

Informe semestral (Sin auditar)

Franklin Templeton
Global Funds Plc

Un fondo paraguas con responsabilidad
separada entre sus subfondos

Para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023

Índice

Información general	3
Carta a los accionistas	16
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	17
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset US Core Bond Fund	18
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	28
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	45
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	48
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset US High Yield Fund	53
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset Global High Yield Fund	57
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	60
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	62
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	66
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	71
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	75
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	83
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	92
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	96
Cartera de inversiones: Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	104
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund	107
Cartera de inversiones: Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	113
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	118
Cartera de inversiones: FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	120
Cartera de inversiones: FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	124
Cartera de inversiones: FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	127
Cartera de inversiones: FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	129
Cartera de inversiones: FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	132
Cartera de inversiones: FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	136
Cartera de inversiones: FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	138
Cartera de inversiónse – FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	140
Cartera de inversiones: FTGF ClearBridge Value Fund	142
Cartera de inversiones: FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	144
Cartera de inversiones: FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	146
Cartera de inversiones: FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	148
Cartera de inversiones: FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	150
Cartera de inversiones: FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	152
Cartera de inversiones: Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund [^]	154
Cartera de inversiones: Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	155
Cartera de inversiones: FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	157
Cartera de inversiones: FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	159
Cartera de inversiones: Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	163
Cartera de inversiones: FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	165
Cartera de inversiones: Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	166
Cartera de inversiones: Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^]	167
Cartera de inversiones: Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	168
Cartera de inversiones: FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	169
Cartera de inversiones: FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	170
Cartera de inversiones: FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	171
Cartera de inversiones: FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	172
Cartera de inversiones: FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	173
Cartera de inversiones: Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	174
Estado de situación financiera – Franklin Templeton Global Funds Plc	176
Estado del resultado global – Franklin Templeton Global Funds Plc	196
Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de acciones participativas rescatables – Franklin Templeton Global Funds Plc	206
Notas a los estados financieros - Franklin Templeton Global Funds Plc	232
Información complementaria — Ratios de gastos totales (TER) — Franklin Templeton Global Funds Plc	251
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	258
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Western Asset US Core Bond Fund	258
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	258
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	259
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	259
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Western Asset US High Yield Fund	260
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Western Asset Global High Yield Fund	260
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	260
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	261
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	261
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	261
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	262
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	262
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	262
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	263
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	263
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund	264
Estado de cambios importantes en la cartera — Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	264
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	264
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	265
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	265

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Índice – (continuación)

Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	265
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	266
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	266
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	267
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	267
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	268
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	268
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	268
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF ClearBridge Value Fund	269
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	269
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	270
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	270
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	270
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	271
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	271
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	272
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	272
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	273
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Royce US Smaller Companies Fund	273
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	273
Estado de cambios importantes en la cartera — Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^]	274
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	274
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	275
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	275
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	275
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	276
Estado de cambios importantes en la cartera — FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	276
Estado de cambios importantes en la cartera — Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	276
Apéndice: Reglamento sobre operaciones de financiación de valores (SFTR)	278

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Información general

Consejo de Administración

Joseph Carrier (Estados Unidos)
 Fionnuala Doris (Irlanda) (Independiente)
 William Jackson (Reino Unido)¹
 Joseph Keane (Irlanda) (Independiente)
 Joseph LaRocque (Estados Unidos)
 Jaspal Sagger (Reino Unido)
 Jane Trust (Estados Unidos)
 Craig Tyle (Estados Unidos)²

¹ dimitió el 17 de julio de 2023.

² nombrado el 27 de julio de 2023.

Domicilio social

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

Secretaría

Bradwell Limited
 Ten Earlsfort Terrace, Dublin 2
 Irlanda

Distribuidor principal y Agente principal de servicios a los Accionistas

Franklin Distributors, LLC
 One Franklin Parkway
 San Mateo, CA 94403
 EE. UU.

Distribuidores adicionales y Agentes de servicios a los Accionistas

Franklin Templeton International Services S.à r.l
 8A, rue Albert Borschette
 L-1246 Luxemburgo
 Gran Ducado de Luxemburgo

Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc.
 8F, No. 87
 Sec. 4, Zhong Xiao E. Rd., Taipéi
 Taiwán

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

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

Estatus de Fondo Declarante y Fondo Distribuidor (relevante solo para los Accionistas del Reino Unido)

Los accionistas del Reino Unido pueden identificar qué clases de acciones de la Sociedad han sido aceptadas en el régimen de fondos declarantes del Reino Unido y qué clases de acciones han obtenido el estatus de fondo declarante en el Reino Unido, comprobando el listado de Fondos Declarantes de la autoridad fiscal británica (HM Revenue and Customs) en la web <https://www.gov.uk/government/publications/offshore-funds-list-of-reporting-funds>. La autoridad fiscal británica (HM Revenue and Customs) actualiza esta lista de forma mensual.

Para obtener más información, consulte el folleto complementario para inversores del Reino Unido, o póngase en contacto con Franklin Templeton International Services S.à r.l.

Representante suizo

First Independent Fund Services Ltd
 Klausstrasse 33
 CH-8008 Zúrich
 Suiza

Agente de pagos suizo

NPB Neue Privat Bank Ltd
 Limmatquai 1/am Bellevue
 CH-8024 Zúrich
 Suiza

El folleto, los documentos de datos fundamentales para el inversor, el acta de constitución de la Sociedad, así como los informes anuales y semestrales y el desglose de las transacciones de compra y venta de los Fondos, se pueden obtener gratuitamente en la oficina del representante suizo.

Asesor Legal irlandés

Arthur Cox LLP
 Ten Earlsfort Terrace, Dublin 2
 Irlanda

Depositario

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

Audidores independientes

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

Administrador

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

Gestor y promotor

Franklin Templeton International Services S.à r.l
 8A, rue Albert Borschette
 L-1246 Luxemburgo
 Gran Ducado de Luxemburgo

Información general — (continuación)

Denominación del Fondo	Fecha de lanzamiento de los Fondos	Gestor/Subgestor(es) de inversiones
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund ^a	27 de febrero de 2004	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestor de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p>
FTGF Western Asset US Core Bond Fund*	30 de agosto de 2002	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestor de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p>
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund*	20 de abril de 2007	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestores de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japón</p>
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund*	1 de octubre de 2003	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestor de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p>
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund ^{a,b}	24 de febrero de 2004 (cesó sus operaciones el 16 de febrero de 2023)	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestor de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p>
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund*	29 de agosto de 2002	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestores de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145</p>

Información general — (continuación)

Denominación del Fondo	Fecha de lanzamiento de los Fondos	Gestor/Subgestor(es) de inversiones
FTGF Western Asset US High Yield Fund*	27 de febrero de 2004	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestor de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p>
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund ^a * ^b	24 de febrero de 2004 (cesó sus operaciones el 10 de octubre de 2022)	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestores de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145</p>
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund ^a * ^b	21 de octubre de 2011 (cesó sus operaciones el 21 de junio de 2022)	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestores de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japón</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145</p> <p>Western Asset Management Company Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Pres. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo – Brasil</p>
FTGF Western Asset Global High Yield Fund*	20 de abril de 2007	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestores de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145</p>
Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund ^a * ^b	20 de abril de 2007 (cesó sus operaciones el 8 de noviembre de 2019)	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestor de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p>

Información general — (continuación)

Denominación del Fondo	Fecha de lanzamiento de los Fondos	Gestor/Subgestor(es) de inversiones
Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund^{^*b}	20 de abril de 2007 (cesó sus operaciones el 2 de agosto de 2019)	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestor de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p>
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^{^*b}	20 de abril de 2007 (cesó sus operaciones el 5 de diciembre de 2022)	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestor de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p>
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund*	12 de junio de 2008	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestores de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145</p>
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund*	3 de junio de 2009	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestores de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japón</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145</p>

Información general — (continuación)

Denominación del Fondo	Fecha de lanzamiento de los Fondos	Gestor/Subgestor(es) de inversiones
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund ^{^*}	3 de diciembre de 2010	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street, London EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestores de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japón</p>
FTGF Western Asset Global Credit Fund ^{^*}	19 de noviembre de 2010	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestores de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145</p> <p>Western Asset Management Company Pty Limited Level 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australia</p>
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund ^{^*p}	3 de diciembre de 2010 (cesó sus operaciones el 21 de junio de 2022)	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestores de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145</p>
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund ^{^*}	5 de septiembre de 2013	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestores de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japón</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145</p>

Información general — (continuación)

Denominación del Fondo	Fecha de lanzamiento de los Fondos	Gestor/Subgestor(es) de inversiones
Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^{^*b}	16 de diciembre de 2015 (cesó sus operaciones el 10 de diciembre de 2019)	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestor de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p>
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^{^*}	16 de diciembre de 2015	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestores de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p> <p>Western Asset Management Company Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Pres. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo – Brasil</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japón</p>
Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^{^*b}	31 de diciembre de 2015 (cesó sus operaciones el 13 de noviembre de 2019)	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestores de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japón</p> <p>Western Asset Management Company Pty Limited Level 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australia</p> <p>Western Asset Management Company Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Pres. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo – Brasil</p>

Información general — (continuación)

Denominación del Fondo	Fecha de lanzamiento de los Fondos	Gestor/Subgestor(es) de inversiones
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund ^{^*}	13 de enero de 2016	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestor de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p>
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund ^{^*}	13 de enero de 2016	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestor de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p>
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund ^{^*}	17 de noviembre de 2016	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestores de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145</p>
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [*]	17 de noviembre de 2016	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestor de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p>
FTGF Western Asset Infrastructure Debt Fund ^{^*^}		<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestores de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p> <p>Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japón</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145</p> <p>Western Asset Management Company Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Pres. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo – Brasil</p>

Información general — (continuación)

Denominación del Fondo	Fecha de lanzamiento de los Fondos	Gestor/Subgestor(es) de inversiones
FTGF Western Asset Short-Dated High Yield Fund ^{†*}		<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestor de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p>
FTGF Western Asset Asian Income Fund ^{†*}		<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestores de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145</p>
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund ^{†*}	11 de enero de 2021	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestor de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p>
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund ^{†*}	10 de enero de 2022	<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestores de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145</p> <p>Western Asset Management Company Pty Limited Level 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australia</p>
FTGF Western Asset China Bond Fund ^{†*}		<p>Gestor de inversiones: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido</p> <p>Subgestores de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.</p> <p>Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145</p>

Información general — (continuación)

Denominación del Fondo	Fecha de lanzamiento de los Fondos	Gestor/Subgestor(es) de inversiones
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund*	1 de octubre de 2003	Gestor de inversiones: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Filadelfia, Pensilvania 19103 EE. UU.
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund ^{^*}	3 de abril de 2012	Gestor de inversiones: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Filadelfia, Pensilvania 19103 EE. UU.
FTGF Brandywine Global High Yield Fund ^{^*}	30 de noviembre de 2012	Gestor de inversiones: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Filadelfia, Pensilvania 19103 EE. UU.
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund*	25 de junio de 2010	Gestor de inversiones: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Filadelfia, Pensilvania 19103 EE. UU.
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund ^{^*b}	10 de mayo de 2012 (cesó sus operaciones el 25 de febrero de 2021)	Gestor de inversiones: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Filadelfia, Pensilvania 19103 EE. UU.
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund*	3 de junio de 2013	Gestor de inversiones: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Filadelfia, Pensilvania 19103 EE. UU.
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund ^{^*}	30 de junio de 2014	Gestor de inversiones: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Filadelfia, Pensilvania 19103 EE. UU.
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund ^{^*b}	6 de abril de 2017 (cesó sus operaciones el 24 de marzo de 2023)	Gestor de inversiones: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Filadelfia, Pensilvania 19103 EE. UU.
Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund ^{^*b}	30 de octubre de 2017 (cesó sus operaciones el 29 de enero de 2020)	Gestor de inversiones: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Filadelfia, Pensilvania 19103 EE. UU.
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund ^{^*}	16 de agosto de 2018	Gestor de inversiones: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Filadelfia, Pensilvania 19103 EE. UU.
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund ^{^*}	1 de diciembre de 2022	Gestor de inversiones: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Filadelfia, Pensilvania 19103 EE. UU.
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund ^{^*b}	31 de diciembre de 2015 (cesó sus operaciones el 24 de marzo de 2023)	Gestor de inversiones: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Filadelfia, Pensilvania 19103 EE. UU.

Información general — (continuación)

Denominación del Fondo	Fecha de lanzamiento de los Fondos	Gestor/Subgestor(es) de inversiones
FTGF Brandywine Global – EM Macro Bond Fund** [^]		Gestor de inversiones: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Filadelfia, Pensilvania 19103 EE. UU.
FTGF ClearBridge Value Fund**	23 de marzo de 1998	Gestor de inversiones: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor Nueva York, Nueva York 10018 EE. UU.
Legg Mason ClearBridge Growth Fund [^] ** ^b	25 de febrero de 2004 (cesó sus operaciones el 15 de febrero de 2019)	Gestor de inversiones: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor Nueva York, Nueva York 10018 EE. UU.
Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund [^] ** ^b	1 de septiembre de 2006 (cesó sus operaciones el 22 de noviembre de 2019)	Gestor de inversiones: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor Nueva York, Nueva York 10018 EE. UU.
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund**	20 de abril de 2007	Gestor de inversiones: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor Nueva York, Nueva York 10018 EE. UU.
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund**	20 de abril de 2007	Gestor de inversiones: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor Nueva York, Nueva York 10018 EE. UU.
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund**	20 de abril de 2007	Gestor de inversiones: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor Nueva York, Nueva York 10018 EE. UU.
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund**	3 de junio de 2013	Gestor de inversiones: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor Nueva York, Nueva York 10018 EE. UU.
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund**	30 de septiembre de 2015	Gestor de inversiones: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor Nueva York, Nueva York 10018 EE. UU.
FTGF ClearBridge Global Growth Fund** [^]	29 de junio de 2018	Gestor de inversiones: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor Nueva York, Nueva York 10018 EE. UU.
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund** [^]	22 de septiembre de 2023	Gestor de inversiones: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor Nueva York, Nueva York 10018 EE. UU.
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund** [^]	9 de diciembre de 2016	Gestor de inversiones: ClearBridge Investments (Norteamérica) Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sidney NSW 2000 Australia
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund** [^] ^b	31 de marzo de 2017 (cesó sus operaciones el 17 de noviembre de 2022)	Gestor de inversiones: ClearBridge Investments (Norteamérica) Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sidney NSW 2000 Australia
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund**	30 de abril de 2021	Gestor de inversiones: ClearBridge Investments (Norteamérica) Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sidney NSW 2000 Australia

Información general — (continuación)

Denominación del Fondo	Fecha de lanzamiento de los Fondos	Gestor/Subgestor(es) de inversiones
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund**	8 de noviembre de 2002	Gestor de inversiones: Royce & Associates, LP 745 5th Avenue Nueva York, Nueva York 10151 EE. UU.
FTGF Royce US Smaller Companies Fund**	1 de marzo de 2004	Gestor de inversiones: Royce & Associates, LP 745 5th Avenue Nueva York, Nueva York 10151 EE. UU.
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^**	1 de diciembre de 2021	Gestor de inversiones: Royce & Associates, LP 745 5th Avenue Nueva York, Nueva York 10151 EE. UU.
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^*** ^b	30 de agosto de 2002 (cesó sus operaciones el 11 de julio de 2022)	Gestor de inversiones: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 EE. UU.
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^*** ^b	25 de febrero de 2004 (cesó sus operaciones el 17 de julio de 2023)	Gestor de inversiones: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 EE. UU.
Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund^*** ^b	20 de abril de 2007 (cesó sus operaciones el 25 de febrero de 2015)	
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^*** ^b	28 de abril de 2008 (cesó sus operaciones el 14 de abril de 2021)	Gestor de inversiones: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 EE. UU.
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^*** ^b	29 de diciembre de 2010 (cesó sus operaciones el 27 de abril de 2022)	Gestor de inversiones: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 EE. UU.
Legg Mason QS US Large Cap Fund^1***		Gestor de inversiones: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 EE. UU.
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund** ^a ^b	11 de marzo de 2016 (cesó sus operaciones el 20 de abril de 2023)	Gestor de inversiones: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edimburgo EH1 2ES Escocia Subgestor de inversiones: Templeton Asset Management Ltd. 7 Temasek Boulevard, #38-03 Suntec Tower One Singapur 038987
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund** ^a ^b	11 de marzo de 2016 (cesó sus operaciones el 21 de agosto de 2019)	Gestor de inversiones: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edimburgo EH1 2ES Escocia Subgestor de inversiones: Templeton Asset Management Ltd. 7 Temasek Boulevard, #38-03 Suntec Tower One Singapur 038987
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund** ^a ^b	11 de marzo de 2016 (cesó sus operaciones el 1 de junio de 2021)	Gestor de inversiones: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edimburgo EH1 2ES Escocia
Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund** ^a ^b	11 de marzo de 2016 (cesó sus operaciones el 31 de julio de 2017)	

Información general — (continuación)

Denominación del Fondo	Fecha de lanzamiento de los Fondos	Gestor/Subgestor(es) de inversiones
Legg Mason Martin Currie Greater China Fund**^{ab}	11 de marzo de 2016 (cesó sus operaciones el 15 de noviembre de 2019)	Gestor de inversiones: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edimburgo EH1 2ES Escocia
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund**^a	28 de junio de 2016	Gestor de inversiones: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edimburgo EH1 2ES Escocia
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund**	28 de junio de 2016	Gestor de inversiones: Franklin Templeton Australia Limited Level 47 120 Collins Street, Melbourne VIC 3000 Australia
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund**^a	24 de noviembre de 2017	Gestor de inversiones: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edimburgo EH1 2ES Escocia
FTGF Martin Currie European Select Absolute Alpha Fund**^{1a}		Gestor de inversiones: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edimburgo EH1 2ES Escocia
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund**^a	9 de noviembre de 2018	Gestor de inversiones: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edimburgo EH1 2ES Escocia
FTGF Martin Currie Improving Society Fund**^a	20 de junio de 2023	Gestor de inversiones: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edimburgo EH1 2ES Escocia
FTGF Multi-Asset Infrastructure Income Fund**^{1a}		Gestores de inversiones: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU. ClearBridge Investments (Norteamérica) Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sidney NSW 2000 Australia
Legg Mason US Equity Fund^{ab}	8 de enero de 2008 (cesó sus operaciones el 24 de agosto de 2010, se relanzó el 13 de abril de 2012 y cesó sus operaciones el 30 de agosto de 2013)	
Legg Mason Japan Equity Fund^{ab}	2 de octubre de 2008 (cesó sus operaciones el 30 de noviembre de 2010)	
Franklin Responsible Income 2028 Fund^a	23 de enero de 2023	Gestor de inversiones: Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street Londres EC4N 6HL Reino Unido
Franklin Responsible Series 2 Fund^{1a}		Gestor de inversiones: Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street Londres EC4N 6HL Reino Unido

Información general — (continuación)

Denominación del Fondo	Fecha de lanzamiento de los Fondos	Gestor/Subgestor(es) de inversiones
Franklin Responsible Series 3 Fund* [†] ^		Gestor de inversiones: Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street Londres EC4N 6HL Reino Unido

[†] Al final del periodo fiscal, estos Fondos no habían comenzado a operar.

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

^μ Fondo del Mercado Monetario.

* Fondos de Renta Fija (Fondos que invierten principalmente en valores de renta fija y valores que devengan intereses).

** Fondos de Renta Variable (Fondos que invierten principalmente en valores de renta variable).

*** Fondo Multiactivos (cualquier Fondo definido como un «Fondo Multiactivos» en el Suplemento correspondiente del Folleto).

[♯] Revocación pendiente de la autorización del Banco Central.

Más información

Para obtener más información sobre la gama de Fondos de Franklin Templeton Global Funds Plc, póngase en contacto con:

Para inversores profesionales en Europa (excepto Reino Unido y Suiza)

Franklin Templeton International Services S.à r.l
 8A, rue Albert Borschette
 L-1246 Luxemburgo
 Gran Ducado de Luxemburgo

www.franklinresources.com

Para intermediarios autorizados en América

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

www.franklintempletonoffshore.com

Visite el sitio web pertinente para obtener información sobre:

- Cotizaciones diarias
- Documentación, incluidas las fichas técnicas con la información más reciente sobre cada Fondo
- Más información sobre las filiales de gestión de activos de Franklin Templeton que gestionan los Fondos

Carta a los accionistas

Estimado/a accionista:

Nos complace proveerle el informe semestral de Franklin Templeton Global Funds Plc (la «Sociedad») para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023. En este informe destacamos los impulsores clave del rendimiento de los mercados de bonos y renta variable durante el periodo.

Análisis de la economía mundial

La economía mundial se enfrentó a numerosos retos, pero resistió durante el periodo analizado. Dicho esto, el crecimiento podría moderarse debido a varios factores en contra. Según la *actualización de julio de 2023 de las Perspectivas Económicas Mundiales*, el Fondo Monetario Internacional (el «FMI») prevé que el crecimiento del producto interior bruto («PIB») mundial disminuya del 3,5 % en 2022 al 3,0 % en 2023. Según el FMI, «la recuperación mundial de la pandemia del COVID-19 y de la invasión rusa de Ucrania se está ralentizando en medio de divergencias cada vez mayores entre sectores económicos y regiones... Aunque la previsión para 2023 sea ligeramente superior a la prevista en Perspectivas de la economía mundial de abril de 2023, sigue siendo débil en comparación con los niveles históricos. La subida de los tipos de interés oficiales de los bancos centrales para luchar contra la inflación sigue lastrando la actividad económica... La inflación está remitiendo en la mayoría de los países, pero sigue siendo elevada, con divergencias entre economías y medidas de inflación.» El FMI prevé para 2023 un crecimiento del PIB del 1,8 % en Estados Unidos (frente al 2,1 % de 2022), del 0,9 % en la Eurozona (frente al 3,5 % de 2022), del 0,4 % en el Reino Unido (frente al 4,1 % de 2022) y del 1,4 % en Japón (frente al 1,1 % de 2022).

Análisis del mercado: renta fijaⁱ

El mercado de renta fija global en su conjunto creció durante el periodo del informe. En Estados Unidos, los rendimientos de los bonos del Tesoro subieron al mantenerse elevada la inflación. En este contexto, la Junta de la Reserva Federal de Estados Unidos («Fed») ha subido el tipo de los fondos federales en diez reuniones consecutivas, desde marzo de 2022 hasta mayo de 2023. Aunque la Reserva Federal hizo una pausa en la subida de tipos en junio de 2023, el banco central volvió a subir los tipos en julio de 2023, situándolos en máximos de 22 años. El rendimiento de los bonos del Tesoro estadounidenses a 10 años comenzó el periodo de del informe en el 3,92 % y lo finalizó en el 4,09 %. También se produjo el aumento de los rendimientos en la mayoría de países de mercados desarrollados aparte de EE. UU. En resumen, los bonos corporativosⁱⁱⁱ con grado de inversiónⁱⁱ y del Tesoro estadounidense registraron resultados positivos. Los bonos corporativos estadounidenses con menor calificación y la deuda soberana de los mercados emergentes denominada en USD también se movieron al alza.

Análisis del mercado: renta variable global^{iv}

La renta variable global experimentó periodos de volatilidad, pero registró rendimientos positivos durante el periodo analizado. La confianza de los inversores se vio respaldada por la resistencia de la economía mundial, unos beneficios empresariales que a menudo superaron las expectativas y la moderación de la inflación. Para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023, el Índice S&P 500 arrojó un rendimiento del 14,50 %. Fuera de EE. UU., la renta variable internacional desarrollada, medida por el índice MSCI EAFE (neto), subió un 4,75 %, mientras que la renta variable de los mercados emergentes, medida por el índice MSCI Emerging Markets (neto), arrojó un rendimiento del 3,62 %.

ⁱ Renta fija: bonos.

ⁱⁱ Grado de inversión: una calificación crediticia que indica que un bono del Estado o uno corporativo entraña un riesgo relativamente bajo de impago.

Le agradecemos su continuo apoyo.

Atentamente,

Franklin Templeton International Services S.à r.l

Septiembre de 2023

La rentabilidad pasada no es garantía de rendimientos futuros. Esta información no pretende ser un pronóstico de futuros acontecimientos, una garantía de futuros resultados ni asesoramiento de inversión.

Todos los datos son exactos a 31 de agosto de 2023 a menos que se especifique lo contrario.

Franklin Templeton Global Funds plc es un fondo tipo paraguas con responsabilidad segregada entre subfondos, constituido como sociedad de inversión abierta de capital variable, autorizada en Irlanda por el Banco Central de Irlanda como organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios.

Toda inversión implica riesgos, incluida la posible pérdida del principal. La rentabilidad histórica no garantiza los resultados futuros y puede que no se repita.

Esta información se ha preparado a partir de fuentes que se consideran fiables, pero no está garantizada por ninguna de las empresas de Franklin Resources, Inc. o empresas vinculadas (conjuntamente denominadas «Franklin Templeton») y no es un resumen o estado completo de todos los datos disponibles.

Las opiniones expresadas están sujetas a cambios sin previo aviso y no tienen en cuenta los objetivos de inversión, la situación financiera o las necesidades concretas de los inversores particulares.

Antes de invertir, debería leer el documento de datos fundamentales para el inversor y el folleto, que describen exhaustivamente los objetivos y factores de riesgo de los subfondos. Estos y otros documentos relevantes pueden obtenerse en varios idiomas en BNY Mellon Fund Services (Irlanda) Designated Activity Company, en One Dockland Central, Guild Street, IFSC, Dublín 1 (Irlanda), en el sitio web www.leggmasonglobal.com y en el domicilio social.

Publicado y aprobado por Franklin Templeton International Services S.à r.l, 8A, rue Albert Borschette, L-1246 Luxemburgo, Gran Ducado de Luxemburgo, constituida en Luxemburgo y regulada por la Comisión de Supervisión del Sector Financiero de Luxemburgo (Commission de Surveillance du Secteur Financier).

Este material no está destinado a ninguna persona o uso que sea contrario a las leyes o regulaciones locales. Franklin Templeton no se responsabiliza por la posterior transferencia de este material.

ⁱⁱⁱ Bono corporativo: un bono emitido por una corporación para recaudar fondos de forma eficaz a fin de expandir su negocio.

^{iv} Renta variable: derecho de propiedad en una corporación en la forma de acción ordinaria o acción preferente.

