité	Valeur
Notation ESG du Fonds	7,31
Notation ESG de l'univers investissable	6,45

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Étant donné que le compartiment a pour mandat d'investir dans des actifs d'infrastructure de base et que les infrastructures jouent un rôle important tant dans la fourniture de services essentiels que dans la transition énergétique, le compartiment détenait des investissements qui contribuaient aux objectifs durables liés aux objectifs d'atténuation et/ou d'adaptation au changement climatique, et/ou qui apportaient une contribution sociale positive.

Parmi les investissements durables, les principales contributions aux objectifs étaient les suivantes :

- Les entreprises de services publics d'électricité qui soutiennent la transition vers une économie à faibles émissions de carbone et donc l'atténuation du changement climatique (32%)
- Les infrastructures de mobilité à faibles émissions qui soutiennent la transition vers une économie à faibles émissions de carbone et donc l'atténuation du changement climatique (38%)
- Les entreprises de services publics d'eau qui soutiennent l'adaptation au changement climatique et l'impact social en fournissant un accès à de l'eau propre et fiable (18%)
- Les infrastructures de communication qui peuvent fournir une alternative au transport ainsi qu'un impact social en fournissant un accès à des services essentiels (12%)

Les éléments ci-dessus ont été initialement évalués en considérant les contributions à l'un des deux éléments suivants :

- Alignement des produits et services sur les ODD (45 % du portefeuille)
- Objectifs d'intensité des GES et de réduction des émissions dans l'ensemble des activités économiques d'une entreprise, déterminés par le biais d'un objectif de décarbonation vérifié par un tiers et aligné sur l'Accord de Paris (48 % du portefeuille).

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé une combinaison de scores de risque grave de controverse obtenus par des tiers, de vérifications basées sur des normes mondiales, y compris le respect du Pacte mondial des Nations unies, la prise en compte des principales incidences négatives* et d'autres facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance importants, qui ont été intégrés dans la recherche fondamentale du gestionnaire de portefeuille et dans son processus exclusif de notation ESG. Ce dernier comprenait une évaluation de la qualité de la gouvernance, afin de déterminer si les investissements portaient un préjudice important à un objectif d'investissement durable.

En outre, le gestionnaire de portefeuille utilise son processus d'engagement pour identifier les meilleurs titres de leur catégorie.

* Les PIN prises en compte ont été déterminées par la matérialité ESG par sous-secteur, évaluée par le gestionnaire de portefeuille via sa méthodologie exclusive au cours de son processus de notation ESG, ou à l'aide des données disponibles.

-----Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Le processus d'investissement du gestionnaire de portefeuille intégrait les paramètres ESG par des recherches ascendantes qui s'appuyaient sur différentes sources de données, notamment les PIN. Les PIN ont été examinés dans le contexte du sous-secteur d'infrastructure concerné.

La manière dont les PIN ont été prises en compte est exposée plus en détail ci-dessous.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le gestionnaire de portefeuille soutient les principes du Pacte mondial des Nations unies. Par conséquent, le Fonds n'a pas investi dans des sociétés qui violaient l'un des dix principes dans chacun des quatre domaines (droits de l'homme, travail, environnement et lutte contre la corruption) du pacte.

Le gestionnaire de portefeuille a fait appel à un fournisseur de données tiers qui contrôlait le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies. En cas de divergence ou de désaccord entre les recherches du gestionnaire de portefeuille et l'évaluation d'une controverse spécifique par le prestataire, le gestionnaire de portefeuille, les membres de l'équipe chargée de la conformité et l'analyste sectoriel ou de portefeuille engageaient un dialogue avec l'entreprise sur la question. Si le gestionnaire de portefeuille parvenait à un consensus sur le fait que l'entreprise avait pris les mesures nécessaires pour répondre à la controverse, ou qu'elle avait effectivement remédié au problème, il devait fournir une explication détaillée des raisons pour lesquelles l'entreprise pouvait continuer à faire l'objet d'un investissement.

Pour s'assurer que les investissements durables étaient conformes aux lignes directrices de l'OCDE, le gestionnaire de portefeuille a fait appel à un prestataire externe afin de contrôler la conformité et les violations potentielles.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les PIN faisaient partie intégrante du processus ESG du gestionnaire de portefeuille, de même que le respect du principe de ne pas causer de préjudice important. Les processus ESG tenant compte des PIN étaient les suivants : (i) les scores ESG exclusifs ; (ii) le suivi des controverses et les engagements correspondants ; et (iii) les critères ESG quantitatifs.

Les PIN suivantes ont été prises en compte :

PAI 1 (Émissions de GES), PAI 2 (Empreinte carbone), PAI 3 (Intensité des GES)

Dans le cadre de son processus ascendant de sélection des titres, le Gestionnaire de portefeuille a évalué les risques et les opportunités spécifiques liés au climat auxquels les entreprises sont exposées. Le processus prenait en compte ces éléments ainsi que les données relatives aux GES parmi d'autres considérations environnementales, sociales et de gouvernance. Chaque sous-secteur d'infrastructure a été évalué selon une pondération de facteurs adaptés aux activités. La gestion des émissions de GES par la société, y compris ses plans de réduction crédibles, font aussi l'objet d'un examen.

PIN #5 (part de production d'énergie non renouvelable)

Dans le cadre de ses recherches ascendantes, le Gestionnaire de portefeuille a évalué le mix énergétique, notamment sur le plan du changement climatique et des cibles de carboneutralité. La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'UE. Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

PIN #10 (violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales)

Veuillez consulter la rubrique « Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? »

PIN #14 (exposition à des armes controversées)

Le Fonds n'a investi et n'investit dans aucune société qui génère du chiffre d'affaires dans les domaines suivants : (a) armes prohibées conformément (i) à la Convention sur l'interdiction de l'emploi, du stockage, de la production et du transfert des mines antipersonnel et sur leur destruction et (ii) à la Convention sur l'interdiction des armes à sous-munitions, et (b) armes de catégorie B ou C conformément à la Convention des Nations Unies sur l'interdiction des armes biologiques et à la Convention des Nations Unies sur l'interdiction des armes chimiques, respectivement.

Les chiffres relatifs aux Principales Incidences Négatives ci-dessous datent du 31 décembre 2022.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Émissions de GES : Émissions totales en USD	319 510,77	92,41%
Empreinte carbone en USD	313,64	92,41%
Intensité des GES en USD	2 125,77	95,98%
Exposition à des entreprises actives dans le secteur des combustibles fossiles.	43,82%	92,41%
Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité	0,00%	92,41%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	95,98%
Mixité du conseil d'administration	37,37%	92,41%
Exposition à des armes controversées	0,00%	92,41%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
NEXTERA ENERGY INC	Services aux collectivités	4,63%	États-Unis
GETLINK SE	Industrie	3,81%	France
AMERICAN TOWER CORP	commercial	3,78%	États-Unis
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	Services aux collectivités	3,59%	États-Unis
EAST JAPAN RAILWAY CO	Industrie	3,55%	Japon
SSE PLC	Services aux collectivités	3,46%	Royaume-Uni
CHENIERE ENERGY INC	Énergie	3,14%	États-Unis
ENBRIDGE INC	Énergie	3,13%	Canada
TRANSURBAN GROUP	Industrie	3,07%	Australie
IBERDROLA SA	Services aux collectivités	2,99%	Espagne
CONSTELLATION ENERGY CORP	Services aux collectivités	2,92%	États-Unis
PEMBINA PIPELINE CORP	Énergie	2,89%	Canada
CELLNEX TELECOM SA	Services de communication	2,87%	Espagne
UNION PACIFIC CORP	Industrie	2,87%	États-Unis
FERROVIAL SA	Industrie	2,85%	Espagne

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

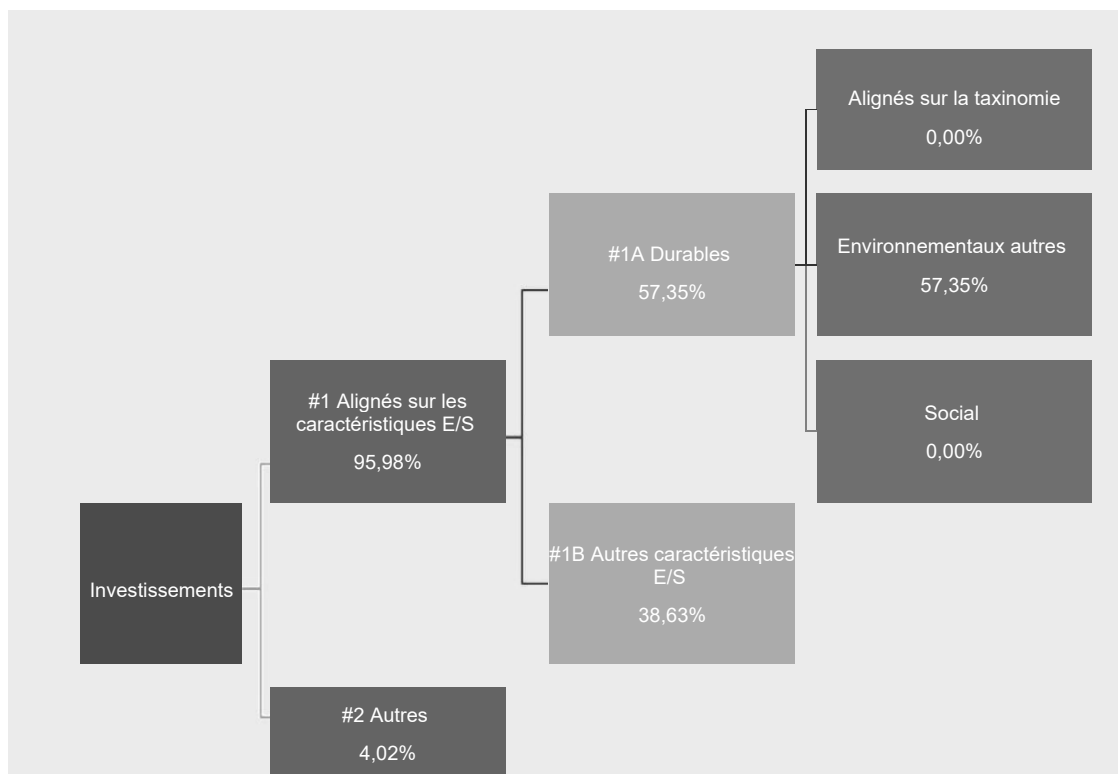
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 57,35 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

95,98 % du portefeuille du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (4,02 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides.

Le Fonds a investi dans des placements durables 57,35 % du segment de son portefeuille qui était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Services aux collectivités	51,68%
Industrie	24,64%
Énergie	13,18%
commercial	3,73%
Services de communication	2,75%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Services publics d'électricité	36,83%
Pétrole, gaz et combustibles	13,18%
Transports terrestres	11,44%
Services publics d'eau	9,85%
Infrastructures de transport	9,02%
Construction et ingénierie	4,18%
Fonds de placements immobiliers	3,73%
Multiservices publics	3,12%
Services de télécommunications diversifiés	2,75%
Services publics de gaz	1,87%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

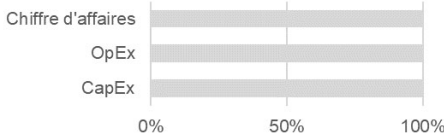
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

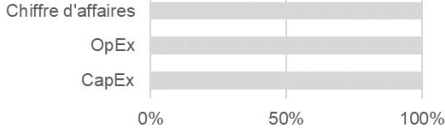
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes telles que définies à l'article 16 et à l'article 10, paragraphe 2, du règlement de l'UE relatif à la taxonomie.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxonomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Non applicable

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxonomie de l'UE ?

En raison de sa stratégie d'investissement, le Fonds n'a pas réalisé d'investissements durables ayant un objectif environnemental aligné avec la taxonomie de l'UE ; par conséquent, à fin février 2023, 57,35 % du portefeuille du Fonds était composé d'investissements ayant un objectif environnemental non aligné avec la taxonomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

La proportion d'investissements durables sur le plan social s'établissait à 0,00 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « #2 Autres » s'établissait à 4,02 % et comprenait les liquidités conservées en dépôt ou dans des instruments dérivés utilisés en couverture, non soumises à un objectif social ou environnemental minimum.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

1. Le Gestionnaire de portefeuille a appliqué son processus ESG, qui est intégré et pris en compte dans toutes les composantes clés du processus d'investissement.

Il s'agit notamment des éléments suivants :

- Des critères négatifs à la constitution de l'univers investissable afin de respecter les limites d'extraction et de production des combustibles fossiles, de tabac, d'armes et des manquements à la Convention des Nations Unies sur les changements climatiques.
- Application de son processus à trois piliers pour l'intégration ESG, à savoir :
 - Ajustements des flux de trésorerie prévisionnels sur la base des facteurs ESG
 - Ajustement du rendement requis sur la base du risque ESG tel qu'évalué par la fiche de notation exclusive des gestionnaires (voir ci-dessous)
 - Engagement, y compris le suivi des controverses
- Autres analyses et processus ESG, y compris, mais sans s'y limiter, les examens de durabilité des fiches de notation ESG des entreprises, l'analyse du bouquet énergétique et les plans de décarbonation, la prise en compte des PIN, etc.

Certaines des actions susmentionnées sont décrites plus en détail ci-dessous, ainsi que leurs résultats.

2. Le Gestionnaire de portefeuille a utilisé son propre système de notation et sa recherche fondamentale pour déterminer comment une entreprise gère ses risques et opportunités ESG. Le système de notation comprenait quatre niveaux de notation : AAA, AA, A et B, ces notations étaient attribuées aux entreprises sur la base de leur stratégie en matière de durabilité et de leurs performances sur les critères ESG. Toutes les entreprises du Fonds ont été évaluées. Au 31/12/22, la répartition des notations pour ce fonds était la suivante :

- AAA : 25%
- AA : 60%
- R : 15%
- B : 0%

3. Le Gestionnaire de portefeuille a entretenu un dialogue permanent avec les entreprises de son portefeuille. L'engagement ESG de ClearBridge combinait généralement deux objectifs qui se recoupaient :

- Recherche : Mieux comprendre les questions ESG susceptibles de modifier notre thèse d'investissement
- L'impact : Encourager des changements spécifiques au sein de l'entreprise susceptibles d'avoir une incidence positive dans le monde réel.

Des changements spécifiques susceptibles d'avoir une incidence positive pendant la rapport, a pris les formes suivantes :

- Sur le plan environnemental : 48%
- Sur le plan social : 22%
- Gouvernance : 30%

4. En conséquence, le Fonds a respecté les éléments contraignants de sa stratégie d'investissement.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Non applicable

FTGF Clearbridge Global Infrastructure Income Fund



**FRANKLIN
TEMPLETON**

LEI de l'entité : 54930016JDVIT9OWQK33

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ ☐ **OUI**

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif environnemental** : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif social** : ____%

☒ ☒ **NON**

☒ Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 35,52% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Fonds a promu des impacts positifs dans les domaines suivants :

- atténuation du changement climatique ;
- adaptation au changement climatique ; et/ou
- impact social.

En favorisant un impact positif dans les domaines susmentionnés, le Fonds a promu les caractéristiques environnementales et/ou sociales suivantes au cours de la période de référence :

- investissements qui soutiennent la transition vers une économie bas carbone par une réduction directe des émissions, par la mise en oeuvre de solutions de rechange à faibles émissions ou par la fourniture de produits ou services de substitution moins émetteurs comme le transport ferroviaire par opposition au transport aérien ou routier ;
- investissements dans des infrastructures favorisant l'adaptation au changement climatique ;
- infrastructures à impact social, permettant notamment la fourniture équitable de services essentiels tels que l'accès à l'eau, à l'énergie et aux communications ; et
- conformité aux principes du Pacte mondial des Nations Unies (UNGC).

Pour sélectionner les titres du compartiment dans la période sous rubrique, le gestionnaire de portefeuille utilisait un processus de recherche et d'engagement exclusif qui visait à déterminer le profil de la société sur le plan environnemental, social et de gouvernance (ESG). Ce processus exclusif inclut un système d'évaluation ESG utilisant une cartographie de matérialité pour identifier les caractéristiques ESG spécifiques de l'investissement.

Le Gestionnaire de portefeuille a appliqué sa méthodologie ESG à la totalité des investissements au cours de la période. En outre, le Fonds a respecté son engagement de 15 % minimum d' « investissement durable ».

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer l'atteinte de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds étaient les suivants :

- la proportion du Fonds détenue dans des investissements durables tels que définis par la méthodologie exclusive du gestionnaire de portefeuille en matière d'investissements durables, qui était de 35,5 % ; et
- et la note ESG du portefeuille du Fonds (7,89) par rapport à celle de l'univers d'investissement (6,58), comme le montre le tableau ci-dessous ;

Lorsque les notes ESG sont basées sur les données MSCI, elles sont à pondération égale pour la « note ESG de l'univers investissable » et à pondération du portefeuille pour la « note ESG du Fonds ». En outre, nous constatons que la performance du Fonds est supérieure à celle de l'Univers investissable évaluée par d'autres fournisseurs externes de notation ESG.

Nom de l'ICP de durabilité	Valeur
Notation ESG du Fonds	7,89
Notation ESG de l'univers investissable	6,58

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Étant donné que le Compartiment a pour mandat d'investir dans des actifs d'infrastructure de base et que les infrastructures jouent un rôle important tant dans la fourniture de services essentiels que dans la transition énergétique, le compartiment détenait des investissements qui contribuaient aux objectifs durables liés aux objectifs d'atténuation et/ou d'adaptation au changement climatique, tout en apportant une contribution sociale positive.

Parmi les investissements durables, les principales contributions aux objectifs étaient les suivantes :

- Les entreprises de services publics d'électricité et d'énergies renouvelables qui soutiennent la transition vers une économie à faibles émissions de carbone et donc l'atténuation du changement climatique (60%)
- Les infrastructures de mobilité à faibles émissions qui soutiennent la transition vers une économie à faibles émissions de carbone et donc l'atténuation du changement climatique (24%)
- Les entreprises de services publics d'eau qui soutiennent l'adaptation au changement climatique et l'impact social en fournissant un accès à de l'eau propre et fiable (15%)

Les éléments ci-dessus ont été initialement évalués en considérant les contributions à l'un des deux éléments suivants :

- Alignement des produits et services sur les ODD (36,5 % du portefeuille)
- Objectifs d'intensité des GES et de réduction des émissions dans l'ensemble des activités économiques d'une entreprise, déterminés par le biais d'un objectif de décarbonation vérifié par un tiers et aligné sur l'Accord de Paris (34,4 % du portefeuille).

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Le gestionnaire de portefeuille a utilisé une combinaison de scores de risque grave de controverse obtenus par des tiers, de vérifications basées sur des normes mondiales, y compris le respect du Pacte mondial des Nations unies, la prise en compte des principales incidences négatives* et d'autres facteurs environnementaux, sociaux et de gouvernance importants, qui ont été intégrés dans la recherche fondamentale du gestionnaire de portefeuille et dans son processus exclusif de notation ESG. Ce dernier comprenait une évaluation de la qualité de la gouvernance, afin de déterminer si les investissements portaient un préjudice important à un objectif d'investissement durable.

