# FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund Class D US$ Distributing (M)

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Obbligazionari Altro | Not Categorized<br>Usato nel Report | Not Benchmarked | Senza rating |

## Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Fund's investment objective is to maximise total return, consisting of income and capital appreciation. The Fund will invest at least 65% of its Net Asset Value in mortgage-backed securities ("MBS") and asset-backed securities which are issued by non-governmental issuers and are not guaranteed by US government-sponsored entities such as FNMA or FHLMC and/or by agencies of the US government such as GNMA (collectively, "Agencies", each "an Agency"). Such securities will be listed or traded on Regulated Markets located anywhere in the world, including Emerging Market Countries.

## Rendimenti

| 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | 2025 | 2026-05 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 10,77 | -2,81 | 2,79 | 16,39 | -6,55 | 2,78 | ● Fondo |

## Misure di Rischio

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3Y Alpha | - | 3Y Sharpe Ratio | 0,19 |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | 7,15 |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |

| Rend. Cumulati % | Fondo |
|---|---|
| 3-Mesi | 3,04 |
| 6-Mesi | 5,81 |
| 1-Anno | 7,03 |
| 3-Anni Ann.ti | 5,64 |
| 5-Anni Ann.ti | 4,16 |
| 10-Anni Ann.ti | - |

Rendimenti aggiornati al 26/06/2026

| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | 2,75 | - | - | - |
| 2025 | -2,19 | -5,91 | 1,01 | 0,54 |
| 2024 | 4,66 | 3,13 | -1,77 | 9,78 |
| 2023 | -0,85 | 1,07 | 4,90 | -2,21 |
| 2022 | -0,68 | 3,41 | 5,80 | -10,56 |

## Portafoglio 31/05/2026

| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|
| ● Azioni | 0,00 |
| ● Obbligazioni | 93,62 |
| ● Liquidità | 4,20 |
| ● Altro | 2,18 |

**Fixed Income Style Box™**

| | Fondo |
|---|---|
| Duration Effettiva | 1,49 |
| Maturity effettiva | 4,24 |
| Qualità Credito Media | BB |

| Credit Quality % | Fondo | Credit Quality % | Fondo |
|---|---|---|---|
| AAA | 9,55 | BBB | 9,34 |
| AA | 5,63 | BB | 11,81 |
| A | 14,29 | B | 3,57 |
| | | Below B | 6,96 |
| | | Not Rated | 38,84 |

### Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---|---|
| Western Asset USD Liquidity... | — | 4,85 |
| Federal Home Loan Mortgage... | — | 1,64 |
| Federal National Mortgage... | — | 1,35 |
| Freddie Mac Stacr Remic... | — | 1,15 |
| 280 Park Avenue Trust 6.76499% | — | 1,08 |
| Federal Home Loan Mortgage... | — | 1,08 |
| VERUS SECURITIZATION TRUST... | — | 1,08 |
| Csmc Trust 2017 11.044% | — | 1,07 |
| Federal Home Loan Mortgage... | — | 1,05 |
| BDS 2026-FL17 LLC 5.9% | — | 1,00 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 15,35 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 269 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|---|---|
| Governativo | 0,04 |
| Societario | 4,75 |
| Cartolarizzazioni | 91,50 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 3,71 |
| Derivati | 0,00 |

| Coupon Range % | Fondo |
|---|---|
| 0 coupon | 3,99 |
| Da 0 a 4 cedole | 16,07 |
| Da 4 a 6 cedole | 32,90 |
| Da 6 a 8 cedole | 28,03 |
| Da 8 a 10 cedole | 12,75 |
| Da 10 a 12 cedole | 3,49 |
| Oltre 12 cedole | 2,76 |

| Scadenze % | Fondo |
|---|---|
| da 1 a 3 | 1,38 |
| da 3 a 5 | 2,50 |
| da 5 a 7 | 4,83 |
| da 7 a 10 | 10,90 |
| da 10 a 15 | 17,58 |
| da 15 a 20 | 15,77 |
| da 20 a 30 | 23,14 |
| oltre 30 | 23,85 |

## Anagrafica

| | |
|---|---|
| Società di Gestione | Franklin Templeton International Services S.à r.l. |
| Telefono | +352 46 66 67 212 |
| Web | www.franklintempleton.lu |
| Data di Partenza | 14/02/2018 |
| Nome del Gestore | - |
| Data Inizio Gestione | 13/01/2016 |
| NAV (26/06/2026) | USD 77,18 |
| Patrimonio Netto (Mln) (31/05/2026) | 532,48 USD |

| | |
|---|---|
| Patrimonio Classe (Mln) (26/06/2026) | 1,05 USD |
| Domicilio | IRLANDA |
| Valuta del Fondo | USD |
| UCITS | Si |
| Inc/Acc | Inc |
| ISIN | IE00BF3FPC39 |

| | |
|---|---|
| Investimento Min. Ingresso | 750.000 USD |
| Investimento Min. Successivo | - |
| T.E.R. | 1,48% |
| Spese correnti | 1,46% |
| Commissione di incentivo | 0,00% |

See disclosures for more details

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.

MORNINGSTAR