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor liquidativo	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor liquidativo
Bonos y obligaciones del Estado — 75,66 % (28 de febrero de 2023: 71,90%)				702.821	75,66
Estados Unidos — 75,66 % (28 de febrero de 2023: 71,90%)					
15.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,340 %, con vencimiento el 20/09/2023 *	1,61			
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,320 %, con vencimiento el 14/11/2023 *	1,08			
3.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,325 %, con vencimiento el 30/11/2023 *	0,32			
2.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Serie 0000, 5,360 %, con vencimiento el 13/12/2023 *	0,21			
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,360 %, con vencimiento el 27/12/2023 *	1,08			
15.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp., Serie 0000, 5,330 %, con vencimiento el 08/01/2024	1,61			
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Serie 0000, 5,380 %, con vencimiento el 29/01/2024 *	1,08			
15.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,345 %, con vencimiento el 20/02/2024 *	1,61			
25.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,450 %, con vencimiento el 20/03/2024 *	2,69			
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp., Serie 0001, 5,380 %, con vencimiento el 06/05/2024 *	1,08			
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Serie 0001, 5,380 %, con vencimiento el 24/05/2024 *	0,997			
10.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, vencimiento el 01/09/2023	1,08			
10.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, vencimiento el 06/09/2023	0,993			
15.862	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, vencimiento el 15/09/2023	1,70			
15.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, vencimiento el 29/09/2023	1,61			
10.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, vencimiento el 27/10/2023	0,923			
5.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, vencimiento el 17/01/2024	0,53			
10.000	Federal Home Loan Banks, Serie 0000, 5,360 %, con vencimiento el 05/09/2023 *	1,08			
10.000	Federal Home Loan Banks, 5,420 %, con vencimiento el 06/09/2023 *	1,08			
4.500	Federal Home Loan Bank, 5,360 %, con vencimiento el 19/09/2023 *	0,48			
10.000	Federal Home Loan Bank, 5,420 %, con vencimiento el 20/09/2023 *	1,08			
26.200	Federal Home Loan Banks, Serie 0002, 5,330 %, con vencimiento el 25/09/2023 *	2,82			
10.000	Federal Home Loan Banks, Serie 0000, 5,340 %, con vencimiento el 23/10/2023 *	1,08			
10.000	Federal Home Loan Bank, 5,335 %, con vencimiento el 16/11/2023 *	1,08			
10.000	Federal Home Loan Banks, Serie 0000, 5,355 %, con vencimiento el 24/11/2023 *	1,08			
5.000	Federal Home Loan Bank, 5,370 %, con vencimiento el 27/11/2023 *	0,54			
10.000	Federal Home Loan Banks, Serie 0000, 5,390 %, con vencimiento el 01/12/2023 *	1,08			
5.000	Federal Home Loan Bank, 5,380 %, vencimiento 24/01/2024 *	0,999			
10.000	Federal Home Loan Banks, Serie 0001, 5,340 %, vencimiento 01/02/2024 *	1,08			
10.000	Federal Home Loan Banks, Serie 0000, 5,340 %, vencimiento 16/02/2024 *	1,08			
20.000	Federal Home Loan Bank, 5,420 %, vencimiento 14/03/2024 *	2,15			
4.000	Federal Home Loan Banks, 5,360 %, con vencimiento el 03/05/2024 *	0,43			
15.000	Federal Home Loan Banks, Serie 0000, 5,365 %, vencimiento 10/05/2024 *	1,61			
10.000	Federal Home Loan Bank, 5,365 %, vencimiento 24/05/2024 *	1,08			
10.000	Federal Home Loan Banks, Serie 0001, 5,420 %, vencimiento 28/05/2024 *	1,08			
10.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 05/09/2023	0,994			
15.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 07/09/2023	1,61			
15.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 12/09/2023	1,61			
15.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 19/09/2023	1,61			
15.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 21/09/2023	1,61			
15.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 26/09/2023	1,61			
10.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 28/09/2023	0,961			
20.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 03/10/2023	1,906			
10.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 05/10/2023	0,950			
20.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 12/10/2023	1,9883			
10.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 19/10/2023	0,930			
10.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 24/10/2023	0,923			
15.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 26/10/2023	1,479			
10.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 31/10/2023	0,913			
10.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 07/11/2023	0,902			
10.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 09/11/2023	0,899			
15.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 16/11/2023	1,432			
10.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 21/11/2023	0,881			
20.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 24/11/2023	1,9756			
10.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 30/11/2023	0,867			
10.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 12/12/2023	0,850			
15.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 19/12/2023	1,4759			
10.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 02/01/2024	0,824			
10.000	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 18/01/2024	0,797			
15.000	United States Treasury Floating Rate Note, 5,448 %, con vencimiento el 31/10/2023 *	1,61			
			Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 702.821\$)	702.821	75,66
			Contratos de recompra inversa — 26,65 % (28 de febrero de 2023: 29,37%)		
			Estados Unidos — 26,65% (28 de febrero de 2023: 29,37%)		
			50.000 Canadian Imperial Bank of Commerce, contrato de recompra inversa a recomprar por 50.007.319 USD (garantizado por bonos y pagarés del Tesoro de EE. UU. por un valor total de 51.007.467 USD), 5,270 %, vencimiento 01/09/2023	50.000	5,39
			55.000 HSBC Bank (EE. UU.), contrato de recompra inversa a recomprar por 55.008.021 USD (garantizado por bonos y pagarés del Tesoro de EE. UU. por un valor total de 56.108.220 USD), 5,250 %, vencimiento 01/09/2023	55.000	5,92
			80.000 JP Morgan Securities LLC, contrato de recompra inversa a recomprar por 80.011.733 USD (garantizado por bonos y pagarés del Tesoro de EE. UU. por un valor total de 81.611.971 USD), 5,280 %, vencimiento 01/09/2023	80.000	8,61
			50.000 Royal Bank of Canada, contrato de recompra inversa a recomprar por 50.007.278 USD (garantizado por bonos y pagarés del Tesoro de EE. UU. por un valor total de 51.000.021 USD), 5,240 %, vencimiento 01/09/2023	50.000	5,38
			12.520 TD Securities (USA) LLC, contrato de recompra inversa a recomprar por 12.521.843 USD (garantizado por bonos y pagarés del Tesoro de EE.UU. por un valor total de 12.770.400 USD), 5,300 %, vencimiento 01/09/2023	12.520	1,35
				247.520	26,65
			Total Contratos de recompra inversa (Coste 247.520 \$)	247.520	26,65
			Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	950.341	102,31
			Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	950.341	102,31
			Excedente de pasivos respecto a otros activos	(21.422)	(2,31)
			Patrimonio	928.919\$	100,00
			– Los importes designados como “–” son 0 \$ menos de 1000 \$, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.		
			* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.		
			Análisis del total de activos		% del total de activos
			Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado		73,79
			Instrumentos del mercado monetario		25,99
			Otros activos		0,22
			Total de activos		100,00

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor liquidativo	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor liquidativo
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			30 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550%, vencimiento 23/01/2049		
185 Government National Mortgage Association, Serie 2020 H09, Clase FL, 4,850 %, con vencimiento el 20/05/2070 *	186	0,09		31	0,02
108 Government National Mortgage Association, Serie 2020 H09, Clase NF, 6,468 %, con vencimiento el 20/04/2070 *	109	0,05		784	0,39
64 Government National Mortgage Association, Serie 2020 H13, Clase FA, 4,989 %, con vencimiento el 20/07/2070 *	62	0,03	Brasil — 0,77 % (28 de febrero de 2023: 0,57%)		
5.902 Government National Mortgage Association, Serie 2021 10, Clase IO, 0,986 %, con vencimiento el 16/05/2063 *	408	0,20	10 Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, con vencimiento 17/03/2024	10	-
159 Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2021 115, Clase MI, 2,500%, con vencimiento el 20/10/2051	17	0,01	50 Petrobras Global Finance BV, 6,850%, vencimiento 05/06/2115	44	0,02
436 Government National Mortgage Association, Serie 2021 188, Clase PA, 2,000 %, con vencimiento el 20/10/2051	361	0,18	1.100 Suzano Austria GmbH, 6,000%, vencimiento 15/01/2029	1.092	0,54
169 Government National Mortgage Association, Serie 2021 2, Clase AH, 1,500 %, con vencimiento el 16/06/2063	126	0,06	20 Vale Overseas Ltd, 6,875%, vencimiento 21/11/2036	21	0,01
88 Government National Mortgage Association, Serie 2021 223, Clase P, 2,000 %, con vencimiento el 20/06/2051	75	0,04	390 Vale Overseas Ltd, 6,875%, vencimiento 10/11/2039	407	0,20
4.990 Government National Mortgage Association, Serie 2021 5, Clase IO, 1,112 %, con vencimiento el 16/01/2061 *	367	0,18		1.574	0,77
200 Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2022 3, Clase B, 1,850%, con vencimiento 16/02/2061	101	0,05	Canadá — 0,39 % (28 de febrero de 2023: 0,83%)		
874 Government National Mortgage Association, Serie 2022 3, Clase IO, 0,640 %, con vencimiento el 16/02/2061 *	44	0,02	130 Banco de Montreal, 1,850%, con vencimiento el 01/05/2025	122	0,06
100 Government National Mortgage Association, Serie 2022 63, Clase LM, 3,500%, con vencimiento el 20/10/2050	83	0,04	30 Bank of Montreal, 3,803 %, con vencimiento el 15/12/2032 *	27	0,01
300 Government National Mortgage Association, Serie 2023 92, Clase AH, 2,000 %, con vencimiento el 16/06/2064	229	0,11	80 Bank of Nova Scotia/The, 3,450 %, con vencimiento el 11/04/2025	77	0,04
570 GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-3PCK, Serie 2018 3PCK, Clase B, 144A, 8,174 %, con vencimiento el 15/09/2031 *	555	0,27	240 Bank of Nova Scotia/The, 1,300 %, con vencimiento el 11/06/2025	222	0,11
466 GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Clase A, 144A, 7,225 %, con vencimiento el 15/09/2031 *	387	0,19	70 Bank of Nova Scotia/The, 4,588 %, con vencimiento el 04/05/2037 *	60	0,03
71 HarborView Mortgage Loan Trust 2005-9, Serie 2005 9, Clase 2A1B, 6,168 %, con vencimiento el 20/06/2035 *	64	0,03	80 Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, con vencimiento el 30/05/2041	80	0,04
450 Independence Plaza Trust 2018-INDP, Serie 2018 INDP, Clase A, 144A, 3,763%, con vencimiento el 10/07/2035	423	0,21	40 Barrick PD Australia Finance Pty Ltd, 5,950 %, con vencimiento el 15/10/2039	41	0,02
10 JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17, Serie 2013 C17, Clase B, 5,039 %, con vencimiento el 15/01/2047 *	9	-	60 Royal Bank of Canada, 1,150%, con vencimiento el 10/06/2025	56	0,03
120 JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23, Serie 2014 C23, Clase AS, 4,202 %, con vencimiento el 15/09/2047 *	116	0,06	110 Royal Bank of Canada, 3,875%, con vencimiento el 04/05/2032	100	0,05
430 Mill City Mortgage Trust 2015-2, Serie 2015 2, Clase M3, 144A, 3,705 %, con vencimiento 25/09/2057 *	416	0,20		785	0,39
100 Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C18, Serie 2014 C18, Clase AS, 4,110 %, con vencimiento el 15/10/2047 *	96	0,05	Chile — 0,32 % (28 de febrero de 2023: 0,28%)		
302 Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C30, Serie 2016 C30, Clase A4, 2,600 %, con vencimiento 15/09/2049	277	0,14	710 Corp Nacional del Cobre de Chile, 3,625%, con vencimiento el 01/08/2027	661	0,32
217 Morgan Stanley Capital I Trust 2017-ASHF, Series 2017 ASHF, Class A, 144A, 6,333%, con vencimiento el 15/11/2034 *	214	0,11	China — 0,37 % (28 de febrero de 2023: 0,45%)		
550 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Clase A, 144A, 3,047%, con vencimiento el 15/08/2036	483	0,24	120 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2,700 %, con vencimiento el 01/05/2025	114	0,06
160 New Residential Mortgage Loan Trust 2015-2, Serie 2015 2A, Class A1, 144A, 3,750%, con vencimiento el 25/08/2055 *	148	0,07	670 Prosus NV, 144A, 4,027%, con vencimiento el 03/08/2050	398	0,19
239 New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Serie 2016 3A, Class A1B, 144A, 3,250%, con vencimiento el 25/09/2056 *	217	0,11	250 Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd, 4,375 %, con vencimiento el 10/04/2024	248	0,12
239 New Residential Mortgage Loan Trust 2017-2, Serie 2017 2A, Class B1, 144A, 4,500%, con vencimiento el 25/03/2057 *	221	0,11		760	0,37
264 New Residential Mortgage Loan Trust 2018-3, Serie 2018 3A, Class A1, 144A, 4,500%, con vencimiento el 25/05/2058 *	252	0,12	Colombia — 0,23% (28 de febrero de 2023: 0,33%)		
174 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Series 2021 NQ2R, Class A3, 144A, 1,353%, con vencimiento el 25/10/2058 *	155	0,08	650 Ecopetrol SA, 5,875 %, con vencimiento 28/05/2045	459	0,23
5 Thornburg Mortgage Securities Trust 2007-4, Series 2007 4, Class 1A1, 3,827%, con vencimiento el 25/09/2037 *	5	-	Dinamarca — 0,29 % (28 de febrero de 2023: 0,30%)		
300 UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C15, Serie 2018 C15, Clase C, 5,323 %, con vencimiento el 15/12/2051 *	243	0,12	200 Danske Bank A/S, 144A, 3,875%, con vencimiento 12/09/2023	200	0,10
289 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, Serie 2016 C36, Clase A3, 2,807 %, con vencimiento el 15/11/2059	266	0,13	400 Danske Bank A/S, 144A, 5,375%, con vencimiento 12/01/2024	398	0,19
150 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, Serie 2016 C36, Clase A4, 3,065 %, con vencimiento el 15/11/2059	137	0,07		598	0,29
1.379 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, Serie 2016 C36, Clase XA, 1,301 %, con vencimiento el 15/11/2059 *	38	0,02	Francia — 0,67 % (28 de febrero de 2023: 0,73%)		
460 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C41, Serie 2017 C41, Clase B, 4,188 %, con vencimiento el 15/11/2050 *	377	0,18	400 BNP Paribas SA, 144A, 4,705 %, con vencimiento el 10/01/2025 *	398	0,20
1.501 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C23, Serie 2014 C23, Clase XA, 0,693 %, con vencimiento el 15/10/2057 *	5	-	400 BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, con vencimiento el 09/06/2026 *	374	0,18
2 WFRBS Fideicomiso Hipotecario Comercial 2014-LC14, Serie 2014 LC14, Clase ASB, 3,522%, con vencimiento el 15/03/2047	2	-	200 BNP Paribas SA, 144A, 4,400%, con vencimiento 14/08/2028	189	0,09
			400 BNP Paribas SA, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 13/01/2029 *	402	0,20
				1.363	0,67
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 88.667 USD)	84.186	41,38	India — 0,09 % (28 de febrero de 2023: 0,14%)		
Bonos y obligaciones corporativos — 31,71 % (28 de febrero de 2023: 37,25%)			270 Reliance Industries Ltd, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 12/01/2052	184	0,09
Australia — 0,03 % (28 de febrero de 2023: 0,05%)			Irlanda — 0,26 % (28 de febrero de 2023: 0,29%)		
70 BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000%, con vencimiento el 30/09/2043	68	0,03	230 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 2,450 %, con vencimiento el 29/10/2026	207	0,10
			360 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,000 %, con vencimiento el 29/10/2028	312	0,16
Bélgica — 0,39% (28 de febrero de 2023: 0,45%)				519	0,26
110 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,650%, con vencimiento el 01/02/2026	106	0,05	Japón — 0,19 % (28 de febrero de 2023: 0,15%)		
230 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,000 %, con vencimiento el 13/04/2028	222	0,11	400 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3,837 %, con vencimiento el 17/04/2026 *	387	0,19
60 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500%, con vencimiento el 01/06/2030	55	0,03	Kazajstán — 0,25 % (28 de febrero de 2023: 0,44%)		
300 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, con vencimiento el 01/06/2040	269	0,13	560 KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, con vencimiento el 24/04/2030	510	0,25
15 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600%, con vencimiento 15/04/2048	13	0,01	Macao — 0,10% (28 de febrero de 2023: 0,15%)		
100 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,439%, con vencimiento 06/10/2048	88	0,04	200 Sands China Ltd, 5,375%, con vencimiento el 08/08/2025	194	0,10
			México — 0,60 % (28 de febrero de 2023: 0,62%)		
			400 Comisión Federal de Electricidad, 144A, 3,875%, con vencimiento 26/07/2033	312	0,15
			450 Orbia Advance Corp SAB de CV, 144A, 2,875%, con vencimiento 11/05/2031	358	0,18
			590 Southern Copper Corp, 5,250 %, con vencimiento el 08/11/2042	546	0,27
				1.216	0,60
			Países Bajos — 0,60 % (28 de febrero de 2023: 0,65%)		
			500 Cooperatieve Rabobank UA, 4,375 %, con vencimiento el 04/08/2025	485	0,24
			260 Cooperativa Rabobank UA/NY, 3,375%, con vencimiento el 21/05/2025	251	0,12
			180 Shell International Finance BV, 2,750%, con vencimiento 06/04/2030	159	0,08
			10 Shell International Finance BV, 4,550%, con vencimiento 12/08/2043	9	-
			260 Shell International Finance BV, 4,000 %, con vencimiento el 10/05/2046	214	0,11
			150 Shell International Finance BV, 3,250 %, con vencimiento el 06/04/2050	107	0,05
				1.225	0,60

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor liquidativo	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor liquidativo
Bonos y pagarés corporativos (continuación)					
Estados Unidos — (continuación)					
150 Pacific Gas and Electric Co, 2.500%, vencimiento el 01/02/2031	117	0,06	30 Walmart Inc, 1,800%, vencimiento 22/09/2031	25	0,01
20 Pacific Gas and Electric Co, 3.300%, vencimiento el 01/08/2040	13	0,01	20 Walt Disney Co/The, 6,650 %, con vencimiento el 15/11/2037	23	0,01
30 Pacific Gas and Electric Co, 3.500%, vencimiento el 01/08/2050	19	0,01	60 Warnermedia Holdings Inc, 6,412 %, con vencimiento el 15/03/2026	60	0,03
60 PayPal Holdings Inc, 4,400 %, con vencimiento el 01/06/2032	57	0,03	30 Warnermedia Holdings Inc, 3,755 %, con vencimiento el 15/03/2027	28	0,01
40 PepsiCo Inc, 1.625%, vencimiento el 01/05/2030	33	0,02	60 Warnermedia Holdings Inc, 4,054 %, con vencimiento el 15/03/2029	55	0,03
40 PepsiCo Inc, 2.875%, vencimiento el 15/10/2049	28	0,01	270 Warnermedia Holdings Inc, 4,279 %, con vencimiento el 15/03/2032	238	0,12
250 Pfizer Inc, 2.625%, vencimiento el 01/04/2030	220	0,11	20 Warnermedia Holdings Inc, 5,050 %, con vencimiento el 15/03/2042	16	0,01
90 Pfizer Inc, 1.700%, vencimiento el 28/05/2030	74	0,04	60 Warnermedia Holdings Inc, 5,141 %, con vencimiento el 15/03/2052	48	0,02
230 Pfizer Inc, 2.550%, vencimiento el 28/05/2040	165	0,08	61 Wells Fargo & Co, 4.480%, vencimiento el 16/01/2024	61	0,03
110 Pfizer Inc, 2.700%, vencimiento el 28/05/2050	75	0,04	90 Wells Fargo & Co, 2.188%, vencimiento el 30/04/2026 *	85	0,04
30 Pioneer Natural Resources Co, 1,125 %, con vencimiento el 15/01/2026	27	0,01	50 Wells Fargo & Co, 4.100%, vencimiento el 03/06/2026	48	0,02
100 Pioneer Natural Resources Co, 1,900 %, con vencimiento el 15/08/2030	81	0,04	28 Wells Fargo & Co, 3.000%, vencimiento el 23/10/2026	28	0,01
230 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, con vencimiento el 15/01/2031	187	0,09	430 Wells Fargo & Co, 4.300%, vencimiento el 22/07/2027	412	0,20
40 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,812 %, con vencimiento el 12/06/2026 *	40	0,02	60 Wells Fargo & Co, 2.393%, vencimiento el 02/06/2028 *	53	0,03
200 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,582 %, con vencimiento el 12/06/2029 *	198	0,10	10 Wells Fargo & Co, 4.150%, vencimiento el 24/01/2029	9	-
70 Principal Life Global Funding II, 144A, 1,250 %, con vencimiento el 23/06/2025	65	0,03	100 Wells Fargo & Co, 5,574%, vencimiento el 25/07/2029 *	100	0,05
90 Procter & Gamble Co/The, 3,000 %, con vencimiento el 25/03/2030	82	0,04	130 Wells Fargo & Co, 2,879%, vencimiento el 30/10/2030 *	111	0,06
460 Prologis LP, 1,250 %, con vencimiento el 15/10/2030	355	0,17	120 Wells Fargo & Co, 4,478%, vencimiento el 04/04/2031 *	112	0,06
130 Salesforce Inc, 3,700 %, con vencimiento el 11/04/2028	125	0,06	220 Wells Fargo & Co, 3,350%, vencimiento el 02/03/2033 *	185	0,09
140 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, con vencimiento el 01/03/2032	159	0,08	17 Wells Fargo & Co, 4,650%, vencimiento el 04/11/2029	17	0,01
180 Targa Resources Corp, 5,200%, vencimiento el 01/07/2027	178	0,09	50 Wells Fargo & Co, 4,900%, vencimiento el 17/11/2045	43	0,02
30 Targa Resources Corp, 4,950%, vencimiento el 15/04/2052	24	0,01	430 Wells Fargo & Co, 4,400%, vencimiento el 14/06/2046	341	0,17
2 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, vencimiento el 16/12/2039	2	-	200 Wells Fargo & Co, 4,750%, vencimiento el 07/12/2046	166	0,08
230 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, con vencimiento el 01/03/2030	197	0,10	1.070 Wells Fargo & Co, 5,013%, vencimiento el 04/04/2051 *	967	0,48
240 Texas Instruments Inc, 2,250%, vencimiento el 04/09/2029	209	0,10	30 Wyeth LLC, 5,950%, vencimiento el 01/04/2037	32	0,02
70 Texas Instruments Inc, 1,750%, vencimiento el 04/05/2030	58	0,03		45,914	22,56
70 Texas Instruments Inc, 4,150%, vencimiento el 15/05/2048	61	0,03	Total de bonos y pagarés corporativos (coste 70.767\$)	64.519	31,71
170 The Vanguard Group Inc, 3,050%, vencimiento el 22/08/2050 †	105	0,05	Bonos y obligaciones del Estado — 26,05% (28 de febrero de 2023: 21,89%)		
30 Time Warner Cable LLC, 6,550%, vencimiento el 01/05/2037	29	0,01	Chile — 0,08 % (28 de febrero de 2023: 0,12%)		
100 Time Warner Cable LLC, 5,875%, vencimiento el 15/11/2040	87	0,04	250 Chile Government International Bond, 3,100%, vencimiento 22/01/2061	158	0,08
100 T-Mobile USA Inc, 3,500%, vencimiento el 15/04/2025	97	0,05	Colombia — 0,33% (28 de febrero de 2023: 0,48%)		
20 T-Mobile USA Inc, 3,750%, vencimiento el 15/04/2027	19	0,01	220 Colombia Government International Bond, 3,125%, vencimiento el 15/04/2031	170	0,08
380 T-Mobile USA Inc, 3,875%, vencimiento el 15/04/2030	347	0,17	260 Colombia Government International Bond, 3,250%, vencimiento el 22/04/2032	196	0,10
80 T-Mobile USA Inc, 2,550%, vencimiento el 15/02/2031	66	0,03	400 Colombia Government International Bond, 5,625%, vencimiento el 26/02/2044	304	0,15
80 T-Mobile USA Inc, 2,250%, vencimiento el 15/11/2031	64	0,03		670	0,33
110 T-Mobile USA Inc, 3,000%, vencimiento el 15/02/2041	78	0,04	India — 0,20% (28 de febrero de 2023: 0,14%)		
30 T-Mobile USA Inc, 3,300%, vencimiento el 15/02/2051	20	0,01	430 Export-Import Bank of India, 3,375 %, con vencimiento el 05/08/2026	406	0,20
320 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850%, vencimiento el 01/02/2026	335	0,16	Israel — 0,34% (28 de febrero de 2023: 0,54%)		
110 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,250%, vencimiento el 15/05/2030	97	0,05	800 Israel Government International Bond, 2,750%, vencimiento 03/07/2030	698	0,34
190 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,950%, vencimiento el 15/05/2050	142	0,07	Kazajistán — 0,09% (28 de febrero de 2023: 0,14%)		
100 Truist Financial Corp, 6,047 %, con vencimiento el 08/06/2027 *	100	0,05	200 Bonos internacionales del Estado de Kazajistán, 4,875%, vencimiento 14/10/2044	179	0,09
130 Union Pacific Corp, 2,400%, vencimiento el 05/02/2030	112	0,06	México — 0,81% (28 de febrero de 2023: 0,83%)		
230 Union Pacific Corp, 3,750%, vencimiento el 05/02/2070	168	0,08	1.580 Mexico Government International Bond, 4,750%, vencimiento el 08/03/2044	1.331	0,65
30 UnitedHealth Group Inc, 3,875%, vencimiento el 15/12/2028	29	0,01	420 Mexico Government International Bond, 4,400%, vencimiento el 12/02/2052	325	0,16
40 UnitedHealth Group Inc, 4,000%, vencimiento el 15/05/2029	38	0,02		1.656	0,81
100 UnitedHealth Group Inc, 2,000%, vencimiento el 15/05/2030	83	0,04	Bonos y obligaciones del Estado (continuación)		
20 UnitedHealth Group Inc, 2,300%, vencimiento el 15/05/2031	17	0,01	Panamá — 0,23% (28 de febrero de 2023: 0,20%)		
50 UnitedHealth Group Inc, 4,200%, vencimiento el 15/05/2032	47	0,02	640 Bono internacional del Estado de Panamá, 4,300%, vencimiento 29/04/2053	463	0,23
270 UnitedHealth Group Inc, 2,750%, vencimiento el 15/05/2040	195	0,10	Perú — 0,22% (28 de febrero de 2023: 0,13%)		
50 UnitedHealth Group Inc, 4,250%, vencimiento el 15/03/2043	44	0,02	40 Peruvian Government International Bond, 3,550%, vencimiento el 10/03/2051	29	0,01
40 UnitedHealth Group Inc, 4,250%, vencimiento el 15/06/2048	34	0,02	640 Peruvian Government International Bond, 3,600%, vencimiento el 15/01/2072	422	0,21
20 UnitedHealth Group Inc, 4,450%, vencimiento el 15/12/2048	18	0,01		451	0,22
50 UnitedHealth Group Inc, 3,700%, vencimiento el 15/08/2049	39	0,02	Corea del Sur — 0,24 % (28 de febrero de 2023: 0,20%)		
60 UnitedHealth Group Inc, 2,900%, vencimiento el 15/05/2050	40	0,02	510 Korea Housing Finance Corp, 144A, 4,625 %, vencimiento 24/02/2033	488	0,24
60 UnitedHealth Group Inc, 3,875%, vencimiento el 15/08/2059	46	0,02	Estados Unidos — 23,00% (28 de febrero de 2023: 18,58%)		
20 UnitedHealth Group Inc, 3,125%, vencimiento el 15/05/2060	13	0,01	440 Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, vencimiento el 12/12/2023	434	0,21
10 US Bancorp, Serie mtn, 2,215 %, con vencimiento el 27/01/2028 *	9	-	640 Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, vencimiento el 02/01/2024	629	0,31
100 US Bancorp, 5,775 %, con vencimiento el 12/06/2029 *	100	0,05	640 Federal Home Loan Bank Discount Notes, zero coupon, vencimiento el 29/01/2024	626	0,31
90 US Bancorp, 5,836 %, con vencimiento el 12/06/2034 *	90	0,04	2.160 United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 03/10/2023	2.150	1,06
300 USAA Capital Corp, 144A, 2,125%, vencimiento 01/05/2030	248	0,12	1.400 United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 12/12/2023	1.379	0,68
40 Verizon Communications Inc, 2,625%, vencimiento el 15/08/2026	37	0,02	1.760 United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 26/12/2023	1.730	0,85
40 Verizon Communications Inc, 4,125%, vencimiento el 16/03/2027	39	0,02	1.470 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125%, vencimiento el 15/01/2033 β	1.405	0,69
100 Verizon Communications Inc, 2,100%, vencimiento el 22/03/2028	87	0,04	20 United States Treasury Note/Bond, 2,250%, vencimiento el 30/04/2024	19	0,01
225 Verizon Communications Inc, 4,329%, vencimiento el 21/09/2028	216	0,11	340 United States Treasury Note/Bond, 4,625%, vencimiento el 28/02/2025	338	0,17
100 Verizon Communications Inc, 3,875%, vencimiento el 08/02/2029	93	0,05	20 United States Treasury Note/Bond, 4,625%, vencimiento el 15/03/2026	20	0,01
100 Verizon Communications Inc, 3,150%, vencimiento el 22/03/2030	88	0,04	70 United States Treasury Note/Bond, 2,250%, vencimiento el 31/03/2026	66	0,03
296 Verizon Communications Inc, 2,550%, vencimiento el 21/03/2031	244	0,12	310 United States Treasury Note/Bond, 4,125%, vencimiento el 31/10/2027	307	0,15
310 Verizon Communications Inc, 4,500%, vencimiento el 10/08/2033	287	0,14			
60 Verizon Communications Inc, 4,400%, vencimiento el 01/11/2034	57	0,03			
20 Verizon Communications Inc, 5,250%, vencimiento el 16/03/2037	20	0,01			
210 Verizon Communications Inc, 2,650%, vencimiento el 20/11/2040	140	0,07			
30 Verizon Communications Inc, 3,400%, vencimiento el 22/03/2041	22	0,01			
70 Verizon Communications Inc, 4,125%, vencimiento el 15/08/2046	56	0,03			
70 Verizon Communications Inc, 4,862%, vencimiento el 21/08/2046	62	0,03			
80 Verizon Communications Inc, 4,000%, vencimiento el 22/03/2050	61	0,03			
10 Verizon Communications Inc, 2,875%, vencimiento el 20/11/2050	6	-			
30 Visa Inc, 3,150%, vencimiento el 14/12/2025	29	0,01			
70 Visa Inc, 4,300%, vencimiento el 14/12/2045	63	0,03			
50 Visa Inc, 3,650%, vencimiento el 15/09/2047	41	0,02			