En outre, le gestionnaire de portefeuille utilise son processus d'engagement pour identifier les meilleurs titres de leur catégorie.

* Les PIN prises en compte ont été déterminées par la matérialité ESG par sous-secteur, évaluée par le gestionnaire de portefeuille via sa méthodologie exclusive au cours de son processus de notation ESG, ou à l'aide des données disponibles.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Le processus d'investissement du gestionnaire de portefeuille intégrait les paramètres ESG par des recherches ascendantes qui s'appuyaient sur différentes sources de données, notamment les PIN. Les PIN ont été examinés dans le contexte du sous-secteur d'infrastructure concerné.

La manière dont les PIN ont été prises en compte est exposée plus en détail ci-dessous.

=====

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le gestionnaire de portefeuille soutient les principes du Pacte mondial des Nations unies. Par conséquent, le Fonds n'a pas investi dans des sociétés qui violaient l'un des dix principes dans chacun des quatre domaines (droits de l'homme, travail, environnement et lutte contre la corruption) du pacte.

Le gestionnaire de portefeuille a fait appel à un fournisseur de données tiers qui contrôlait le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies. En cas de divergence ou de désaccord entre les recherches du gestionnaire de portefeuille et l'évaluation d'une controverse spécifique par le prestataire, le gestionnaire de portefeuille, les membres de l'équipe chargée de la conformité et l'analyste sectoriel ou de portefeuille engageaient un dialogue avec l'entreprise sur la question. Si le gestionnaire de portefeuille parvenait à un consensus sur le fait que l'entreprise avait pris les mesures nécessaires pour répondre à la controverse, ou qu'elle avait effectivement remédié au problème, il devait fournir une explication détaillée des raisons pour lesquelles l'entreprise pouvait continuer à faire l'objet d'un investissement.

Pour s'assurer que les investissements durables étaient conformes aux lignes directrices de l'OCDE, le gestionnaire de portefeuille a fait appel à un prestataire externe afin de contrôler la conformité et les violations potentielles.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les PIN faisaient partie intégrante du processus ESG du gestionnaire de portefeuille, de même que le respect du principe de ne pas causer de préjudice important. Les processus ESG tenant compte des PIN étaient les suivants : (i) les scores ESG exclusifs ; (ii) le suivi des controverses et les engagements correspondants ; et (iii) les critères ESG quantitatifs.

Les PIN suivantes ont été prises en compte :

PAI 1 (Émissions de GES), PAI 2 (Empreinte carbone), PAI 3 (Intensité des GES)

Dans le cadre de son processus ascendant de sélection des titres, le Gestionnaire de portefeuille a évalué les risques et les opportunités spécifiques liés au climat auxquels les entreprises sont exposées. Le processus prenait en compte ces éléments ainsi que les données relatives aux GES parmi d'autres considérations environnementales, sociales et de gouvernance. Chaque sous-secteur d'infrastructure a été évalué selon une pondération de facteurs adaptés aux activités. La gestion des émissions de GES par la société, y compris ses plans de réduction crédibles, a aussi fait l'objet d'un examen.

PIN #5 (part de production d'énergie non renouvelable)

Dans le cadre de ses recherches ascendantes, le Gestionnaire de portefeuille a évalué le mix énergétique, notamment sur le plan du changement climatique et des cibles de carboneutralité.

PIN #10 (violations des principes du pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE pour les entreprises multinationales)

Veuillez consulter la rubrique « Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? »

PIN #14 (exposition à des armes controversées)

Le Fonds n'a investi et n'investit dans aucune société qui génère du chiffre d'affaires dans les domaines suivants : (a) armes prohibées conformément (i) à la Convention sur l'interdiction de l'emploi, du stockage, de la production et du transfert des mines antipersonnel et sur leur destruction et (ii) à la Convention sur l'interdiction des armes à sous-munitions, et (b) armes de catégorie B ou C conformément à la Convention des Nations Unies sur l'interdiction des armes biologiques et à la Convention des Nations Unies sur l'interdiction des armes chimiques, respectivement.

Les chiffres relatifs aux Principales Incidences Négatives ci-dessous datent du 31 décembre 2022.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Émissions de GES : Émissions totales en USD	139 114,60	96,67%
Empreinte carbone en USD	351,77	96,67%
Intensité des GES en USD	2 500,32	98,02%
Exposition à des entreprises actives dans le secteur des combustibles fossiles.	61,11%	94,59%
Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité	0,00%	94,59%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	98,02%
Mixité du conseil d'administration	37,07%	94,59%
Exposition à des armes controversées	0,00%	94,59%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
IBERDROLA SA	Services aux collectivités	4,72%	Espagne
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	Services aux collectivités	4,36%	États-Unis
NATIONAL GRID PLC	Services aux collectivités	4,34%	Royaume-Uni
SSE PLC	Services aux collectivités	4,28%	Royaume-Uni
EDP- ENERGIAS DE PORTUGAL SA	Services aux collectivités	3,98%	Portugal
APA GROUP	Services aux collectivités	3,77%	Australie
SNAM SPA	Services aux collectivités	3,49%	Italie
PEMBINA PIPELINE CORP	Énergie	3,43%	Canada
ENBRIDGE INC	Énergie	3,35%	Canada
ENTERGY CORP	Services aux collectivités	3,26%	États-Unis
ATLAS ARTERIA	Industrie	3,23%	Australie
NEXTERA ENERGY INC	Services aux collectivités	3,22%	États-Unis
TRANSURBAN GROUP	Industrie	3,10%	Australie
CLEARWAY ENERGY INC	Services aux collectivités	2,98%	États-Unis
CROWN CASTLE INC	commercial	2,95%	États-Unis

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

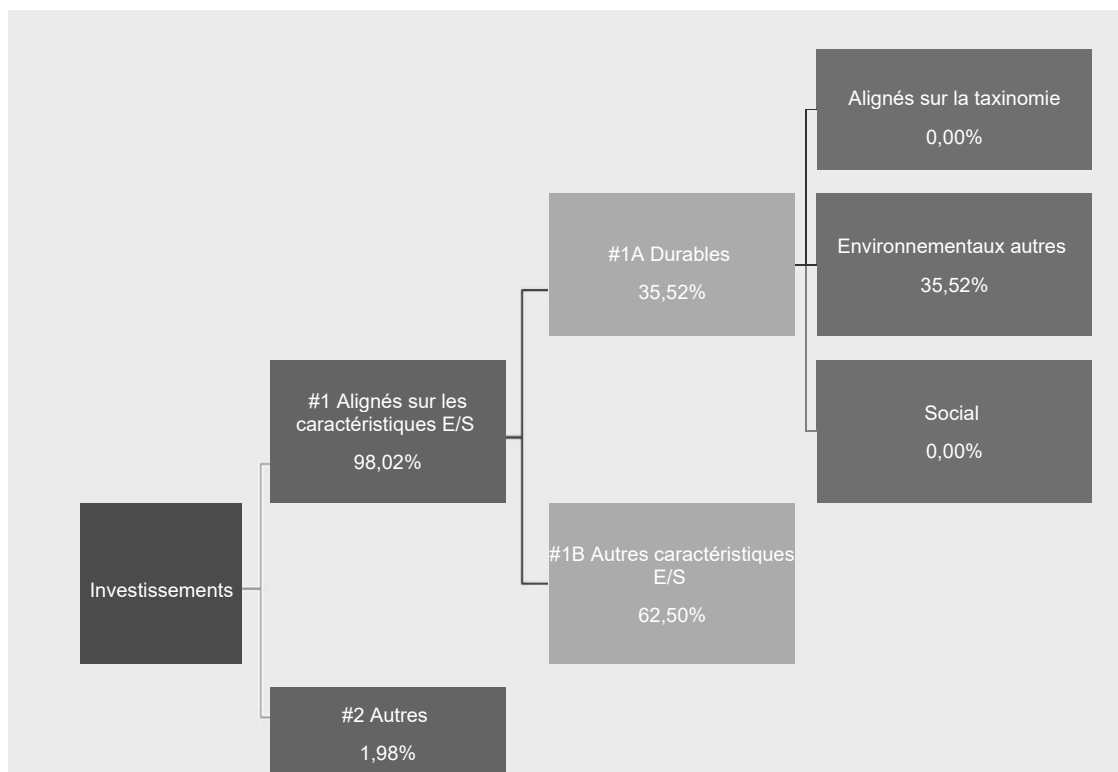
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 35,52 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

98,02 % du portefeuille du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (1,98 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides.

Le Fonds a investi dans des placements durables 35,52 % du segment de son portefeuille qui était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Services aux collectivités	66,99%
Énergie	15,36%
Industrie	12,93%
commercial	2,75%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Services publics d'électricité	32,55%
Pétrole, gaz et combustibles	15,36%
Services publics de gaz	13,56%
Multiservices publics	8,82%
Infrastructures de transport	7,68%
Producteurs indépendants d'énergie et d'électricité renouvelable	6,04%
Services publics d'eau	6,03%
Transports terrestres	3,10%
Fonds de placements immobiliers	2,75%
Construction et ingénierie	2,14%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

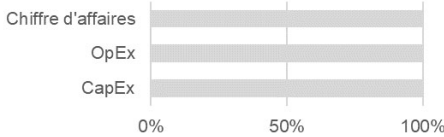
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

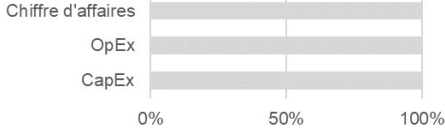
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes telles que définies à l'article 16 et à l'article 10, paragraphe 2, du règlement de l'UE relatif à la taxonomie.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxonomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Non applicable

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxonomie de l'UE ?

En raison de sa stratégie d'investissement, le Fonds n'a pas réalisé d'investissements durables ayant un objectif environnemental aligné avec la taxonomie de l'UE ; par conséquent, à fin février 2023, 35,52 % du portefeuille du Fonds était composé d'investissements ayant un objectif environnemental non aligné avec la taxonomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

La proportion d'investissements durables sur le plan social s'établissait à 0,00 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « #2 Autres » s'établissait à 1,98 % et comprenait les liquidités conservées en dépôt ou dans des instruments dérivés utilisés en couverture, non soumises à un objectif social ou environnemental minimum.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

1. Le Gestionnaire de portefeuille a appliqué son processus ESG, qui est intégré et pris en compte dans toutes les composantes clés du processus d'investissement.

Il s'agit notamment des éléments suivants :

- Des critères négatifs à la constitution de l'univers investissable afin de respecter les limites d'extraction et de production des combustibles fossiles, de tabac, d'armes et des manquements à la Convention des Nations Unies sur les changements climatiques.
- L'application de son processus à trois piliers pour l'intégration ESG, à savoir :
 - Ajustements des flux de trésorerie prévisionnels sur la base des facteurs ESG
 - Ajustement du rendement requis sur la base du risque ESG tel qu'évalué par la fiche de notation exclusive des gestionnaires (voir ci-dessous)
 - Engagement, y compris le suivi des controverses
- Autres analyses et processus ESG, y compris, mais sans s'y limiter, les examens de durabilité des fiches de notation ESG des entreprises, l'analyse du bouquet énergétique et les plans de décarbonation, la prise en compte des PIN, etc.

Certaines des actions susmentionnées sont décrites plus en détail ci-dessous, ainsi que leurs résultats.

2. Le Gestionnaire de portefeuille a utilisé son propre système de notation et sa recherche fondamentale pour déterminer comment une entreprise gère ses risques et opportunités ESG. Le système de notation comprenait quatre niveaux de notation : AAA, AA, A et B, ces notations étaient attribuées aux entreprises sur la base de leur stratégie en matière de durabilité et de leurs performances sur les critères ESG. Toutes les entreprises du Fonds ont été évaluées. Au 31/12/22, la répartition des notations pour ce fonds était la suivante :

- AAA : 11%
- AA : 73%
- R : 16%
- B : 0%

3. Le Gestionnaire de portefeuille a entretenu un dialogue permanent avec les entreprises de son portefeuille. L'engagement ESG du Gestionnaire de portefeuille combinait généralement deux objectifs qui se recoupaient :

- Recherche : Mieux comprendre les questions ESG susceptibles de modifier notre thèse d'investissement
- L'impact : Encourager des changements spécifiques au sein de l'entreprise susceptibles d'avoir une incidence positive dans le monde réel.

Des changements spécifiques susceptibles d'avoir une incidence positive pendant la période de référence, a pris les formes suivantes :

- Sur le plan environnemental : 48%
- Sur le plan social : 22%
- Gouvernance : 30%

4. En conséquence, le Fonds a respecté les éléments contraignants de sa stratégie d'investissement.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Non applicable

FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund



**FRANKLIN
TEMPLETON**

LEI de l'entité : 549300E56Y0Z3ZFW4W35

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ ☐ **OUI**

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif environnemental** : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif social** : ____%

☒ ☒ **NON**

☒ Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 73,90% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Pour répondre aux caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le produit financier, le fonds incluait des investissements dans des entreprises :

- qui réduisent et contrôlent leurs émissions de carbone ;
- dont l'exposition à l'industrie des combustibles fossiles est limitée ou nulle ;
- qui mettent l'accent sur l'utilisation efficace de l'énergie et de l'eau ;
- qui limitent la pollution et contrôlent les risques liés à la biodiversité ;
- qui ont de bons antécédents en matière de droits de l'homme et de relations sociales ; et
- qui ne sont pas exposées à des armes controversées.

Toutes les positions du Fonds ne promouvaient pas nécessairement toutes les caractéristiques. Ces facteurs ont été pris en compte dans le cadre de l'analyse de chaque entreprise, et leur prise en compte a été essentielle dans l'analyse de l'investissement.

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

À la fin de la période de référence, 73,9 % du Compartiment étaient détenus dans des investissements durables, tels que définis par le cadre exclusif du Gestionnaire de portefeuille basé sur les objectifs de développement durable (ODD) des Nations unies.

Les 14 indicateurs de PIN obligatoires et deux indicateurs supplémentaires ont été pris en compte et mesurés. Veuillez vous référer aux valeurs indiquées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? ».

À la fin de la période, 5 % de la valeur nette d'inventaire (VNI) du portefeuille étaient investis dans des entreprises ayant approuvé des objectifs fondés sur la science dans le cadre de l'initiative SBT (Science-Based Targets Initiative), et 24 % supplémentaires l'ont été dans des entreprises s'étant engagées à fixer des objectifs au cours des deux prochaines années.

Au cours de la période de référence, l'équipe de gestion a mené 25 engagements sur des sujets environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG) à des fins d'information ou dans le but d'influencer les comportements, couvrant des sujets tels que la composition des organes de gouvernance, les plans de réduction des émissions de gaz à effet de serre (GES) des entreprises et la promotion d'une meilleure divulgation des informations des entreprises. À la fin de l'année, les engagements en étaient au stade de finalisation, comme indiqué ci-dessous.

En outre, le Gestionnaire de portefeuille s'est appuyé sur des mesures de données externes (par exemple MSCI), notamment pour l'empreinte carbone et la notation ESG, sur sa recherche interne (notamment pour l'analyse du coût du carbone et les facteurs de risque liés à l'esclavage moderne), afin d'étayer son analyse et sur une notation interne exclusive de la gouvernance et du risque de durabilité, qui ont servi de base à la sélection des titres, aux exclusions et à la procédure d'engagement.

Nom de l'ICP de durabilité	Valeur
1. L'entreprise est contactée pour évoquer les problématiques	0,00%
2. L'entreprise prend acte du contact	11,00%
3. Les problématiques font l'objet de discussions	44,00%
4. L'entreprise élabore un plan pour remédier aux problématiques	44,00%
5. L'entreprise traite le problème	0,00%

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Les investissements durables du compartiment comprenaient des titres de participation émis par des sociétés qui contribuaient, par leurs produits ou services, aux objectifs environnementaux ou sociaux d'un sous-ensemble pertinent de cibles sous-jacentes aux 17 Objectifs de développement durable (ODD). Au 31 décembre 2022, 82,10 % du Fonds étaient placés dans des investissements durables, soit plus que l'exigence minimale de 50 %.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Outre l'identification d'investissements durables potentiels par la cartographie des entreprises par rapport à un sous-ensemble spécifique de cibles des ODD, comme détaillé ci-dessus, les entreprises bénéficiaires d'investissements potentiels étaient soumises à l'évaluation, par le gestionnaire de portefeuille, du principe de « ne pas causer de préjudice important », qui était réalisée de deux manières :

1. une évaluation du respect des normes mondiales, basée sur les principes du Pacte mondial des Nations unies (PMNU), et des controverses liées aux autres aspects environnementaux des indicateurs de PIN.
2. une évaluation du principe de « ne pas causer de préjudice important » au regard des facteurs liés au changement climatique mis en évidence par les indicateurs de PIN, y compris des domaines tels que l'exposition de l'entreprise à l'extraction de combustibles fossiles et une empreinte carbone élevée et non maîtrisée dans un secteur à fortes émissions.

Lors de l'évaluation du principe de « ne pas causer de préjudice important » lié au changement climatique, le gestionnaire de portefeuille a également tenu compte de la nature des activités d'une société ainsi que de la présence de controverses ou de signaux provenant des indicateurs de PIN. Pour chaque groupe d'indicateurs de PIN, le gestionnaire de portefeuille a évalué la matérialité de chaque indicateur et la présence d'un préjudice potentiel important, cette évaluation étant réalisée à l'aide d'une analyse exclusive. Les résultats de l'évaluation du principe de « ne pas causer de préjudice important » ont influencé les notations de risque liées à la gouvernance et à la durabilité attribuées par le gestionnaire de portefeuille, mais cette évaluation est conçue pour fonctionner comme un processus parallèle aux notations de risque afin de respecter l'engagement de réaliser des « investissements durables » au sens du règlement SFDR. L'évaluation a pour but principal de déterminer s'il existait des preuves d'un préjudice important qui auraient empêché un investissement d'être considéré comme durable.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Dans sa gestion du Compartiment, le Gestionnaire de portefeuille a pris en compte les 14 indicateurs de PIN obligatoires et deux indicateurs supplémentaires. Les deux indicateurs supplémentaires étaient :

- Sur le plan environnemental : les investissements dans des entreprises sans initiative de réduction des émissions de carbone ; et
- Sur le plan social : l'absence de politique en matière de droits de l'homme.

L'analyse des sociétés par le Gestionnaire de portefeuille tenait compte de ces facteurs et lorsque le Gestionnaire de portefeuille identifiait de potentielles incidences négatives importantes, il engageait un dialogue avec les sociétés. Conformément aux exigences spécifiques du SFDR, le Gestionnaire de portefeuille a également établi des rapports sur les indicateurs de PIN en utilisant des données provenant de l'entreprise ou en recherchant des substituts lorsque celles-ci n'étaient pas disponibles.

Pour plus d'informations sur la manière dont l'analyse des entreprises par le gestionnaire de portefeuille a pris en compte ces facteurs, veuillez vous référer à la section ci-dessous intitulée « Comment ce produit financier a-t-il pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? ».