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor liquidativo	Contratos (miles)	Valor (en miles) USD	% del valor liquidativo
1.700	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, vencimiento el 31/12/2027	0,82			
890	United States Treasury Note/Bond, 3.500%, vencimiento el 31/01/2028	0,42			
10	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, vencimiento el 29/02/2028	-			
50	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, vencimiento el 31/03/2028	0,02			
1.870	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, vencimiento el 31/05/2028	0,89			
6.110	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, vencimiento el 31/07/2028	2,99			
280	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, vencimiento el 31/03/2030	0,13			
40	United States Treasury Note/Bond, 3.500%, vencimiento el 30/04/2030	0,02			
1.140	United States Treasury Note/Bond, 3.750%, vencimiento el 31/05/2030	0,55			
970	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, vencimiento el 31/07/2030	0,47			
3.340	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, vencimiento el 31/08/2030	1,63			
245	United States Treasury Note/Bond, 3.375%, vencimiento el 15/05/2033	0,11			
170	United States Treasury Note/Bond, 3.250%, vencimiento el 15/05/2042	0,07			
380	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, vencimiento el 15/02/2043	0,17			
1.990	United States Treasury Note/Bond, 3.875%, vencimiento el 15/05/2043	0,91			
1.500	United States Treasury Note/Bond, 4.375%, vencimiento el 15/08/2043	0,74			
640	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, vencimiento el 15/02/2048	0,25			
460	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, vencimiento el 15/02/2049	0,18			
130	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, vencimiento el 15/05/2049	0,05			
3.200	United States Treasury Note/Bond, 2.000%, vencimiento el 15/02/2050	1,01			
700	United States Treasury Note/Bond, 1.625%, vencimiento el 15/11/2050	0,20			
280	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, vencimiento el 15/02/2052	0,09			
1.590	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, vencimiento el 15/05/2052	0,61			
3.450	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, vencimiento el 15/08/2052	1,35			
60	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, vencimiento el 15/11/2052	0,03			
2.315	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, vencimiento el 15/02/2053	1,03			
8.530	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, vencimiento el 15/05/2053	3,78			
		23,00			
Uruguay — 0,51 % (28 de febrero de 2023: 0,53%)					
440	Bono internacional del Estado de Uruguay, 4.375%, vencimiento el 23/01/2031	0,22			
40	Bono internacional del Estado de Uruguay, 5.750%, vencimiento el 28/10/2034	0,02			
220	Bono internacional del Estado de Uruguay, 7.625%, vencimiento el 21/03/2036	0,13			
300	Bono internacional del Estado de Uruguay, 5,100%, vencimiento el 18/06/2050	0,14			
		0,51			
		26,05			
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 57.071\$)					
Organismos de inversión colectiva — 5,29% (28 de febrero de 2023: 1,32%)					
10.768	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Clase WA (Reparto)	5,29			
Total de organismos de inversión colectiva (coste: 10.768\$)					
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 241.741\$)					
		111,44			
Opciones compradas — 0,16% (28 de febrero de 2023: 0,05%)					
	- 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures December 2023 Put 95.8750, con vencimiento el 15/12/2023 - Goldman Sachs			20	0,01
	- 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures December 2023 Put 96.00, con vencimiento el 15/12/2023 - Goldman Sachs			57	0,03
	- 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures October 2023 Put 97.00, con vencimiento el 13/10/2023 - Goldman Sachs			80	0,04
	- CME 3 Month SOFR Futures March 2024 Call 95.25, con vencimiento el 15/03/2024 - Goldman Sachs			8	-
	- CME 3 Month SOFR Futures September 2023 Call 96.00, con vencimiento el 15/09/2023 - Goldman Sachs			-	-
	- U.S. 10 Year October 2023 Call 110.50, con vencimiento el 22/09/2023 - Goldman Sachs			13	0,01
	- U.S. 10 Year October 2023 Call 111.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Goldman Sachs			9	-
	- U.S. 5 Year October 2023 Call 106.50, con vencimiento el 22/09/2023 - Goldman Sachs			18	0,01
	- U.S. 5 Year October 2023 Call 107.25, con vencimiento el 22/09/2023 - Goldman Sachs			14	0,01
	- U.S. Bond October 2023 Call 119.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Goldman Sachs			39	0,02
	- U.S. Bond October 2023 Call 120.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Goldman Sachs			15	0,01
	- U.S. Bond October 2023 Call 121.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Goldman Sachs			36	0,02
	- U.S. Bond October 2023 Call 121.50, con vencimiento el 22/09/2023 - Goldman Sachs			13	-
	- U.S. Bond October 2023 Call 122.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Goldman Sachs			5	-
Total de opciones compradas (coste 233\$)					
				327	0,16
Swaps de incumplimiento de crédito — (0,17%) (28 febrero de 2023: 0,23%)					
	Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)			350	0,17
Swaps sobre índices — 0,48% (28 de febrero de 2023: 1,66%)					
	Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)			971	0,48
Futuros — 0,15% (28 de febrero de 2023: 0,23%)					
	Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)			310	0,15
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias					
				228.705	112,40
Opciones suscritas — (0,10%) (28 de febrero de 2023: 0,05%)					
	- 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures December 2023 Put 95.25, con vencimiento el 15/12/2023 - Goldman Sachs			(12)	(0,01)
	- 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures December 2023 Put 95.3750, con vencimiento el 15/12/2023 - Goldman Sachs			(36)	(0,02)
	- 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures October 2023 Put 96.25, con vencimiento el 13/10/2023 - Goldman Sachs			(34)	(0,02)
	- 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures October 2023 Put 96.50, con vencimiento el 13/10/2023 - Goldman Sachs			(48)	(0,02)
	- CME 3 Month SOFR Futures March 2024 Call 96.1250, con vencimiento el 15/03/2024 - Goldman Sachs			(8)	(0,01)
	- CME 3 Month SOFR Futures September 2023 Call 96.75, con vencimiento el 15/09/2023 - Goldman Sachs			-	-
	- U.S. 10 Year April 2023 Call 112.00, con vencimiento el 27/10/2023 - Goldman Sachs			(14)	(0,01)
	- U.S. 10 Year April 2023 Put 107.50, con vencimiento el 27/10/2023 - Goldman Sachs			(3)	-
	- U.S. 10 Year April 2023 Put 108.00, con vencimiento el 27/10/2023 - Goldman Sachs			(3)	-
	- U.S. 10 Year October 2023 Call 111.75, con vencimiento el 22/09/2023 - Goldman Sachs			(7)	-
	- U.S. 10 Year October 2023 Call 112.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Goldman Sachs			(4)	-
	- U.S. 10 Year October 2023 Call 112.50, con vencimiento el 22/09/2023 - Goldman Sachs			(6)	-
	- U.S. 10 Year October 2023 Put 109.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Goldman Sachs			(2)	-
	- U.S. 5 Year October 2023 Put 105.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Goldman Sachs			(1)	-
	- U.S. Bond October 2023 Call 123.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Goldman Sachs			(7)	-
	- U.S. Bond October 2023 Call 124.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Goldman Sachs			(9)	(0,01)
	- U.S. Bond October 2023 Put 117.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Goldman Sachs			(1)	-
Total de opciones suscritas (coste: [171] USD)					
				(195)	(0,10)
Swaps de incumplimiento de crédito: (0,01 %) (28 febrero de 2023: 0,03%)					
	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)			(20)	(0,01)
Futuros — (0,07%) (28 de febrero de 2023: 0,14%)					
	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)			(152)	(0,07)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias					
				(367)	(0,18)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias					
				228.338	112,22
Excedente de pasivos respecto a otros activos					
				(24.862)	(12,22)
Patrimonio					
				203.476\$	100,00

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

- Los importes designados como “-” son 0 \$, menos de 1000 \$, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.
- 144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. Al 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 27 078 000 USD o el 13,29 % del patrimonio neto.
- * Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.
- † Poca liquidez.
- ∞ El título es valorado de buena fe y a un valor razonable por el Comité de Valoración o según el criterio de este.
- ± Títulos adquiridos siguiendo la norma “se anunciará”.
- β El tipo de interés sobre esta clase de título está vinculado al índice de precios de consumo (IPC)/índice de precios minoristas (Retail Price Index, RPI). El tipo del cupón es el tipo a 31 de agosto de 2023.

Análisis del total de activos		% del total de activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado		90,97
Organismos de inversión colectiva		4,54
Instrumentos financieros derivados		0,82
Otros activos		3,67
Total de activos		100,00

ABREVIATURAS:

- Perpetuo – Un bono sin fecha de vencimiento. Los bonos perpetuos no son rescatables, pero pagan un flujo constante de intereses.
- REMIC – Conducto de inversiones hipotecarias inmobiliarias.
- TBA – Pendiente de anuncio.

Listado de swaps de incumplimiento de crédito

Contraparte	Entidad de Referencia – Protección Compra/Venta	Fecha de vencimiento	Importe teórico (en miles)	Valor (en miles)
Goldman Sachs	CDX.NA.IG, 1,000 % - Vender	20 jun. 2033	4.870	USD (20)
Goldman Sachs	CDX.NA.IG, 1,000 % - Vender	20 jun. 2028	22.680	350
Apreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 febrero de 2023 [miles]: 304\$)				USD 350
Depreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(44))				(20)
Apreciación neta de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 [miles]: 260 \$)				USD 330

Listado de swaps de índices

Contraparte	Entidad de referencia	Fecha de vencimiento	Importe teórico (en miles)	Valor (en miles)
Goldman Sachs	Pay Fixed 2,500%, Receive Floating USD Sofr Compound	21 abr. 2052	559	USD 105
Goldman Sachs	Pay Fixed 2,600%, Receive Floating USD Sofr Compound	15 feb. 2048	954	160
Goldman Sachs	Pay Fixed 2,850%, Receive Floating USD Sofr Compound	15 feb. 2029	2.092	115
Goldman Sachs	Pay Fixed 3,050%, Receive Floating USD Sofr Compound	15 feb. 2048	2.107	203
Goldman Sachs	Pay Fixed 3,150%, Receive Floating USD Sofr Compound	15 DE MAYO DE -2048	2.163	173
Goldman Sachs	Pay Fixed 3,270%, Receive Floating USD Sofr Compound	30 abr. 2029	1.719	61
Goldman Sachs	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 4,000%	29 feb. 2028	6.950	4
Goldman Sachs	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 4,180 %	29 feb. 2028	19.990	150
Apreciación latente de swaps de índices (28 de febrero de 2023 [miles]: 2 192\$)				USD 971
Depreciación latente de swaps de índices (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(2))				-
Apreciación neta de swaps de índices (28 de febrero de 2023 [miles]: 2 190\$)				USD 971

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico (miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2023	Goldman Sachs	(115)	USD (27.197)	USD 165
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2024	Goldman Sachs	70	16.770	2
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2025	Goldman Sachs	29	6.990	9
Índice SOFR de 3 meses Junio 2023	Goldman Sachs	1	237	(5)
U.S. 10 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Goldman Sachs	(50)	(5.552)	(44)
U.S. 10 Year Ultra Note Diciembre 2023	Goldman Sachs	(15)	(1.742)	(26)
U.S. 2 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Goldman Sachs	56	11.413	36
U.S. 5 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Goldman Sachs	(100)	(10.692)	(72)
U.S. Long Bond (CBT) Diciembre 2023	Goldman Sachs	(8)	(973)	(5)
U.S. Ultra Bond (CBT) Diciembre 2023	Goldman Sachs	37	4.790	98
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: 303\$)				USD 310
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(180))				(152)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: 123\$)				USD 158

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles)	% del valor liquidativo	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles)	% del valor liquidativo
Valores garantizados por activos — 6,25% (28 de febrero de 2023: 6,51%)					
640	AB BSL CLO 4 Ltd, Serie 2023 4A, Clase A, 144A, 6,957 %, con vencimiento el 20/04/2036 *	0,06	719	BANK 2017-BNK7, Serie 2017 BNK7, Clase AS, 3,435 %, con vencimiento el 15/09/2060	0,07
107	Aegis Asset Backed Sec Corp Mort Pass Thr Certs Serie 2003-3, Serie 2003 3, Clase M2, 7,904 %, con vencimiento el 25/01/2034 *	0,01	266	BANK 2017-BNK7, Serie 2017 BNK7, Clase XA, 0,850 %, con vencimiento el 15/09/2060 *	0,03
3.060	Ameriquet Mortgage Securities Inc. Cfts transferibles respaldados por activos Ser 2005-RB, Serie 2005 RB, Clase M4, 6,299 %, con vencimiento el 25/10/2035 *	0,29	1.307	BANK 2018-BNK15, Serie 2018 BN15, Clase B, 4,814 %, con vencimiento el 15/11/2061 *	0,13
2.500	Apidos CLO XXXVII, Serie 2021 37A, Clase A, 144A, 6,737 %, con vencimiento el 22/10/2034 *	0,25	1.892	BBCRE Trust 2015-GTP, Serie 2015 GTP, Clase E, 144A, 4,715 %, con vencimiento el 10/08/2033 *	0,19
2.390	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust, Serie 1996 1, Clase B1, 7,875 %, con vencimiento el 10/10/2026	0,01	220	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR1, Serie 2007 AR1, Clase 1A1, 5,589 %, con vencimiento el 25/01/2037 *	0,02
1.500	BCRED MML CLO 2021-1 LLC, Serie 2021 1A, Clase A, 144A, 7,050 %, con vencimiento el 15/01/2035 *	0,15	512	Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, Serie 2018 B1, Clase AS, 3,666 %, con vencimiento el 15/01/2051 *	0,05
1.000	BCRED MML CLO 2022-1 LLC, Serie 2022 1A, Clase A1, 144A, 6,976 %, con vencimiento el 20/04/2035 *	0,10	2.961	BXP Trust 2017-CQHP, Serie 2017 CQHP, Clase A, 144A, 6,208 %, con vencimiento el 15/11/2034 *	0,30
1.740	Cayuga Park CLO Ltd, Serie 2020 1A, Clase AR, 144A, 6,690 %, con vencimiento el 17/07/2034 *	0,17	46	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-3, Serie 2005 3, Clase 1A2, 6,009 %, con vencimiento el 25/04/2035 *	-
13	ContiMortgage Home Equity Loan Trust 1999-1, Serie 1999 1, Clase B, 9,000 %, con vencimiento el 25/04/2030	-	285	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27, Serie 2015 GC27, Clase AS, 3,571 %, con vencimiento el 10/02/2048	0,03
2.628	Countrywide Asset-Backed Certificates, Serie 2004 3, Clase 1A, 5,849 %, con vencimiento el 25/08/2034 *	0,25	1.786	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C3, Serie 2016 C3, Clase XA, 1,121 %, con vencimiento el 15/11/2049 *	0,18
845	DB Master Finance LLC, Serie 2021 1A, Clase A23, 144A, 2,791 %, con vencimiento el 20/11/2051	0,07	8.968	Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-AR6, Serie 2006 AR6, Clase 2A4, 5,869 %, con vencimiento el 25/09/2036 *	0,28
2.713	Educational Funding Co LLC/The, Serie 2006 1A, Clase A3, 144A, 5,963 %, con vencimiento el 25/04/2033 *	0,19	20	COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, Serie 2013 CR12, Clase B, 4,762 %, con vencimiento el 10/10/2046 *	15
2.672	Encore Credit Receivables Trust 2005-3, Serie 2005 3, Clase M5, 6,389 %, con vencimiento el 25/10/2035 *	0,25	10	COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, Serie 2013 CR12, Clase C, 5,124 %, con vencimiento el 10/10/2046 *	4
179	Fannie Mae Grantor Trust 2017-T1, Serie 2017 T1, Clase A, 2,898 %, con vencimiento el 25/06/2027	0,02	340	COMM 2013-CCRE6 Mortgage Trust, Serie 2013 CR6, Clase B, 144A, 3,397 %, con vencimiento el 10/03/2046	289
8.581	Fieldstone Mortgage Investment Trust Serie 2005-2, Serie 2005 2, Clase M3, 6,209 %, con vencimiento el 25/12/2035 *	0,74	610	COMM 2015-CCRE22 Mortgage Trust, Serie 2015 CR22, Clase A4, 3,048 %, con vencimiento el 10/03/2048	0,06
185	Certificados de transferencia estructurada de Freddie Mac FRESR 2017-SR01, Serie 2017 SR01, Clase A3, 3,089 %, con vencimiento el 25/11/2027	0,02	90	COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Serie 2015 DC1, Clase B, 4,035 %, con vencimiento el 10/02/2048 *	77
640	Golub Capital Partners CLO 668 Ltd, Serie 2023 66A, Clase A, 144A, 6,926 %, con vencimiento el 25/04/2036 *	0,06	70	COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Serie 2015 DC1, Clase C, 4,438 %, con vencimiento el 10/02/2048 *	58
2.450	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, Serie 2021 4GS, Clase A, 144A, 1,930 %, con vencimiento el 20/07/2048	0,18	1.450	COMM 2015-PC1 Fideicomiso Hipotecario, Serie 2015 PC1, Clase AS, 3,902 %, con vencimiento el 10/07/2050	1,395
3.226	Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, Serie 2021 1GS, Clase A, 144A, 2,290 %, con vencimiento el 20/01/2048	0,24	77	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Serie 2019 R07, Clase 1M2, 144A, 7,502 %, con vencimiento el 25/10/2039 *	77
1.264	Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1, Serie 2004 1, Clase M1, 6,179 %, con vencimiento el 25/02/2034 *	0,12	1.620	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05, Serie 2023 R05, Clase 1M2, 144A, 8,396 %, con vencimiento el 25/06/2043 *	1,650
2.000	Magnetite XIV-R Ltd, Serie 2015 14RA, Clase A2, 144A, 6,692 %, con vencimiento el 18/10/2031 *	0,20	560	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R06, Serie 2023 R06, Clase 1M2, 144A, 7,988 %, con vencimiento el 25/07/2043 *	564
1.757	Magnolia Finance, 8,205 %, con vencimiento el 09/08/2024	0,17	500	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, Serie 2015 C1, Clase AS, 3,791 %, con vencimiento el 15/04/2050 *	459
3.113	MF1 2021-FL6 Ltd, Serie 2021 FL6, Clase A, 144A, 6,526 %, con vencimiento el 16/07/2036 *	0,30	1.050	CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Clase A2, 144A, 3,953 %, con vencimiento el 15/09/2037	917
3.319	Mosaic Solar Loan Trust 2021-3, Serie 2021 3A, Clase B, 144A, 1,920 %, con vencimiento el 20/06/2052	0,24	140	CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Clase E, 144A, 4,373 %, con vencimiento el 15/09/2037	73
3.000	National Collegiate II Commutation Trust, Serie 2005 AR15, Clase AR15, 0,000 %, con vencimiento el 01/06/2045	0,03	5.170	CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Clase F, 144A, 4,373 %, con vencimiento el 15/09/2037	2,033
3.300	National Collegiate Student Loan Trust 2006-3, Serie 2006 3, Clase B, 5,789 %, con vencimiento el 26/01/2032 *	0,25	1.960	CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Clase M2, 144A, 2,963 %, con vencimiento el 25/07/2057 *	1,454
2.000	Nelnet Student Loan Trust 2014-2, Serie 2014 2A, Clase B, 144A, 6,902 %, con vencimiento el 25/06/2041 *	0,19	2.360	CSMC 2021-NQMB, Serie 2021 NQMB, Clase A1, 144A, 1,841 %, con vencimiento el 25/10/2066 *	1,959
2.000	Neuberger Berman Loan Advisers Clo 42 Ltd, Serie 2021 42A, Clase A, 144A, 6,670 %, con vencimiento el 16/07/2035 *	0,20	600	CSMC Trust 2017-CHOP, Serie 2017 CHOP, Clase G, 144A, 10,794 %, con vencimiento el 15/07/2032 *	553
1.500	Ocean Trails Clo X, Serie 2020 10A, Clase AR, 144A, 6,790 %, con vencimiento el 15/10/2034 *	0,15	1.680	DBC6 2017-BBG Mortgage Trust, Serie 2017 BBG, Clase A, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/06/2034 *	1,661
635	Ocean Trails Clo XI, Serie 2021 11A, Clase A, 144A, 6,808 %, con vencimiento el 20/07/2034 *	0,06	150	Deutsche Mortgage Securities Inc Mortgage Loan Trust Series 2006-PR1, Serie 2006 PR1, Clase 3AF1, 144A, 5,705 %, con vencimiento el 15/04/2036 *	134
1.123	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Serie 2007 FXD1, Clase 1A1, 5,866 %, con vencimiento el 25/01/2037	0,09	600	Fannie Mae 5Yr Pool, 4,830 %, con vencimiento el 01/09/2028 ∞	594
253	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2006-A, Serie 2006 A, Clase A2, 6,675 %, con vencimiento el 15/10/2037 *	0,02	200	Fannie Mae 5Yr Pool, 4,880 %, con vencimiento el 01/09/2028 ∞	201
1.000	Point Au Roche Park CLO Ltd, Serie 2021 1A, Clase A, 144A, 6,668 %, con vencimiento el 20/07/2034 *	0,10	320	Fannie Mae 5Yr Pool, 5,340 %, con vencimiento el 01/09/2028 ∞	203
3.004	RASC Serie 2007-KS1 Trust, Serie 2007 KS1, Clase A4, 5,649 %, con vencimiento el 25/01/2037 *	0,28	320	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2014 C03, Clase 1M2, 8,402 %, con vencimiento el 25/07/2024 *	326
1.859	Renaissance Home Equity Loan Trust 2004-1, Serie 2004 1, Clase AV3, 6,369 %, con vencimiento el 25/05/2034 *	0,16	1.317	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C03, Clase 1B1, 9,152 %, con vencimiento el 25/10/2030 *	1,413
2.565	SLM Private Education Loan Trust 2010-C, Serie 2010 C, Clase AS, 144A, 10,175 %, con vencimiento el 15/10/2041 *	0,27	11	Fannie Mae Interest Strip 390, Clase C3, 6,000 %, con vencimiento el 25/07/2038	2
192	SMB Private Education Loan Trust 2014-A, Serie 2014 A, Clase A3, 144A, 6,925 %, con vencimiento el 15/04/2032 *	0,02	6	Fannie Mae Interest Strip 407, Clase 22, 5,000 %, con vencimiento el 25/01/2039	1
2	SMB Private Education Loan Trust 2015-A, Serie 2015 A, Clase R, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 15/10/2048	0,05	3	Fannie Mae Interest Strip 407, Clase 23, 5,000 %, con vencimiento el 25/01/2039 *	1
345	SMB Private Education Loan Trust, Serie 2020 B, Clase A1A, 144A, 1,290 %, con vencimiento el 15/07/2053	0,03	6	Fannie Mae Interest Strip 407, Clase 27, 5,500 %, con vencimiento el 25/01/2039 *	1
1.746	Stonepeak 2021-1 ABS, Serie 2021 1A, Clase A, 144A, 2,675 %, con vencimiento el 28/02/2033	0,16	5	Fannie Mae Interest Strip 407, Clase 34, 5,000 %, con vencimiento el 25/01/2038	1
1.095	Structured Asset Investment Loan Trust 2005-HE1, Serie 2005 HE1, Clase M2, 6,149 %, con vencimiento el 25/07/2035 *	0,10	15	Fannie Mae Interest Strip 407, Clase 41, 6,000 %, con vencimiento el 25/01/2038	3
	Total de valores garantizados por activos (coste 68.053\$)	62.530		47 Fannie Mae Interest Strip 409, Clase C13, 3,500 %, con vencimiento el 25/11/2041	7
	Valores garantizados por hipotecas — 40,85 % (28 de febrero de 2023: 32,48%)	6,25		54 Fannie Mae Interest Strip 409, Clase C18, 4,000 %, con vencimiento el 25/04/2042	10
54	Alternative Loan Trust 2005-14, Serie 2005 14, Clase 2A2, 5,679 %, con vencimiento el 25/05/2035 *	-	53	Fannie Mae Interest Strip 409, Clase C2, 3,000 %, con vencimiento el 25/04/2027	2
190	Alternative Loan Trust 2005-56, Serie 2005 56, Clase 4A1, 6,049 %, con vencimiento el 25/11/2035 *	0,02	53	Fannie Mae Interest Strip 409, Clase C22, 4,500 %, con vencimiento el 25/11/2039	10
37	Alternative Loan Trust 2006-18CB, Serie 2006 18CB, Clase A6, 6,882 %, con vencimiento el 25/07/2036 *	-	644	Fannie Mae Interest Strip 427, Clase C73, 3,000 %, con vencimiento el 25/12/2048	104
3.660	AREIT 2022-CRE7 LLC, Serie 2022 CRE7, Clase A, 144A, 7,556 %, con vencimiento el 17/06/2039 *	0,37	200	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,500 % ±	179
992	BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Serie 2016 GG10, Clase AJA, 144A, 5,810 %, con vencimiento el 10/08/2045 *	0,02	700	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,000 % ±	646
2.034	Banc of America Funding 2014-R2 Trust, Serie 2014 R2, Clase 2A2, 144A, 5,645 %, con vencimiento el 26/05/2037 *	0,18	1.500	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 5,000 % ±	1.455
			1.500	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,000 % ±	1.195
			300	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 % ±	249
			2.300	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,000 % ±	1.982
			6.400	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 5,500 % ±	6.320
			100	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 6,000 % ±	100
			6	Fannie Mae Pool '745000', 6,000%, vencimiento el 01/10/2035	6

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo
Valores garantizados por hipotecas (continuación)					
1.019	857	0,09	213	37	-
974	819	0,08	1.350	214	0,02
333	279	0,03	451	66	0,01
598	501	0,05	1.232	175	0,02
89	75	0,01	1.200	1.073	0,11
94	78	0,01	629	631	0,06
282	234	0,02	1.298	1.308	0,13
96	80	0,01	950	953	0,10
1.273	1.069	0,11	1.131	1.128	0,11
54	51	-	40	4	-
214	175	0,02	320	29	-
438	423	0,04	1.302	1.333	0,13
252	219	0,02	28	28	-
437	353	0,04	47	47	-
529	442	0,04	49	44	-
351	294	0,03	373	346	0,03
957	886	0,09	70	63	0,01
83	80	0,01	165	149	0,01
1.613	1.567	0,16	360	324	0,03
1.224	1.096	0,11	232	206	0,02
1.227	1.028	0,10	1	1	-
652	547	0,05	201	179	0,02
675	642	0,06	16	16	-
758	679	0,07	19	19	-
196	194	0,02	22	22	-
293	290	0,03	75	75	0,01
290	275	0,03	14	14	-
747	753	0,08	10	10	-
387	376	0,04	6	6	-
389	370	0,04	19	20	-
471	458	0,05	3	3	-
467	476	0,05	12	12	-
184	182	0,02	163	160	0,02
285	265	0,03	4	4	-
388	389	0,04	49	48	-
192	181	0,02	103	96	0,01
677	659	0,07	104	96	0,01
778	770	0,08	1.151	1.069	0,11
98	94	0,01	78	71	0,01
482	478	0,05	423	374	0,04
687	680	0,07	73	67	0,01
190	185	0,02	760	640	0,06
294	278	0,03	1.245	1.048	0,10
484	479	0,05	2.660	2.241	0,22
2.056	2.031	0,20	925	779	0,08
197	191	0,02	1.038	874	0,09
191	194	0,02	528	445	0,04
388	384	0,04	613	516	0,05
399	388	0,04	895	754	0,08
466	408	0,04	1.335	1.179	0,12
1.073	904	0,09	351	309	0,03
702	591	0,06	445	393	0,04
1.268	1.075	0,11	652	561	0,06
5.483	4.604	0,46	263	233	0,02
5.444	4.562	0,46	286	257	0,03
1.349	1.260	0,13	920	795	0,08
196	163	0,02	558	496	0,05
2.077	1.661	0,17	955	915	0,09
197	165	0,02	384	379	0,04
200	194	0,02	765	730	0,07
100	97	0,01	287	269	0,03
117	107	0,01	679	666	0,07
986	952	0,10	1.284	1.277	0,13
99	99	0,01	295	288	0,03
161	147	0,01	600	524	0,05
45	42	-	757	717	0,07
3	3	-	203	187	0,02
5	5	-	160	147	0,01
17	18	-	86	78	0,01
80	79	0,01	92	87	0,01
49	50	-			
96	91	0,01			
101	95	0,01			
13	13	-			
539	500	0,05			
235	215	0,02			
22	20	-			
321	284	0,03			
550	526	0,05			
49	51	-			
33	3	-			
181	158	0,02			
397	60	0,01			
1.030	177	0,02			
404	64	0,01			
835	110	0,01			

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo
Valores garantizados por hipotecas (continuación)					
73	68	0,01	200	203	0,02
76	73	0,01	122	123	0,01
63	60	0,01	4	-	-
318	274	0,03	1	-	-
93	81	0,01	390	391	0,04
280	262	0,03	240	238	0,02
177	153	0,02	1	1	-
147	137	0,01	380	377	0,04
39	36	-	15	14	-
62	55	0,01	133	133	0,01
52	48	-	30	30	-
236	218	0,02	299	266	0,03
127	117	0,01	4.514	6	-
216	199	0,02	821	18	-
130	120	0,01	35	33	-
79	73	0,01	206	37	-
109	97	0,01	1.535	1.524	0,15
83	74	0,01	460	87	0,01
21	18	-	797	19	-
1.390	1.318	0,13	393	52	0,01
247	240	0,02	750	79	0,01
15	13	-	356	70	0,01
558	528	0,05	929	29	-
157	140	0,01	920	32	-
240	227	0,02	896	31	-
210	198	0,02	511	15	-
1.231	1.164	0,12	102	102	0,01
200	189	0,02	4.037	174	0,02
366	354	0,04	52	2	-
113	107	0,01	235	233	0,02
561	542	0,05	435	433	0,04
96	95	0,01	279	245	0,02
322	311	0,03	1.464	1.115	0,11
140	135	0,01	296	38	-
307	297	0,03	915	127	0,01
277	267	0,03	447	61	0,01
165	163	0,02	388	53	0,01
369	364	0,04	15.965	1.000	0,10
268	259	0,03	241	33	-
285	281	0,03	309	44	-
420	406	0,04	1.331	177	0,02
1.144	1.128	0,11	1.445	189	0,02
697	657	0,07	12.214	1.111	0,11
467	451	0,05	2.907	316	0,03
183	173	0,02	759	128	0,01
1.124	1.086	0,11	284	47	-
181	179	0,02	804	806	0,08
154	146	0,01	162	163	0,02
91	88	0,01	97	95	0,01
135	133	0,01	383	375	0,04
113	112	0,01			
119	118	0,01			
285	281	0,03			
363	358	0,04			
170	168	0,02			
1.489	1.362	0,14			
1.685	1.531	0,15			
433	413	0,04			
82	79	0,01			
144	119	0,01			
311	265	0,03			
1.609	1.332	0,13			
104	93	0,01			
137	116	0,01			
1.150	980	0,10			
1.067	944	0,09			
2.123	1.876	0,19			
2.813	2.397	0,24			
1.062	938	0,09			
2.620	2.233	0,22			
2.414	2.129	0,21			
3.237	2.941	0,29			
931	888	0,09			
366	312	0,03			
186	158	0,02			
1.056	1.008	0,10			
671	654	0,07			
1.063	1.036	0,10			
766	758	0,08			
1.233	1.050	0,10			
2.084	1.838	0,18			
195	189	0,02			
1.154	984	0,10			
688	691	0,07			
484	429	0,04			
197	184	0,02			
1.800	1.485	0,15			
1.100	967	0,10			
200	182	0,02			
300	280	0,03			
1.900	1.849	0,18			
2.200	2.178	0,22			
1.800	1.806	0,18			

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo
Valores garantizados por hipotecas (continuación)					
97	Government National Mortgage Association, Serie 2020 H13, Clase FC, 4,796 %, con vencimiento el 20/07/2070 *	95	0,01		
943	Government National Mortgage Association, Serie 2021 14, Clase AB, 1,340 %, con vencimiento el 16/06/2063	707	0,07		
1.834	Government National Mortgage Association, Serie 2021 21, Clase AH, 1,400 %, con vencimiento el 16/06/2063	1.390	0,14		
25.502	Government National Mortgage Association, Serie 2021 5, Clase IO, 1,112 %, con vencimiento el 16/01/2061 *	1.875	0,19		
1.107	Government National Mortgage Association, Serie 2021 77, Clase LC, 1,250 %, con vencimiento el 20/07/2050	850	0,08		
1.500	Government National Mortgage Association, Serie 2022 139, Clase AL, 4,000 %, con vencimiento el 20/07/2051	1.353	0,14		
1.748	Government National Mortgage Association, Serie 2022 3, Clase IO, 0,640 %, con vencimiento el 16/02/2061 *	88	0,01		
200	Government National Mortgage Association, Serie 2022 63, Clase LM, 3,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	166	0,02		
3.000	Government National Mortgage Association, Serie 2023 92, Clase AH, 2,000 %, con vencimiento el 16/06/2064	2.290	0,23		
2.000	Government National Mortgage Association, Serie 2023 92, Clase IA, 0,611 %, con vencimiento el 16/06/2064 *	124	0,01		
2.849	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Clase A, 144A, 7,225 %, con vencimiento el 15/09/2031 *	2.365	0,24		
2.160	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Clase B, 144A, 8,425 %, con vencimiento el 15/09/2031 *	1.167	0,12		
851	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20, Serie 2014 GC20, Clase XA, 1,167 %, con vencimiento el 10/04/2047 *	1	-		
15	HarborView Mortgage Loan Trust 2007-7, Serie 2007 7, Clase 2A1A, 6,429 %, con vencimiento el 25/10/2037 *	14	-		
3.980	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHH, Serie 2018 PHH, Clase F, 144A, 8,667 %, con vencimiento el 15/06/2035 **	835	0,08		
4.070	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Serie 2020 MKST, Clase F, 144A, 8,524 %, con vencimiento el 15/12/2036 *	1.085	0,11		
1.812	JP Morgan Mortgage Trust 2017-5, Serie 2017 5, Clase A2, 144A, 3,470 %, con vencimiento el 26/10/2048 *	1.750	0,17		
175	JP Morgan Mortgage Trust 2018-4, Serie 2018 4, Clase A1, 144A, 3,500 %, con vencimiento el 25/10/2048 *	154	0,02		
30	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17, Serie 2013 C17, Clase B, 5,039 %, con vencimiento el 15/01/2047 *	28	-		
160	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C31, Serie 2015 C31, Clase B, 4,776 %, con vencimiento el 15/08/2048 *	133	0,01		
72	ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Clase AJ, 5,450 %, con vencimiento el 12/08/2048 *	18	-		
14	ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-9, Serie 2007 9, Clase AJ, 6,193 %, con vencimiento el 12/09/2049 *	13	-		
20	Morgan Stanley Capital I Trust 2007-IQ16, Series 2007 IQ16, Class AJ, 6,282 %, con vencimiento el 12/12/2049 *	10	-		
280	MSCG Trust 2015-ALDR, Serie 2015 ALDR, Clase A2, 144A, 3,577 %, con vencimiento el 07/06/2035 *	258	0,03		
2.870	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Clase A, 144A, 3,047 %, con vencimiento el 15/08/2036	2.519	0,25		
341	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Series 2016 3A, Class A1B, 144A, 3,250 %, con vencimiento el 25/09/2056 *	309	0,03		
632	New Residential Mortgage Loan Trust 2017-6, Series 2017 6A, Class A1, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 27/08/2057 *	596	0,06		
857	Prime Mortgage Trust 2006-DR1, Serie 2006 DR1, Clase 2A1, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 25/05/2035	703	0,07		
103	Residential Asset Securitization Trust 2005-A15, Serie 2005 A15, Clase 1A4, 5,750 %, con vencimiento el 25/02/2036	95	0,01		
4	Sequoia Mortgage Trust 2004-10, Serie 2004 10, Clase A1A, 6,048 %, con vencimiento el 20/11/2034 *	4	-		
2.694	Towd Point Mortgage Trust 2017-5, Serie 2017 5, Clase B1, 144A, 5,118 %, con vencimiento el 25/02/2057 *	2.652	0,27		
690	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C2, Serie 2017 C2, Clase A4, 3,487 %, con vencimiento el 15/08/2050	630	0,06		
553	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C7, Serie 2017 C7, Clase A3, 3,418 %, con vencimiento el 15/12/2050	514	0,05		
72.635	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C9, Serie 2018 C9, Clase XA, 1,082 %, con vencimiento el 15/03/2051 *	2.456	0,25		
176	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2007-OA2 Trust, Serie 2007 OA2, Clase 2A, 5,228 %, con vencimiento el 25/03/2047 *	153	0,02		
38	Waterfall Commercial Mortgage Trust 2015-SBC5, Serie 2015 SBC5, Clase A, 144A, 4,104 %, con vencimiento el 14/09/2022 *	37	-		
250	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-LC20, Serie 2015 LC20, Clase AS, 3,467 %, con vencimiento el 15/04/2050	235	0,02		
160	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1, Serie 2015 NXS1, Clase AS, 3,406 %, con vencimiento el 15/05/2048	149	0,01		
4.826	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RB1, Serie 2017 RB1, Clase XA, 1,353 %, con vencimiento el 15/03/2050 *	151	0,01		
2.330	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2013-C14, Serie 2013 C14, Clase B, 3,841 %, con vencimiento el 15/06/2046 *	1.895	0,19		
2.010	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21, Serie 2014 C21, Clase B, 4,213 %, con vencimiento el 15/08/2047 *	1.824	0,18		
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 450 409 USD)				408.481	40,85
Bonos y obligaciones corporativos — 35,79% (28 de febrero de 2023: 36,53%)					
Australia — 0,04 % (28 de febrero de 2023: 0,04%)					
	300 BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000%, vencimiento el 30/09/2043	290	0,03		
	200 Commonwealth Bank of Australia, 144A, 3,900 %, con vencimiento el 12/07/2047	166	0,01		
		456	0,04		
Bélgica — 0,40% (28 de febrero de 2023: 0,40%)					
	1.110 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, con vencimiento el 01/02/2046	1.033	0,10		
	680 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,000 %, con vencimiento el 13/04/2028	655	0,07		
	280 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2030	258	0,03		
	920 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, con vencimiento el 01/06/2040	824	0,08		
	153 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, con vencimiento el 15/04/2048	138	0,01		
	1.060 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, con vencimiento el 23/01/2049	1.087	0,11		
		3.995	0,40		
Brasil — 0,60 % (28 de febrero de 2023: 0,67%)					
	57 Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, con vencimiento el 17/03/2024	57	0,01		
	3.440 Petrobras Global Finance BV, 5,299 %, con vencimiento el 27/01/2025	3.405	0,34		
	290 Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, con vencimiento 05/06/2115	255	0,02		
	190 Suzano Austria GmbH, 3,750 %, con vencimiento el 15/01/2031	161	0,02		
	2.050 Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125 %, con vencimiento el 15/01/2032	1.621	0,16		
	60 Vale Canada Ltd, 7,200 %, con vencimiento el 15/09/2032	62	0,01		
	410 Vale Overseas Ltd, 6,875 %, con vencimiento el 21/11/2036	428	0,04		
		5.989	0,60		
Canadá — 0,38 % (28 de febrero de 2023: 0,34%)					
	120 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/01/2028	109	0,01		
	110 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2029	96	0,01		
	160 Bank of Montreal, 3,803 %, con vencimiento el 15/12/2032 *	142	0,01		
	550 Bank of Nova Scotia/The, 4,588 %, con vencimiento el 04/05/2037 *	475	0,05		
	290 Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, con vencimiento el 30/05/2041	289	0,03		
	500 Barrick North America Finance LLC, 5,750 %, con vencimiento el 01/05/2043	501	0,05		
	650 Canadian Pacific Railway Co, 3,100 %, con vencimiento el 02/12/2051	442	0,05		
	30 Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 15/02/2030	26	-		
	40 Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 01/12/2031	33	-		
	20 Teck Resources Ltd, 6,000 %, con vencimiento el 15/08/2040	19	-		
	1.350 Toronto-Dominion Bank/The, 4,456 %, con vencimiento 08/06/2032	1.258	0,13		
	390 Alphabet Inc, 4,625 %, con vencimiento 15/12/2027	370	0,04		
		3.760	0,38		
China — 0,33% (28 de febrero de 2023: 0,30%)					
	370 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2,700 %, con vencimiento el 01/05/2025	352	0,04		
	2.650 Prosus NV, 144A, 3,061 %, con vencimiento el 13/07/2031	2.014	0,20		
	1.660 Prosus NV, 144A, 3,832 %, con vencimiento el 08/02/2025	946	0,09		
		3.312	0,33		
Colombia — 0,14% (28 de febrero de 2023: 0,13%)					
	940 Ecopetrol SA, 4,625 %, con vencimiento el 02/11/2031	743	0,07		
	960 Ecopetrol SA, 5,875 %, con vencimiento 28/05/2045	678	0,07		
		1.421	0,14		
Dinamarca — 0,22% (28 de febrero de 2023: 0,19%)					
	280 Danske Bank A/S, 144A, 3,244 %, con vencimiento el 20/12/2025 *	268	0,03		
	2.040 Danske Bank A/S, 144A, 4,298 %, con vencimiento el 01/04/2028 *	1.921	0,19		
		2.189	0,22		
Francia — 1,17 % (28 de febrero de 2023: 1,08%)					
	280 BNP Paribas SA, 144A, 3,375 %, con vencimiento el 09/01/2025 *	271	0,03		
	310 BNP Paribas SA, 144A, 4,705 %, con vencimiento el 10/01/2025 *	308	0,03		
	1.660 BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, con vencimiento el 09/06/2026 *	1.552	0,16		
	620 BNP Paribas SA, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 13/03/2027	595	0,06		
	2.890 BNP Paribas SA, 144A, 1,675 %, con vencimiento el 30/06/2027 *	2.581	0,26		
	1.160 BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, con vencimiento el 14/08/2028	1.097	0,11		
	1.620 BNP Paribas SA, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 13/01/2029 *	1.588	0,16		
	360 BNP Paribas SA, 144A, 5,198 %, con vencimiento el 10/01/2030 *	348	0,03		
	550 BNP Paribas SA, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 01/03/2033 *	498	0,05		
	710 BNP Paribas SA, 144A, 8,500 %, Perpetuo *	709	0,07		
	500 BPCE SA, 144A, 5,150 %, con vencimiento el 21/07/2024	494	0,05		
	590 Credit Agricole SA, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 10/01/2033 *	529	0,05		
	240 Danone SA, 144A, 2,947 %, con vencimiento el 02/11/2026	225	0,02		
	940 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 3,750 %, con vencimiento el 17/09/2024	897	0,09		
		11.692	1,17		

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo
Bonos y pagarés corporativos (continuación)					
India — 0,10% (28 de febrero de 2023: 0,10%)					
330 Reliance Industries Ltd, 144A, 2,875 %, con vencimiento el 12/01/2032	271	0,03	200 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 10/04/2027	194	0,02
1.020 Reliance Industries Ltd, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 12/01/2052	695	0,07	290 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 11/09/2027	274	0,03
	966	0,10		1.123	0,11
Irlanda — 0,42% (28 de febrero de 2023: 0,38%)					
850 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,150 %, con vencimiento el 15/02/2024	838	0,08	España — 0,22% (28 de febrero de 2023: 0,19%)		
1.990 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 2,450 %, con vencimiento el 29/10/2026	1.792	0,18	1.200 Banco Santander SA, 2,746 %, con vencimiento el 28/05/2025	1.136	0,11
1.000 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,000 %, con vencimiento el 29/10/2028	868	0,09	200 Banco Santander SA, 4,175 %, con vencimiento el 24/03/2028 *	188	0,02
480 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, con vencimiento el 30/01/2032	390	0,04	500 Telefonica Emisiones SA, 4,103 %, con vencimiento el 08/03/2027	476	0,05
162 Avolon TLB Borrower 1 (US) LLC, 7,664 %, con vencimiento el 01/12/2027 *	162	0,02	210 Telefonica Emisiones SA, 5,213 %, con vencimiento el 08/03/2047	176	0,02
120 Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/02/2024	119	0,01	260 Telefonica Emisiones SA, 4,895 %, con vencimiento el 06/03/2048	208	0,02
	4.169	0,42		2.184	0,22
Israel — 0,41% (28 de febrero de 2023: 0,42%)					
590 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125 %, con vencimiento el 31/01/2025	594	0,06	Suiza — 1,19% (28 de febrero de 2023: 1,28%)		
1.570 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, vencimiento 01/10/2026	1.421	0,14	1.570 Credit Suisse AG/New York NY, 7.950%, vencimiento el 09/01/2025	1.602	0,16
430 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, vencimiento 09/05/2027	402	0,04	710 Credit Suisse AG/New York NY, 2.950%, vencimiento el 09/04/2025	675	0,07
1.530 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, vencimiento 09/05/2029	1.417	0,14	1.530 Credit Suisse AG/New York NY, 5.000%, vencimiento el 09/07/2027	1.491	0,15
240 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, con vencimiento el 15/09/2031	255	0,03	1.640 Credit Suisse AG/New York NY, 7.500%, vencimiento el 15/02/2028	1.755	0,17
	4.089	0,41	200 UBS AG/London, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 26/06/2048	178	0,02
Italia — 0,19% (28 de febrero de 2023: 0,17%)					
1.160 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, vencimiento 26/06/2024	1.134	0,11	700 UBS Group AG, 144A, 2,593 %, con vencimiento el 11/09/2025 *	675	0,07
850 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, vencimiento 15/01/2026	818	0,08	270 UBS Group AG, 144A, 4,488 %, con vencimiento el 12/05/2026 *	262	0,03
	1.952	0,19	610 UBS Group AG, 144A, 2,193 %, con vencimiento el 05/06/2026 *	569	0,06
Japón — 0,40% (28 de febrero de 2023: 0,37%)					
540 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3,837 %, con vencimiento el 17/04/2026 *	523	0,05	680 UBS Group AG, 144A, 4,751 %, con vencimiento el 12/05/2028 *	653	0,06
560 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 4,080 %, con vencimiento el 19/04/2028 *	532	0,05	670 UBS Group AG, 144A, 4,194 %, con vencimiento el 01/04/2031 *	604	0,06
580 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,043 %, con vencimiento 15/09/2023	579	0,06	720 UBS Group AG, 144A, 3,091 %, con vencimiento el 14/05/2032 *	594	0,06
1.600 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,522 %, con vencimiento 17/09/2025	1.516	0,15	300 UBS Group AG, 144A, 2,746 %, con vencimiento el 11/02/2033 *	236	0,02
990 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 4,345 %, con vencimiento 17/09/2027	908	0,09	420 UBS Group AG, 144A, 9,016 %, con vencimiento el 15/11/2033 *	509	0,05
	4.058	0,40	2.090 UBS Group AG, 144A, 7,000 %, Perpetuo *	2.077	0,21
Kazajstán — 0,06% (28 de febrero de 2023: 0,05%)					
200 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 19/04/2047	161	0,02		11.880	1,19
520 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 6,375 %, con vencimiento el 24/10/2048	437	0,04	Emiratos Árabes Unidos — 0,09% (28 de febrero de 2023: 0,08%)		
	598	0,06	200 DP World Ltd/United Arab Emirates, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 25/09/2048	186	0,02
Kuwait — 0,05% (28 de febrero de 2023: 0,04%)					
520 MEGlobal BV, 144A, 4,250 %, con vencimiento 03/11/2026	499	0,05	760 DP World Ltd/Emiratos Árabes Unidos, 5,625 %, con vencimiento el 25/09/2048	704	0,07
Luxemburgo — 0,06% (28 de febrero de 2023: 0,01%)					
620 Altice France SA, 144A, 5,750 %, con vencimiento 15/08/2029	491	0,05		890	0,09
150 ArcelorMittal SA, 7,000 %, con vencimiento 15/10/2039	155	0,01	Reino Unido — 0,93% (28 de febrero de 2023: 1,05%)		
	646	0,06	410 Barclays Plc, 4,972 %, con vencimiento al 16/05/2029 *	390	0,04
Macao — 0,40% (28 de febrero de 2023: 0,43%)					
2.290 Sands China Ltd, 5,375 %, con vencimiento el 08/08/2025	2.216	0,22	2.610 Barclays Plc, 5,088 %, con vencimiento al 20/06/2030 *	2.393	0,24
710 Sands China Ltd, 2,800 %, con vencimiento el 08/03/2027	619	0,06	430 HSBC Holdings Plc, 4,250 %, con vencimiento el 18/08/2025	415	0,04
580 Sands China Ltd, 5,650 %, con vencimiento el 08/08/2028	548	0,06	330 HSBC Holdings Plc, 4,300 %, con vencimiento el 08/03/2026	319	0,03
730 Sands China Ltd, 3,100 %, con vencimiento el 08/03/2029	609	0,06	400 HSBC Holdings Plc, 4,041 %, con vencimiento el 13/03/2028 *	376	0,04
	3.992	0,40	400 HSBC Holdings Plc, 4,583 %, con vencimiento el 19/06/2029 *	378	0,04
México — 0,11% (28 de febrero de 2023: 0,11%)					
20 America Movil SAB de CV, 6,375 %, con vencimiento el 01/03/2035	22	-	950 HSBC Holdings Plc, 4,762 %, con vencimiento el 29/03/2033 *	845	0,09
20 America Movil SAB de CV, 6,125 %, con vencimiento el 15/11/2037	21	-	340 HSBC Holdings Plc, 6,500 %, con vencimiento el 02/05/2036	346	0,04
1.110 Southern Copper Corp, 5,250 %, con vencimiento el 08/11/2042	1.027	0,11	820 Lloyds Banking Group Plc, 4,650 %, con vencimiento el 24/03/2026	792	0,08
	1.070	0,11	780 Lloyds Banking Group Plc, 4,375 %, con vencimiento el 22/03/2028	740	0,07
Marruecos — 0,11% (28 de febrero de 2023: 0,12%)					
940 OCP SA, 144A, 3,750 %, con vencimiento el 23/06/2031	778	0,08	630 NatWest Group Plc, 4,269 %, con vencimiento el 22/03/2025 *	623	0,06
480 OCP SA, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 23/06/2051	341	0,03	230 NatWest Group Plc, 4,892 %, con vencimiento el 18/05/2029 *	219	0,02
	1.119	0,11	250 NatWest Group Plc, 5,076 %, con vencimiento el 27/01/2030 *	238	0,02
Países Bajos — 0,49% (28 de febrero de 2023: 0,45%)					
200 ABN AMRO Bank NV, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 28/07/2025	194	0,02	420 Standard Chartered Plc, 144A, 5,700 %, con vencimiento el 26/03/2044	381	0,04
1.840 Cooperatieve Rabobank UA, 4,375 %, con vencimiento el 04/08/2025	1.785	0,18	340 Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, con vencimiento 15/05/2029	311	0,03
250 Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 1,339 %, con vencimiento el 24/06/2026 *	230	0,02	630 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/07/2031	527	0,05
600 Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 3,649 %, con vencimiento el 06/04/2028 *	557	0,06		9.293	0,93
350 Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 3,758 %, con vencimiento el 06/04/2033 *	302	0,03	470 3M Co, 2,375 %, con vencimiento el 26/08/2029	406	0,04
160 Shell International Finance BV, 4,550 %, con vencimiento el 12/08/2043	145	0,01	110 3M Co, 3,050 %, con vencimiento el 15/04/2030	116	0,01
770 Shell International Finance BV, 4,375 %, con vencimiento el 11/05/2045	669	0,07	670 3M Co, 3,700 %, con vencimiento el 15/04/2050	515	0,05
270 Shell International Finance BV, 4,000 %, con vencimiento el 10/05/2046	222	0,02	230 Abbott Laboratories, 4,750 %, con vencimiento el 30/11/2036	229	0,02
1.120 Shell International Finance BV, 3,250 %, con vencimiento el 06/04/2050	796	0,08	420 Abbott Laboratories, 4,900 %, con vencimiento el 30/11/2046	410	0,04
	4.900	0,49	140 AbbVie Inc, 3,750%, con vencimiento el 14/11/2023	139	0,01
Sudáfrica — 0,11% (28 de febrero de 2023: 0,10%)					
			1.990 AbbVie Inc, 2,600%, con vencimiento el 21/11/2024	1.921	0,19
			590 AbbVie Inc, 3,800%, con vencimiento el 15/03/2025	575	0,06
			250 AbbVie Inc, 3,600%, con vencimiento el 14/05/2025	243	0,02
			520 AbbVie Inc, 2,950%, con vencimiento el 21/11/2026	487	0,05
			3.520 AbbVie Inc, 3,200%, con vencimiento el 21/11/2029	3.175	0,32
			7 AbbVie Inc, 4,750%, con vencimiento el 15/03/2045	6	-
			90 AbbVie Inc, 4,875%, con vencimiento el 14/11/2048	83	0,01
			110 AbbVie Inc, 4,250%, con vencimiento el 21/11/2049	93	0,01
			450 Air Lease Corp, 3,375 %, con vencimiento el 01/07/2025	429	0,04
			600 Air Lease Corp, 5,300 %, con vencimiento el 01/02/2028	590	0,06
			370 Alphabet Inc, 1,100 %, con vencimiento el 15/08/2030	297	0,03
			370 Alphabet Inc, 1,900 %, con vencimiento el 15/08/2040	249	0,03
			230 Alphabet Inc, 2,050 %, con vencimiento el 15/08/2050	138	0,01
			210 Amazon.com Inc, 3,300%, con vencimiento el 13/04/2027	200	0,02
			800 Amazon.com Inc, 1,200%, con vencimiento el 03/06/2027	705	0,07
			320 Amazon.com Inc, 3,150%, con vencimiento el 22/08/2027	301	0,03
			430 Amazon.com Inc, 3,450%, con vencimiento el 13/04/2029	405	0,04
			510 Amazon.com Inc, 1,500%, con vencimiento el 03/06/2030	415	0,04
			260 Amazon.com Inc, 2,100%, con vencimiento el 12/05/2031	216	0,02
			1.040 Amazon.com Inc, 3,600%, con vencimiento el 13/04/2032	957	0,10
			1.710 Amazon.com Inc, 3,875%, con vencimiento el 22/08/2037	1.540	0,15
			340 Amazon.com Inc, 4,950%, con vencimiento el 05/12/2044	336	0,03
			320 Amazon.com Inc, 4,050%, con vencimiento el 22/08/2047	276	0,03
			650 Amazon.com Inc, 2,500%, con vencimiento el 03/06/2050	415	0,04
			140 Amazon.com Inc, 4,250%, con vencimiento el 22/08/2057	121	0,01
			440 American Express Co, 3,375 %, con vencimiento el 03/05/2024	433	0,04
			1.000 American Express Co, 4,050 %, con vencimiento el 03/05/2029	951	0,10
			246 American International Group Inc, 2,500%, con vencimiento el 30/06/2025	233	0,02