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Tout investissement durable potentiel identifié a été soumis à l'analyse ESG plus large du Gestionnaire de portefeuille qui a porté son attention sur le management, la culture, ainsi que sur le risque social et environnemental. Cette analyse s'articulait autour des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales, et le Gestionnaire de portefeuille s'est également concentré sur le risque d'exploitation sociale au sens des Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme.

Le Pacte mondial des Nations unies (dont les critères sont contraignants pour le compartiment) énonce 10 principes qui définissent les responsabilités minimales dans les domaines des droits de l'homme, des normes internationales du travail, de l'environnement et de la lutte contre la corruption, découlant des conventions établies.

Il existe un chevauchement important entre les principes du Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs de l'OCDE, qui sont effectivement pris en compte par le Gestionnaire de portefeuille à travers le filtrage relatif au Pacte mondial. D'autres instruments multilatéraux importants cités dans les principes directeurs constituent également des éléments de base des principes directeurs de l'OCDE, à savoir les Principes fondamentaux de l'OIT (Organisation internationale du travail) et la Déclaration universelle des droits de l'homme. Ils couvrent efficacement les controverses potentielles liées aux piliers clés de l'OCDE que sont les droits de l'homme, le droit du travail, l'environnement, la lutte contre la corruption et la protection des consommateurs.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les facteurs de durabilité peuvent avoir un impact sur les entreprises dans lesquelles le compartiment investit, et le gestionnaire de portefeuille est également conscient du fait que les entreprises elles-mêmes peuvent avoir un impact négatif, par exemple sur l'environnement, leurs employés ou les communautés dans lesquelles elles opèrent. Ces incidences négatives comprennent, sans s'y limiter, les émissions de gaz à effet de serre (GES) et d'autres formes de pollution, ou les violations potentielles du Pacte mondial des Nations unies. L'analyse des sociétés par le gestionnaire de portefeuille a tenu compte de ces facteurs et lorsqu'il identifiait de potentielles incidences négatives importantes, le gestionnaire de portefeuille engageait un dialogue avec les sociétés concernées, comme indiqué plus en détail dans la politique de gestion et d'engagement du gestionnaire de portefeuille. Conformément aux exigences spécifiques du SFDR, le gestionnaire de portefeuille a également établi des rapports sur les indicateurs de PIN en utilisant des données provenant de l'entreprise ou en recherchant des substituts lorsque celles-ci n'étaient pas disponibles.

L'analyse des PIN était intégrée au processus de diligence raisonnable du gestionnaire de portefeuille pour chaque société. L'évaluation des 14 PIN obligatoires et des deux PIN supplémentaires est regroupée en six domaines clés pour l'évaluation de la matérialité. Toutes les PIN n'étaient pas significatives pour chaque entreprise. Le gestionnaire de portefeuille évaluait si l'un des six domaines était important pour la société bénéficiaire et, lorsque c'était le cas, il l'intégrait dans ses évaluations de risque, sa thèse d'investissement et, le cas échéant, dans son activité d'engagement planifiée.

Les six principaux groupes de PIN sont les suivants :

- Emissions et la gestion du carbone — PIN #1 (émissions de gaz à effet de serre), #2 (empreinte carbone) et #3 (intensité des émissions de gaz à effet de serre des sociétés bénéficiaires des investissements ainsi qu'une PIN facultative sur les sociétés n'ayant pas mis en place d'initiative de réduction des émissions de carbone) ;
- l'exposition à des entreprises du secteur des combustibles fossiles — PIN #4 (exposition à des entreprises actives dans le secteur des combustibles fossiles) ;
- Efficacité énergétique et utilisation rationnelle de l'eau (PIN 5 (part de la consommation et de la production d'énergie non renouvelable) et 6 (intensité de la consommation d'énergie par secteur à fort impact)) ;
- Pollution et biodiversité — PIN n°7 (activités ayant une incidence négative sur les zones sensibles sur le plan de la biodiversité), #8 (rejets dans l'eau) et #9 (taux de déchets dangereux) ;
- Les droits de l'homme et les questions relatives aux employés (PIN n° 10-13 (violations des Principes directeurs de l'ONU et de l'OCDE ; absence de processus et de mécanismes de conformité permettant de contrôler le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE ; écarts de rémunération entre hommes et femmes non corrigés ; et mixité au sein des organes de gouvernance)) ; et
- L'exposition à des armes controversées — PIN #14 (exposition à des armes controversées).

Dans certains cas, tels que la PIN 10 (violations des Principes directeurs de l'ONU et de l'OCDE), le compartiment dispose de critères contraignants et n'investira pas dans des sociétés qui sont considérées comme « défaillantes » au regard du Pacte mondial des Nations unies. Conformément à la politique du gestionnaire en matière d'armes controversées, le compartiment ne détiendra pas de sociétés exposées à des armes controversées.

Des informations sur les PIN concernant les facteurs de durabilité sont disponibles dans la politique d'investissement du gestionnaire.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Émissions de GES : Émissions totales en EUR	4 751,00	96,54%
Empreinte carbone en EUR	347,32	96,54%
Intensité des GES en EUR	675,20	96,54%
Exposition à des entreprises actives dans le secteur des combustibles fossiles.	6,71%	96,54%
Part de la consommation et de la production d'énergie non renouvelable	97,76%	87,82%
Intensité de consommation énergétique : Agriculture en EUR	0,00	90,34%
Intensité de consommation énergétique : Industrie minière en EUR	0,00	90,34%
Intensité de consommation énergétique : Secteur manufacturier en EUR	0,45	90,34%
Intensité de consommation énergétique : Électricité en EUR	0,00	90,34%
Intensité de consommation énergétique : Eau en EUR	4,70	90,34%
Intensité de consommation énergétique : Construction en EUR	0,00	90,34%
Intensité de consommation énergétique : Négoce et véhicules en EUR	0,00	90,34%
Intensité de consommation énergétique : Transports et entreposage en EUR	0,07	90,34%
Intensité de consommation énergétique : Immobilier en EUR	0,00	90,34%
Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité	0,00%	96,54%
Rejets dans l'eau en EUR	0,09	9,88%
Déchets dangereux EUR	0,70	45,28%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	98,19%
Absence de processus et de mécanismes de conformité pour garantir le respect des principes du Pacte mondial des Nations Unies (UNGC) et les principes directeurs de l'Organisation de coopération et de développement économiques (OCDE) à l'intention des entreprises multinationales.	71,01%	96,54%
Écarts de rémunération hommes/femmes non ajustés	24,97%	6,43%
Mixité du conseil d'administration	20,50%	96,54%
Exposition à des armes controversées	0,00%	96,54%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	Technologies de l'information	6,67%	Taïwan
HDFC BANK LTD	Secteur financier	5,56%	Inde
TENCENT HOLDINGS LTD	Services de communication	5,48%	Chine
AIA GROUP LTD	Secteur financier	5,14%	Hong Kong
UNITED OVERSEAS BANK LTD	Secteur financier	5,04%	Singapour
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	Biens de consommation discrétionnaire	4,20%	Chine
HERO MOTOCORP LTD	Biens de consommation discrétionnaire	3,84%	Inde
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	Services aux collectivités	3,76%	Chine
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	Industrie	3,70%	Singapour
VENTURE CORP LTD	Technologies de l'information	3,65%	Singapour
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LTD	Services de communication	3,62%	Singapour
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	Santé	3,46%	Chine
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	Technologies de l'information	3,18%	Inde
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	Industrie	2,95%	Hong Kong
MINTH GROUP LTD	Biens de consommation discrétionnaire	2,74%	Chine

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

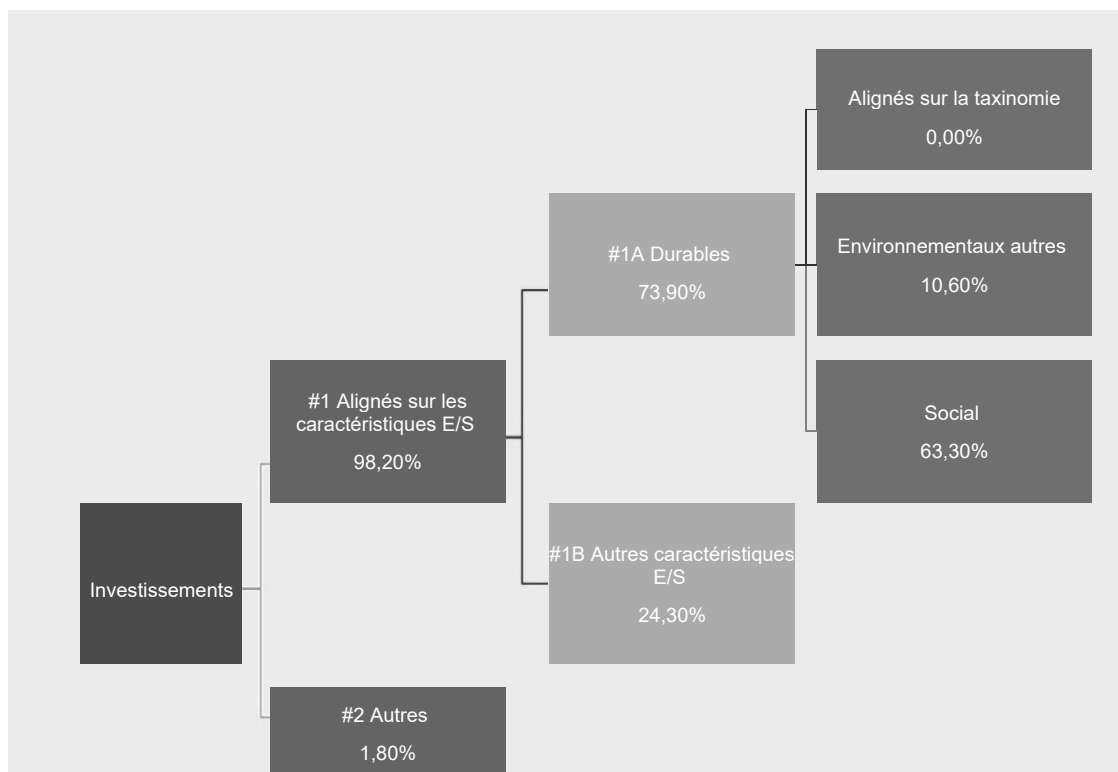
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 73,90 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

98,20 % du portefeuille du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (1,80 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides.

Le Fonds a investi dans des placements durables 73,90 % du segment de son portefeuille qui était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Biens de consommation discrétionnaire	21,13%
Technologies de l'information	19,85%
Secteur financier	18,96%
Services de communication	12,81%
Industrie	7,74%
Services aux collectivités	6,08%
Matériaux	5,08%
Santé	4,89%
Biens de consommation courante	1,66%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Banques	10,72%
Assurances	8,24%
Semi-conducteurs et équipements pour semi-conducteurs	7,06%
Internet et marketing direct de détail	6,92%
Services de télécommunications diversifiés	6,43%
Médias et services interactifs	6,37%
Chimie	5,08%
Services informatiques	4,97%
Textiles, confection et produits de luxe	4,85%
Automobiles	3,95%
Équipements, instruments et composants électroniques	3,84%
Services publics de gaz	3,55%
Aérospatial et défense	3,54%
Produits pharmaceutiques	3,44%
Pièces automobiles	2,91%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

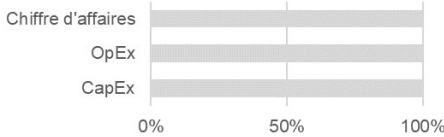
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

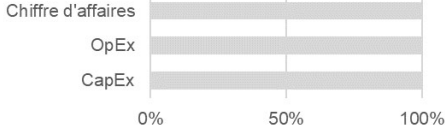
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Non applicable

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

En raison de sa stratégie d'investissement, le Fonds n'a pas réalisé d'investissements durables ayant un objectif environnemental aligné avec la taxinomie de l'UE ; par conséquent, à la fin du mois de février 2023, 10,60 % du portefeuille du Fonds était composé d'investissements ayant un objectif environnemental non aligné avec la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

La proportion d'investissements durables sur le plan social s'établissait à 63,30 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 1,80 % et comprenait les liquidités pour lesquelles il n'y avait pas de garanties environnementales ou sociales minimales.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

- S'est engagé avec les entreprises de son portefeuille à fixer ou à mettre en œuvre des objectifs de réduction des émissions de gaz à effet de serre.
- A respecté les exclusions énoncées dans le prospectus en ce qui concerne les notations exclusives du risque de durabilité, les violations du Pacte mondial des Nations unies, la production de tabac, les armes controversées et l'extraction de combustibles fossiles.
- A pris en compte les 14 PIN obligatoires et deux PIN supplémentaires dans le cadre de l'analyse des investissements, qui comprend des indicateurs relatifs à l'efficacité énergétique et à l'utilisation rationnelle de l'eau, à la pollution et aux risques liés à la biodiversité.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Non applicable

FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund



**FRANKLIN
TEMPLETON**

LEI de l'entité : 5493007B7CQP4E08O434

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ ☐ **OUI**

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif environnemental** : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif social** : ____%

☒ ☒ **NON**

☒ Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 88,00% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Pour répondre aux caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le produit financier, le fonds incluait des investissements dans des entreprises :

- qui réduisent et contrôlent leurs émissions de carbone ;
- dont l'exposition à l'industrie des combustibles fossiles est limitée ou nulle ;
- qui mettent l'accent sur l'utilisation efficace de l'énergie et de l'eau ;
- qui limitent la pollution et contrôlent les risques liés à la biodiversité ;
- qui ont de bons antécédents en matière de droits de l'homme et de relations sociales ; et
- qui ne sont pas exposées à des armes controversées.

Toutes les positions du Fonds ne promouvaient pas nécessairement toutes les caractéristiques. Ces facteurs ont été pris en compte dans le cadre de l'analyse de chaque entreprise, et leur prise en compte a été essentielle dans l'analyse de l'investissement.

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

À la fin de la période de référence, 88 % du Compartiment étaient détenus dans des investissements durables, tels que définis par le cadre exclusif du Gestionnaire de portefeuille basé sur les objectifs de développement durable (ODD) des Nations unies.

Les 14 indicateurs de PIN obligatoires et deux indicateurs supplémentaires ont été pris en compte et mesurés. Veuillez vous référer aux valeurs indiquées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? ».

À la fin de la période, environ 60 % de la valeur nette d'inventaire (VNI) du portefeuille étaient investis dans des entreprises ayant approuvé des objectifs fondés sur la science dans le cadre de l'initiative SBT (Science-Based Targets Initiative), et 7 % supplémentaires l'ont été dans des entreprises s'étant engagées à fixer des objectifs au cours des deux prochaines années.

Au cours de la période, l'équipe de gestion du fonds a mené 5 engagements sur des sujets environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG) dans le but d'influencer les comportements, couvrant des sujets tels que la composition des organes de gouvernance, des plans de réduction des émissions de carbone, et les droits de l'homme. À la fin de l'année, les engagements en étaient au stade de finalisation, comme indiqué ci-dessous.

En outre, le Gestionnaire de portefeuille s'est appuyé sur des mesures de données externes (par exemple MSCI), notamment pour l'empreinte carbone et la notation ESG, sur sa recherche interne (notamment pour l'analyse du coût du carbone et les facteurs de risque liés à l'esclavage moderne), afin d'étayer son analyse et sur une notation interne exclusive de la gouvernance et du risque de durabilité, qui ont servi de base à la sélection des titres, aux exclusions et à la procédure d'engagement.

Nom de l'ICP de durabilité	Valeur
1. L'entreprise est contactée pour évoquer les problématiques	40,00%
2. L'entreprise prend acte du contact	0,00%
3. Les problématiques font l'objet de discussions	0,00%
4. L'entreprise élabore un plan pour remédier aux problématiques	40,00%
5. L'entreprise traite le problème	20,00%

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Les investissements durables du compartiment comprenaient des titres de participation émis par des sociétés qui contribuaient, par leurs produits ou services, aux objectifs environnementaux ou sociaux d'un sous-ensemble pertinent de cibles sous-jacentes aux 17 Objectifs de développement durable (ODD). Au 31 décembre 2022, 88 % du Fonds étaient placés dans des investissements durables, soit plus que l'exigence minimale de 50 %.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Outre l'identification d'investissements durables potentiels par la cartographie des entreprises par rapport à un sous-ensemble spécifique de cibles des ODD, comme détaillé ci-dessus, les entreprises bénéficiaires d'investissements potentiels étaient soumises à l'évaluation, par le gestionnaire de portefeuille, du principe de « ne pas causer de préjudice important », qui était réalisée de deux manières :

1. une évaluation du respect des normes mondiales, basée sur les principes du Pacte mondial des Nations unies (PMNU), et des controverses liées aux autres aspects environnementaux des indicateurs de PIN.

2. une évaluation du principe de « ne pas causer de préjudice important » au regard des facteurs liés au changement climatique mis en évidence par les indicateurs de PIN, y compris des domaines tels que l'exposition de l'entreprise à l'extraction de combustibles fossiles et une empreinte carbone élevée et non maîtrisée dans un secteur à fortes émissions.

Lors de l'évaluation du principe de « ne pas causer de préjudice important » lié au changement climatique, le gestionnaire de portefeuille a également tenu compte de la nature des activités d'une société ainsi que de la présence de controverses ou de signaux provenant des indicateurs de PIN. Pour chaque groupe d'indicateurs de PIN, le gestionnaire de portefeuille a évalué la matérialité de chaque indicateur et la présence d'un préjudice potentiel important, cette évaluation étant réalisée à l'aide d'une analyse exclusive. Les résultats de l'évaluation du principe de « ne pas causer de préjudice important » ont influencé les notations de risque liées à la gouvernance et à la durabilité attribuées par le gestionnaire de portefeuille, mais cette évaluation est conçue pour fonctionner comme un processus parallèle aux notations de risque afin de respecter l'engagement de réaliser des « investissements durables » au sens du règlement SFDR. L'évaluation a pour but principal de déterminer s'il existait des preuves d'un préjudice important qui auraient empêché un investissement d'être considéré comme durable.

-----Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Dans sa gestion du Compartiment, le Gestionnaire de portefeuille a pris en compte les 14 indicateurs de PIN obligatoires et deux indicateurs supplémentaires. Les deux indicateurs supplémentaires étaient :

- Sur le plan environnemental : les investissements dans des entreprises sans initiative de réduction des émissions de carbone ; et
- Sur le plan social : l'absence de politique en matière de droits de l'homme.

L'analyse des sociétés par le Gestionnaire de portefeuille tenait compte de ces facteurs et lorsque le Gestionnaire de portefeuille identifiait de potentielles incidences négatives importantes, il engageait un dialogue avec les sociétés. Conformément aux exigences spécifiques du SFDR, le Gestionnaire de portefeuille a également établi des rapports sur les indicateurs de PIN en utilisant des données provenant de l'entreprise ou en recherchant des substituts lorsque celles-ci n'étaient pas disponibles.

Pour plus d'informations sur la manière dont l'analyse des entreprises par le gestionnaire de portefeuille a pris en compte ces facteurs, veuillez vous référer à la section ci-dessous intitulée « Comment ce produit financier a-t-il pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? ».