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo
Bonos y pagarés corporativos (continuación)					
Estados Unidos — 27,10% (28 de febrero de 2023: 27,97%)					
220 American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, con vencimiento el 15/01/2032	180	0,02	1.170 Charles Schwab Corp/The, 5,875 %, con vencimiento el 24/08/2026	1.177	0,12
34 Amgen Inc, 4,663 %, con vencimiento el 15/06/2051	29	-	230 Charles Schwab Corp/The, 6,136 %, con vencimiento el 24/08/2034 *	234	0,02
270 Apache Corp, 7,750 %, con vencimiento el 15/12/2029	282	0,03	760 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908%, vencimiento el 23/07/2025	747	0,07
17 Apache Corp, 6,000 %, con vencimiento el 15/01/2037	16	-	1.440 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200%, vencimiento el 15/03/2028	1.342	0,13
930 Apache Corp, 5,100 %, con vencimiento el 01/09/2040	774	0,08	1.200 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050%, vencimiento el 30/03/2029	1.143	0,11
60 Apache Corp, 5,250 %, con vencimiento el 01/02/2042	49	0,01	380 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,400%, vencimiento el 01/04/2033	335	0,03
510 Apache Corp, 4,750 %, con vencimiento el 15/04/2043	390	0,04	500 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375%, vencimiento el 01/04/2038	424	0,04
180 Apache Corp, 4,250 %, con vencimiento el 15/01/2044	123	0,01	270 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500%, vencimiento el 01/03/2042	177	0,02
290 Apache Corp, 5,350 %, con vencimiento el 01/07/2049	233	0,02	260 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484%, vencimiento el 23/10/2045	239	0,02
720 Apple Inc, 2,450 %, con vencimiento el 04/08/2026	674	0,07	70 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375%, vencimiento el 01/05/2047	56	0,01
250 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 01/09/2029	203	0,02	430 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750%, vencimiento el 01/04/2048	363	0,04
300 AT&T Inc, 3,800%, vencimiento el 15/02/2027	286	0,03	240 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125%, vencimiento el 01/07/2049	185	0,02
970 AT&T Inc, 2,300%, vencimiento el 01/06/2027	869	0,09	210 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800%, vencimiento el 01/03/2050	156	0,02
150 AT&T Inc, 2,250%, vencimiento el 01/02/2032	117	0,01	440 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,500%, vencimiento el 01/04/2063	346	0,03
60 AT&T Inc, 2,550%, vencimiento el 01/12/2033	46	-	400 Cheniere Energy Inc, 4,625 %, con vencimiento el 15/10/2028	377	0,04
170 AT&T Inc, 5,350%, vencimiento el 01/09/2040	159	0,02	130 Cheniere Energy Partners LP, 4,000 %, con vencimiento el 01/03/2031	115	0,01
190 AT&T Inc, 5,550%, vencimiento el 15/08/2041	179	0,02	690 Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, con vencimiento el 31/01/2032	571	0,06
161 AT&T Inc, 4,350%, vencimiento el 15/06/2045	127	0,01	340 Chevron Corp, 2,954 %, con vencimiento el 16/05/2026	324	0,03
1.218 AT&T Inc, 4,500%, vencimiento el 09/03/2048	973	0,10	240 Chevron Corp, 1,995 %, con vencimiento el 11/05/2027	218	0,02
70 AT&T Inc, 3,800%, vencimiento el 01/12/2057	47	-	80 Chevron Corp, 3,078 %, con vencimiento el 11/05/2050	57	0,01
465 AT&T Inc, 3,650%, vencimiento el 15/09/2059	301	0,03	950 Chevron USA Inc, 3,850%, vencimiento el 15/01/2028	919	0,09
530 Ball Corp, 3,125 %, con vencimiento el 15/09/2031	430	0,04	140 Chubb INA Holdings Inc, 3,350 %, con vencimiento el 03/05/2026	134	0,01
520 Bank of America Corp, 4,200%, vencimiento el 26/08/2024	511	0,05	290 Cigna Group/The, 4,125 %, con vencimiento el 15/11/2025	283	0,03
470 Bank of America Corp, 4,000%, vencimiento el 22/01/2025	458	0,05	2.840 Cigna Group/The, 4,375 %, con vencimiento el 15/10/2028	2.737	0,27
130 Bank of America Corp, 4,450%, vencimiento el 03/03/2026	126	0,01	110 Cigna Group/The, 4,900 %, con vencimiento el 15/12/2048	98	0,01
830 Bank of America Corp, 3,500%, vencimiento el 19/04/2026	790	0,08	90 Cigna Group/The, 3,400 %, con vencimiento el 15/03/2050	63	0,01
1.510 Bank of America Corp, 1,319%, vencimiento el 19/06/2026 *	1.390	0,14	270 Cintas Corp No 2, 3,700%, vencimiento el 01/04/2027	259	0,03
970 Bank of America Corp, 4,250%, vencimiento el 22/10/2026	932	0,09	300 Cintas Corp No 2, 4,000%, vencimiento el 01/05/2032	281	0,03
1.290 Bank of America Corp, 4,376%, vencimiento el 27/04/2028 *	1.239	0,12	330 Citigroup Inc, 3,300%, vencimiento el 27/04/2025	319	0,03
940 Bank of America Corp, 3,593%, vencimiento el 21/07/2028 *	875	0,09	440 Citigroup Inc, 4,400%, vencimiento el 10/06/2025	429	0,04
1.770 Bank of America Corp, 3,419%, vencimiento el 20/12/2028 *	1.624	0,16	220 Citigroup Inc, 5,500%, vencimiento el 13/09/2025	219	0,02
2.470 Bank of America Corp, 3,970%, vencimiento el 05/03/2029 *	2.309	0,23	490 Citigroup Inc, 3,106%, vencimiento el 08/04/2026 *	469	0,05
1.480 Bank of America Corp, 3,974%, vencimiento el 07/02/2030 *	1.363	0,14	110 Citigroup Inc, 4,300%, vencimiento el 20/11/2026	106	0,01
1.500 Bank of America Corp, 2,884%, vencimiento el 22/10/2030 *	1.288	0,13	1.260 Citigroup Inc, 4,450%, vencimiento el 29/09/2027	1.205	0,12
1.580 Bank of America Corp, 2,572%, vencimiento el 20/10/2032 *	1.267	0,13	450 Citigroup Inc, 4,658%, vencimiento el 24/05/2028 *	438	0,04
1.870 Bank of America Corp, 2,972%, vencimiento el 04/02/2033 *	1.538	0,15	60 Citigroup Inc, 4,125%, vencimiento el 25/07/2028	56	0,01
560 Bank of America Corp, 4,330%, vencimiento el 15/03/2050 *	475	0,05	1.360 Citigroup Inc, 3,520%, vencimiento el 27/10/2028 *	1.256	0,13
2.070 Bank of America Corp, 4,083%, vencimiento el 20/03/2051 *	1.665	0,17	1.180 Citigroup Inc, 4,075%, vencimiento el 23/04/2029 *	1.107	0,11
380 Bank of New York Mellon Corp/The, 1,600%, vencimiento el 24/04/2025	357	0,04	1.470 Citigroup Inc, 3,980%, vencimiento el 20/03/2030 *	1.355	0,14
30 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 01/11/2025	27	-	1.590 Citigroup Inc, 4,412%, vencimiento el 31/03/2031 *	1.477	0,15
435 Becton Dickinson and Co, 3,363 %, con vencimiento el 06/06/2024	427	0,04	1.180 Citigroup Inc, 2,520%, vencimiento el 03/11/2032 *	937	0,09
26 Becton Dickinson and Co, 3,734 %, con vencimiento el 15/12/2024	25	-	1.150 Citigroup Inc, 3,785%, vencimiento el 17/03/2033 *	1.000	0,10
377 Becton Dickinson and Co, 4,685 %, con vencimiento el 15/12/2044	334	0,03	540 Citigroup Inc, 4,910%, vencimiento el 24/05/2033 *	514	0,05
180 Becton Dickinson and Co, 4,669 %, con vencimiento el 06/06/2047	160	0,02	1.456 Citigroup Inc, 8,125%, vencimiento el 15/07/2039	1.814	0,18
850 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, con vencimiento el 15/01/2049	749	0,08	255 Citigroup Inc, 5,300%, vencimiento el 06/05/2044	232	0,02
3.380 Boston Properties LP, 3,400 %, con vencimiento el 21/06/2029	2.895	0,29	390 Citigroup Inc, Series P, 5,950%, Perpetuo *	377	0,04
950 BP Capital Markets America Inc, 3,119%, vencimiento el 04/05/2026	904	0,09	90 Citigroup Inc, Series M, 6,300%, Perpetuo *	89	0,01
440 BP Capital Markets America Inc, 3,633%, vencimiento el 06/04/2030	407	0,04	100 Citigroup Inc, Series O, 9,699%, Perpetuo *	100	0,01
900 BP Capital Markets America Inc, 3,000%, vencimiento el 24/02/2050	600	0,06	720 Coca-Cola Co/The, 3,375%, vencimiento el 25/03/2027	690	0,07
43 Brighthouse Financial Inc, 4,700 %, con vencimiento el 22/06/2047	32	-	370 Coca-Cola Co/The, 1,450%, vencimiento el 01/06/2027	331	0,03
532 Bristol-Myers Squibb Co, 3,200%, vencimiento el 15/06/2026	508	0,05	20 Coca-Cola Co/The, 2,500%, vencimiento el 01/06/2040	14	-
705 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400%, vencimiento el 26/07/2029	653	0,07	280 Coca-Cola Co/The, 2,600%, vencimiento el 01/06/2050	187	0,02
2.040 CommScope Inc, 144A, 3,137 %, con vencimiento el 15/11/2035	1.558	0,16	1.090 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,036 %, con vencimiento el 15/11/2033	1.102	0,11
110 Builders FirstSource Inc, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 01/02/2032	94	0,01	380 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,544 %, con vencimiento el 15/11/2053	389	0,04
630 Cameron LNG LLC, 144A, 2,902 %, con vencimiento el 15/07/2031	539	0,05	130 Comcast Corp, 3,950%, vencimiento el 15/10/2025	127	0,01
850 Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, con vencimiento el 15/01/2035	704	0,07	640 Comcast Corp, 3,150%, vencimiento el 01/03/2026	611	0,06
30 Carrier Global Corp, 2,700%, vencimiento el 15/02/2031	25	-	280 Comcast Corp, 3,300%, vencimiento el 01/04/2027	264	0,03
50 Carrier Global Corp, 3,577%, vencimiento el 05/04/2050	36	-	1.090 Comcast Corp, 4,150%, vencimiento el 15/10/2028	1.052	0,11
70 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 15/08/2030	59	0,01			
370 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2032	307	0,03			
770 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, con vencimiento el 01/05/2032	625	0,06			
360 Centene Corp, 4,250 %, con vencimiento el 15/12/2027	337	0,03			
520 Centene Corp, 4,625 %, con vencimiento el 15/12/2029	479	0,05			
290 Centene Corp, 3,375 %, con vencimiento el 15/02/2030	248	0,03			
50 Centene Corp, 3,000 %, con vencimiento el 15/10/2030	42	-			
60 Centene Corp, 2,625 %, con vencimiento el 01/08/2031	48	-			

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo
Bonos y pagarés corporativos (continuación)					
Estados Unidos — (continuación)					
390 Comcast Corp, 3.400%, vencimiento el 01/04/2030	356	0,04	1.880 Enterprise Products Operating LLC, 4.200%, vencimiento el 31/01/2050	1.504	0,15
510 Comcast Corp, 4.250%, vencimiento el 15/10/2030	486	0,05	280 Enterprise Products Operating LLC, 3.700%, vencimiento el 31/01/2051	205	0,02
60 Comcast Corp, 4.250%, vencimiento el 15/01/2033	56	0,01	90 Enterprise Products Operating LLC, 3.950%, vencimiento el 31/01/2060	66	0,01
60 Comcast Corp, 5.650%, vencimiento el 15/06/2035	62	0,01	220 Enterprise Products Operating LLC, 5.375%, vencimiento el 15/02/2078 *	183	0,02
13 Comcast Corp, 6.500%, vencimiento el 15/11/2035	14	-	240 EOG Resources Inc, 4.150 %, con vencimiento el 15/01/2026	235	0,02
1.420 Comcast Corp, 3.900%, vencimiento el 01/03/2038	1.212	0,12	190 EOG Resources Inc, 4.375 %, con vencimiento el 15/04/2030	185	0,02
400 Comcast Corp, 3.250%, vencimiento el 01/11/2039	308	0,03	690 EOG Resources Inc, 3.900 %, con vencimiento el 01/04/2035	611	0,06
300 Comcast Corp, 3.750%, vencimiento el 01/04/2040	247	0,02	180 EOG Resources Inc, 4.950 %, con vencimiento el 15/04/2050	170	0,02
80 Comcast Corp, 3.400%, vencimiento el 15/07/2046	59	0,01	28 EQT Corp, 6.125%, vencimiento el 01/02/2025	28	-
120 Comcast Corp, 4.000%, vencimiento el 15/08/2047	96	0,01	20 EQT Corp, 144A, 3.125%, vencimiento el 15/05/2026	19	-
224 Comcast Corp, 3.969%, vencimiento el 01/11/2047	180	0,02	1.340 EQT Corp, 3.900%, vencimiento el 01/10/2027	1.252	0,13
110 Comcast Corp, 4.000%, vencimiento el 01/03/2048	89	0,01	200 EQT Corp, 5.000%, vencimiento el 15/01/2029	190	0,02
293 Comcast Corp, 3.999%, vencimiento el 01/11/2049	234	0,02	420 EQT Corp, 144A, 3.625%, vencimiento el 15/05/2031	363	0,04
200 Comcast Corp, 3.450%, vencimiento el 01/02/2050	146	0,01	180 Exxon Mobil Corp, 3.043 %, con vencimiento el 01/03/2026	172	0,02
619 Comcast Corp, 2.887%, vencimiento el 01/11/2051	397	0,04	440 Exxon Mobil Corp, 3.482 %, con vencimiento el 19/03/2030	407	0,04
66 Comcast Corp, 4.049%, vencimiento el 01/11/2052	53	0,01	1.010 Exxon Mobil Corp, 4.114 %, con vencimiento el 01/03/2046	859	0,09
137 Comcast Corp, 2.937%, vencimiento el 01/11/2056	85	0,01	80 Exxon Mobil Corp, 4.327 %, con vencimiento el 19/03/2050	69	0,01
100 Comcast Corp, 4.950%, vencimiento el 15/10/2058	92	0,01	270 FirstEnergy Corp, Series A, 1.600%, vencimiento el 15/01/2026	245	0,02
74 Comcast Corp, 2.987%, vencimiento el 01/11/2063	45	-	3.160 FirstEnergy Corp, Series B, 4.150%, vencimiento el 15/07/2027	2.984	0,30
20 CommonSpirit Health, 4.350 %, con vencimiento el 01/11/2042	17	-	1.000 FirstEnergy Corp, Series C, 5.100%, vencimiento el 15/07/2047	871	0,09
300 CommScope Inc, 144A, 6.000 %, con vencimiento el 01/03/2026	273	0,03	770 Ford Motor Co, 3.250 %, con vencimiento el 12/02/2032	602	0,06
130 CommScope Inc, 144A, 4.750 %, con vencimiento el 01/09/2029	97	0,01	570 Ford Motor Co, 6.100 %, con vencimiento 19/08/2032	545	0,05
85 ConocoPhillips Co, 6.950 %, con vencimiento el 15/04/2029	94	0,01	150 Ford Motor Co, 4.750 %, con vencimiento 15/01/2043	112	0,01
240 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20A, 3.350%, vencimiento el 01/04/2030	217	0,02	400 Ford Motor Credit Co LLC, 5.125 %, con vencimiento el 16/06/2025	390	0,04
190 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20B, 3.950%, vencimiento el 01/04/2050	151	0,02	1.390 Ford Motor Credit Co LLC, 4.950 %, con vencimiento 28/05/2027	1.306	0,13
440 Constellation Brands Inc, 4.750 %, con vencimiento el 15/11/2024	436	0,04	600 Ford Motor Credit Co LLC, 4.125 %, con vencimiento el 17/08/2027	545	0,05
450 Constellation Brands Inc, 4.350 %, con vencimiento el 09/05/2027	436	0,04	610 Ford Motor Credit Co LLC, 7.350 %, con vencimiento 04/11/2027	621	0,06
130 Continental Resources Inc/OK, 3.800 %, con vencimiento el 01/06/2024	128	0,01	260 Ford Motor Credit Co LLC, 2.900 %, con vencimiento el 16/02/2028	222	0,02
290 Continental Resources Inc/OK, 144A, 2.268 %, con vencimiento 15/11/2026	259	0,03	200 Ford Motor Credit Co LLC, 2.900 %, con vencimiento 10/02/2029	165	0,02
1.000 Continental Resources Inc/OK, 4.375 %, con vencimiento el 15/01/2028	942	0,09	810 Ford Motor Credit Co LLC, 5.113 %, con vencimiento 03/05/2029	746	0,07
390 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5.750 %, con vencimiento 15/01/2031	373	0,04	890 Ford Motor Credit Co LLC, 4.000 %, con vencimiento el 13/11/2030	754	0,08
100 Continental Resources Inc/OK, 4.900 %, con vencimiento el 01/06/2044	77	0,01	500 Ford Motor Credit Co LLC, 3.625 %, con vencimiento el 17/06/2031	406	0,04
1.020 Costco Wholesale Corp, 1.375 %, con vencimiento el 20/06/2027	902	0,09	30 Freeport-McMoRan Inc, 4.550%, vencimiento el 14/11/2024	30	-
340 Costco Wholesale Corp, 1.600 %, con vencimiento el 20/04/2030	281	0,03	260 Freeport-McMoRan Inc, 4.625%, vencimiento el 01/08/2030	241	0,02
1.790 Coterra Energy Inc, 3.900 %, con vencimiento el 15/05/2027	1.703	0,17	240 Freeport-McMoRan Inc, 5.400%, vencimiento el 14/11/2034	228	0,02
560 Coterra Energy Inc, 4.375 %, con vencimiento el 15/03/2029	527	0,05	670 Freeport-McMoRan Inc, 5.450%, vencimiento el 15/03/2043	602	0,06
300 CSC Holdings LLC, 144A, 4.125 %, con vencimiento 01/12/2030	214	0,02	440 General Motors Co, 6.125%, con vencimiento el 01/10/2025	442	0,04
200 CSC Holdings LLC, 144A, 3.375 %, con vencimiento el 15/02/2031	138	0,01	210 General Motors Co, 5.600%, con vencimiento el 15/10/2032	202	0,02
510 CSC Holdings LLC, 144A, 4.500 %, con vencimiento el 15/11/2031	363	0,04	50 General Motors Co, 6.600%, con vencimiento el 01/04/2036	50	0,01
130 CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp, 144A, 3.875 %, con vencimiento el 30/06/2028	113	0,01	50 General Motors Co, 5.150%, con vencimiento el 01/04/2038	44	-
541 CVS Health Corp, 3.875%, con vencimiento el 20/07/2025	525	0,05	230 General Motors Co, 6.250%, con vencimiento el 02/10/2043	217	0,02
220 CVS Health Corp, 3.625%, con vencimiento el 01/04/2027	208	0,02	330 General Motors Co, 5.950%, con vencimiento el 01/04/2049	296	0,03
268 CVS Health Corp, 4.300%, con vencimiento el 25/03/2028	258	0,03	50 General Motors Financial Co Inc, 4.350 %, con vencimiento el 17/01/2027	48	-
530 CVS Health Corp, 3.750%, con vencimiento el 01/04/2030	482	0,05	200 Gilead Sciences Inc, 3.500%, con vencimiento el 01/02/2025	195	0,02
410 CVS Health Corp, 2.125%, con vencimiento el 15/09/2031	324	0,03	250 Gilead Sciences Inc, 4.750%, con vencimiento el 01/03/2046	228	0,02
400 CVS Health Corp, 4.780%, con vencimiento el 25/03/2038	358	0,04	10 GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5.250 %, con vencimiento el 01/06/2025	10	-
220 CVS Health Corp, 4.125%, con vencimiento el 01/04/2040	179	0,02	80 GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5.375 %, con vencimiento el 15/04/2026	78	0,01
440 CVS Health Corp, 5.125%, con vencimiento el 20/07/2045	392	0,04	3 Goldman Sachs Capital II, 6.439 %, Perpetuo *	2	-
2.800 CVS Health Corp, 5.050%, con vencimiento el 25/03/2048	2.458	0,25	800 Goldman Sachs Group Inc/The, 3.850%, con vencimiento el 08/07/2024	787	0,08
70 CVS Health Corp, 4.250%, con vencimiento el 01/04/2050	55	0,01	760 Goldman Sachs Group Inc/The, 3.500%, con vencimiento el 01/04/2025	734	0,07
15 CVS Pass-Through Trust, 6.036%, con vencimiento el 10/12/2028	15	-	460 Goldman Sachs Group Inc/The, 4.250%, con vencimiento el 21/10/2025	447	0,04
28 CVS Pass-Through Trust, 6.943%, con vencimiento el 10/01/2030	28	-	1.390 Goldman Sachs Group Inc/The, 0.855%, con vencimiento el 12/02/2026 *	1.290	0,13
150 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6.450 %, con vencimiento el 03/11/2036	153	0,02	1.970 Goldman Sachs Group Inc/The, 3.500%, con vencimiento el 16/11/2026	1.852	0,19
140 Deere & Co, 3.100 %, con vencimiento el 15/04/2030	127	0,01	270 Goldman Sachs Group Inc/The, 3.615%, con vencimiento el 15/03/2028 *	253	0,03
510 Deere & Co, 3.750 %, con vencimiento el 15/04/2050	437	0,04	4.320 Goldman Sachs Group Inc/The, 3.814%, con vencimiento el 23/04/2029 *	3.999	0,40
410 Delta Air Lines Inc, 2.900 %, con vencimiento el 28/10/2024	398	0,04	2.240 Goldman Sachs Group Inc/The, 4.223%, con vencimiento el 01/05/2029 *	2.112	0,21
630 Delta Air Lines Inc, 7.375 %, con vencimiento el 15/01/2026	649	0,07	2.940 Goldman Sachs Group Inc/The, 2.650%, con vencimiento el 21/10/2032 *	2.360	0,24
530 Devon Energy Corp, 5.850%, con vencimiento el 15/12/2025	533	0,05	670 Goldman Sachs Group Inc/The, 6.250%, con vencimiento el 01/02/2041	708	0,07
260 Devon Energy Corp, 4.500%, con vencimiento el 15/01/2030	243	0,02	160 Goldman Sachs Group Inc/The, 3.210%, con vencimiento el 22/04/2042 *	115	0,01
40 Devon Energy Corp, 5.600%, con vencimiento el 15/07/2041	37	-	380 Goldman Sachs Group Inc/The, 2.908%, con vencimiento el 21/07/2042 *	263	0,03
520 Devon Energy Corp, 4.750%, con vencimiento el 15/05/2042	434	0,04	450 Goldman Sachs Group Inc/The, 5.150%, con vencimiento el 22/05/2045	414	0,04
1.480 Devon Energy Corp, 5.000%, con vencimiento el 15/06/2045	1.268	0,13	540 Goldman Sachs Group Inc/The, 4.750%, con vencimiento el 21/10/2045	486	0,05
50 Diamondback Energy Inc, 3.250%, con vencimiento el 01/12/2026	47	-	100 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3.875 %, con vencimiento el 15/12/2028	87	0,01
660 Diamondback Energy Inc, 3.500%, con vencimiento el 01/12/2029	598	0,06	580 HALEON US Capital LLC, 3.375 %, con vencimiento el 24/03/2027	546	0,05
480 Diamondback Energy Inc, 4.400%, con vencimiento el 24/03/2051	373	0,04	410 HALEON US Capital LLC, 3.375 %, con vencimiento el 24/03/2029	375	0,04
450 DISH DBS Corp, 5.875 %, con vencimiento el 15/11/2024	419	0,04	370 HALEON US Capital LLC, 3.625 %, con vencimiento el 24/03/2032	329	0,03
410 DISH DBS Corp, 7.750 %, con vencimiento el 01/07/2026	307	0,03	11 Halliburton Co, 3.800 %, con vencimiento el 15/11/2025	11	-
230 DISH DBS Corp, 144A, 5.250 %, con vencimiento 01/12/2026	194	0,02			
40 DISH DBS Corp, 144A, 5.750 %, con vencimiento 01/12/2028	31	-			
170 DISH DBS Corp, 5.125 %, con vencimiento el 01/06/2029	92	0,01			
130 Duke Energy Carolinas LLC, 5.300 %, con vencimiento el 15/02/2040	127	0,01			
640 Duke Energy Ohio Inc, 3.650 %, con vencimiento el 01/02/2029	597	0,06			
420 Eaton Corp, 4.150 %, con vencimiento el 02/11/2042	365	0,04			
36 El Paso Natural Gas Co LLC, 8.375 %, con vencimiento el 15/06/2032	41	-			
200 Elevance Health Inc, 3.350 %, con vencimiento el 01/12/2024	195	0,02			
840 Elevance Health Inc, 4.100 %, con vencimiento el 15/05/2032	774	0,08			
360 Elevance Health Inc, 4.550 %, con vencimiento el 15/05/2052	310	0,03			
720 Enterprise Products Operating LLC, 4.150%, con vencimiento el 16/10/2028	688	0,07			
510 Enterprise Products Operating LLC, 2.800%, con vencimiento el 31/01/2030	442	0,04			

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo
Bonos y pagarés corporativos (continuación)					
Estados Unidos — (continuación)					
60 Halliburton Co, 4,850 %, con vencimiento el 15/11/2035	56	0,01	80 Kraft Heinz Foods Co, 4,375 %, con vencimiento el 01/06/2046	66	0,01
320 Halliburton Co, 5,000 %, con vencimiento el 15/11/2045	288	0,03	260 Kraft Heinz Foods Co, 4,875 %, con vencimiento el 01/10/2049	231	0,02
100 HCA Inc, 5,000 %, vencimiento el 15/03/2024	99	0,01	300 Kraft Heinz Foods Co, 5,500 %, con vencimiento el 01/06/2050	290	0,03
270 HCA Inc, 5,375 %, vencimiento el 01/02/2025	268	0,03	1.860 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, con vencimiento el 08/08/2024	1.802	0,18
10 HCA Inc, 5,250 %, vencimiento el 15/04/2025	10	-	1.320 Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, con vencimiento el 25/06/2025	1.247	0,12
170 HCA Inc, 5,250 %, vencimiento el 15/06/2026	168	0,02	160 Lehman Brothers Escrow, Series DMTN, zero coupon, Perpetuo ***	-	-
30 HCA Inc, 5,375 %, vencimiento el 01/09/2026	30	-	120 Lennar Corp, 4,500 %, con vencimiento el 30/04/2024	119	0,01
90 HCA Inc, 5,625 %, vencimiento el 01/09/2028	90	0,01	50 Lennar Corp, 4,750 %, con vencimiento el 30/05/2025	49	0,01
660 HCA Inc, 5,875 %, vencimiento el 01/02/2029	664	0,07	460 Lennar Corp, 4,750 %, con vencimiento el 29/11/2027	446	0,04
930 HCA Inc, 3,500 %, vencimiento el 01/09/2030	813	0,08	280 Lowe's Cos Inc, 4,500 %, con vencimiento el 15/04/2030	270	0,03
400 HCA Inc, 5,500 %, vencimiento el 15/06/2047	364	0,04	300 Mars Inc, 144A, 3,200 %, con vencimiento el 01/04/2030	271	0,01
180 Hershey Co/The, 0,900 %, con vencimiento el 01/06/2025	167	0,02	110 Mastercard Inc, 3,850 %, con vencimiento el 26/03/2050	91	0,01
380 Home Depot Inc/The, 2,500 %, con vencimiento el 15/04/2027	351	0,04	100 McDonald's Corp, 1,450 %, con vencimiento el 01/09/2025	93	0,01
70 Home Depot Inc/The, 3,900 %, con vencimiento el 06/12/2028	67	0,01	460 McDonald's Corp, 3,700 %, con vencimiento el 30/01/2026	445	0,04
440 Home Depot Inc/The, 2,700 %, con vencimiento el 15/04/2030	387	0,04	310 McDonald's Corp, 3,500 %, con vencimiento el 01/03/2027	295	0,03
360 Home Depot Inc/The, 3,300 %, con vencimiento el 15/04/2040	284	0,03	360 McDonald's Corp, 3,500 %, con vencimiento el 01/07/2027	342	0,03
90 Home Depot Inc/The, 3,900 %, con vencimiento el 15/06/2047	73	0,01	260 McDonald's Corp, 3,800 %, con vencimiento el 01/04/2028	249	0,03
1.120 Home Depot Inc/The, 3,350 %, con vencimiento el 15/04/2050	821	0,08	130 McDonald's Corp, 3,600 %, con vencimiento el 01/07/2030	120	0,01
430 Humana Inc, 3,950 %, con vencimiento el 15/03/2027	413	0,04	80 McDonald's Corp, 3,625 %, con vencimiento el 01/09/2049	60	0,01
1.100 Humana Inc, 3,125 %, con vencimiento el 15/08/2029	979	0,10	600 McDonald's Corp, 4,200 %, con vencimiento el 01/04/2050	499	0,05
190 Humana Inc, 2,150 %, con vencimiento el 03/02/2032	149	0,02	60 MDC Holdings Inc, 6,000 %, con vencimiento el 15/01/2043	53	0,01
70 Humana Inc, 4,625 %, con vencimiento el 01/12/2042	60	0,01	450 Merck & Co Inc, 1,450 %, con vencimiento el 24/06/2030	363	0,04
20 Humana Inc, 4,800 %, con vencimiento el 15/03/2047	18	-	790 Merck & Co Inc, 2,750 %, con vencimiento el 10/12/2051	519	0,05
50 ILFC E-Capital Trust II, 144A, 7,314 %, con vencimiento el 21/12/2065 *	37	-	300 MetLife Inc, 6,400 %, con vencimiento el 15/12/2036	297	0,03
350 Intel Corp, 1,600 %, con vencimiento el 12/08/2028	301	0,03	540 Micron Technology Inc, 5,875 %, con vencimiento el 09/02/2033	534	0,05
240 Intel Corp, 5,125 %, con vencimiento el 10/02/2030	241	0,02	50 Micron Technology Inc, 5,875 %, con vencimiento el 15/09/2033	49	0,01
130 Intel Corp, 3,734 %, con vencimiento el 08/12/2047	99	0,01	10 Microsoft Corp, 3,450 %, con vencimiento el 08/08/2036	9	-
380 Intel Corp, 4,750 %, con vencimiento el 25/03/2050	334	0,03	650 Microsoft Corp, 2,525 %, con vencimiento el 01/06/2050	430	0,04
200 Intel Corp, 3,050 %, con vencimiento el 12/08/2051	130	0,01	10 Microsoft Corp, 2,921 %, con vencimiento el 17/03/2052	7	-
1.230 Intercontinental Exchange Inc, 4,600 %, con vencimiento el 15/03/2033	1.176	0,12	207 Microsoft Corp, 3,041 %, con vencimiento el 17/03/2062	144	0,01
210 Intercontinental Exchange Inc, 4,950 %, con vencimiento el 15/06/2052	196	0,02	584 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 20/06/2027	583	0,06
1.940 International Business Machines Corp, 3,000 %, con vencimiento el 15/05/2024	1.905	0,19	960 Mondelez International Inc, 1,500 %, con vencimiento el 04/05/2025	898	0,09
790 Johnson & Johnson, 3,625 %, con vencimiento el 03/03/2037	699	0,07	2.060 Morgan Stanley Serie I, 0,864 %, con vencimiento el 21/10/2025 *	1.940	0,19
250 JPMorgan Chase & Co, 3,875 %, con vencimiento el 10/09/2024	245	0,02	340 Morgan Stanley, 2,188 %, con vencimiento el 28/04/2026 *	321	0,03
1.400 JPMorgan Chase & Co, 4,023 %, con vencimiento el 05/12/2024 *	1.393	0,14	1.150 Morgan Stanley, 3,772 %, con vencimiento el 24/01/2029 *	1.067	0,11
940 JPMorgan Chase & Co, 2,083 %, con vencimiento el 22/04/2026 *	885	0,09	50 Morgan Stanley, 4,431 %, con vencimiento el 23/01/2030 *	48	-
1.000 JPMorgan Chase & Co, 3,509 %, con vencimiento el 23/01/2029 *	922	0,09	960 Morgan Stanley, 2,699 %, con vencimiento el 22/01/2031 *	809	0,08
610 JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, con vencimiento el 23/07/2029 *	576	0,06	1.190 Morgan Stanley, 3,622 %, con vencimiento el 01/04/2031 *	1.058	0,11
780 JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, con vencimiento el 05/12/2029 *	744	0,07	460 Morgan Stanley, 2,511 %, con vencimiento el 20/10/2032 *	366	0,04
640 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, con vencimiento el 22/04/2031 *	537	0,05	680 Morgan Stanley, 2,484 %, con vencimiento el 16/09/2036 *	513	0,05
790 JPMorgan Chase & Co, 2,545 %, con vencimiento el 08/11/2032 *	638	0,06	230 MPLX LP, 4,000 %, con vencimiento el 15/03/2028	216	0,02
1.660 JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, con vencimiento el 01/06/2045	1.527	0,15	840 MPLX LP, 4,800 %, con vencimiento el 15/02/2029	810	0,08
300 JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, con vencimiento el 22/04/2051 *	203	0,02	410 MPLX LP, 4,500 %, con vencimiento el 15/04/2038	348	0,03
870 Kenvue Inc, 144A, 4,900 %, con vencimiento el 22/03/2033	866	0,09	20 MPLX LP, 5,200 %, con vencimiento el 01/03/2047	17	-
380 Kinder Morgan Energy Partners LP, 3,500 %, con vencimiento el 01/09/2023	380	0,04	830 MPLX LP, 4,700 %, con vencimiento el 15/04/2048	667	0,07
110 Kinder Morgan Energy Partners LP, 4,250 %, con vencimiento el 01/09/2024	108	0,01	320 MPLX LP, 5,500 %, con vencimiento el 15/02/2049	285	0,03
300 Kinder Morgan Inc, 4,300 %, con vencimiento el 01/06/2025	293	0,03	580 NIKE Inc, 2,750 %, con vencimiento el 27/03/2027	542	0,05
520 Kinder Morgan Inc, 4,300 %, con vencimiento el 01/03/2028	496	0,05	290 NIKE Inc, 3,250 %, con vencimiento el 27/03/2040	234	0,02
270 Kinder Morgan Inc, 5,300 %, con vencimiento el 01/12/2034	257	0,03	760 NIKE Inc, 3,375 %, con vencimiento el 27/03/2050	588	0,06
370 Kinder Morgan Inc, 5,550 %, con vencimiento el 01/06/2045	335	0,03	320 NVIDIA Corp, 2,850 %, con vencimiento el 01/04/2030	287	0,03
60 Kinder Morgan Inc, 5,200 %, con vencimiento el 01/03/2048	52	0,01	860 NVIDIA Corp, 3,500 %, con vencimiento el 01/04/2040	717	0,07
30 KKR Group Finance Co II LLC, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 01/02/2043	27	-	350 NVIDIA Corp, 3,500 %, con vencimiento el 01/04/2050	276	0,03
130 Kraft Heinz Foods Co, 3,000 %, con vencimiento el 01/06/2026	123	0,01	620 NVIDIA Corp, 3,700 %, con vencimiento el 01/04/2060	495	0,05
150 Kraft Heinz Foods Co, 4,250 %, con vencimiento el 01/03/2031	141	0,01	14 Occidental Petroleum Corp, 6,950 %, con vencimiento el 01/07/2024	14	-
20 Kraft Heinz Foods Co, 6,750 %, con vencimiento el 15/03/2032	22	-	130 Occidental Petroleum Corp, 5,550 %, con vencimiento el 15/03/2026	129	0,01
80 Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, con vencimiento el 15/07/2035	78	0,01	410 Occidental Petroleum Corp, 3,400 %, con vencimiento el 15/04/2026	385	0,04
50 Kraft Heinz Foods Co, 6,875 %, con vencimiento el 26/01/2039	55	0,01	610 Occidental Petroleum Corp, 3,200 %, con vencimiento el 15/08/2026	558	0,06
10 Kraft Heinz Foods Co, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 01/08/2039	11	-	260 Occidental Petroleum Corp, 3,000 %, con vencimiento el 15/02/2027	234	0,02
10 Kraft Heinz Foods Co, 4,625 %, con vencimiento el 01/10/2039	9	-	360 Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, con vencimiento el 15/08/2029	311	0,03
170 Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, con vencimiento el 04/06/2042	155	0,02	260 Occidental Petroleum Corp, 7,875 %, con vencimiento el 15/09/2031	288	0,03
520 Kraft Heinz Foods Co, 5,200 %, con vencimiento el 15/07/2045	478	0,05	730 Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, con vencimiento el 15/09/2036	747	0,07
			200 Occidental Petroleum Corp, 6,200 %, con vencimiento el 15/03/2040	198	0,02
			240 Occidental Petroleum Corp, 4,625 %, con vencimiento el 15/06/2045	183	0,02
			240 Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, con vencimiento el 15/03/2046	247	0,02
			100 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, con vencimiento el 15/04/2046	77	0,01
			380 Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, con vencimiento el 15/02/2047	262	0,03
			260 Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, con vencimiento el 15/03/2048	192	0,02

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles)	% del valor liquidativo	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles)	% del valor liquidativo
Bonos y pagarés corporativos (continuación)					
Estados Unidos — (continuación)					
1.000 Occidental Petroleum Corp, 4.400 %, con vencimiento el 15/08/2049	716	0,07	70 T-Mobile USA Inc, 2.250%, vencimiento el 15/11/2031	5	0,01
220 ONEOK Inc, 5,550 %, con vencimiento el 01/11/2026	220	0,02	1.170 T-Mobile USA Inc, 2.700%, vencimiento el 15/03/2032	953	0,10
350 ONEOK Inc, 5,800 %, con vencimiento el 01/11/2030	351	0,04	220 T-Mobile USA Inc, 3.000%, vencimiento el 15/02/2041	156	0,02
720 ONEOK Inc, 6,050 %, con vencimiento el 01/09/2033	726	0,07	10 T-Mobile USA Inc, 3.300%, vencimiento el 15/02/2051	7	-
930 ONEOK Inc, 6,625 %, con vencimiento el 01/09/2053	939	0,09	850 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7.850%, vencimiento el 01/02/2026	889	0,09
1.000 Oracle Corp, 1.650%, vencimiento el 25/03/2026	912	0,09	560 Truist Financial Corp, 6,047 %, con vencimiento el 08/06/2027 *	560	0,06
90 Oracle Corp, 2.950%, vencimiento el 01/04/2030	78	0,01	340 Union Pacific Corp, 3.750%, vencimiento el 15/07/2025	331	0,03
430 Oracle Corp, 4.650%, vencimiento el 06/05/2030	413	0,04	820 Union Pacific Corp, 2.891 %, con vencimiento el 06/04/2036	649	0,07
1.390 Oracle Corp, 2.875 %, con vencimiento el 25/03/2031	1.175	0,12	1.010 Union Pacific Corp, 3.839%, vencimiento el 20/03/2060	776	0,08
300 Otis Worldwide Corp, 2.056 %, con vencimiento el 05/04/2025	284	0,03	470 Union Pacific Corp, 3.750%, vencimiento el 05/02/2070	343	0,03
310 Pacific Gas and Electric Co, 2.100%, con vencimiento el 01/08/2027	268	0,03	440 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, con vencimiento 15/04/2026	415	0,04
390 Pacific Gas and Electric Co, 2.500%, con vencimiento el 01/02/2031	305	0,03	690 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento 15/04/2029	614	0,06
80 Pacific Gas and Electric Co, 3.300%, con vencimiento el 01/08/2040	54	0,01	70 United Rentals North America Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/11/2027	65	0,01
190 Pacific Gas and Electric Co, 3.500%, con vencimiento el 01/08/2050	120	0,01	160 United Rentals North America Inc, 4,875 %, con vencimiento el 15/01/2028	152	0,02
90 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 15/02/2028	85	0,01	210 United Rentals North America Inc, 5,250 %, con vencimiento el 15/01/2030	200	0,02
560 PayPal Holdings Inc, 1,650 %, con vencimiento el 01/06/2025	525	0,05	1.370 United Rentals North America Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/02/2031	1.173	0,12
70 PepsiCo Inc, 2.625 %, con vencimiento el 19/03/2027	65	0,01	420 United Rentals North America Inc, 3,750 %, con vencimiento el 15/01/2032	354	0,04
320 PepsiCo Inc, 1.625 %, con vencimiento el 01/05/2030	264	0,03	660 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/12/2028	632	0,06
220 PepsiCo Inc, 2.875 %, con vencimiento el 15/10/2049	156	0,02	430 UnitedHealth Group Inc, 4,000 %, con vencimiento el 15/05/2029	411	0,04
620 Pfizer Inc, 2.625 %, con vencimiento el 01/04/2030	545	0,05	200 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, con vencimiento el 15/05/2030	167	0,02
580 Pfizer Inc, 1.700%, con vencimiento el 28/05/2030	478	0,05	110 UnitedHealth Group Inc, 2,300 %, con vencimiento el 15/05/2031	92	0,01
170 Pioneer Natural Resources Co, 1,125 %, con vencimiento el 15/01/2026	154	0,02	400 UnitedHealth Group Inc, 4,200 %, con vencimiento el 15/05/2032	378	0,04
270 Pioneer Natural Resources Co, 1,900 %, con vencimiento el 15/08/2030	218	0,02	160 UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, con vencimiento el 15/06/2048	136	0,01
470 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, con vencimiento el 15/01/2031	381	0,04	130 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, con vencimiento el 15/12/2048	114	0,01
250 PNC Bank NA, 3,875 %, con vencimiento el 10/04/2025	242	0,02	990 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, con vencimiento el 15/08/2049	769	0,08
310 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,812 %, con vencimiento el 12/06/2026 *	310	0,03	300 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2059	232	0,02
1.070 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,582 %, con vencimiento el 12/06/2029 *	1.062	0,11	80 UnitedHealth Group Inc, 3,125 %, con vencimiento el 15/05/2060	53	0,01
240 Principal Life Global Funding II, 144A, 1,250 %, con vencimiento el 23/06/2025	221	0,02	1.410 US Bancorp, 1,450 %, con vencimiento el 12/05/2025	1.319	0,13
120 Procter & Gamble Co/The, 2,800 %, con vencimiento el 25/03/2027	113	0,01	90 US Bancorp, Serie mtn, 2,215 %, con vencimiento el 27/01/2028 *	80	0,01
340 Procter & Gamble Co/The, 3,000 %, con vencimiento el 25/03/2030	311	0,03	500 US Bancorp, 5,775 %, con vencimiento el 12/06/2029 *	499	0,05
3.900 Prologis LP, 1,250 %, con vencimiento el 15/10/2030	3.007	0,30	260 US Bancorp, 5,836 %, con vencimiento el 12/06/2034 *	260	0,03
200 Range Resources Corp, 4,875 %, con vencimiento 15/05/2025	196	0,02	410 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 01/11/2033	334	0,03
60 Republic Services Inc, 2,500 %, con vencimiento el 15/08/2024	58	0,01	260 Verizon Communications Inc, 2,625 %, con vencimiento el 15/08/2026	242	0,02
140 Salesforce Inc, 3,700 %, con vencimiento el 11/04/2028	134	0,01	190 Verizon Communications Inc, 3,000 %, con vencimiento el 22/03/2027	177	0,02
80 Santander Holdings USA Inc, 4,500 %, con vencimiento el 17/07/2025	78	0,01	580 Verizon Communications Inc, 2,100 %, con vencimiento el 22/03/2028	507	0,05
322 Schlumberger Holdings Corp, 3,900 %, con vencimiento el 17/05/2028	306	0,03	962 Verizon Communications Inc, 4,329 %, con vencimiento el 21/09/2028	922	0,09
430 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, con vencimiento el 01/03/2032	487	0,05	190 Verizon Communications Inc, 3,875 %, con vencimiento el 08/02/2029	178	0,02
20 Southwestern Energy Co, 5,375 %, con vencimiento el 01/02/2029	19	-	500 Verizon Communications Inc, 3,150 %, con vencimiento el 22/03/2030	439	0,04
160 Southwestern Energy Co, 5,375 %, con vencimiento el 15/03/2030	150	0,02	630 Verizon Communications Inc, 1,750 %, con vencimiento el 20/01/2031	491	0,05
250 Southwestern Energy Co, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2032	222	0,02	544 Verizon Communications Inc, 2,550 %, con vencimiento el 21/03/2031	448	0,04
552 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 20/09/2025	553	0,06	1.060 Verizon Communications Inc, 4,500 %, con vencimiento el 10/08/2033	980	0,10
20 Sprint Capital Corp, 6,875 %, con vencimiento el 15/11/2028	21	-	580 Verizon Communications Inc, 5,250 %, con vencimiento el 16/03/2037	565	0,06
655 Sprint Capital Corp, 8,750 %, con vencimiento el 15/03/2032	781	0,08	670 Verizon Communications Inc, 2,650 %, con vencimiento el 20/11/2040	448	0,04
10 Sprint LLC, 7,875 %, con vencimiento el 15/09/2023	10	-	180 Verizon Communications Inc, 3,400 %, con vencimiento el 22/03/2041	134	0,01
220 Sprint LLC, 7,625 %, con vencimiento el 15/02/2025	225	0,02	510 Verizon Communications Inc, 3,850 %, con vencimiento el 01/11/2042	396	0,04
370 Targa Resources Corp, 5,200 %, con vencimiento el 01/07/2027	366	0,04	430 Verizon Communications Inc, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2046	342	0,03
240 Targa Resources Corp, 4,200 %, con vencimiento el 01/02/2033	212	0,02	550 Verizon Communications Inc, 4,862 %, con vencimiento el 21/08/2046	484	0,05
150 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,000 %, con vencimiento el 15/01/2028	144	0,01	50 Verizon Communications Inc, 5,500 %, con vencimiento el 16/03/2047	48	0,01
290 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500 %, con vencimiento el 01/03/2030	278	0,03	270 Verizon Communications Inc, 4,000 %, con vencimiento el 22/03/2050	207	0,02
490 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, con vencimiento el 01/02/2031	451	0,05	60 Verizon Communications Inc, 2,875 %, con vencimiento el 20/11/2050	37	-
200 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, con vencimiento el 15/01/2032	173	0,02	690 Verizon Communications Inc, 3,550 %, con vencimiento el 22/03/2051	484	0,05
16 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, con vencimiento el 16/12/2039	18	-	200 Vertiv Group Corp, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 15/11/2028	180	0,02
300 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 4,900 %, con vencimiento el 15/09/2044	270	0,03	770 Visa Inc, 3,150 %, con vencimiento el 14/12/2025	739	0,07
30 Tenet Healthcare Corp, 4,375 %, con vencimiento el 15/01/2030	27	-	640 Visa Inc, 4,300 %, con vencimiento el 14/12/2045	579	0,06
160 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, con vencimiento el 01/03/2030	137	0,01	300 Walmart Inc, 1,500 %, con vencimiento el 22/09/2028	259	0,03
380 Texas Instruments Inc, 1,750 %, con vencimiento el 04/05/2030	317	0,03	150 Walmart Inc, 1,800 %, con vencimiento el 22/09/2031	123	0,01
980 The Vanguard Group Inc, 3,050 %, con vencimiento el 22/08/2050 t=	604	0,06	170 Walt Disney Co/The, 6,650 %, con vencimiento el 15/11/2037	192	0,02
85 Time Warner Cable Enterprises LLC, 8,375 %, con vencimiento el 15/07/2033	95	0,01	510 Warnermedia Holdings Inc, 6,412 %, con vencimiento el 15/03/2026	511	0,05
182 Time Warner Cable LLC, 6,550 %, con vencimiento el 01/05/2037	173	0,02	300 Warnermedia Holdings Inc, 3,755 %, con vencimiento el 15/03/2027	281	0,03
420 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, con vencimiento el 01/07/2038	426	0,04	370 Warnermedia Holdings Inc, 4,054 %, con vencimiento el 15/03/2029	340	0,03
560 Time Warner Cable LLC, 5,875 %, con vencimiento el 15/11/2040	488	0,05	640 Warnermedia Holdings Inc, 4,279 %, con vencimiento el 15/03/2032	565	0,06
50 TJX Cos Inc/The, 2,250 %, con vencimiento el 15/09/2026	46	-	130 Warnermedia Holdings Inc, 5,050 %, con vencimiento el 15/03/2042	107	0,01
1.660 T-Mobile USA Inc, 3.500 %, con vencimiento el 15/04/2025	1.606	0,16	600 Warnermedia Holdings Inc, 5,141 %, con vencimiento el 15/03/2052	479	0,05
148 T-Mobile USA Inc, 2.250 %, con vencimiento el 15/02/2026	148	0,01	240 Wells Fargo & Co, 3,750 %, con vencimiento el 24/01/2024	238	0,02
120 T-Mobile USA Inc, 3.750 %, con vencimiento el 15/04/2027	114	0,01	1.150 Wells Fargo & Co, 2,188 %, con vencimiento el 30/04/2026 *	1.082	0,11
520 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, con vencimiento el 15/02/2029	451	0,05			
1.720 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/04/2030	1.571	0,16			
450 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, con vencimiento el 15/02/2031	371	0,04			
380 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, con vencimiento el 15/02/2031	320	0,03			
270 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, con vencimiento el 15/04/2031	236	0,02			