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Tout investissement durable potentiel identifié a été soumis à l'analyse ESG plus large du Gestionnaire de portefeuille qui a porté son attention sur le management, la culture, ainsi que sur le risque social et environnemental. Cette analyse s'articulait autour des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales, et le Gestionnaire de portefeuille s'est également concentré sur le risque d'exploitation sociale au sens des Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme.

Le Pacte mondial des Nations unies (dont les critères sont contraignants pour le compartiment) énonce 10 principes qui définissent les responsabilités minimales dans les domaines des droits de l'homme, des normes internationales du travail, de l'environnement et de la lutte contre la corruption, découlant des conventions établies.

Il existe un chevauchement important entre les principes du Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs de l'OCDE, qui sont effectivement pris en compte par le Gestionnaire de portefeuille à travers le filtrage relatif au Pacte mondial. D'autres instruments multilatéraux importants cités dans les principes directeurs constituent également des éléments de base des principes directeurs de l'OCDE, à savoir les Principes fondamentaux de l'OIT (Organisation internationale du travail) et la Déclaration universelle des droits de l'homme. Ils couvrent efficacement les controverses potentielles liées aux piliers clés de l'OCDE que sont les droits de l'homme, le droit du travail, l'environnement, la lutte contre la corruption et la protection des consommateurs.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les facteurs de durabilité peuvent avoir un impact sur les entreprises dans lesquelles le compartiment investit, et le gestionnaire de portefeuille est également conscient du fait que les entreprises elles-mêmes peuvent avoir un impact négatif, par exemple sur l'environnement, leurs employés ou les communautés dans lesquelles elles opèrent. Ces incidences négatives comprennent, sans s'y limiter, les émissions de gaz à effet de serre (GES) et d'autres formes de pollution, ou les violations potentielles du Pacte mondial des Nations unies. L'analyse des sociétés par le gestionnaire de portefeuille a tenu compte de ces facteurs et lorsqu'il identifiait de potentielles incidences négatives importantes, le gestionnaire de portefeuille engageait un dialogue avec les sociétés concernées, comme indiqué plus en détail dans la politique de gestion et d'engagement du gestionnaire de portefeuille. Conformément aux exigences spécifiques du SFDR, le gestionnaire de portefeuille a également établi des rapports sur les indicateurs de PIN en utilisant des données provenant de l'entreprise ou en recherchant des substituts lorsque celles-ci n'étaient pas disponibles.

L'analyse des PIN était intégrée au processus de diligence raisonnable du gestionnaire de portefeuille pour chaque société. L'évaluation des 14 PIN obligatoires et des deux PIN supplémentaires est regroupée en six domaines clés pour l'évaluation de la matérialité. Toutes les PIN n'étaient pas significatives pour chaque entreprise. Le gestionnaire de portefeuille évaluait si l'un des six domaines était important pour la société bénéficiaire et, lorsque c'était le cas, il l'intégrait dans ses évaluations de risque, sa thèse d'investissement et, le cas échéant, dans son activité d'engagement planifiée.

Les six principaux groupes de PIN sont les suivants :

- Emissions et la gestion du carbone — PIN #1 (émissions de gaz à effet de serre), #2 (empreinte carbone) et #3 (intensité des émissions de gaz à effet de serre des sociétés bénéficiaires des investissements ainsi qu'une PIN facultative sur les sociétés n'ayant pas mis en place d'initiative de réduction des émissions de carbone) ;
- l'exposition à des entreprises du secteur des combustibles fossiles — PIN #4 (exposition à des entreprises actives dans le secteur des combustibles fossiles) ;
- Efficacité énergétique et utilisation rationnelle de l'eau (PIN 5 (part de la consommation et de la production d'énergie non renouvelable) et 6 (intensité de la consommation d'énergie par secteur à fort impact)) ;
- Pollution et biodiversité — PIN n°7 (activités ayant une incidence négative sur les zones sensibles sur le plan de la biodiversité), #8 (rejets dans l'eau) et #9 (taux de déchets dangereux) ;
- Droits humains et questions relatives aux employés — PIN #10-13 (violations des Principes directeurs de l'ONU et de l'OCDE ; absence de processus et de mécanismes de conformité permettant de contrôler le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE ; écarts de rémunération entre hommes et femmes non corrigés ; diversité du conseil d'administration) et un PIN supplémentaire pour les sociétés démunies de politique sur les droits humains ; et
- L'exposition à des armes controversées — PIN #14 (exposition à des armes controversées).

Dans certains cas, tels que la PIN 10 (violations des Principes directeurs de l'ONU et de l'OCDE), le compartiment dispose de critères contraignants et n'investira pas dans des sociétés qui sont considérées comme « défaillantes » au regard du Pacte mondial des Nations unies. Conformément à la politique du gestionnaire en matière d'armes controversées, le compartiment ne détiendra pas de sociétés exposées à des armes controversées.

Des informations sur les PIN concernant les facteurs de durabilité sont disponibles dans la politique d'investissement du gestionnaire.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Émissions de GES : Émissions totales en EUR	8 716,25	99,49%
Empreinte carbone en EUR	67,27	99,49%
Intensité des GES en EUR	431,12	99,49%
Exposition à des entreprises actives dans le secteur des combustibles fossiles.	0,00%	99,49%
Part de la consommation et de la production d'énergie non renouvelable	65,03%	85,02%
Intensité de consommation énergétique : Agriculture en EUR	0,00	93,86%
Intensité de consommation énergétique : Industrie minière en EUR	0,00	93,86%
Intensité de consommation énergétique : Secteur manufacturier en EUR	0,34	93,86%
Intensité de consommation énergétique : Électricité en EUR	0,00	93,86%
Intensité de consommation énergétique : Eau en EUR	0,00	93,86%
Intensité de consommation énergétique : Construction en EUR	0,00	93,86%
Intensité de consommation énergétique : Négoce et véhicules en EUR	0,02	93,86%
Intensité de consommation énergétique : Transports et entreposage en EUR	0,00	93,86%
Intensité de consommation énergétique : Immobilier en EUR	0,00	93,86%
Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité	0,00%	99,49%
Rejets dans l'eau en EUR	1,01	10,62%
Déchets dangereux EUR	0,06	36,29%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	99,49%
Absence de processus et de mécanismes de conformité pour garantir le respect des principes du Pacte mondial des Nations Unies (UNGC) et les principes directeurs de l'Organisation de coopération et de développement économiques (OCDE) à l'intention des entreprises multinationales.	52,33%	99,12%
Écarts de rémunération hommes/femmes non ajustés	11,75%	20,44%
Mixité du conseil d'administration	32,86%	99,49%
Exposition à des armes controversées	0,00%	99,49%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
MICROSOFT CORP	Technologies de l'information	5,80%	États-Unis
LINDE PLC	Matériaux	5,15%	Royaume-Uni
RESMED INC	Santé	4,87%	États-Unis
NVIDIA CORP	Technologies de l'information	4,73%	États-Unis
L'OREAL SA	Biens de consommation courante	4,29%	France
ASML HOLDING NV	Technologies de l'information	4,12%	Pays-Bas
MASTERCARD INC	Technologies de l'information	4,10%	États-Unis
KINGSPAN GROUP PLC	Industrie	4,09%	Irlande
ATLAS COPCO AB	Industrie	3,98%	Suède
MONCLER SPA	Biens de consommation discrétionnaire	3,84%	Italie
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	Santé	3,76%	Chine
FERRARI NV	Biens de consommation discrétionnaire	3,61%	Italie
CSL LTD	Santé	3,57%	Australie
HEXAGON AB	Technologies de l'information	3,56%	Suède
COLOPLAST A/S	Santé	3,46%	Danemark

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

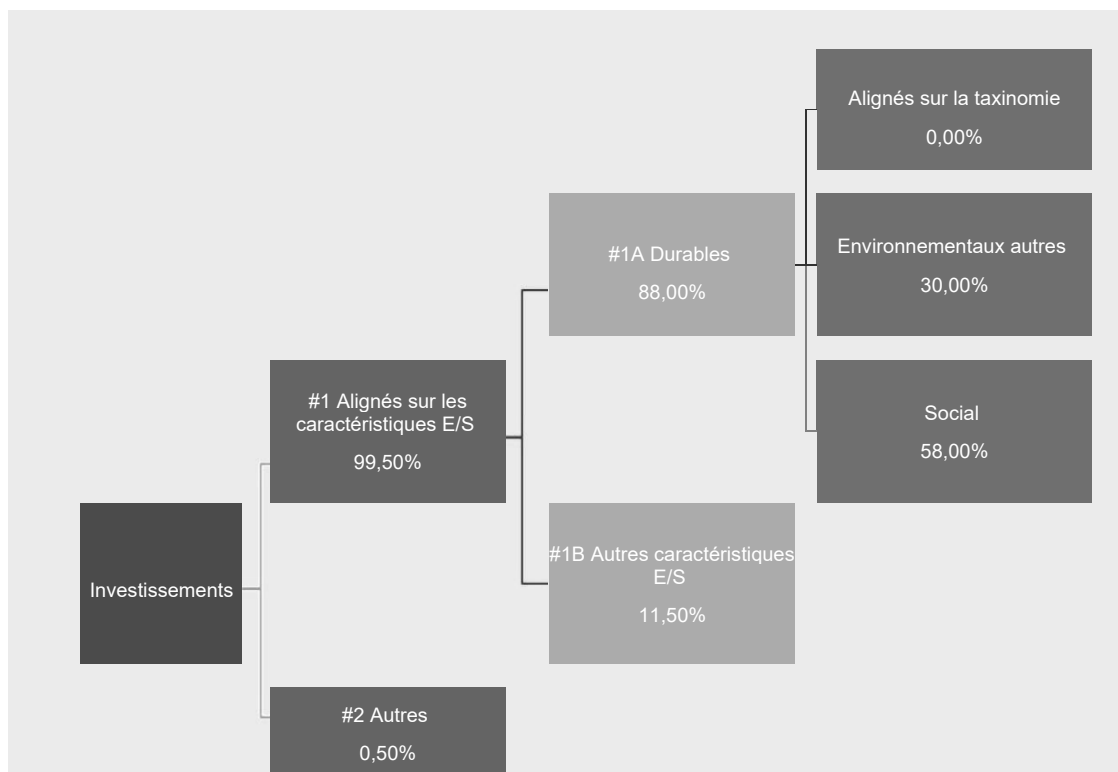
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 88,00 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

99,50 % du portefeuille du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (0,50 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides.

Le Fonds a investi dans des placements durables 88,00 % du segment de son portefeuille qui était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Technologies de l'information	30,33%
Santé	26,33%
Biens de consommation discrétionnaire	14,51%
Industrie	10,53%
Matériaux	7,70%
Biens de consommation courante	6,56%
Secteur financier	3,53%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Logiciels	13,14%
Équipements et fournitures de soins de santé	11,37%
Textiles, confection et produits de luxe	10,70%
Semi-conducteurs et équipements pour semi-conducteurs	9,67%
Chimie	7,70%
Produits de construction	6,31%
Outils et services de sciences de la vie	5,86%
Produits personnels	4,29%
Services informatiques	4,24%
Machines	4,23%
Automobiles	3,81%
Biotechnologie	3,55%
Assurances	3,53%
Équipements, instruments et composants électroniques	3,28%
Produits pharmaceutiques	2,94%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;

- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;

- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

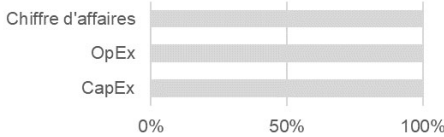
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

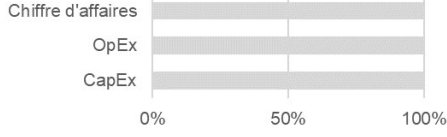
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Non applicable



Le symbole représente des investissements durables ayant

un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

En raison de sa stratégie d'investissement, le Fonds n'a pas réalisé d'investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE ; par conséquent, à la fin du mois de février 2023, 30,00 % du portefeuille du Fonds était composé d'investissements ayant un objectif environnemental non aligné avec la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

La proportion d'investissements durables sur le plan social s'établissait à 58,00 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 0,50 % et comprenait les liquidités pour lesquelles il n'y avait pas de garanties environnementales ou sociales minimales.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

- S'est engagé avec les entreprises de son portefeuille à fixer ou à mettre en œuvre des objectifs de réduction des émissions de gaz à effet de serre.
- A respecté les exclusions énoncées dans le prospectus en ce qui concerne les notations exclusives en matière de gouvernance et du risque de durabilité, les violations du Pacte mondial des Nations unies, les armes controversées et toutes les autres activités commerciales faisant l'objet d'une exclusion.
- A pris en compte les 14 PIN obligatoires et deux PIN supplémentaires dans le cadre de l'analyse des investissements, qui comprend des indicateurs relatifs à l'efficacité énergétique et à l'utilisation rationnelle de l'eau, à la pollution et aux risques liés à la biodiversité.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Non applicable

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund



**FRANKLIN
TEMPLETON**

LEI de l'entité : 549300REHT50ARB1IW32

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ **OUI**

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif environnemental** : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif social** : ____%

☒ **NON**

☒ Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 80,40% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Pour répondre aux caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le produit financier, le fonds incluait des investissements dans des entreprises :

- qui réduisent et contrôlent leurs émissions de carbone ;
- dont l'exposition à l'industrie des combustibles fossiles est limitée ou nulle ;
- qui mettent l'accent sur l'utilisation efficace de l'énergie et de l'eau ;
- qui limitent la pollution et contrôlent les risques liés à la biodiversité ;
- qui ont de bons antécédents en matière de droits de l'homme et de relations sociales ; et
- qui ne sont pas exposées à des armes controversées.

Toutes les positions du Fonds ne promouvaient pas nécessairement toutes les caractéristiques. Ces facteurs ont été pris en compte dans le cadre de l'analyse de chaque entreprise, et leur prise en compte a été essentielle dans l'analyse de l'investissement.

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

À la fin de la période de référence, 80,40 % du Compartiment étaient détenus dans des investissements durables, tels que définis par le cadre exclusif du Gestionnaire de portefeuille basé sur les objectifs de développement durable (ODD) des Nations unies.

Les 14 indicateurs de PIN obligatoires et deux indicateurs supplémentaires ont été pris en compte et mesurés. Veuillez vous référer aux valeurs indiquées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? ».

À la fin de la période, 12 % de la valeur nette d'inventaire (VNI) du portefeuille étaient investis dans des entreprises ayant approuvé des objectifs fondés sur la science dans le cadre de l'initiative SBT (Science-Based Targets Initiative), et 16 % supplémentaires l'ont été dans des entreprises s'étant engagées à fixer des objectifs au cours des deux prochaines années.

Au cours de la période, l'équipe de gestion a mené 8 engagements sur des sujets environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG) dans le but d'influencer les comportements, couvrant des sujets tels que la composition des organes de gouvernance et les plans de transition vers un bilan neutre en carbone des entreprises.

En outre, le Gestionnaire de portefeuille s'est appuyé sur des mesures de données externes (par exemple MSCI), notamment pour l'empreinte carbone et la notation ESG, sur sa recherche interne (notamment pour l'analyse du coût du carbone et les facteurs de risque liés à l'esclavage moderne), afin d'étayer son analyse et sur une notation interne exclusive de la gouvernance et du risque de durabilité, qui ont servi de base à la sélection des titres, aux exclusions et à la procédure d'engagement.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Les investissements durables du compartiment comprenaient des titres de participation émis par des sociétés qui contribuaient, par leurs produits ou services, aux objectifs environnementaux ou sociaux d'un sous-ensemble pertinent de cibles sous-jacentes aux 17 Objectifs de développement durable (ODD). Au 31 décembre 2022, 80 % du Fonds étaient placés dans des investissements durables, soit plus que l'exigence minimale de 50 %.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Outre l'identification d'investissements durables potentiels par la cartographie des entreprises par rapport à un sous-ensemble spécifique de cibles des ODD, comme détaillé ci-dessus, les entreprises bénéficiaires d'investissements potentiels étaient soumises à l'évaluation, par le gestionnaire de portefeuille, du principe de « ne pas causer de préjudice important », qui était réalisée de deux manières :

1. une évaluation du respect des normes mondiales, basée sur les principes du Pacte mondial des Nations unies (PMNU), et des controverses liées aux autres aspects environnementaux des indicateurs de PIN.

2. une évaluation du principe de « ne pas causer de préjudice important » au regard des facteurs liés au changement climatique mis en évidence par les indicateurs de PIN, y compris des domaines tels que l'exposition de l'entreprise à l'extraction de combustibles fossiles et une empreinte carbone élevée et non maîtrisée dans un secteur à fortes émissions.

Lors de l'évaluation du principe de « ne pas causer de préjudice important » lié au changement climatique, le gestionnaire de portefeuille a également tenu compte de la nature des activités d'une société ainsi que de la présence de controverses ou de signaux provenant des indicateurs de PIN. Pour chaque groupe d'indicateurs de PIN, le gestionnaire de portefeuille a évalué la matérialité de chaque indicateur et la présence d'un préjudice potentiel important, cette évaluation étant réalisée à l'aide d'une analyse exclusive. Les résultats de l'évaluation du principe de « ne pas causer de préjudice important » ont influencé les notations de risque liées à la gouvernance et à la durabilité attribuées par le gestionnaire de portefeuille, mais cette évaluation est conçue pour fonctionner comme un processus parallèle aux notations de risque afin de respecter l'engagement de réaliser des « investissements durables » au sens du règlement SFDR. L'évaluation a pour but principal de déterminer s'il existait des preuves d'un préjudice important qui auraient empêché un investissement d'être considéré comme durable.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Dans sa gestion du Compartiment, le Gestionnaire de portefeuille a pris en compte les 14 indicateurs de PIN obligatoires et deux indicateurs supplémentaires. Les deux indicateurs supplémentaires étaient :

- Sur le plan environnemental : les investissements dans des entreprises sans initiative de réduction des émissions de carbone ; et
- Sur le plan social : l'absence de politique en matière de droits de l'homme.

L'analyse des sociétés par le Gestionnaire de portefeuille tenait compte de ces facteurs et lorsque le Gestionnaire de portefeuille identifiait de potentielles incidences négatives importantes, il engageait un dialogue avec les sociétés. Conformément aux exigences spécifiques du SFDR, le Gestionnaire de portefeuille a également établi des rapports sur

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

les indicateurs de PIN en utilisant des données provenant de l'entreprise ou en recherchant des substituts lorsque celles-ci n'étaient pas disponibles.

Pour plus d'informations sur la manière dont l'analyse des entreprises par le gestionnaire de portefeuille a pris en compte ces facteurs, veuillez vous référer à la section ci-dessous intitulée « Comment ce produit financier a-t-il pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? ».

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Tout investissement durable potentiel identifié a été soumis à l'analyse ESG plus large du Gestionnaire de portefeuille qui a porté son attention sur le management, la culture, ainsi que sur le risque social et environnemental. Cette analyse s'articulait autour des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales, et le Gestionnaire de portefeuille s'est également concentré sur le risque d'exploitation sociale au sens des Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme.

Le Pacte mondial des Nations unies (dont les critères sont contraignants pour le compartiment) énonce 10 principes qui définissent les responsabilités minimales dans les domaines des droits de l'homme, des normes internationales du travail, de l'environnement et de la lutte contre la corruption, découlant des conventions établies.