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo
Bonos y pagarés corporativos (continuación)					
Estados Unidos — (continuación)			Nigeria — 0,03% (28 de febrero de 2023: 0,02%)		
870 Wells Fargo & Co, 3.000%, vencimiento el 23/10/2026	806	0,08	300 Bono internacional del Estado de Nigeria, 144A, 6,500 %, con vencimiento 28/11/2027	258	0,03
880 Wells Fargo & Co, 4.300%, vencimiento el 22/07/2027	843	0,08	Panamá — 0,12% (28 de febrero de 2023: 0,10%)		
560 Wells Fargo & Co, 3.584%, vencimiento el 22/05/2028 *	520	0,05	670 Bono Internacional del Estado de Panamá, 2,252 %, con vencimiento el 29/09/2032	510	0,05
750 Wells Fargo & Co, 2.393%, vencimiento el 02/06/2028 *	668	0,07	950 Bono Internacional del Estado de Jordania, 4,500 %, con vencimiento el 01/04/2056	692	0,07
370 Wells Fargo & Co, 4.150%, vencimiento el 24/01/2029	349	0,04	Paraguay — 0,04 % (28 de febrero de 2023: 0,04%)		
320 Wells Fargo & Co, 5.574%, vencimiento el 25/07/2029 *	319	0,03	470 Bono Internacional del Estado de Paraguay, 144A, 3,849 %, con vencimiento el 28/06/2033	402	0,04
1.040 Wells Fargo & Co, 2.879%, vencimiento el 30/10/2030 *	890	0,09	Perú — 0,10% (28 de febrero de 2023: 0,10%)		
620 Wells Fargo & Co, 4.478%, vencimiento el 04/04/2031 *	580	0,06	730 Peruvian Government International Bond, 2.783%, vencimiento el 23/01/2031	621	0,06
330 Wells Fargo & Co, 3.350%, vencimiento el 02/03/2033 *	278	0,03	380 Peruvian Government International Bond, 5.625%, vencimiento el 18/11/2050	379	0,04
410 Wells Fargo & Co, 5.557%, vencimiento el 25/07/2034 *	405	0,04	Rusia — 0,41% (28 de febrero de 2023: 0,08%)		
580 Wells Fargo & Co, 4.900%, vencimiento el 17/11/2045	498	0,05	16.270 RUB Bono Federal Ruso – OFZ, 0,000 %, con vencimiento el 16/09/2026 ty	51	-
720 Wells Fargo & Co, 4.400%, vencimiento el 14/06/2046	571	0,06	RUB 89.250 Bono Federal Ruso – OFZ, 0,000 %, con vencimiento el 03/02/2027 ty	279	0,03
1.200 Wells Fargo & Co, 4.750%, vencimiento el 07/12/2046	999	0,10	RUB 203.271 Bono Federal Ruso – OFZ, 0,000 %, con vencimiento el 19/01/2028 ty	636	0,06
5.340 Wells Fargo & Co, 5.013%, vencimiento el 04/04/2051 *	4.826	0,48	RUB 436.124 Bono Federal Ruso – OFZ, 0,000 %, con vencimiento el 23/05/2029 ty	1.365	0,14
130 Wells Fargo & Co, Series U, 5.875%, Perpetuo *	129	0,01	RUB 232.730 Bono Federal Ruso – OFZ, 0,000 %, con vencimiento el 10/04/2030 ty	728	0,07
460 Western Midstream Operating LP, 3,100 %, vencimiento el 01/02/2025	441	0,04	Bonos y obligaciones del Estado (continuación)		
110 Western Midstream Operating LP, 4,500 %, vencimiento el 01/03/2028	104	0,01	Rusia — (continuación)		
1.340 Western Midstream Operating LP, 4,050 %, vencimiento el 01/02/2030	1.197	0,12	RUB 22.030 Bono Federal Ruso – OFZ, 0,000 %, con vencimiento el 10/05/2034 ty	59	0,01
40 Western Midstream Operating LP, 5,300 %, vencimiento el 01/03/2048	33	-	RUB 382.680 Bono Federal Ruso - OFZ, 0,000 %, con vencimiento el 16/03/2039 ty	1.018	0,10
250 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, con vencimiento el 15/08/2048	208	0,02	Estados Unidos — 7,29% (28 de febrero de 2023: 16,97%)		
310 Western Midstream Operating LP, 5,250 %, vencimiento el 01/02/2050	251	0,03	1.440 Federal National Mortgage Association, 6,625 %, con vencimiento el 15/11/2030	1.640	0,16
350 Williams Cos Inc/The, Serie A, 7,500 %, con vencimiento el 15/01/2031	384	0,04	13.460 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1.125%, vencimiento el 15/01/2033 β	12.864	1,29
760 Williams Cos Inc/The, 7,750 %, con vencimiento el 15/06/2031	835	0,08	7.480 United States Treasury Note/Bond, 4.375%, vencimiento el 15/08/2043	7.461	0,75
718 Williams Cos Inc/The, 8,750 %, con vencimiento el 15/03/2032	842	0,08	1.630 United States Treasury Note/Bond, 3.000%, vencimiento el 15/02/2048	1.294	0,13
110 Wyeth LLC, 5.950%, vencimiento el 01/04/2037	118	0,01	1.510 United States Treasury Note/Bond, 3.375%, vencimiento el 15/11/2048	1.284	0,13
	271.019	27,10	5.770 United States Treasury Note/Bond, 3.000%, vencimiento el 15/02/2049	4.581	0,46
Zambia — 0,07% (28 de febrero de 2023: 0,06%)			900 United States Treasury Note/Bond, 2.875%, vencimiento el 15/05/2049	698	0,07
680 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, vencimiento el 15/10/2027	663	0,07	5.320 United States Treasury Note/Bond, 2.000%, vencimiento el 15/02/2050	3.408	0,34
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 401.3645)			9.430 United States Treasury Note/Bond, 1.250%, vencimiento el 15/05/2050	4.931	0,49
	357.924	35,79	15.600 United States Treasury Note/Bond, 1.375%, vencimiento el 15/08/2050 ≠	8.434	0,84
Bonos y obligaciones del Estado — 14,64% (28 de febrero de 2023: 23,40%)			1.270 United States Treasury Note/Bond, 1.625%, vencimiento el 15/11/2050	735	0,07
Argentina — 0,21 % (28 de febrero de 2023: 0,18%)			14.670 United States Treasury Note/Bond, 1.875%, vencimiento el 15/02/2051	9.052	0,91
212 Bono Internacional de la República Argentina, 1,000 %, vencimiento 09/07/2029	69	0,01	11.000 United States Treasury Note/Bond, 2.375%, vencimiento el 15/05/2051 ≠	7.648	0,76
596 Bono Internacional de la República Argentina, 0,750%, vencimiento 09/07/2030	200	0,02	7.650 United States Treasury Note/Bond, 2.000%, vencimiento el 15/08/2051	4.858	0,49
1.062 Bono Internacional de la República Argentina, 3,625 %, vencimiento 09/07/2035	316	0,03	4.679 United States Treasury Note/Bond, 1.875%, vencimiento el 15/11/2051	2.876	0,29
1.850 Bono Internacional de la República Argentina, 3,500 %, vencimiento 09/07/2041	576	0,06	810 United States Treasury Note/Bond, 3.625%, vencimiento el 15/02/2053	730	0,07
1.680 Bonos del Gobierno de la Provincia de Buenos Aires, 6,375 %, con vencimiento el 01/09/2037	640	0,06	470 United States Treasury Note/Bond, 3.625%, vencimiento el 15/05/2053	424	0,04
757 Bonos del Gobierno de la Provincia de Buenos Aires, 144A, 6,375%, vencimiento 01/09/2037	289	0,03	Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 195.6175)		
	2.090	0,21	Obligaciones de préstamo — 3,25% (28 de febrero de 2023: 4,08%)		
Brasil — 1,14 % (28 de febrero de 2023: 1,02%)			554 Air Canada, 9,128 %, con vencimiento el 27/07/2028 *	556	0,06
14.000 BRL Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2027	2.799	0,28	562 Ali Group S.R.L., 7,446 %, con vencimiento el 13/10/2028 *	563	0,06
BRL 17.099 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2033	3.243	0,32	546 Alterra Mountain Co, 8,946 %, con vencimiento el 30/07/2028 *	548	0,06
6.000 Bono internacional del Estado de Brasil, 5,000 %, con vencimiento el 27/01/2045	4.685	0,47	445 AmWINS Group, Inc., 7,696 %, con vencimiento el 17/02/2028 *	445	0,04
880 Bono internacional del Estado de Brasil, 4,750 %, con vencimiento el 14/01/2050	649	0,07	614 API Group Inc, 7,946 %, con vencimiento el 01/10/2026 *	616	0,06
	11.376	1,14	90 Asplundh Tree Expert LLC, 7,181 %, con vencimiento el 04/09/2027 *	90	0,01
Colombia — 0,20% (28 de febrero de 2023: 0,17%)			768 Asurion LLC, 8,788 %, con vencimiento el 18/12/2026 *	748	0,08
890 Colombia Government International Bond, 3.250%, vencimiento el 22/04/2032	669	0,07	1.074 Asurion LLC, 9,681 %, con vencimiento el 19/08/2028 *	1.040	0,10
900 Colombia Government International Bond, 4.125%, vencimiento el 22/02/2042	585	0,06	746 Brown Group Holding LLC, 7,820 %, con vencimiento el 07/06/2028 *	738	0,07
990 Colombia Government International Bond, 5.625%, vencimiento el 26/02/2044	753	0,07	90 Caesars Entertainment, 8,681 %, con vencimiento el 25/01/2030 *	90	0,01
	2.007	0,20	106 Castlelake Aviation Ltd, 8,302 %, con vencimiento el 22/10/2026 *	106	0,01
Indonesia — 1,09 % (28 de febrero de 2023: 0,93%)			196 Charter Communications Operating LLC, 7,116 %, con vencimiento el 01/02/2027 *	195	0,02
610 Bono internacional del Estado de Indonesia, 3,700 %, con vencimiento el 30/10/2049	467	0,04	896 Citadel Securities, 7,888 %, con vencimiento el 25/07/2030 *	894	0,09
IDR 159.624.000 Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR91, 6,375 %, con vencimiento el 15/04/2032	10.476	1,05	1.174 DCert Buyer, Inc., 9,331 %, con vencimiento el 16/10/2026 *	1.171	0,12
	10.943	1,09	1.021 Deerfield Dakota Holding LLC, 8,992 %, con vencimiento el 05/03/2027 *	988	0,10
Israel — 0,08% (28 de febrero de 2023: 0,08%)			262 Energizer Holdings, Inc., 7,679 %, con vencimiento el 16/12/2027 *	262	0,03
650 Israel Government International Bond, 2,750%, vencimiento 03/07/2030	568	0,05			
390 Estado de Israel, 3,375%, con vencimiento el 15/01/2050	277	0,03			
	845	0,08			
Kenia — 0,17 % (28 de febrero de 2023: 0,15%)					
2.270 Bono internacional de la República de Kenia, 144A, 6,300 %, con vencimiento el 23/01/2034	1.650	0,17			
México — 3,76% (28 de febrero de 2023: 3,56%)					
37.380 MXN Bonos Mexicanos, Serie M, 8,500 %, con vencimiento el 31/05/2029	2.113	0,21			
MXN 194.400 Bonos Mexicanos, Series M, 7,750 %, con vencimiento el 23/11/2034	10.217	1,02			
MXN 232.457 Bonos Mexicanos, Series M, 7,750 %, vencimiento 13/11/2042	11.651	1,16			
MXN 220.640 Bonos Mexicanos, Series M, 8,000 %, vencimiento 07/11/2047	11.259	1,13			
2.710 Mexico Government International Bond, 4,600%, vencimiento el 10/02/2048	2.185	0,22			
190 Mexico Government International Bond, 5,750%, vencimiento el 12/10/2110	167	0,02			

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo	Contratos (miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo
256 Eyecare Partners LLC, 9,253 %, con vencimiento el 20/02/2027 *	204	0,02			
232 First Eagle Holdings Inc, 8,038 %, con vencimiento el 17/02/2027 *	228	0,02			
857 Focus Financial Partners LLC, 8,581 %, con vencimiento el 30/06/2028 *	856	0,09			
1.836 Gainwell Acquisition Corp, 9,342 %, con vencimiento el 01/10/2027 *	1.811	0,18			
350 Garda World Security Corp, 9,668 %, con vencimiento el 30/10/2026 *	351	0,03			
1.325 Gen Digital Inc, 7,431 %, con vencimiento el 12/09/2029 *	1.325	0,13			
1.897 Genesee & Wyoming Inc, 7,342 %, con vencimiento el 30/12/2026 *	1.899	0,19			
59 GFL Environmental Inc, 8,469 %, con vencimiento el 31/05/2027 *	59	0,01			
1.060 Grifols Worldwide Operations USA Inc, 7,481 %, con vencimiento el 15/11/2027 *	1.048	0,10			
283 GVC Holdings Gibraltar Ltd, 7,437 %, con vencimiento el 16/03/2027 *	284	0,03			
861 Harbor Freight Tools USA Inc, 8,196 %, con vencimiento el 19/10/2027 *	858	0,09			
1.405 Hilton Worldwide Finance LLC, 7,165 %, con vencimiento el 21/06/2026 *	1.406	0,14			
709 ICON Luxembourg S.a.r.l., 7,753 %, con vencimiento el 01/07/2028 *	711	0,07			
177 Indigo Merger Sub, Inc., 7,753 %, con vencimiento el 01/07/2028 *	177	0,02			
229 Mozart Borrower LP, 8,696 %, con vencimiento el 30/09/2028 *	229	0,02			
264 PCI Gaming Authority, 7,946 %, con vencimiento el 31/05/2026 *	264	0,03			
619 Phoenix Guarantor Inc, 8,696 %, con vencimiento el 05/03/2026 *	616	0,06			
793 Prime Security Installations Ltd, 8,182 %, con vencimiento el 23/09/2026 *	795	0,08			
349 Project Sky Merger Sub, Inc., 9,181 %, con vencimiento el 10/08/2028 *	342	0,03			
612 Quikrete Holdings, Inc., 8,320 %, con vencimiento el 11/06/2028 *	613	0,06			
219 Rackspace Technology Global, Inc, 8,177 %, con vencimiento el 09/02/2028 *	99	0,01			
1.420 Setanta Aircraft Leasing DAC, 7,538 %, con vencimiento el 05/11/2028 *	1.422	0,14			
1.258 SkyMiles IP Ltd, 9,076 %, con vencimiento el 16/09/2027 *	1.310	0,13			
1.400 Sotera Health, 8,196 %, con vencimiento el 13/12/2026 *	1.388	0,14			
1.278 Station Casinos LLC, 7,681 %, con vencimiento el 08/02/2027 *	1.276	0,13			
470 Terrier Media Buyer, Inc., 8,842 %, con vencimiento el 17/12/2026 *	438	0,04			
9 Triton Water Holdings, Inc., 8,753 %, con vencimiento el 16/03/2028 *	9	-			
1.063 UFC Holdings LLC, 8,369 %, con vencimiento el 29/04/2026 *	1.065	0,11			
864 United Airlines Inc, 9,292 %, con vencimiento el 14/04/2028 *	867	0,09			
1.472 Virgin Media Bristol LLC, 7,925 %, con vencimiento el 04/01/2028 *	1.434	0,14			
Total de obligaciones de préstamo (coste 32.727\$)	32.434	3,25			
Acciones ordinarias — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
Suiza — 0,00% (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
2.840 Credit Suisse Group AG Escrow †	-	-			
Total de acciones ordinarias (coste de - USD)	-	-			
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 1 148 170 USD)	1.007.788	100,78			
Contratos (miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo			
Opciones compradas — 0,23% (28 de febrero de 2023: 0,05%)					
- 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures December 2023 Put 95.8750, con vencimiento el 15/12/2023 - Morgan Stanley	176	0,02			
- 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures December 2023 Put 96.00, con vencimiento el 15/12/2023 - Morgan Stanley	501	0,05			
- 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures October 2023 Put 97.00, con vencimiento el 13/10/2023 - Morgan Stanley	651	0,06			
- CME 3 Month SOFR Futures March 2024 Call 95.25, con vencimiento el 15/03/2024 - Morgan Stanley	43	-			
- CME 3 Month SOFR Futures September 2023 Call 96.00, con vencimiento el 15/09/2023 - Morgan Stanley	-	-			
- U.S. 10 Year October 2023 Call 110.50, con vencimiento el 22/09/2023 - Morgan Stanley	63	0,01			
- U.S. 10 Year October 2023 Call 111.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Morgan Stanley	46	-			
- U.S. 5 Year October 2023 Call 106.50, con vencimiento el 22/09/2023 - Morgan Stanley	89	0,01			
- U.S. 5 Year October 2023 Call 107.25, con vencimiento el 22/09/2023 - Morgan Stanley	69	0,01			
- U.S. Bond October 2023 Call 119.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Morgan Stanley	186	0,02			
- U.S. Bond October 2023 Call 120.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Morgan Stanley	77	0,01			
- U.S. Bond October 2023 Call 121.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Morgan Stanley	194	0,02			
- U.S. Bond October 2023 Call 121.50, con vencimiento el 22/09/2023 - Morgan Stanley	68	0,01			
- U.S. Bond October 2023 Call 122.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Morgan Stanley	23	-			
10.370 USD Put/AUD Call 0.67, vencimiento 03/11/2023 -JP Morgan	56	0,01			
5.227 USD Put/MXN Call 16.9310, con vencimiento el 06/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	14	-			
Total de opciones compradas (coste 1.698\$)	2.256	0,23			
Swaps de incumplimiento de crédito — (0,27%) (28 febrero de 2023: 0,19%)					
Apresiasi latente sobre contratos (véase más abajo)	2.759	0,27			

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Contratos (miles)	Valor (en miles \$)	% del valor liquidativo		
Opciones suscritas — (0,16%) (28 de febrero de 2023: 0,06%)				
- 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures December 2023 Put 95.25, con vencimiento el 15/12/2023 - Morgan Stanley	(102)	(0,01)		
(1) 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures December 2023 Put 95.3750, con vencimiento el 15/12/2023 - Morgan Stanley	(319)	(0,03)		
- 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures October 2023 Put 96.25, con vencimiento el 13/10/2023 - Morgan Stanley	(275)	(0,03)		
- 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures October 2023 Put 96.50, con vencimiento el 13/10/2023 - Morgan Stanley	(394)	(0,04)		
- CME 3 Month SOFR Futures March 2024 Call 96.1250, con vencimiento el 15/03/2024 - Morgan Stanley	(44)	(0,01)		
- CME 3 Month SOFR Futures September 2023 Call 96.75, con vencimiento el 15/09/2023 - Morgan Stanley	(1)	-		
- U.S. 10 Year November 2023 Call 112.00, con vencimiento el 27/10/2023 - Morgan Stanley	(67)	(0,01)		
- U.S. 10 Year November 2023 Put 107.50, con vencimiento el 27/10/2023 - Morgan Stanley	(13)	-		
- U.S. 10 Year November 2023 Put 108.00, con vencimiento el 27/10/2023 - Morgan Stanley	(16)	-		
- U.S. 10 Year October 2023 Call 111.75, con vencimiento el 22/09/2023 - Morgan Stanley	(37)	-		
- U.S. 10 Year October 2023 Call 112.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Morgan Stanley	(20)	-		
- U.S. 10 Year October 2023 Call 112.50, con vencimiento el 22/09/2023 - Morgan Stanley	(28)	-		
- U.S. 10 Year October 2023 Put 109.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Morgan Stanley	(10)	-		
- U.S. 5 Year October 2023 Put 105.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Morgan Stanley	(3)	-		
- U.S. Bond October 2023 Call 123.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Morgan Stanley	(33)	-		
- U.S. Bond October 2023 Call 124.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Morgan Stanley	(44)	(0,01)		
- U.S. Bond October 2023 Put 117.00, con vencimiento el 22/09/2023 - Morgan Stanley	(3)	-		
(14.030) USD Put/MXN Call 17.0655, vencimiento 11/10/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(179)	(0,02)		
Total de opciones suscritas (coste: [1.280] USD)	(1.588)	(0,16)		
Swaps de incumplimiento de crédito: (0,02%) (28 febrero de 2023: 0,01%)				
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(222)	(0,02)		
Swaps sobre índices — 0,02 % (28 de febrero de 2023: 0,04%)				
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(253)	(0,02)		
Swaps de tasas de interés: (0,13%) (28 de febrero de 2023: 0,11%)				
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(1.274)	(0,13)		
Contratos de divisas a plazo — (0,20%) (28 de febrero de 2023: 0,23%)				
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(2.005)	(0,20)		
Futuros — (0,15%) (28 de febrero de 2023: 0,32%)				
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(1.496)	(0,15)		
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias			(6.838)	(0,68)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias			1.015.776	101,58
Excedente de pasivos respecto a otros activos			(15.747)	(1,58)
Patrimonio			1.000.029\$	100,00

ABREVIATURAS:

Perpetuo	- Un bono sin fecha de vencimiento. Los bonos perpetuos no son rescatables, pero pagan un flujo constante de intereses.
REMIC	- Conducto de inversiones hipotecarias inmobiliarias.
TBA	- Pendiente de anuncio.
BRL	- Real brasileño
IDR	- Rupia indonesia
MXN	- peso mexicano
RUB	- Rublo ruso

Análisis del total de activos		% del total de activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado		92,40
Otros valores mobiliarios negociables en otro mercado regulado		3,07
Instrumentos financieros derivados		1,40
Otros activos		3,13
Total de activos		100,00

- Los importes designados como “-” son 0 \$, menos de 1000 \$, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.
- 144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. Al 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 126 582 000 USD o el 12,70 % del patrimonio neto.
- * Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.
- † Poca liquidez.
- ∞ El título es valorado de buena fe y a un valor razonable por el Comité de Valoración o según el criterio de este.
- ε El valor se encuentra en mora a 31 de agosto de 2023 (ya sea capital y/o interés).
- ≠ Valor (total o parcial) pignorado como garantía para la negociación de derivados a 31 de agosto de 2023.
- ± Títulos adquiridos siguiendo la norma “se anunciará”.
- β El tipo de interés sobre esta clase de título está vinculado al índice de precios de consumo (IPC)/índice de precios minoristas (Retail Price Index, RPI). El tipo del cupón es el tipo a 31 de agosto de 2023.
- γ El valor ya no acumula ingresos durante y/o después del período financiero finalizado el 31 de agosto de 2023 debido a la incertidumbre de los pagos de intereses.

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Listado de swaps de incumplimiento de crédito

Contraparte	Entidad de Referencia – Protección Compra/Venta	Fecha de vencimiento	Importe teórico (en miles)	Valor (en miles)
Morgan Stanley	CDX.NA.HY, 5,000 % - Comprar	20 jun. 2028	7.385	USD (207)
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % - Vender	20 jun. 2033	3.640	(15)
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % - Vender	20 jun. 2028	178.551	2.759
Apreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 febrero de 2023 [miles]: 2.240\$)				USD 2.759
Depreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 febrero de 2023 [miles]: \$(158))				(222)
Apreciación neta de swaps de incumplimiento de crédito (28 febrero de 2023 [miles]: 2.082\$)				USD 2.537

Listado de swaps de tipos de interés

Contraparte	Tipo	Fecha de vencimiento	Importe teórico (en miles)	Valor (en miles)
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI Banxico, Receive Fixed 10,230 %	02 ene. 2029	82.920	USD (222)
Morgan Stanley	Pay Floating MXN TIE Banxico, Receive Fixed 7,450%	18 jul. 2029	142.060	(513)
Morgan Stanley	Pay Floating MXN TIE Banxico, Receive Fixed 7,440%	20 jul. 2029	147.960	(539)
Apreciación latente de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 [miles]: USD-)				USD -
Depreciación latente de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(1.287))				(1.274)
Depreciación neta de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(1.287))				USD (1.274)

Listado de swaps de índices

Contraparte	Entidad de referencia	Fecha de vencimiento	Importe teórico (en miles)	Valor (en miles)
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,500%, Receive Floating USD Sofr Compound	21 abr. 2052	86	USD 16
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,600%, Receive Floating USD Sofr Compound	15 feb. 2048	6.547	1.100
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,850%, Receive Floating USD Sofr Compound	15 feb. 2029	966	53
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,050%, Receive Floating USD Sofr Compound	15 feb. 2048	44.763	4.314
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,850%, Receive Floating USD Sofr Compound	30 jun. 2029	30.262	169
Morgan Stanley	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 4,180 %	29 feb. 2028	140.700	1.058
Morgan Stanley	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 3,500%	30 sep. 2024	13.390	(253)
Apreciación latente de swaps de índices (28 de febrero de 2023 [miles]: 6.036\$)				USD 6.710
Depreciación latente de swaps de índices (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(422))				(253)
Apreciación neta de swaps de índices (28 de febrero de 2023 [miles]: 5.614\$)				USD 6.457

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)		Moneda de venta (en miles)		Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
07 sep. 2023	Bank of America Merrill Lynch	Compra	USD 1.443	Venta	MXN 25.059	USD (25)	
07 sep. 2023	Goldman Sachs	Compra	MXN 25.418	Venta	USD 1.464	26	
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	USD 15	Venta	AUD 23	-	
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	USD 882	Venta	EUR 808	5	
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	USD 1	Venta	GBP 1	-	
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	AUD 13	Venta	USD 8	-	
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	AUD 1.037	Venta	USD 678	(6)	
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	EUR 37.206	Venta	USD 40.926	(553)	
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	GBP 35	Venta	USD 46	-	
12 oct. 2023	Bank of America Merrill Lynch	Compra	MXN 65.485	Venta	USD 3.704	108	
20 oct. 2023	BNP Paribas	Compra	NOK 66.018	Venta	EUR 5.692	31	

Listado de contratos de divisas a plazo (continuación)

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)		Moneda de venta (en miles)		Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
20 oct. 2023	BNP Paribas	Compra	CAD 24.270	Venta	USD 18.313	(338)	
20 oct. 2023	BNP Paribas	Compra	AUD 13.031	Venta	USD 8.696	(237)	
20 oct. 2023	Goldman Sachs	Compra	USD 2.334	Venta	MXN 40.567	(23)	
20 oct. 2023	JP Morgan	Compra	USD 5.210	Venta	CNH 37.268	75	
20 oct. 2023	JP Morgan	Compra	USD 1.551	Venta	IDR 23.418.528	15	
20 oct. 2023	JP Morgan	Compra	ZAR 29.450	Venta	USD 1.552	-	
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD 13.195	Venta	CNH 94.905	118	
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD 7.133	Venta	GBP 5.511	151	
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	JPY 2.944.327	Venta	USD 21.129	(727)	
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	INR 156.175	Venta	USD 1.890	(4)	
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	EUR 3.034	Venta	USD 3.350	(52)	
06 nov. 2023	JP Morgan	Compra	USD 3.714	Venta	AUD 5.660	38	
06 nov. 2023	Morgan Stanley	Compra	AUD 5.690	Venta	USD 3.735	(40)	
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 540\$)						USD 567	
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(2.578))						(2.005)	

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Listado de contratos de divisas a plazo (continuación)

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)	Moneda de venta (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(2.038))				USD (1.438)

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico(en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2023	Morgan Stanley	(240)	USD (56.760)	USD 121
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2024	Morgan Stanley	393	94.153	(43)
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2025	Morgan Stanley	196	47.238	49
Índice SOFR de 3 meses Junio 2023	Morgan Stanley	5	1.184	(23)
Bono a 10 años de Australia Septiembre 2023	Morgan Stanley	148	11.141	(13)
Euro FX Currency Septiembre 2023	Morgan Stanley	3	407	1
Euro-Bobl Diciembre de 2023	Morgan Stanley	50	6.369	29
Bonos Euro-Buxl a 30 años Diciembre de 2023	Morgan Stanley	(25)	(3.626)	(47)
Euro-OAT Ficiembre de 2023	Morgan Stanley	91	12.578	91
Bono a 10 años de Japón (OSE) Septiembre 2023	Morgan Stanley	(17)	(17.155)	136
Long Gilt Diciembre 2023	Morgan Stanley	60	7.264	68
U.S. 10 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Morgan Stanley	(72)	(7.994)	(61)
U.S. 10 Year Ultra Note Diciembre 2023	Morgan Stanley	(633)	(73.497)	(1.081)
U.S. 2 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Morgan Stanley	72	14.674	41
U.S. 5 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Morgan Stanley	(425)	(45.442)	(228)
U.S. Long Bond (CBT) Diciembre 2023	Morgan Stanley	315	38.332	526
U.S. Ultra Bond (CBT) Diciembre 2023	Morgan Stanley	554	71.726	1.472
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): 2.474\$				USD 2.534
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(3.625)				(1.496)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(1.151)				USD 1.038