Il existe un chevauchement important entre les principes du Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs de l'OCDE, qui sont effectivement pris en compte par le Gestionnaire de portefeuille à travers le filtrage relatif au Pacte mondial. D'autres instruments multilatéraux importants cités dans les principes directeurs constituent également des éléments de base des principes directeurs de l'OCDE, à savoir les Principes fondamentaux de l'OIT (Organisation internationale du travail) et la Déclaration universelle des droits de l'homme. Ils couvrent efficacement les controverses potentielles liées aux piliers clés de l'OCDE que sont les droits de l'homme, le droit du travail, l'environnement, la lutte contre la corruption et la protection des consommateurs.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les facteurs de durabilité peuvent avoir un impact sur les entreprises dans lesquelles le compartiment investit, et le gestionnaire de portefeuille est également conscient du fait que les entreprises elles-mêmes peuvent avoir un impact négatif, par exemple sur l'environnement, leurs employés ou les communautés dans lesquelles elles opèrent. Ces incidences négatives comprennent, sans s'y limiter, les émissions de gaz à effet de serre (GES) et d'autres formes de pollution, ou les violations potentielles du Pacte mondial des Nations unies. L'analyse des sociétés par le gestionnaire de portefeuille a tenu compte de ces facteurs et lorsqu'il identifiait de potentielles incidences négatives importantes, le gestionnaire de portefeuille engageait un dialogue avec les sociétés concernées, comme indiqué plus en détail dans la politique de gestion et d'engagement du gestionnaire de portefeuille. Conformément aux exigences spécifiques du SFDR, le gestionnaire de portefeuille a également établi des rapports sur les indicateurs de PIN en utilisant des données provenant de l'entreprise ou en recherchant des substituts lorsque celles-ci n'étaient pas disponibles.

L'analyse des PIN était intégrée au processus de diligence raisonnable du gestionnaire de portefeuille pour chaque société. L'évaluation des 14 PIN obligatoires et des deux PIN supplémentaires est regroupée en six domaines clés pour l'évaluation de la matérialité. Toutes les PIN n'étaient pas significatives pour chaque entreprise. Le gestionnaire de portefeuille évaluait si l'un des six domaines était important pour la société bénéficiaire et, lorsque c'était le cas, il l'intégrait dans ses évaluations de risque, sa thèse d'investissement et, le cas échéant, dans son activité d'engagement planifiée.

Les six principaux groupes de PIN sont les suivants :

- Emissions et la gestion du carbone — PIN #1 (émissions de gaz à effet de serre), #2 (empreinte carbone) et #3 (intensité des émissions de gaz à effet de serre des sociétés bénéficiaires des investissements ainsi qu'une PIN facultative sur les sociétés n'ayant pas mis en place d'initiative de réduction des émissions de carbone) ;
- l'exposition à des entreprises du secteur des combustibles fossiles — PIN #4 (exposition à des entreprises actives dans le secteur des combustibles fossiles) ;
- Efficacité énergétique et utilisation rationnelle de l'eau (PIN 5 (part de la consommation et de la production d'énergie non renouvelable) et 6 (intensité de la consommation d'énergie par secteur à fort impact)) ;
- Pollution et biodiversité — PIN n°7 (activités ayant une incidence négative sur les zones sensibles sur le plan de la biodiversité), #8 (rejets dans l'eau) et #9 (taux de déchets dangereux) ;
- Droits humains et questions relatives aux employés — PIN #10-13 (violations des Principes directeurs de l'ONU et de l'OCDE ; absence de processus et de mécanismes de conformité permettant de contrôler le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE ; écarts de rémunération entre hommes et femmes non corrigés ; diversité du conseil d'administration) et un PIN supplémentaire pour les sociétés démunies de politique sur les droits humains ; et
- L'exposition à des armes controversées — PIN #14 (exposition à des armes controversées).

Dans certains cas, tels que la PIN 10 (violations des Principes directeurs de l'ONU et de l'OCDE), le compartiment dispose de critères contraignants et n'investira pas dans des sociétés qui sont considérées comme « défaillantes » au regard du Pacte mondial des Nations unies. Conformément à la politique du gestionnaire en matière d'armes controversées, le compartiment ne détiendra pas de sociétés exposées à des armes controversées.

Des informations sur les PIN concernant les facteurs de durabilité sont disponibles dans la politique d'investissement du gestionnaire.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Émissions de GES : Émissions totales en EUR	19 032,27	88,06%
Empreinte carbone en EUR	854,37	88,06%
Intensité des GES en EUR	1 411,15	88,06%
Exposition à des entreprises actives dans le secteur des combustibles fossiles.	15,95%	88,06%
Part de la consommation et de la production d'énergie non renouvelable	81,00%	80,36%
Intensité de consommation énergétique : Agriculture en EUR	0,00	86,78%
Intensité de consommation énergétique : Industrie minière en EUR	0,01	86,78%
Intensité de consommation énergétique : Secteur manufacturier en EUR	0,00	86,78%
Intensité de consommation énergétique : Électricité en EUR	8,92	86,78%
Intensité de consommation énergétique : Eau en EUR	4,70	86,78%
Intensité de consommation énergétique : Construction en EUR	0,05	86,78%
Intensité de consommation énergétique : Négoce et véhicules en EUR	0,00	86,78%
Intensité de consommation énergétique : Transports et entreposage en EUR	1,06	86,78%
Intensité de consommation énergétique : Immobilier en EUR	0,24	86,78%
Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité	0,00%	88,06%
Rejets dans l'eau en EUR	0,00	0,00%
Déchets dangereux EUR	0,34	28,29%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	95,90%
Absence de processus et de mécanismes de conformité pour garantir le respect des principes du Pacte mondial des Nations Unies (UNGC) et les principes directeurs de l'Organisation de coopération et de développement économiques (OCDE) à l'intention des entreprises multinationales.	56,51%	84,70%
Écarts de rémunération hommes/femmes non ajustés	17,86%	2,48%
Mixité du conseil d'administration	28,83%	88,06%
Exposition à des armes controversées	0,00%	88,06%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
EMBASSY OFFICE PARKS REIT	commercial	5,04%	Inde
TRANSURBAN GROUP	Industrie	5,02%	Australie
LINK REIT	commercial	4,90%	Hong Kong
GUANGDONG INVESTMENT LTD	Services aux collectivités	4,82%	Chine
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	Services aux collectivités	4,56%	Inde
NHPC LTD	Services aux collectivités	4,48%	Inde
CHARTER HALL RETAIL REIT	commercial	4,30%	Australie
SCENTRE GROUP	commercial	3,96%	Australie
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	commercial	3,87%	Singapour
DIGITAL TELECOMMUNICATIONS INFRASTRUCTURE FUND	commercial	3,61%	Thaïlande
VICINITY LTD	commercial	3,59%	Australie
AURIZON HOLDINGS LTD	Industrie	3,36%	Australie
AGL ENERGY LTD	Services aux collectivités	3,25%	Australie
CLP HOLDINGS LTD	Services aux collectivités	3,20%	Hong Kong
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	commercial	3,04%	Hong Kong

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

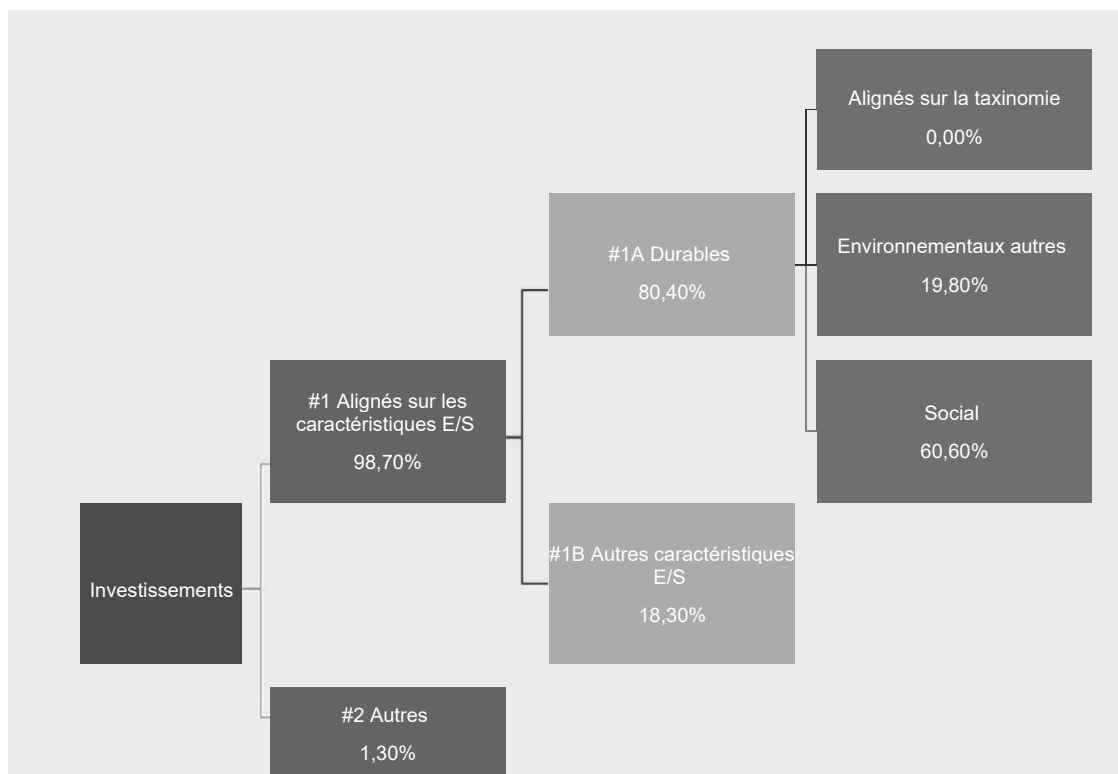
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 80,40 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

98,70 % du portefeuille du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (1,30 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides.

Le Fonds a investi dans des placements durables 80,40 % du segment de son portefeuille qui était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
commercial	48,80%
Services aux collectivités	27,72%
Industrie	15,82%
Services de communication	6,68%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Fonds de placements immobiliers	41,45%
Services publics d'électricité	12,91%
Infrastructures de transport	12,45%
Gestion et promotion immobilières	7,30%
Services de télécommunications diversifiés	6,68%
Services publics d'eau	5,35%
Transports terrestres	3,37%
Multiservices publics	3,36%
Producteurs indépendants d'énergie et d'électricité renouvelable	3,11%
Services publics de gaz	2,99%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

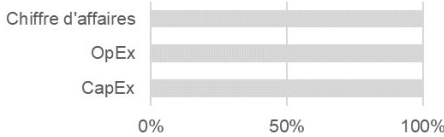
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

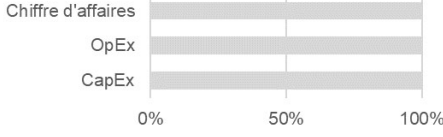
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Non applicable

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

En raison de sa stratégie d'investissement, le Fonds n'a pas réalisé d'investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE ; par conséquent, à la fin du mois de février 2023, 19,80 % du portefeuille du Fonds était composé d'investissements ayant un objectif environnemental non aligné avec la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

La proportion d'investissements durables sur le plan social s'établissait à 60,60 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 1,30 % et comprenait les liquidités pour lesquelles il n'y avait pas de garanties environnementales ou sociales minimales.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

- S'est engagé avec les entreprises de son portefeuille à fixer ou à mettre en œuvre des objectifs de réduction des émissions de gaz à effet de serre.
- A respecté les exclusions énoncées dans le prospectus en ce qui concerne les notations exclusives du risque de durabilité, les violations du Pacte mondial des Nations unies, les armes controversées et d'autres activités commerciales exclues.
- A pris en compte les 14 PIN obligatoires et deux PIN supplémentaires dans le cadre de l'analyse des investissements, qui comprend des indicateurs relatifs à l'efficacité énergétique et à l'utilisation rationnelle de l'eau, à la pollution et aux risques liés à la biodiversité.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Non applicable

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund

LEI de l'entité : 549300Y8TPNIB3NAMF62



FRANKLIN TEMPLETON

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

☐ ☐ **OUI**

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif environnemental** : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif social** : ____%

☒ ☒ **NON**

☒ Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 73,00% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Pour répondre aux caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le produit financier, le fonds incluait des investissements dans des entreprises :

- qui réduisent et contrôlent leurs émissions de carbone ;
- dont l'exposition à l'industrie des combustibles fossiles est limitée ou nulle ;
- qui mettent l'accent sur l'utilisation efficace de l'énergie et de l'eau ;
- qui limitent la pollution et contrôlent les risques liés à la biodiversité ;
- qui ont de bons antécédents en matière de droits de l'homme et de relations sociales ; et
- qui ne sont pas exposées à des armes controversées.

Toutes les positions du Fonds ne promouvaient pas nécessairement toutes les caractéristiques. Ces facteurs ont été pris en compte dans le cadre de l'analyse de chaque entreprise, et leur prise en compte a été essentielle dans l'analyse de l'investissement.

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

À la fin de la période de référence, 73 % du Compartiment étaient détenus dans des investissements durables, tels que définis par le cadre exclusif du Gestionnaire de portefeuille basé sur les objectifs de développement durable (ODD) des Nations unies.

Les 14 indicateurs de PIN obligatoires et deux indicateurs supplémentaires ont été pris en compte et mesurés. Veuillez vous référer aux valeurs indiquées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? ».

À la fin de la période, environ 4 % de la valeur nette d'inventaire (VNI) du portefeuille étaient investis dans des entreprises ayant approuvé des objectifs fondés sur la science dans le cadre de l'initiative SBT (Science-Based Targets Initiative), et 20 % supplémentaires l'ont été dans des entreprises s'étant engagées à fixer des objectifs au cours des deux prochaines années.

Au cours de la période, l'équipe de gestion du fonds a mené 52 engagements sur des sujets environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG) dans le but d'influencer les comportements, couvrant des sujets tels que la composition des organes de gouvernance, les plans de transition vers un bilan neutre en carbone des entreprises et la culture du lieu de travail. À la fin de l'année, les engagements en étaient au stade de finalisation, comme indiqué ci-dessous.

En outre, le Gestionnaire de portefeuille s'est appuyé sur des mesures de données externes (par exemple MSCI), notamment pour l'empreinte carbone et la notation ESG, sur sa recherche interne (notamment pour l'analyse du coût du carbone et les facteurs de risque liés à l'esclavage moderne), afin d'étayer son analyse et sur une notation interne exclusive de la gouvernance et du risque de durabilité, qui ont servi de base à la sélection des titres, aux exclusions et à la procédure d'engagement.

Nom de l'ICP de durabilité	Valeur
1. L'entreprise est contactée pour évoquer les problématiques	4,00%
2. L'entreprise prend acte du contact	12,00%
3. Les problématiques font l'objet de discussions	58,00%
4. L'entreprise élabore un plan pour remédier aux problématiques	19,00%
5. L'entreprise traite le problème	8,00%

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Les investissements durables du compartiment comprenaient des titres de participation émis par des sociétés qui contribuaient, par leurs produits ou services, aux objectifs environnementaux ou sociaux d'un sous-ensemble pertinent de cibles sous-jacentes aux 17 Objectifs de développement durable (ODD). Au 31 décembre 2022, 73 % du Fonds étaient placés dans des investissements durables, soit plus que l'exigence minimale de 50 %.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

● Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Outre l'identification d'investissements durables potentiels par la cartographie des entreprises par rapport à un sous-ensemble spécifique de cibles des ODD, comme détaillé ci-dessus, les entreprises bénéficiaires d'investissements potentiels étaient soumises à l'évaluation, par le gestionnaire de portefeuille, du principe de « ne pas causer de préjudice important », qui était réalisée de deux manières :

1. une évaluation du respect des normes mondiales, basée sur les principes du Pacte mondial des Nations unies (PMNU), et des controverses liées aux autres aspects environnementaux des indicateurs de PIN.

2. une évaluation du principe de « ne pas causer de préjudice important » au regard des facteurs liés au changement climatique mis en évidence par les indicateurs de PIN, y compris des domaines tels que l'exposition de l'entreprise à l'extraction de combustibles fossiles et une empreinte carbone élevée et non maîtrisée dans un secteur à fortes émissions.

Lors de l'évaluation du principe de « ne pas causer de préjudice important » lié au changement climatique, le gestionnaire de portefeuille a également tenu compte de la nature des activités d'une société ainsi que de la présence de controverses ou de signaux provenant des indicateurs de PIN. Pour chaque groupe d'indicateurs de PIN, le gestionnaire de portefeuille a évalué la matérialité de chaque indicateur et la présence d'un préjudice potentiel important, cette évaluation étant réalisée à l'aide d'une analyse exclusive. Les résultats de l'évaluation du principe de « ne pas causer de préjudice important » ont influencé les notations de risque liées à la gouvernance et à la durabilité attribuées par le gestionnaire de portefeuille, mais cette évaluation est conçue pour fonctionner comme un processus parallèle aux notations de risque afin de respecter l'engagement de réaliser des « investissements durables » au sens du règlement SFDR. L'évaluation a pour but principal de déterminer s'il existait des preuves d'un préjudice important qui auraient empêché un investissement d'être considéré comme durable.

-----Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Dans sa gestion du Compartiment, le Gestionnaire de portefeuille a pris en compte les 14 indicateurs de PIN obligatoires et deux indicateurs supplémentaires. Les deux indicateurs supplémentaires étaient :

- Sur le plan environnemental : les investissements dans des entreprises sans initiative de réduction des émissions de carbone ; et
- Sur le plan social : l'absence de politique en matière de droits de l'homme.

L'analyse des sociétés par le Gestionnaire de portefeuille tenait compte de ces facteurs et lorsque le Gestionnaire de portefeuille identifiait de potentielles incidences négatives importantes, il engageait un dialogue avec les sociétés. Conformément aux exigences spécifiques du SFDR, le Gestionnaire de portefeuille a également établi des rapports sur les indicateurs de PIN en utilisant des données provenant de l'entreprise ou en recherchant des substituts lorsque celles-ci n'étaient pas disponibles.

Pour plus d'informations sur la manière dont l'analyse des entreprises par le gestionnaire de portefeuille a pris en compte ces facteurs, veuillez vous référer à la section ci-dessous intitulée « Comment ce produit financier a-t-il pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? ».

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Tout investissement durable potentiel identifié a été soumis à l'analyse ESG plus large du Gestionnaire de portefeuille qui a porté son attention sur le management, la culture, ainsi que sur le risque social et environnemental. Cette analyse s'articulait autour des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales, et le Gestionnaire de portefeuille s'est également concentré sur le risque d'exploitation sociale au sens des Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme.

Le Pacte mondial des Nations unies (dont les critères sont contraignants pour le compartiment) énonce 10 principes qui définissent les responsabilités minimales dans les domaines des droits de l'homme, des normes internationales du travail, de l'environnement et de la lutte contre la corruption, découlant des conventions établies.

Il existe un chevauchement important entre les principes du Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs de l'OCDE, qui sont effectivement pris en compte par le Gestionnaire de portefeuille à travers le filtrage relatif au Pacte mondial. D'autres instruments multilatéraux importants cités dans les principes directeurs constituent également des éléments de base des principes directeurs de l'OCDE, à savoir les Principes fondamentaux de l'OIT (Organisation internationale du travail) et la Déclaration universelle des droits de l'homme. Ils couvrent efficacement les controverses potentielles liées aux piliers clés de l'OCDE que sont les droits de l'homme, le droit du travail, l'environnement, la lutte contre la corruption et la protection des consommateurs.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les facteurs de durabilité peuvent avoir un impact sur les entreprises dans lesquelles le compartiment investit, et le gestionnaire de portefeuille est également conscient du fait que les entreprises elles-mêmes peuvent avoir un impact négatif, par exemple sur l'environnement, leurs employés ou les communautés dans lesquelles elles opèrent. Ces incidences négatives comprennent, sans s'y limiter, les émissions de gaz à effet de serre (GES) et d'autres formes de pollution, ou les violations potentielles du Pacte mondial des Nations unies. L'analyse des sociétés par le gestionnaire de portefeuille a tenu compte de ces facteurs et lorsqu'il identifiait de potentielles incidences négatives importantes, le gestionnaire de portefeuille engageait un dialogue avec les sociétés concernées, comme indiqué plus en détail dans la politique de gestion et d'engagement du gestionnaire de portefeuille. Conformément aux exigences spécifiques du SFDR, le gestionnaire de portefeuille a également établi des rapports sur les indicateurs de PIN en utilisant des données provenant de l'entreprise ou en recherchant des substituts lorsque celles-ci n'étaient pas disponibles.

L'analyse des PIN était intégrée au processus de diligence raisonnable du gestionnaire de portefeuille pour chaque société. L'évaluation des 14 PIN obligatoires et des deux PIN supplémentaires est regroupée en six domaines clés pour l'évaluation de la matérialité. Toutes les PIN n'étaient pas significatives pour chaque entreprise. Le gestionnaire de portefeuille évaluait si l'un des six domaines était important pour la société bénéficiaire et, lorsque c'était le cas, il l'intégrait dans ses évaluations de risque, sa thèse d'investissement et, le cas échéant, dans son activité d'engagement planifiée.

Les six principaux groupes de PIN sont les suivants :

- Emissions et la gestion du carbone — PIN #1 (émissions de gaz à effet de serre), #2 (empreinte carbone) et #3 (intensité des émissions de gaz à effet de serre des sociétés bénéficiaires des investissements ainsi qu'une PIN facultative sur les sociétés n'ayant pas mis en place d'initiative de réduction des émissions de carbone) ;
- l'exposition à des entreprises du secteur des combustibles fossiles — PIN #4 (exposition à des entreprises actives dans le secteur des combustibles fossiles) ;
- Efficacité énergétique et utilisation rationnelle de l'eau (PIN 5 (part de la consommation et de la production d'énergie non renouvelable) et 6 (intensité de la consommation d'énergie par secteur à fort impact)) ;
- Pollution et biodiversité — PIN n°7 (activités ayant une incidence négative sur les zones sensibles sur le plan de la biodiversité), #8 (rejets dans l'eau) et #9 (taux de déchets dangereux) ;
- Droits humains et questions relatives aux employés — PIN #10-13 (violations des Principes directeurs de l'ONU et de l'OCDE ; absence de processus et de mécanismes de conformité permettant de contrôler le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE ; écarts de rémunération entre hommes et femmes non corrigés ; diversité du conseil d'administration) et un PIN supplémentaire pour les sociétés démunies de politique sur les droits humains ; et
- L'exposition à des armes controversées — PIN #14 (exposition à des armes controversées).

Dans certains cas, tels que la PIN 10 (violations des Principes directeurs de l'ONU et de l'OCDE), le compartiment dispose de critères contraignants et n'investira pas dans des sociétés qui sont considérées comme « défaillantes » au regard du Pacte mondial des Nations unies. Conformément à la politique du gestionnaire en matière d'armes controversées, le compartiment ne détiendra pas de sociétés exposées à des armes controversées.

Des informations sur les PIN concernant les facteurs de durabilité sont disponibles dans la politique d'investissement du gestionnaire.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Émissions de GES : Émissions totales en EUR	11 085,00	96,39%
Empreinte carbone en EUR	329,97	96,39%
Intensité des GES en EUR	1 004,71	96,39%
Exposition à des entreprises actives dans le secteur des combustibles fossiles.	7,95%	96,39%
Part de la consommation et de la production d'énergie non renouvelable	86,15%	81,90%
Intensité de consommation énergétique : Agriculture en EUR	0,00	87,61%
Intensité de consommation énergétique : Industrie minière en EUR	1,47	87,61%
Intensité de consommation énergétique : Secteur manufacturier en EUR	3,01	87,61%
Intensité de consommation énergétique : Électricité en EUR	0,00	87,61%
Intensité de consommation énergétique : Eau en EUR	0,00	87,61%
Intensité de consommation énergétique : Construction en EUR	0,00	87,61%
Intensité de consommation énergétique : Négoce et véhicules en EUR	0,22	87,61%
Intensité de consommation énergétique : Transports et entreposage en EUR	0,07	87,61%
Intensité de consommation énergétique : Immobilier en EUR	0,00	87,61%
Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité	0,00%	96,39%
Rejets dans l'eau en EUR	0,02	14,67%
Déchets dangereux EUR	0,45	50,50%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	96,68%
Absence de processus et de mécanismes de conformité pour garantir le respect des principes du Pacte mondial des Nations Unies (UNGC) et les principes directeurs de l'Organisation de coopération et de développement économiques (OCDE) à l'intention des entreprises multinationales.	74,61%	95,98%
Écarts de rémunération hommes/femmes non ajustés	25,65%	9,73%
Mixité du conseil d'administration	18,30%	96,39%
Exposition à des armes controversées	0,00%	96,39%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	Technologies de l'information	8,46%	Taïwan
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	Technologies de l'information	7,60%	Corée du Sud
TENCENT HOLDINGS LTD	Services de communication	6,42%	Chine
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	Biens de consommation discrétionnaire	3,82%	Chine
ICICI BANK LTD	Secteur financier	3,60%	Inde
RELIANCE INDUSTRIES LTD	Énergie	3,09%	Inde
SK HYNIX INC	Technologies de l'information	2,87%	Corée du Sud
AIA GROUP LTD	Secteur financier	2,76%	Hong Kong
TITAN CO LTD	Biens de consommation discrétionnaire	2,72%	Inde
MEITUAN	Biens de consommation discrétionnaire	2,71%	Chine
HDFC BANK LTD	Secteur financier	2,45%	Inde
BANK RAKYAT INDONESIA PERSERO TBK PT	Secteur financier	2,33%	Indonésie
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	Secteur financier	2,22%	Chine
AL RAJHI BANK	Secteur financier	2,10%	Arabie saoudite
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	Industrie	2,08%	Chine

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

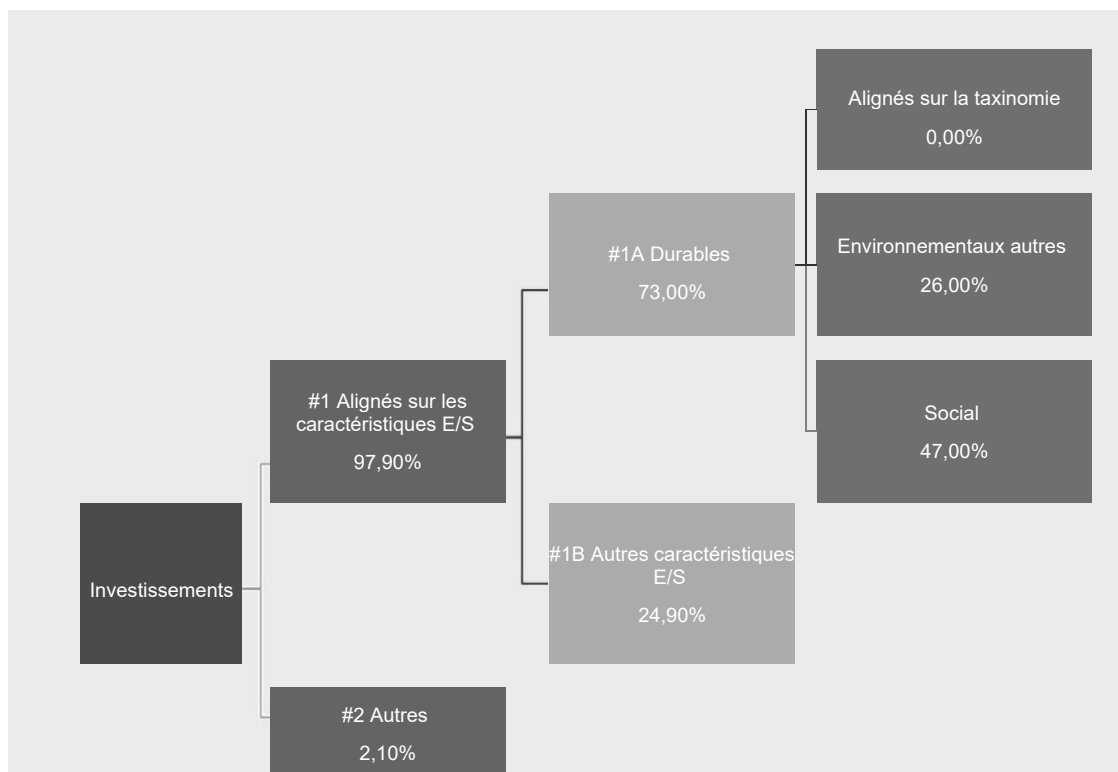
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 73,00 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

97,90 % du portefeuille du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (2,10 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides.

Le Fonds a investi dans des placements durables 73,00 % du segment de son portefeuille qui était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Secteur financier	26,33%
Technologies de l'information	25,33%
Biens de consommation discrétionnaire	13,38%
Services de communication	8,77%
Matériaux	7,10%
Industrie	5,47%
Énergie	4,79%
Santé	3,00%
Biens de consommation courante	2,51%
Services aux collectivités	1,21%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Banques	19,35%
Semi-conducteurs et équipements pour semi-conducteurs	12,70%
Internet et marketing direct de détail	8,22%
Matériel informatique, stockage et périphériques	7,38%
Médias et services interactifs	7,31%
Assurances	5,40%
Pétrole, gaz et combustibles	4,79%
Équipements électriques	4,16%
Chimie	3,93%
Équipements, instruments et composants électroniques	2,76%
Textiles, confection et produits de luxe	2,56%
Services informatiques	2,50%
Métaux et exploitations minières	2,11%
Distribution de produits alimentaires et de consommation courante	2,04%
Automobiles	1,70%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

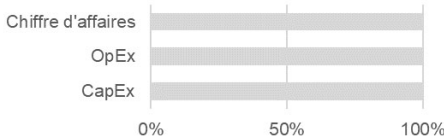
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

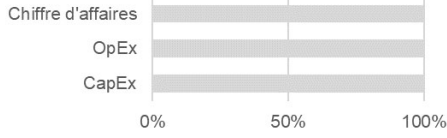
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Non applicable



Le symbole représente des investissements durables ayant

un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

En raison de sa stratégie d'investissement, le Fonds n'a pas réalisé d'investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE ; par conséquent, à la fin du mois de février 2023, 26,00 % du portefeuille du Fonds était composé d'investissements ayant un objectif environnemental non aligné avec la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

La proportion d'investissements durables sur le plan social s'établissait à 47,00 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 2,10 % et comprenait les liquidités pour lesquelles il n'y avait pas de garanties environnementales ou sociales minimales.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

- S'est engagé avec les entreprises de son portefeuille à fixer ou à mettre en œuvre des objectifs de réduction des émissions de gaz à effet de serre.
- A respecté les exclusions énoncées dans le prospectus en ce qui concerne les notations exclusives en matière de gouvernance et du risque de durabilité, les violations du Pacte mondial des Nations unies, les armes controversées et d'autres activités commerciales exclues.
- A pris en compte les 14 PIN obligatoires et deux PIN supplémentaires dans le cadre de l'analyse des investissements, qui comprend des indicateurs relatifs à l'efficacité énergétique et à l'utilisation rationnelle de l'eau, à la pollution et aux risques liés à la biodiversité.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Non applicable

FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund



**FRANKLIN
TEMPLETON**

LEI de l'entité : 5493001JP7YZEMZJTE31

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ ☐ **OUI**

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif environnemental** : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des **investissements durables** ayant un **objectif social** : ____%

☒ ☒ **NON**

☒ Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 76,00% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Pour répondre aux caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le produit financier, le fonds incluait des investissements dans des entreprises :

- qui réduisent et contrôlent leurs émissions de carbone ;
- dont l'exposition à l'industrie des combustibles fossiles est limitée ou nulle ;
- qui mettent l'accent sur l'utilisation efficace de l'énergie et de l'eau ;
- qui limitent la pollution et contrôlent les risques liés à la biodiversité ;
- qui ont de bons antécédents en matière de droits de l'homme et de relations sociales ; et
- qui ne sont pas exposées à des armes controversées.

Toutes les positions du Fonds ne promouvaient pas nécessairement toutes les caractéristiques. Ces facteurs ont été pris en compte dans le cadre de l'analyse de chaque entreprise, et leur prise en compte a été essentielle dans l'analyse de l'investissement.

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

À la fin de la période de référence, 76 % du Compartiment étaient détenus dans des investissements durables, tels que définis par le cadre exclusif du Gestionnaire de portefeuille basé sur les objectifs de développement durable (ODD) des Nations unies.

Les 14 indicateurs de PIN obligatoires et deux indicateurs supplémentaires ont été pris en compte et mesurés. Veuillez vous référer aux valeurs indiquées dans la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? ».

À la fin de la période, environ 64 % de la valeur nette d'inventaire (VNI) du portefeuille étaient investis dans des entreprises ayant approuvé des objectifs fondés sur la science dans le cadre de l'initiative SBT (Science-Based Targets Initiative), et 9 % supplémentaires l'ont été dans des entreprises s'étant engagées à fixer des objectifs au cours des deux prochaines années.

Au cours de l'année, l'équipe de gestion du fonds a mené 26 engagements sur des sujets environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG) dans le but d'influencer les comportements, couvrant des sujets tels que la composition des organes de gouvernance et les plans de transition vers un bilan neutre en carbone des entreprises.

En outre, le Gestionnaire de portefeuille s'est appuyé sur des mesures de données externes (par exemple MSCI), notamment pour l'empreinte carbone et la notation ESG, sur sa recherche interne (notamment pour l'analyse du coût du carbone et les facteurs de risque liés à l'esclavage moderne), afin d'étayer son analyse et sur une notation interne exclusive de la gouvernance et du risque de durabilité, qui ont servi de base à la sélection des titres, aux exclusions et à la procédure d'engagement.

● **...et par rapport aux périodes précédentes ?**

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?**

Les investissements durables du compartiment comprenaient des titres de participation émis par des sociétés qui contribuaient, par leurs produits ou services, aux objectifs environnementaux ou sociaux d'un sous-ensemble pertinent de cibles sous-jacentes aux 17 Objectifs de développement durable (ODD). Au 31 décembre 2022, 76 % du Fonds étaient placés dans des investissements durables, soit plus que l'exigence minimale de 50 %.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Outre l'identification d'investissements durables potentiels par la cartographie des entreprises par rapport à un sous-ensemble spécifique de cibles des ODD, comme détaillé ci-dessus, les entreprises bénéficiaires d'investissements potentiels étaient soumises à l'évaluation, par le gestionnaire de portefeuille, du principe de « ne pas causer de préjudice important », qui était réalisée de deux manières :

1. une évaluation du respect des normes mondiales, basée sur les principes du Pacte mondial des Nations unies (PMNU), et des controverses liées aux autres aspects environnementaux des indicateurs de PIN.

2. une évaluation du principe de « ne pas causer de préjudice important » au regard des facteurs liés au changement climatique mis en évidence par les indicateurs de PIN, y compris des domaines tels que l'exposition de l'entreprise à l'extraction de combustibles fossiles et une empreinte carbone élevée et non maîtrisée dans un secteur à fortes émissions.

Lors de l'évaluation du principe de « ne pas causer de préjudice important » lié au changement climatique, le gestionnaire de portefeuille a également tenu compte de la nature des activités d'une société ainsi que de la présence de controverses ou de signaux provenant des indicateurs de PIN. Pour chaque groupe d'indicateurs de PIN, le gestionnaire de portefeuille a évalué la matérialité de chaque indicateur et la présence d'un préjudice potentiel important, cette évaluation étant réalisée à l'aide d'une analyse exclusive. Les résultats de l'évaluation du principe de « ne pas causer de préjudice important » ont influencé les notations de risque liées à la gouvernance et à la durabilité attribuées par le gestionnaire de portefeuille, mais cette évaluation est conçue pour fonctionner comme un processus parallèle aux notations de risque afin de respecter l'engagement de réaliser des « investissements durables » au sens du règlement SFDR. L'évaluation a pour but principal de déterminer s'il existait des preuves d'un préjudice important qui auraient empêché un investissement d'être considéré comme durable.

----- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Dans sa gestion du Compartiment, le Gestionnaire de portefeuille a pris en compte les 14 indicateurs de PIN obligatoires et deux indicateurs supplémentaires. Les deux indicateurs supplémentaires étaient :

- Sur le plan environnemental : les investissements dans des entreprises sans initiative de réduction des émissions de carbone ; et
- Sur le plan social : l'absence de politique en matière de droits de l'homme.

L'analyse des sociétés par le Gestionnaire de portefeuille tenait compte de ces facteurs et lorsque le Gestionnaire de portefeuille identifiait de potentielles incidences négatives importantes, il engageait un dialogue avec les sociétés. Conformément aux exigences spécifiques du SFDR, le Gestionnaire de portefeuille a également établi des rapports sur

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

les indicateurs de PIN en utilisant des données provenant de l'entreprise ou en recherchant des substituts lorsque celles-ci n'étaient pas disponibles.

Pour plus d'informations sur la manière dont l'analyse des entreprises par le gestionnaire de portefeuille a pris en compte ces facteurs, veuillez vous référer à la section ci-dessous intitulée « Comment ce produit financier a-t-il pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? ».

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Tout investissement durable potentiel identifié a été soumis à l'analyse ESG plus large du Gestionnaire de portefeuille qui a porté son attention sur le management, la culture, ainsi que sur le risque social et environnemental. Cette analyse s'articulait autour des Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales, et le Gestionnaire de portefeuille s'est également concentré sur le risque d'exploitation sociale au sens des Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme.

Le Pacte mondial des Nations unies (dont les critères sont contraignants pour le compartiment) énonce 10 principes qui définissent les responsabilités minimales dans les domaines des droits de l'homme, des normes internationales du travail, de l'environnement et de la lutte contre la corruption, découlant des conventions établies.

Il existe un chevauchement important entre les principes du Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs de l'OCDE, qui sont effectivement pris en compte par le Gestionnaire de portefeuille à travers le filtrage relatif au Pacte mondial. D'autres instruments multilatéraux importants cités dans les principes directeurs constituent également des éléments de base des principes directeurs de l'OCDE, à savoir les Principes fondamentaux de l'OIT (Organisation internationale du travail) et la Déclaration universelle des droits de l'homme. Ils couvrent efficacement les controverses potentielles liées aux piliers clés de l'OCDE que sont les droits de l'homme, le droit du travail, l'environnement, la lutte contre la corruption et la protection des consommateurs.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les facteurs de durabilité peuvent avoir un impact sur les entreprises dans lesquelles le compartiment investit, et le gestionnaire de portefeuille est également conscient du fait que les entreprises elles-mêmes peuvent avoir un impact négatif, par exemple sur l'environnement, leurs employés ou les communautés dans lesquelles elles opèrent. Ces incidences négatives comprennent, sans s'y limiter, les émissions de gaz à effet de serre (GES) et d'autres formes de pollution, ou les violations potentielles du Pacte mondial des Nations unies. L'analyse des sociétés par le gestionnaire de portefeuille a tenu compte de ces facteurs et lorsqu'il identifiait de potentielles incidences négatives importantes, le gestionnaire de portefeuille engageait un dialogue avec les sociétés concernées, comme indiqué plus en détail dans la politique de gestion et d'engagement du gestionnaire de portefeuille. Conformément aux exigences spécifiques du SFDR, le gestionnaire de portefeuille a également établi des rapports sur les indicateurs de PIN en utilisant des données provenant de l'entreprise ou en recherchant des substituts lorsque celles-ci n'étaient pas disponibles.

L'analyse des PIN était intégrée au processus de diligence raisonnable du gestionnaire de portefeuille pour chaque société. L'évaluation des 14 PIN obligatoires et des deux PIN supplémentaires est regroupée en six domaines clés pour l'évaluation de la matérialité. Toutes les PIN n'étaient pas significatives pour chaque entreprise. Le gestionnaire de portefeuille évaluait si l'un des six domaines était important pour la société bénéficiaire et, lorsque c'était le cas, il l'intégrait dans ses évaluations de risque, sa thèse d'investissement et, le cas échéant, dans son activité d'engagement planifiée.

Les six principaux groupes de PIN sont les suivants :

- Emissions et la gestion du carbone — PIN #1 (émissions de gaz à effet de serre), #2 (empreinte carbone) et #3 (intensité des émissions de gaz à effet de serre des sociétés bénéficiaires des investissements ainsi qu'une PIN facultative sur les sociétés n'ayant pas mis en place d'initiative de réduction des émissions de carbone) ;
- l'exposition à des entreprises du secteur des combustibles fossiles — PIN #4 (exposition à des entreprises actives dans le secteur des combustibles fossiles) ;
- Efficacité énergétique et utilisation rationnelle de l'eau (PIN 5 (part de la consommation et de la production d'énergie non renouvelable) et 6 (intensité de la consommation d'énergie par secteur à fort impact)) ;
- Pollution et biodiversité — PIN n°7 (activités ayant une incidence négative sur les zones sensibles sur le plan de la biodiversité), #8 (rejets dans l'eau) et #9 (taux de déchets dangereux) ;
- Droits humains et questions relatives aux employés — PIN #10-13 (violations des Principes directeurs de l'ONU et de l'OCDE ; absence de processus et de mécanismes de conformité permettant de contrôler le respect des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE ; écarts de rémunération entre hommes et femmes non corrigés ; diversité du conseil d'administration) et un PIN supplémentaire pour les sociétés démunies de politique sur les droits humains ; et
- L'exposition à des armes controversées — PIN #14 (exposition à des armes controversées).

Dans certains cas, tels que la PIN 10 (violations des Principes directeurs de l'ONU et de l'OCDE), le compartiment dispose de critères contraignants et n'investira pas dans des sociétés qui sont considérées comme « défaillantes » au regard du Pacte mondial des Nations unies. Conformément à la politique du gestionnaire en matière d'armes controversées, le compartiment ne détiendra pas de sociétés exposées à des armes controversées.

Des informations sur les PIN concernant les facteurs de durabilité sont disponibles dans la politique d'investissement du gestionnaire.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Émissions de GES : Émissions totales en EUR	12 594,31	96,22%
Empreinte carbone en EUR	71,95	96,22%
Intensité des GES en EUR	416,67	96,22%
Exposition à des entreprises actives dans le secteur des combustibles fossiles.	0,00%	96,22%
Part de la consommation et de la production d'énergie non renouvelable	70,31%	82,33%
Intensité de consommation énergétique : Agriculture en EUR	0,00	93,16%
Intensité de consommation énergétique : Industrie minière en EUR	0,00	93,16%
Intensité de consommation énergétique : Secteur manufacturier en EUR	0,31	93,16%
Intensité de consommation énergétique : Électricité en EUR	0,00	93,16%
Intensité de consommation énergétique : Eau en EUR	0,00	93,16%
Intensité de consommation énergétique : Construction en EUR	0,00	93,16%
Intensité de consommation énergétique : Négoce et véhicules en EUR	0,02	93,16%
Intensité de consommation énergétique : Transports et entreposage en EUR	0,00	93,16%
Intensité de consommation énergétique : Immobilier en EUR	0,00	93,16%
Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité	0,00%	96,22%
Rejets dans l'eau en EUR	0,01	5,04%
Déchets dangereux EUR	0,09	47,76%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	98,99%
Absence de processus et de mécanismes de conformité pour garantir le respect des principes du Pacte mondial des Nations Unies (UNGC) et les principes directeurs de l'Organisation de coopération et de développement économiques (OCDE) à l'intention des entreprises multinationales.	50,36%	95,15%
Écarts de rémunération hommes/femmes non ajustés	19,03%	11,63%
Mixité du conseil d'administration	35,94%	96,22%
Exposition à des armes controversées	0,00%	96,22%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les principaux investissements de ce Fonds, à l'exclusion des liquidités et des produits dérivés, ont été les suivants :

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
ASML HOLDING NV	Technologies de l'information	9,13%	Pays-Bas
FERRARI NV	Biens de consommation discrétionnaire	8,29%	Italie
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	Santé	6,35%	États-Unis
KERING SA	Biens de consommation discrétionnaire	5,04%	France
MONCLER SPA	Biens de consommation discrétionnaire	5,03%	Italie
LINDE PLC	Matériaux	4,98%	Royaume-Uni
HEXAGON AB	Technologies de l'information	4,96%	Suède
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	Santé	4,91%	France
L'OREAL SA	Biens de consommation courante	4,84%	France
ASSA ABLOY AB	Industrie	4,75%	Suède
INFINEON TECHNOLOGIES AG	Technologies de l'information	4,39%	Allemagne
DASSAULT SYSTEMES SE	Technologies de l'information	4,29%	France
KINGSPAN GROUP PLC	Industrie	4,01%	Irlande
PARTNERS GROUP HOLDING AG	Secteur financier	3,53%	Suisse
COLOPLAST A/S	Santé	3,53%	Danemark

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2022-01-01 - 2022-12-31.



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

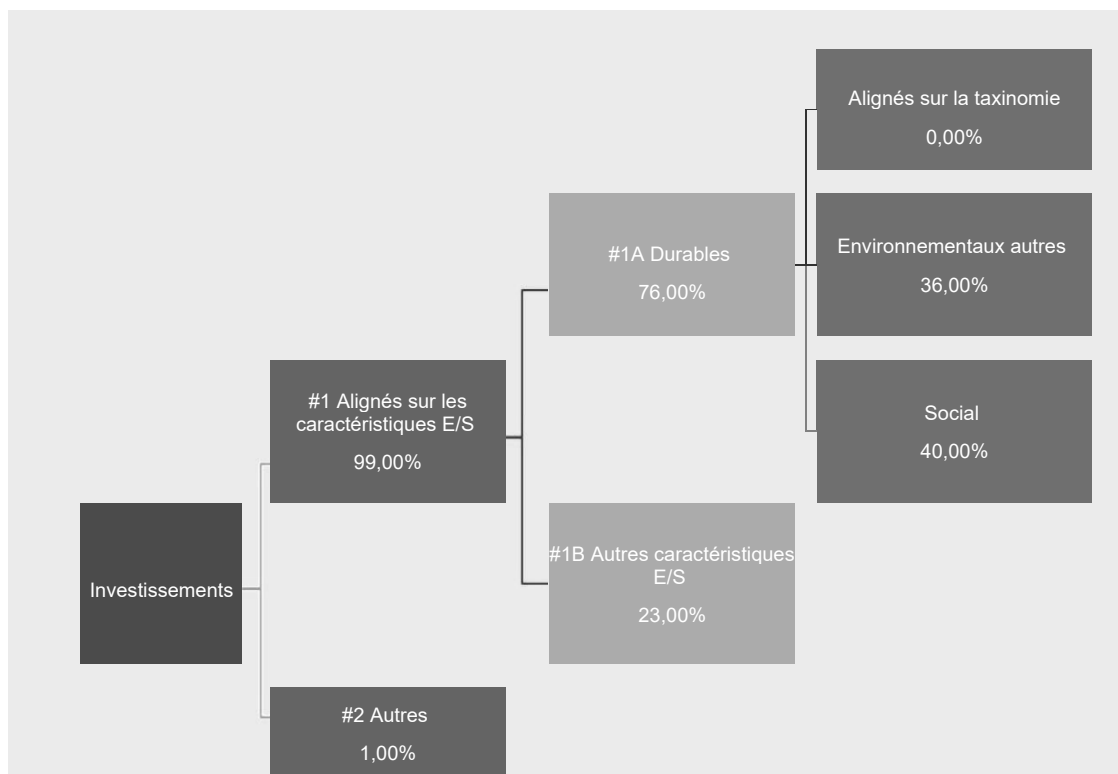
La proportion d'investissements liés à la durabilité s'établissait à 76,00 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

99,00 % du portefeuille du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (1,00 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides.

Le Fonds a investi dans des placements durables 76,00 % du segment de son portefeuille qui était aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Principal secteur	% d'actifs
Technologies de l'information	24,91%
Biens de consommation discrétionnaire	20,46%
Santé	19,19%
Industrie	13,19%
Biens de consommation courante	7,95%
Matériaux	7,63%
Secteur financier	5,66%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Outils et services de sciences de la vie	14,95%
Semi-conducteurs et équipements pour semi-conducteurs	13,07%
Textiles, confection et produits de luxe	11,45%
Automobiles	9,01%
Produits de construction	8,39%
Chimie	7,63%
Logiciels	7,26%
Marchés financiers	5,66%
Produits personnels	4,94%
Machines	4,80%
Équipements, instruments et composants électroniques	4,58%
Équipements et fournitures de soins de santé	4,24%
Produits alimentaires	3,01%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

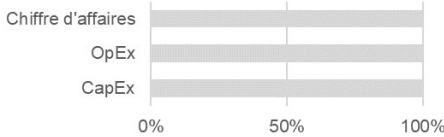
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

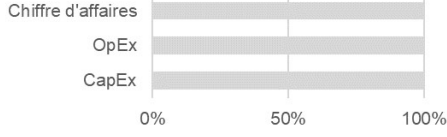
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Non applicable



Le symbole représente des investissements durables ayant

un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

En raison de sa stratégie d'investissement, le Fonds n'a pas réalisé d'investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE ; par conséquent, à la fin du mois de février 2023, 36,00 % du portefeuille du Fonds était composé d'investissements ayant un objectif environnemental non aligné avec la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

La proportion d'investissements durables sur le plan social s'établissait à 40,00 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie «#2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements relevant de la catégorie « 2 Autres » s'établissait à 1,00 % et comprenait les liquidités pour lesquelles il n'y avait pas de garanties environnementales ou sociales minimales.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

- S'est engagé avec les entreprises de son portefeuille à fixer ou à mettre en œuvre des objectifs de réduction des émissions de gaz à effet de serre.
- A respecté les exclusions énoncées dans le prospectus en ce qui concerne les notations exclusives en matière de gouvernance et du risque de durabilité, les violations du Pacte mondial des Nations unies, les armes controversées et toutes les autres activités commerciales faisant l'objet d'une exclusion.
- A pris en compte les 14 PIN obligatoires et deux PIN supplémentaires dans le cadre de l'analyse des investissements, qui comprend des indicateurs relatifs à l'efficacité énergétique et à l'utilisation rationnelle de l'eau, à la pollution et aux risques liés à la biodiversité.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Non applicable

Franklin Responsible Income 2028 Fund

LEI de l'entité : 254900FTK4TK4QA6CU84



FRANKLIN TEMPLETON

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ ☐ OUI

☐ Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ____%

☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ____%

☒ ☒ NON

☒ Il promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 17,58% d'investissements durables

☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☒ ayant un objectif social

☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables

Par investissement durable, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La taxinomie de l'UE est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Étant donné que le Fonds a été lancé le 23 janvier 2023 et qu'il se trouve toujours dans un processus de collecte de fonds et de déploiement du capital, la composition du portefeuille prévu n'a pas encore été finalisée (et cette phase initiale peut durer jusqu'à 6 mois). Néanmoins, depuis son lancement, le Fonds a promu des caractéristiques environnementales et sociales conformément à l'article 8 du règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (Sustainable Finance Disclosure Regulation, le « SFDR »). Les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le Fonds sont les suivantes :

- la promotion de la transition vers une économie à faible intensité de carbone en évitant les investissements dans des émetteurs accusant du retard dans la transition ;
- l'application de filtres négatifs dans le cadre de son processus d'investissement.

Les deux caractéristiques susmentionnées ont été respectées.

Le Fonds alloue au moins 11 % de son portefeuille à des investissements durables. Le Fonds veille à ce que ses investissements durables n'aient pas causé de préjudice important à un quelconque objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social. Au 28 février, l'exposition du fonds aux obligations vertes et sociales dépassait 17,5 %. Au 28 février, le fonds promouvait la transition vers une économie à faible intensité de carbone en déployant environ 35 % de ses actifs dans des émetteurs classés comme « champions » selon la méthodologie exclusive de l'équipe d'investissement. Par ailleurs, environ 26 % ont été investis dans des émetteurs classés comme surperformants. Ainsi, plus de la moitié des actifs du fonds ont été déployés dans des émetteurs dont la caractéristique carbone a surpassé l'univers d'investissement du fonds. En évitant d'investir dans des titres impliqués dans des controverses majeures ou exposés à des activités économiques préjudiciables au-delà de seuils rigoureux, l'exposition du fonds aux indicateurs de principales incidences négatives est supérieure à celle d'un indice de référence. Veuillez consulter les paragraphes suivants pour des informations plus détaillées.

Les produits dérivés n'ont pas été utilisés pour atteindre les caractéristiques sociales ou environnementales promues par le Compartiment.

Aucun indice de référence n'a été désigné pour le respect des caractéristiques environnementales / sociales préconisées par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les indicateurs de durabilité suivants ont été utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le compartiment :

A. Exposition aux obligations vertes, sociales et durables (Green, Social and Sustainability, GSS) et à celles émises par les champions de l'environnement.

- 12.98% d'investissements dans des obligations vertes ;
- 4.59% d'investissements dans des obligations sociales ;
- 0 % des investissements en obligations durables ;
- 35% d'investissements dans des obligations émises par les meilleurs émetteurs de leur catégorie (les « champions environnementaux ») ;

l'exposition totale aux obligations vertes, sociales et durables et à celles émises par les Champions de l'environnement s'élève à 52 % de la VNI. L'exposition aux obligations vertes et sociales représentait exactement 17,58 % de la VNI. Par conséquent, l'engagement concernant l'élément contraignant de la stratégie d'investissement - investir au moins 11 % du portefeuille du Compartiment dans des investissements durables - a été pleinement respecté.

B. L'application des exclusions ESG.

Le fonds a investi 0 % dans des émetteurs exposés ou liés à des secteurs exclus et à d'autres exclusions plus amplement décrites dans la section relative à la stratégie d'investissement ; L'exclusion des 20 % d'émetteurs les moins bien notés de l'univers d'investissement à l'issue des classements EETI et ESG Credit App ; Au 28 février, le fonds ne détenait qu'une seule position classée comme « retardataire ». Ce titre a été acheté en tant que « sous-performant » éligible à un investissement, mais tout au long de la période d'investissement, ses caractéristiques carbone se sont dégradées, et la gestion du portefeuille est en train de céder ce titre dans les délais impartis par la politique d'investissement.

C. Exposition aux indicateurs des principales incidences négatives (PIN).

Une moyenne pondérée au niveau du Fonds de chacun des indicateurs obligatoires des principales incidences négatives a été calculée trimestriellement pour le Fonds et pour son indice de référence. Le Fonds ne s'engage pas à obtenir une meilleure moyenne des PIN que celle de son indice de référence.

D. La liste des émetteurs avec lesquels le Gestionnaire de portefeuille s'engage.

Les émetteurs suivants ont fait l'objet d'un engagement au cours de la période de référence :

1. CEZ AS
2. International Business Machines Corp
3. Italmatch Chemicals Spa
4. Morgan Stanley
5. Natwest Markets PLC

Les 5 émetteurs qui ont fait l'objet d'un engagement sur 64 émetteurs uniques (8 %) constituent 9 % des positions et représentent 9,5 % de la valeur nette d'inventaire du fonds au 28 février 2023. Tous les engagements ont insisté sur l'amélioration de la divulgation et de la transparence des données relatives aux rapports ESG de l'entreprise (y compris les indicateurs de PIN). Les autres thèmes abordés avec les émetteurs étaient notamment les suivants :

- réduction des émissions de gaz à effet de serre (80 % des engagements),
- conformité au Pacte mondial des Nations unies (60 % des engagements),
- dépendances et incidences sur la biodiversité, y compris l'utilisation de l'eau (40 % des engagements).

D'autres engagements sont prévus pour le reste de l'année 2023.

Nom de l'ICP de durabilité	Valeur
Exposition aux obligations vertes	12,98%
Exposition aux obligations sociales	4,59%
Exposition aux obligations durables	0,00%
Exposition à des champions environnementaux	34,59%
Exposition aux secteurs exclus	0,00%
Exposition aux indicateurs des principales incidences négatives (PIN)	1,00
Liste des émetteurs auprès desquels le Gestionnaire de portefeuille s'engage.	1,00

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Sans objet car il n'y a pas eu de périodes de référence antérieures.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

L'objectif des investissements durables consistait notamment à financer et à promouvoir :

- a) l'utilisation efficace de l'énergie, des matières premières, de l'eau et des terres ;
- b) la production d'énergies renouvelables ;

- c) la réduction des déchets et des émissions de gaz à effet de serre (GES), et la diminution de l'impact des activités économiques sur la biodiversité ;
- d) le développement d'une économie circulaire ;
- e) la lutte contre les inégalités et la favorisation de la cohésion sociale ;
- f) l'intégration sociale ;
- g) les bonnes relations de travail ;
- h) les investissements dans le capital humain, y compris les communautés défavorisées.

Les investissements durables du Fonds comprenaient une allocation minimale de 10 % de son portefeuille dans des investissements durables dans des activités économiques contribuant à des objectifs environnementaux.

Pour ce faire, le Fonds a investi dans des obligations jugées vertes ou dans tout autre titre dont :

- A) les produits ont été utilisés pour des projets environnementaux éligibles ;
- B) Le cadre de référence applique des normes internationales (dont, notamment, les principes applicables aux obligations vertes de l'International Capital Market Association (l'« ICMA »), la future norme européenne relative aux obligations vertes (« European Union Green Bond Standard », EU-GBS)) ; et
- C) les émetteurs ne causent pas de préjudice important à d'autres objectifs environnementaux et sociaux, tout en appliquant des pratiques de bonne gouvernance.

L'utilisation du produit de ces obligations a été clairement définie et alignée sur les objectifs susmentionnés.

En outre, le Fonds s'est engagé à prévoir une allocation minimale de 1 % de son portefeuille à des investissements durables sur le plan social. Pour ce faire, le Fonds a investi dans des obligations labellisées « sociales » ou dans tout autre titre dont :

- A) les produits ont été utilisés pour des projets sociaux éligibles ;
- B) le cadre de référence applique des normes internationales (dont, notamment, les principes applicables aux obligations sociales de l'ICMA ;
- C) les émetteurs ne causent pas de préjudice important à d'autres objectifs environnementaux et sociaux, tout en appliquant des pratiques de bonne gouvernance.

Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Les principales incidences **négligées** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Le gestionnaire de portefeuille a recouru à des outils d'analyse de données développés en interne et applique des critères de recherche qualitatifs afin de garantir un alignement sur les principes consistant à « ne pas causer de préjudice important » à l'échelle du portefeuille.

Les émetteurs d'obligations d'entreprises ont fait l'objet d'un suivi réalisé à l'aide d'une application d'analyse du risque des principales incidences négatives, PAI Risk App. L'application utilisait des données fournies par MSCI pour identifier les émetteurs impliqués dans des activités économiques causant des préjudices et/ou impliqués dans des controverses. Les émetteurs considérés comme violant les critères des principales incidences négatives n° 7 (« activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité »), n° 10 (« violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et des principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales ») et n° 14 (« exposition à des armes controversées ») ont été exclus de l'univers d'investissement du Fonds.

Le gestionnaire de portefeuille a également recouru à l'indice Energy and Environmental Transition Index (« EETI »), qui classe les autres émetteurs de l'univers d'investissement du compartiment en fonction de leurs émissions et intensité de GES. Les émetteurs classés dans les 20 % inférieurs de leur groupe en ce qui concerne les indicateurs n° 1 (« émissions de GES ») et n° 3 (« empreinte carbone ») (pour les entreprises) et n° 15 (« intensité de GES ») (pour les émetteurs souverains) ont été exclus de l'univers d'investissement.

Par ailleurs, les émetteurs souverains ont été soumis à des tests évaluant leur niveau en matière de libertés politiques (indicateur n° 16) et/ou de corruption.

Lorsqu'il engageait des fonds dans des investissements durables, en particulier dans le cadre de l'engagement consistant à investir 11 % de la valeur liquidative pour contribuer à atteindre des objectifs environnementaux et sociaux, le Gestionnaire de portefeuille appliquait des critères qualitatifs supplémentaires (fondés sur la recherche interne ou sur un deuxième avis extérieur) pour évaluer l'éligibilité de l'émetteur et du projet par rapport aux principes consistant à « ne pas causer de préjudice important ».

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Les indicateurs d'impact négatif, y compris les PIN et d'autres points de données considérés par le Gestionnaire d'investissement comme des indicateurs d'incidence négative, ont été utilisés pour :

- a. éliminer du portefeuille les émetteurs considérés comme ayant un impact négatif important ; et
- b. Informer le Gestionnaire de portefeuille du risque lié à l'incidence négative et prendre des mesures appropriées, y compris en matière de diligence raisonnable, d'examen qualitatif et/ou d'engagement (pour des détails sur un engagement, voir les chapitres « Principales incidences négatives » et « Stratégie d'investissement » du Fonds de la présente annexe).

Lors de son évaluation des obligations vertes et sociales éligibles, le Gestionnaire de portefeuille examinait et documentait l'importance des principales incidences négatives concernées pour le projet ainsi que la mesure dans

laquelle la mise en œuvre du projet affectait les perspectives globales de l'émetteur en ce qui concerne les principales incidences négatives.

Par exemple, lorsqu'il investissait dans une obligation verte dont l'utilisation des revenus visait le développement de sources d'énergie renouvelable p. ex. des panneaux solaires/photovoltaïques, le gestionnaire de portefeuille s'assurait que le projet financé était assorti d'une note favorable en ce qui concerne les principales incidences négatives liées aux émissions de GES.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Les investissements réalisés dans des obligations émises par des pays souverains n'étaient pas soumis aux principes directeurs de l'Organisation de coopération et de développement économiques (l'« OCDE ») à l'intention des entreprises multinationales ni aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme. En ce qui concerne les obligations émises par des entreprises, les investissements durables étaient alignés sur les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales ainsi que sur les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme.

Cet alignement a fait l'objet d'un suivi constant réalisé à l'aide de données de MSCI. Les violations identifiées par ces prestataires de services étaient signalées dans le système de conformité des investissements en vue d'un examen ultérieur par le gestionnaire de portefeuille.

Lorsque l'examen de la diligence raisonnable prouvait que l'émetteur n'était pas en conformité avec les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les principes directeurs des Nations Unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, l'émetteur était considéré comme non investissable.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les indicateurs de PIN ont été pris en compte dans le but :

- (i) identifier les émetteurs considérés comme les meilleurs de leur catégorie ;
- (ii) restreindre l'univers d'investissement du compartiment ;
- (iii) orientation générale donnée aux engagements thématiques

Identification des meilleurs émetteurs

Le Fonds a investi dans des obligations émises par des entreprises et des émetteurs souverains considérés comme des « champions environnementaux » par le gestionnaire de portefeuille. Les « champions environnementaux » étaient identifiés à l'aide de deux classements ESG exclusifs :

- L'EETI classe les émetteurs souverains suivant leur efficacité énergétique, la conservation de leur capital naturel et leurs performances en matière d'énergies renouvelables en utilisant à plusieurs points de données, dont l'intensité de GES (émissions normalisées par produit intérieur brut, CO2e/PIB).
- L'application ESG Credit classe les entreprises émettant des obligations en fonction de leurs émissions de GES et de leur intensité de GES à l'aide de différents points de données, tels que les émissions de GES de niveau 1 et 2 et les trajectoires historiques des émetteurs.

Restriction de l'univers d'investissement du compartiment

Les émetteurs souverains qui se retrouvent dans les 20 % inférieurs de l'univers d'investissement à l'issue du classement EETI et les entreprises se retrouvant dans les 20 % inférieurs (c.-à-d. celles accusant un retard en matière climatique) à l'issue du classement de l'application ESG Credit étaient également exclus du portefeuille.

Orientation générale donnée aux engagements thématiques

Le gestionnaire de portefeuille a veillé à s'engager auprès des 5 % des positions actives considérées comme affichant une sous-performance en termes d'exposition globale en référence aux indicateurs obligatoires applicables des principales incidences négatives.

De plus amples informations sur la façon dont le Fonds a pris en considération ses principales incidences négatives sont présentées dans son rapport périodique.

Indicateurs de PAI	Valeur	Couverture
Émissions de GES : Scope 1 en EUR	1 109,46	64,71%
Émissions de GES : Scope 2 en EUR	144,52	64,71%
Émissions de GES : Scope 3 est. en EUR	6 075,57	64,71%
Émissions de GES : Scopes 1 & 2 en EUR	1 253,97	64,71%
Émissions de GES : Émissions totales est. en EUR	7 329,55	64,71%
Empreinte carbone 1 & 2 en EUR	53,15	64,71%
Empreinte carbone est. en EUR	310,66	64,71%
Intensité des GES 1 & 2 en EUR	492,67	88,87%
Intensité des GES est. en EUR	1 196,48	88,87%
Exposition à des entreprises actives dans le secteur des combustibles fossiles.	5,14%	81,11%
Part de la consommation et de la production d'énergie non renouvelable	62,08%	75,68%
Intensité de consommation énergétique : Agriculture en EUR	0,00	0,00%
Intensité de consommation énergétique : Industrie minière en EUR	0,00	0,00%
Intensité de consommation énergétique : Secteur manufacturier en EUR	0,43	6,87%
Intensité de consommation énergétique : Électricité en EUR	11,63	5,14%
Intensité de consommation énergétique : Eau en EUR	0,00	0,00%
Intensité de consommation énergétique : Construction en EUR	0,06	0,92%
Intensité de consommation énergétique : Négoce et véhicules en EUR	0,03	1,19%
Intensité de consommation énergétique : Transports et entreposage en EUR	0,11	1,86%
Intensité de consommation énergétique : Immobilier en EUR	0,00	0,00%
Activités ayant une incidence négative sur des zones sensibles sur le plan de la biodiversité	0,00%	81,11%
Rejets dans l'eau en EUR	0,03	3,44%
Déchets dangereux EUR	0,09	12,86%
Violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies et des principes directeurs de l'OCDE	0,00%	81,11%
Absence de processus et de mécanismes de conformité pour garantir le respect des principes du Pacte mondial des Nations Unies (UNGC) et les principes directeurs de l'Organisation de coopération et de développement économiques (OCDE) à l'intention des entreprises multinationales.	0,00%	81,11%
Écarts de rémunération hommes/femmes non ajustés	27,51%	20,65%
Mixité du conseil d'administration	38,31%	81,11%
Exposition à des armes controversées	0,00%	81,11%
Intensité en GES des pays en portefeuille en EUR	481,28	2,32%
Pays d'investissement connaissant des violations de normes sociales	0,00	2,32%



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Les 15 principaux investissements de ce produit financier au 28 février 2023, hors liquidités et produits dérivés, ont été les suivants :

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 2023-01-23 - 2023-02-28.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Romanian Government International Bond 2,125 % 03/07/2028 REG S	Obligations d'État	2,36%	Roumanie
Caixa Geral de Depositos SA 5,75 %, 31/10/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Secteur financier	2,28%	Portugal
Morgan Stanley 4,813 % 25/10/2028 *FIXED TO FLOAT*	Secteur financier	2,24%	États-Unis
Crelan SA 5,75 % 26/01/2028 REG S	Secteur financier	2,20%	Belgique
Natwest Markets PLC 4,25 % 13/01/2028 REG S	Secteur financier	2,17%	Royaume-Uni
BPCE SA 4,375 % 13/07/2028 REG S	Secteur financier	2,16%	France
ABN AMRO Bank NV 4 % 16/01/2028 REG S	Secteur financier	2,15%	Pays-Bas
Orano SA 2,75 % 08/03/2028 REG S	Industrie	2,04%	France
AIB Group PLC 2,25 % 04/04/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Secteur financier	2,01%	Irlande
Engie SA 1,75 % 27/03/2028 REG S	Services aux collectivités	2,00%	France
Intesa Sanpaolo Spa 1,75 % 20/03/2028 REG S	Secteur financier	1,94%	Italie
Abanca Corp Bancaria SA 5,25 % 14/09/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Secteur financier	1,93%	Espagne
Commerzbank AG 4,625 % 21/03/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Secteur financier	1,92%	Danemark
La Banque Postale SA 1 % 09/02/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Secteur financier	1,89%	France
Barclays PLC 0,877 % 28/01/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Secteur financier	1,88%	Royaume-Uni



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

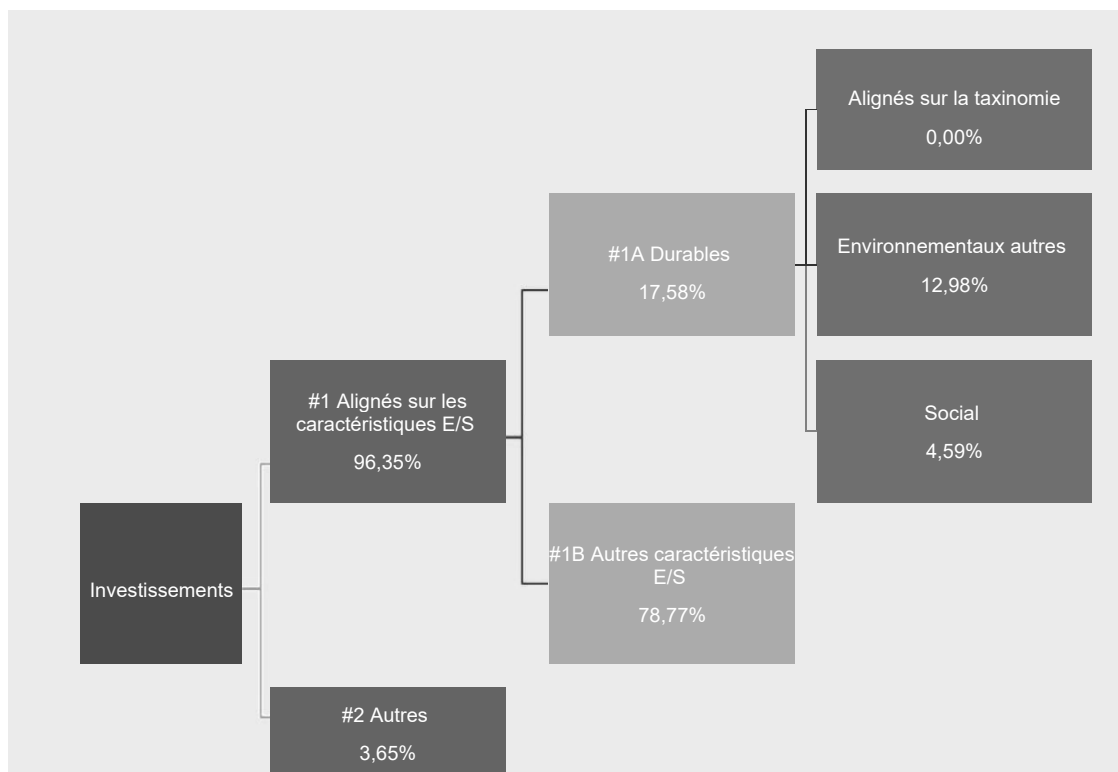
La proportion d'investissements durables s'établit à 17,58 %.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

96,35 % du portefeuille du Fonds étaient alignés sur les caractéristiques E/S promues par le Fonds. La portion restante (3,65 %), non alignée sur les caractéristiques promues, se composait principalement d'actifs liquides.

En plus du segment aligné sur les caractéristiques environnementales et sociales promues, le Fonds a investi 17,53 % de son portefeuille dans des placements durables.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● **Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?**

Les principaux secteurs de ce produit financier au 28 février 2023 ont été les suivants :

Principal secteur	% d'actifs
Secteur financier	53,77%
Industrie	13,13%
Services aux collectivités	7,01%
Technologies de l'information	6,81%
Biens de consommation discrétionnaire	3,79%
Matériaux	3,10%
commercial	2,38%
Obligations d'État	2,36%
Services de communication	2,17%
Santé	2,06%

Principal sous-secteur	% d'actifs
Banques	39,02%
Services financiers diversifiés	13,71%
Services aux collectivités	7,01%
Transports	6,51%
Logiciels et services	4,27%
Biens d'équipement	4,06%
Matériaux	3,10%
Services commerciaux et professionnels	2,56%
Matériel et équipements technologiques	2,54%
commercial	2,38%
Obligations d'État	2,36%
Télécommunications	2,17%
Équipements et services de soins de santé	2,06%
Biens de consommation durable et habillement	2,00%
Distribution	1,78%

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

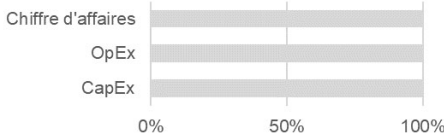
Le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE ?¹

- ☐ Oui
- ☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire
- ☒ Non

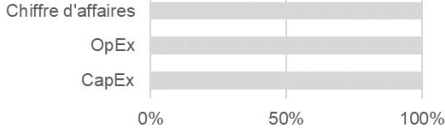
Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



	CapEx	OpEx	Chiffre d'affaires
■ Alignés sur la taxinomie : gaz fossile	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie : nucléaire	0,00%	0,00%	0,00%
■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)	0,00%	0,00%	0,00%
■ Non alignés sur la taxinomie	100,00%	100,00%	100,00%

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

*Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires habilitantes ?

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le Fonds n'a pas investi dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Non applicable

 Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Au terme de la période de référence, 12,98 % du portefeuille du Fonds était composé d'investissements ayant un objectif environnemental non aligné avec la taxinomie de l'UE.

En raison de sa stratégie d'investissement, le Fonds n'a procédé à aucun investissement durable ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE.



Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

La proportion d'investissements durables sur le plan social s'établissait à 4,59 %.



Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « #2 Autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

La proportion d'investissements « #2 Autres » se chiffrait à 3,65 % et comprenait les liquidités (liquidités détenues à titre accessoire, dépôts bancaires, instruments du marché monétaire et fonds du marché monétaire) détenues afin de répondre aux besoins au jour le jour du Fonds.

Aucunes garanties environnementales et/ou sociales minimales n'ont été mises en place.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Les mesures suivantes ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence :

A. Les indicateurs de durabilité ont été utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds.

B. Le gestionnaire de portefeuille a recouru à des outils d'analyse de données développés en interne et a appliqué des critères de recherche qualitatifs afin de garantir un alignement sur les principes consistant à « ne pas causer de préjudice important » à l'échelle du portefeuille. Les émetteurs d'obligations d'entreprises ont fait l'objet d'un suivi réalisé à l'aide d'une application d'analyse du risque des principales incidences négatives, PAI Risk App. Le gestionnaire de portefeuille recourait également à l'indice Energy and Environmental Transition Index (« EETI »), qui classe les autres émetteurs de l'univers d'investissement du compartiment en fonction de leurs émissions et intensité de GES.

C. Lorsqu'il engageait des fonds dans des investissements durables, en particulier dans le cadre de l'engagement consistant à investir 11 % de la valeur liquidative pour contribuer à atteindre des objectifs environnementaux et sociaux, le gestionnaire de portefeuille appliquait des critères qualitatifs supplémentaires (le formulaire d'évaluation de l'investissement durable - fondés sur des recherches internes ou sur un deuxième avis extérieur) pour évaluer l'éligibilité de l'émetteur et du projet par rapport au principe consistant à « ne pas causer de préjudice important ».

D. Le Fonds utilisait une méthodologie de notation ESG exclusive en vue d'éviter d'investir dans des émetteurs qui sont à la traîne dans la transition vers une économie à faible intensité de carbone. La méthodologie de notation ESG était appliquée à au moins 90 % du portefeuille du Fonds et elle était contraignante pour la constitution du portefeuille. Le Fonds recourait à une approche sélective afin d'exclure de son portefeuille les émetteurs (entreprises et États) qui se situaient dans les 20 % les moins performants de son univers d'investissement pour ce qui concerne les indicateurs visés.

E. Les 5 émetteurs qui ont fait l'objet d'un engagement sur 64 émetteurs uniques (8 %) constituent 9 % des positions et représentent 9,5 % de la valeur nette d'inventaire du Fonds au 28 février 2023. Nous avons eu recours au courrier électronique, à des appels vidéo directs, à la participation à des tournées de présentation ou à l'occasion de réunions en présentiel. Nous continuons à nous engager auprès des émetteurs que nous détenons sur le compte. Les sections ci-dessus fournissent de plus amples informations sur les engagements.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Non applicable