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) EUR	% del valor liquidativo	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) EUR	% del valor liquidativo
Bonos y pagarés corporativos (continuación)					
Estados Unidos — (continuación)					
USD	76	0,08	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 20/10/2025		
USD	90	0,09	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 20/10/2028		
	430		DH Europe Finance II Sarl, 1,800 %, con vencimiento el 18/09/2049		
USD	30	0,31	Diamondback Energy Inc, 3,500%, vencimiento el 01/12/2029		
USD	130	0,12	Energy Transfer LP, 5,950 %, con vencimiento el 01/10/2043		
USD	60	0,04	Exxon Mobil Corp, 3,452 %, con vencimiento el 15/04/2051		
USD	60	0,05	Ford Motor Co, 3,250 %, con vencimiento el 12/02/2032		
USD	200	0,17	Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, con vencimiento el 13/11/2030		
USD	20	0,02	Freepport-McMoRan Inc, 4,625%, vencimiento el 01/08/2030		
USD	350	0,32	Freepport-McMoRan Inc, 5,450%, vencimiento el 15/03/2043		
USD	780	0,82	General Electric Co, 0,875 %, con vencimiento el 17/05/2025		
	260		Goldman Sachs Group Inc/The, 2,125%, vencimiento el 30/09/2024		
USD	50	0,05	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500%, vencimiento el 01/04/2025		
	1.290	1,067	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,875%, vencimiento el 09/05/2029		
USD	20	0,02	Humana Inc, 2,150%, vencimiento el 03/02/2032		
	1.130	1,116	JPMorgan Chase & Co, 0,625%, vencimiento el 25/01/2024		
USD	60	0,05	JPMorgan Chase & Co, 2,522%, vencimiento el 22/04/2031 *		
USD	110	0,08	JPMorgan Chase & Co, 3,109%, vencimiento el 22/04/2051 *		
	400	0,375	McDonald's Corp, 1,875%, vencimiento el 26/05/2027		
USD	230	0,21	Morgan Stanley, 3,622 %, con vencimiento el 01/04/2031 *		
	100	0,106	Morgan Stanley, 5,148 %, con vencimiento el 25/01/2034 *		
	320	0,316	Netflix Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/11/2029		
	180	0,174	Netflix Inc, 3,625 %, con vencimiento el 15/06/2030		
	190	0,168	Prologis Euro Finance LLC, 1,875 %, con vencimiento el 05/01/2029		
	700	0,57	Prologis Euro Finance LLC, 1,500 %, con vencimiento el 08/02/2034		
USD	180	0,16	Southwestern Energy Co, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2032		
USD	42	0,04	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 20/09/2025		
USD	40	0,04	State Street Corp, 3,152 %, con vencimiento el 30/03/2031 *		
USD	130	0,11	Targa Resources Corp, 4,950%, vencimiento el 15/04/2052		
USD	10	0,01	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, con vencimiento el 15/01/2032		
USD	10	0,01	T-Mobile USA Inc, 2,250%, vencimiento el 15/02/2026		
USD	30	0,03	T-Mobile USA Inc, 2,625%, vencimiento el 15/02/2029		
USD	110	0,10	T-Mobile USA Inc, 3,875%, vencimiento el 15/04/2030		
USD	30	0,03	T-Mobile USA Inc, 2,875%, vencimiento el 15/02/2031		
USD	40	0,04	T-Mobile USA Inc, 3,500%, vencimiento el 15/04/2031		
USD	10	0,01	United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 15/04/2026		
USD	150	0,14	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 15/04/2029		
USD	110	0,10	United Rentals North America Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/02/2031		
USD	20	0,02	UnitedHealth Group Inc, 3,750%, vencimiento el 15/07/2025		
USD	450	0,48	Wells Fargo & Co, 1,625%, vencimiento el 02/06/2025		
		12,155			13,46
Zambia — 0,21% (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
USD	200	0,21	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, con vencimiento el 01/06/2031		
		41,343			45,77
Bonos y obligaciones del Estado — 46,66% (28 de febrero de 2023: 51,32%)					
Austria — 2,42 % (28 de febrero de 2023: 2,40%)					
	2.590	2,189	Bono del Estado de la República de Austria, 144A, 0,900 %, con vencimiento el 20/02/2032		
Bélgica — 2,12% (28 de febrero de 2023: 2,12%)					
	1.830	1,919	Bono del Estado del Reino de Bélgica, Serie 71, 3,750 %, con vencimiento el 22/06/2045		
Francia — 11,17 % (28 de febrero de 2023: 11,80%)					
	4.210	3,442	Bono del Estado de la República Francesa OAT, 0,000 %, con vencimiento el 25/11/2030		
	1.890	1,474	Bono del Estado de la República Francesa OAT, 0,000 %, con vencimiento el 25/05/2032		
	3.545	3,482	Bono del Estado de la República Francesa OAT, 3,250 %, con vencimiento el 25/05/2045		
	590	397	Bono del Estado de la República Francesa OAT, 144A, 1,500 %, con vencimiento el 25/05/2050		
	400	446	Bono del Estado de la República Francesa OAT, 4,000 %, con vencimiento el 25/04/2060		
	1.000	846	UNEDIC ASSEO, 1,250 %, con vencimiento el 25/05/2033		
		10,087			11,17
Alemania — 6,83 % (28 de febrero de 2023: 11,53%)					
	970	904	Bundessobligation, Serie 183, 0,000 %, con vencimiento el 10/04/2026		
	580	493	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, con vencimiento el 15/08/2030		
	5.050	4,768	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, con vencimiento el 15/08/2032		
		6,165			6,83
Irlanda — 1,06% (28 de febrero de 2023: 1,03%)					
	1.190	955	Bono Internacional del Estado de Irlanda, 0,350 %, con vencimiento el 18/10/2032		
Italia — 5,97 % (28 de febrero de 2023: 6,17%)					
	1.670	1,484	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie 10Y, 2,500 %, con vencimiento el 01/12/2032		
	4.685	3,913	Italia Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie 31Y, 144A, 3,250 %, con vencimiento el 01/09/2046		
		5,397			5,97
México — 1,24% (28 de febrero de 2023: 1,91%)					
	1.530	1,123	Mexico Government International Bond, 2,875%, vencimiento el 08/04/2039		
					1,24
Países Bajos — 4,30% (28 de febrero de 2023: 4,24%)					
	4.660	3,887	Bono del Estado de los Países Bajos, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 15/07/2030		
					4,30
Polonia — 1,43 % (28 de febrero de 2023: 1,27%)					
	7.770	1,293	PLN Bono del Estado de la República de Polonia, Serie 0432, 1,750 %, con vencimiento el 25/04/2032		
					1,43
Sudáfrica — 1,36% (28 de febrero de 2023: 1,59%)					
USD	1 500	1,224	Bono Internacional del Estado de la República de Sudáfrica, 4,300 %, con vencimiento el 12/10/2028		
					1,36
Corea del Sur — 1,25% (28 de febrero de 2023: 0,84%)					
	1.150	1,126	Export-Import Bank of Korea, 0,375 %, con vencimiento el 26/03/2024		
					1,25
España — 5,03 % (28 de febrero de 2023: 5,75%)					
	1.080	1,020	Bono del Estado de España, 144A, 1,300 %, con vencimiento el 31/10/2026		
	1.210	1,121	Bono del Estado de España, 144A, 1,400 %, con vencimiento el 30/04/2028		
	890	754	Bono del Estado de España, 144A, 2,900 %, con vencimiento el 31/10/2046		
	2.050	1,646	Bono del Estado de España, Serie 30Y, 144A, 2,700 %, con vencimiento el 31/10/2048		
		4,541			5,03
Supranacional — 2,06% (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
	2.080	1,864	European Stability Mechanism, Serie EUR, 0,750 %, con vencimiento el 05/09/2028		
					2,06
Reino Unido — 0,42% (28 de febrero de 2023: 0,35%)					
	8	0,01	GBP United Kingdom Gilt, 2,500 %, con vencimiento el 22/07/2065		
GBP	290	368	United Kingdom Inflation-Linked Gilt, Serie 3MO, 0,125 %, con vencimiento el 22/03/2068 β		
		376			0,42
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 49.965€)					
			42,146		46,66
Organismos de inversión colectiva — 0,58% (28 de febrero de 2023: 0,50%)					
USD	564	520	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Clase WA (Reparto)		
			520		0,58
Total de organismos de inversión colectiva (coste: 508€)					
			520		0,58
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 97.472€)					
			86,466		95,73
Swaps de inflación — 0,02 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
			22		0,02
Apresiasi latente sobre contratos (véase más abajo)					
Contratos de divisas a plazo — 0,01% (28 de febrero de 2023: 0,05%)					
			4		0,01
Apresiasi latente sobre contratos (véase más abajo)					
Futuros — 0,36% (28 de febrero de 2023: 0,36%)					
			322		0,36
Apresiasi latente sobre contratos (véase más abajo)					
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias					
			86,814		96,12
Contratos de divisas a plazo — (0,20 %) (28 de febrero de 2023: 0,25%)					
			(179)		(0,20)
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)					
Futuros — (0,10%) (28 de febrero de 2023: 0,80%)					
			(91)		(0,10)
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)					
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias					
			(270)		(0,30)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias					
			86,544		95,82
Excedente de otros activos respecto a los pasivos					
			3,779		4,18
Patrimonio					
			90,323 €		100,00
— Los importes designados como “-” son 0 €, menos de 1000 €, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.					
144A	Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. Al 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 16 144 000 USD o el 17,87 % del patrimonio neto.				
*	Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.				
±	Títulos adquiridos siguiendo la norma “se anunciará”.				
β	El tipo de interés sobre esta clase de título está vinculado al índice de precios de consumo (IPC)/índice de precios minoristas (Retail Price Index, RPI). El tipo del cupón es el tipo a 31 de agosto de 2023.				

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

ABREVIATURAS:					% del total de activos
Perpetuo	– Un bono sin fecha de vencimiento. Los bonos perpetuos no son rescatables, pero pagan un flujo constante de intereses.				
TBA	– Pendiente de anuncio.				
GBP	– libra esterlina				
PLN	– Zloty polaco				
USD	– Dólar estadounidense				
Análisis del total de activos					
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado					94,13
Organismos de inversión colectiva					0,57
Instrumentos financieros derivados					0,38
Otros activos					4,92
Total de activos					100,00

Listado de swaps de inflación

Contraparte	Tipo	Fecha de vencimiento	Importe teórico (en miles)	Valor (en miles)
Bank of America Merrill Lynch	USD - IPC Consumidores urbanos	08 mar. 2053	930	€ -
Bank of America Merrill Lynch	EUR - Índice Armonizado de Precios de Consumo	15 mar. 2053	1.120	22
Apreciación latente de swaps de inflación (28 de febrero de 2023 [miles]: – €)				€ 22
Depreciación latente de swaps de inflación (28 de febrero de 2023 [miles]: – €)				-
Apreciación neta de swaps de inflación (28 de febrero de 2023 [miles]: – €)				€ 22

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)		Moneda de venta (en miles)		Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
16 nov. 2023	Citi	Compra	SEK 10.430	Venta	EUR 893	€ (14)
16 nov. 2023	Citi	Compra	EUR 122	Venta	JPY 18.900	2
16 nov. 2023	Goldman Sachs	Compra	EUR 68	Venta	CAD 100	-
16 nov. 2023	Goldman Sachs	Compra	EUR 451	Venta	GBP 391	(4)
16 nov. 2023	Goldman Sachs	Compra	EUR 70	Venta	GBP 60	-
16 nov. 2023	Goldman Sachs	Compra	EUR 3.212	Venta	USD 3.541	(41)
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	EUR 91	Venta	AUD 152	-
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	EUR 62	Venta	CAD 92	-
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	PLN 1.120	Venta	EUR 250	(2)
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	NOK 10.885	Venta	EUR 971	(29)
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	JPY 19.538	Venta	EUR 125	-
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	EUR 2.573	Venta	GBP 2.229	(21)
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	EUR 147	Venta	JPY 22.627	2
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	EUR 665	Venta	USD 733	(9)
16 nov. 2023	UBS	Compra	EUR 4.581	Venta	USD 5.050	(59)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): 72€						€ 4
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): (338) EUR						(179)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (266) EUR						€ (175)

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico(en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Euro-Bobl Diciembre de 2023	Bank of America Merrill Lynch	77	€ 9.045	€ 58
Euro-Bund diciembre de 2023	Bank of America Merrill Lynch	65	8.621	86
Bonos Euro-Buxl a 30 años Diciembre de 2023	Bank of America Merrill Lynch	(8)	(1.070)	(15)
Euro-Schatz diciembre de 2023	Bank of America Merrill Lynch	134	14.134	35
ICE 3 Month SONIA Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	50	13.769	(25)
ICE 3 Month SONIA Junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	50	13.785	9
Bono a 10 años de Japón (OSE) Septiembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(11)	(10.237)	74
Long Gilt Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	9	1.005	18
U.S. 10 Year Ultra Note Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(33)	(3.533)	(51)
U.S. 5 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	61	6.015	37
U.S. Ultra Bond (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	3	358	5
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): 476€				€ 322
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): (1 065) EUR				(91)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): (589) EUR				€ 231

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles)	% del valor liquidativo	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles)	% del valor liquidativo
Valores garantizados por activos — 0,24% (28 de febrero de 2023: 0,24%)					
590 Home Equity Asset Trust 2005-6, Serie 2005 6, Clase M5, 6,374 %, con vencimiento el 25/12/2035 *	540	0,24	770 Intesa Sanpaolo SpA, 6,500 %, vencimiento al 14/03/2029 *	938	0,42
			270 EUR Marcollin SpA, 6,125 %, con vencimiento el 15/11/2026	271	0,12
			1.010 EUR Telecom Italia SpA/Milano, 2,375 %, con vencimiento el 12/10/2027	956	0,43
Total de valores garantizados por activos (coste 5775)	540	0,24	2.707	1,22	
Valores garantizados por hipotecas — 2,34 % (28 de febrero de 2023: 1,81%)					
580 BANK 2018-BNK15, Serie 2018 BN15, Clase B, 4,814 %, con vencimiento el 15/11/2061 *	505	0,23	Kazajstán — 1,04% (28 de febrero de 2023: 1,01%)		
234 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Serie 2019 R05, Clase 1B1, 144A, 9,502 %, con vencimiento el 25/07/2039 *	241	0,11	460 KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, con vencimiento el 24/04/2030	419	0,19
260 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Serie 2020 R01, Clase 1B1, 144A, 8,652 %, con vencimiento el 25/01/2040 *	261	0,12	660 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 3,500 %, con vencimiento el 14/04/2033	498	0,22
450 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Clase 1B1, 144A, 8,388 %, con vencimiento el 25/10/2041 *	449	0,20	1.520 QazaqGaz NC JSC, 4,375 %, con vencimiento 26/09/2027	1.401	0,63
390 Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05, Serie 2023 R05, Clase 1M2, 144A, 8,396 %, con vencimiento el 25/06/2043 *	397	0,18		2.318	1,04
730 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, Serie 2021 DNA3, Clase B1, 144A, 8,788 %, con vencimiento el 25/10/2033 *	753	0,34	Luxemburgo — 0,65% (28 de febrero de 2023: 0,47%)		
947 Hilton USA Trust 2016-HHV, Serie 2016 HHV, Clase D, 144A, 4,333 %, con vencimiento el 05/11/2038 *	870	0,39	820 EUR Altice France SA, 2,250 %, con vencimiento 15/01/2025	854	0,38
5.300 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Serie 2018 PHMZ, Clase M, 144A, 13,993 %, con vencimiento el 15/06/2035 **a	—	—	GBP 530 Citidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, con vencimiento el 01/04/2028	592	0,27
4 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-LDP12, Serie 2007 LD12, Clase AJ, 6,561 %, con vencimiento el 15/02/2051 *	—	—		1.446	0,65
365 PMT Credit Risk Transfer Trust 2021-1R, Serie 2021 1R, Clase A, 144A, 8,343 %, con vencimiento el 27/02/2024 *	363	0,16	México — 1,97% (28 de febrero de 2023: 1,97%)		
427 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-1, Serie 2017 1, Clase M1, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 25/01/2055 *	423	0,19	1.250 Banco Mercantil del Norte SA/Gran Caimán, 7,500 %, Perpetuo*	1.141	0,51
1.426 WaMu Mortgage Pass-Through Certificated Serie 2005-AR17 Trust, Serie 2005 AR17, Clase A1C3, 6,389 %, con vencimiento el 25/12/2045 *	927	0,42	1.360 BBVA Bancomer SA/Texas, 5,125 %, con vencimiento el 18/01/2033 *	1.184	0,53
	5.193	2,34	1.220 Orbica Advance Corp SAB de CV, 5,875 %, con vencimiento 17/09/2044	1.070	0,48
			1.070 Southern Copper Corp, 5,250 %, con vencimiento el 08/11/2042	991	0,45
				4.386	1,97
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 10 949 USD)					
			Países Bajos — 1,97% (28 de febrero de 2023: 1,90%)		
Bonos y obligaciones corporativas — 50,58% (28 de febrero de 2023: 55,37%)			250 Cooperatieve Rabobank UA, 3,649 %, con vencimiento el 06/04/2028 *	232	0,11
Argentina — 0,21 % (28 de febrero de 2023: 0,20%)			EUR 800 Cooperatieve Rabobank UA, 3,250 %, Perpetuo *	729	0,33
500 YPF SA, 8,500 %, con vencimiento al 28/07/2025	473	0,21	EUR 200 Cooperatieve Rabobank UA, 4,875 %, Perpetuo *	184	0,08
			GBP 1 100 ING Groep NV, 5,000 %, con vencimiento el 30/08/2026 *	1.358	0,61
			1.510 Trivium Packaging Finance BV, 5,500 %, con vencimiento el 15/08/2026	1.426	0,64
			550 VZ Secured Financing BV, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 15/01/2032	449	0,20
				4.378	1,97
			Perú — 0,18% (28 de febrero de 2023: 0,63%)		
			610 Petroleos del Perú SA, 5,625 %, con vencimiento el 19/06/2047	391	0,18
			Singapur — 0,06 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)		
			139 EUR Cromwell Ereit Lux Finco Sarl, 2,125 %, con vencimiento el 19/11/2025	133	0,06
			Eslovenia — 0,41 % (28 de febrero de 2023: 0,37%)		
			1.020 EUR United Group BV, 5,250 %, con vencimiento el 01/02/2030	919	0,41
			Sudáfrica — 0,09% (28 de febrero de 2023: 0,09%)		
			200 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 10/04/2027	194	0,09
			España — 1,37 % (28 de febrero de 2023: 0,49%)		
			1.000 EUR Banco Santander SA, 5,750 %, con vencimiento 23/08/2033 *	1.083	0,49
			600 EUR Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, con vencimiento el 18/09/2027	604	0,27
			EUR 300 Telefonica Europe BV, 3,875 %, Perpetuo *	304	0,14
			EUR 300 Telefonica Europe BV, 2,376 %, Perpetuo *	258	0,12
			770 EUR Via Celere Desarrollos Inmobiliarios SA, 5,250 %, con vencimiento 01/04/2026	787	0,35
				3.036	1,37
			Suecia — 0,67 % (28 de febrero de 2023: 0,77%)		
			EUR 300 Assemblin Group AB, 8,587 %, con vencimiento 05/07/2029 *	322	0,15
			Bonos y pagarés corporativos (continuación)		
			Suecia — (continuación)		
			EUR 680 Heimstaden Bostad AB, 3,625 %, Perpetuo *	337	0,15
			750 EUR Verisure Holding AB, 7,125 %, con vencimiento el 01/02/2028	825	0,37
				1.484	0,67
			Suiza — 0,90% (28 de febrero de 2023: 2,00%)		
			2.010 UBS Group AG, 7,000 %, Perpetuo *	1.998	0,90
			Reino Unido — 8,57% (28 de febrero de 2023: 7,21%)		
			750 EUR 888 Acquisitions Ltd, 7,558 %, con vencimiento el 15/07/2027	776	0,35
			620 Barclays Plc, 7,125 %, Perpetuo *	726	0,32
			570 Bellis Acquisition Co Plc, 4,500 %, con vencimiento el 16/02/2026	635	0,28
			210 Galaxy Bidco Ltd, 6,500 %, con vencimiento el 31/07/2026	245	0,11
			GBP 1 160 Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, con vencimiento el 07/04/2026	1.349	0,61
			GBP 1 459 Greene King Finance Plc, Serie B2, 7,080 %, con vencimiento el 15/03/2036 *	1.439	0,65
			400 HSBC Holdings Plc, 4,762 %, con vencimiento el 29/03/2033 *	356	0,16
			1.240 HSBC Holdings Plc, 6,375 %, Perpetuo *	1.197	0,54
			110 EUR INEOS Quattro Finance 1 Plc, 3,750 %, con vencimiento el 15/07/2026	106	0,05
			GBP 1.600 EUR Lloyds Banking Group Plc, 4,947 %, Perpetuo *	1.621	0,73
			GBP 1 275 Marston's Issuer Plc, Serie B1, 7,819 %, con vencimiento el 16/07/2035 *	1.155	0,52
			GBP 660 NatWest Group Plc, 3,619 %, con vencimiento el 29/03/2029 *	738	0,33
			GBP 170 NatWest Markets Plc, 6,375 %, con vencimiento el 08/11/2027	216	0,10
			GBP 230 EUR PEU Fin Plc, 7,250 %, con vencimiento 01/07/2028	249	0,11
			GBP 540 Pinewood Finance Co Ltd, 3,250 %, con vencimiento el 30/09/2025	638	0,29
			GBP 550 Premier Foods Finance Plc, 3,500 %, con vencimiento el 15/10/2026	633	0,28
			GBP 1 150 Saga Plc, 5,500 %, con vencimiento el 15/07/2026	1.114	0,50
			GBP 425 Tesco Property Finance 5 Plc, 5,661 %, con vencimiento el 13/10/2041	530	0,24
			GBP 1 027 Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, con vencimiento el 13/07/2044	1.172	0,53
			EUR 300 Victoria Plc, 3,625 %, con vencimiento 24/08/2026	264	0,12
			GBP 810 Vmed O2 UK Financing I Plc, 4,500 %, con vencimiento el 15/07/2031	802	0,36
			GBP 1 020 Vodafone Group Plc, 8,000 %, con vencimiento 30/08/2086 *	1.290	0,58
			GBP 680 Wheel Bidco Ltd, 6,750 %, con vencimiento el 15/07/2026	713	0,32
			GBP 1 000 Whitbread Group Plc, 2,375 %, con vencimiento el 31/05/2027	1.085	0,49
				19.049	8,57
			Estados Unidos — 21,38% (28 de febrero de 2023: 23,51%)		
			500 AbbVie Inc, 4,850 %, con vencimiento el 15/06/2044	458	0,21
			202 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2026	198	0,09
			1.320 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 20/04/2029	1.264	0,57
			660 American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2029	544	0,25
			890 American Express Co, 3,550 %, Perpetuo *	743	0,33
			1.790 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 15/08/2027	1.535	0,69
			570 Bank of America Corp, 5,015 %, con vencimiento el 22/07/2033 *	549	0,25
			280 Bank of America Corp, 5,288 %, con vencimiento el 25/04/2034 *	273	0,12
			1.150 Bank of America Corp, 3,311 %, con vencimiento el 22/04/2042 *	861	0,39

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo
140 Bank of America Corp, 4.083%, vencimiento el 20/03/2051 *	113	0,05	Paraguay — 0,76% (28 de febrero de 2023: 0,85%)		
494 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, vencimiento 15/12/2025	496	0,22	1.360 Bono internacional del Estado de Egipto, 3,875 %, con vencimiento el 16/02/2026	982	0,44
650 Carnival Corp, 144A, 10,500 %, vencimiento 01/06/2030	693	0,31	EUR 1 180 Bono Internacional del Estado de Egipto, 6,375 %, con vencimiento el 11/04/2031	708	0,32
1.400 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 01/05/2027	1.317	0,59		1.690	0,76
610 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 01/06/2033	482	0,22	Alemania — 0,16 % (28 de febrero de 2023: 0,15%)		
1.020 Centene Corp, 4,625 %, con vencimiento el 15/12/2029	939	0,42	360 EUR Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, con vencimiento el 15/02/2029	348	0,16
400 Charles Schwab Corp/The, Serie H, 4,000 %, Perpetuo *	303	0,14	Indonesia — 3,24 % (28 de febrero de 2023: 2,96%)		
1.380 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3.500 %, vencimiento el 01/06/2041	916	0,41	50.976.000 IDR Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR59, 7,000 %, con vencimiento el 15/05/2027	3.431	1,55
250 Cigna Group/The, 4,800 %, con vencimiento el 15/08/2038	231	0,10			
1.030 Citigroup Inc, 8,125%, vencimiento el 15/07/2039	1.283	0,58			
572 Comcast Corp, 2,937%, vencimiento el 01/11/2056	356	0,16			
420 Comcast Corp, 4,950%, vencimiento el 15/10/2058	388	0,17			
1.798 Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, con vencimiento el 01/06/2044	1.380	0,62			
750 CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, con vencimiento 01/02/2029	621	0,28			
680 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, con vencimiento el 03/11/2036	695	0,31			
624 Devon Energy Corp, 5,250%, vencimiento el 15/10/2027	619	0,28			
246 Devon Energy Corp, 5,875%, vencimiento el 15/06/2028	246	0,11			
1.200 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 15/08/2027	1.065	0,48			
420 DISH DBS Corp, 5,875 %, con vencimiento el 15/11/2024	391	0,18			
1.160 DISH DBS Corp, 7,750 %, con vencimiento el 01/07/2026	869	0,39			
670 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, con vencimiento 01/12/2028	521	0,24			
830 Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, con vencimiento el 15/06/2025	817	0,37			
740 Enterprise Products Operating LLC, 4,800%, vencimiento el 01/02/2049	651	0,29			
1.050 EQT Corp, 3,900%, con vencimiento el 01/10/2027	981	0,44			
380 EQT Corp, 5,000%, con vencimiento el 15/01/2029	361	0,16			
GBP 780 Ford Motor Credit Co LLC, 2,748 %, con vencimiento el 14/06/2024	954	0,43			
390 Ford Motor Credit Co LLC, 3,815 %, con vencimiento 02/11/2027	347	0,16			
1.515 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, con vencimiento 10/02/2029	1.252	0,56			
1.430 Freeport-McMoRan Inc, 5,450%, con vencimiento el 15/03/2043	1.285	0,58			
235 Goldman Sachs Capital II, 6,439 %, Perpetuo *	190	0,09			
GBP 590 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,625%, con vencimiento el 29/10/2029 *	662	0,30			
1.400 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/12/2028	1.224	0,55			
200 JPMorgan Chase & Co, 2,522%, con vencimiento el 22/04/2031 *	168	0,08			
30 JPMorgan Chase & Co, 3,109%, con vencimiento el 22/04/2051 *	20	0,01			
330 JPMorgan Chase & Co, 3,328%, con vencimiento el 22/04/2052 *	232	0,10			
270 Kraft Heinz Foods Co, 5,200 %, con vencimiento el 15/07/2045	248	0,11			
440 Legacy LifePoint Health LLC, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 15/02/2027	381	0,17			
170 McDonald's Corp, 4,200%, con vencimiento el 01/04/2050	141	0,06			
1.430 Morgan Stanley, 3,622 %, con vencimiento el 01/04/2031 *	1.271	0,57			
40 Morgan Stanley, 5,597 %, con vencimiento el 24/03/2051 *	40	0,02			
640 Netflix Inc, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 15/06/2030	623	0,28			
690 Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, con vencimiento el 15/08/2029	597	0,27			
490 Radiology Partners Inc, 144A, 9,250 %, con vencimiento el 01/02/2028	193	0,09			
1.850 Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/02/2030	1.672	0,75			
205 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, con vencimiento el 01/03/2032	232	0,10			
500 Southwestern Energy Co, 8,375 %, con vencimiento el 15/09/2028	521	0,23			
1.210 Southwestern Energy Co, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2032	1.073	0,48			
700 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 20/09/2025	702	0,32			
1.620 Sprint Capital Corp, 8,750 %, con vencimiento el 15/03/2032	1.932	0,87			
640 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500 %, con vencimiento el 01/03/2030	614	0,28			
450 T-Mobile USA Inc, 3,875%, con vencimiento el 15/04/2030	411	0,19			
1.130 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento 15/04/2029	1.006	0,45			
790 United Rentals North America Inc, 5,500 %, con vencimiento el 15/05/2027	775	0,35			
1.000 United Rentals North America Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/02/2031	856	0,39			
530 Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 15/02/2029	493	0,22			
GBP 1.000 VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 15/02/2028	929	0,42			
510 Wells Fargo & Co, 3,473%, con vencimiento el 26/04/2028 *	581	0,26			
730 Wells Fargo & Co, 5,013%, con vencimiento el 04/04/2051 *	660	0,30			
880 Wells Fargo & Co, Series U, 5,875%, Perpetuo *	875	0,39			
210 Western Midstream Operating LP, 3,950 %, con vencimiento 01/06/2025	203	0,09			
480 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, con vencimiento el 15/08/2048	400	0,18			
720 Western Midstream Operating LP, 5,250 %, con vencimiento 01/02/2050	583	0,26			
	47.505	21,38			
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 124.539\$)	112.381	50,58			
Bonos y obligaciones del Estado — 36,60% (28 de febrero de 2023: 26,03%)					
Argentina — 0,56% (28 de febrero de 2023: 0,55%)					
3.264 Bonos del Gobierno de la Provincia de Buenos Aires, 144A, 6,375%, con vencimiento 01/09/2037	1.244	0,56			
Brasil — 1,32 % (28 de febrero de 2023: 0,90%)					
14.694 BRL Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2027	2.938	1,32			
Colombia — 0,46% (28 de febrero de 2023: 0,43%)					
1.350 Colombia Government International Bond, 5,625%, con vencimiento el 26/02/2044	1.027	0,46			
Costa de Marfil — 0,36 % (28 de febrero de 2023: 0,34%)					
EUR 880 Bono Internacional del Estado de Costa de Marfil, 5,250 %, con vencimiento el 22/03/2030	809	0,36			
República Dominicana — 0,52 % (28 de febrero de 2023: 0,50%)					
1.360 Bono internacional de la República Dominicana, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 23/09/2032	1.157	0,52			

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo
Bonos y obligaciones del Estado (continuación)					
Indonesia — (continuación)					
52.396.000 IDR	Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR78, 8,250 %, con vencimiento el 15/05/2029	3.757	1,69		
		7.188	3,24		
Jordania — 0,18% (28 de febrero de 2023: 0,17%)					
430	Bono Internacional del Estado de Jordania, 5,850 %, con vencimiento el 07/07/2030	399	0,18		
México — 3,68% (28 de febrero de 2023: 3,33%)					
69.240	MXN Bonos Mexicanos, Serie M, 8,500 %, con vencimiento el 31/05/2029	3.913	1,76		
MXN	84.947 Bonos Mexicanos, Series M, 7,750 %, con vencimiento 13/11/2042	4.258	1,92		
		8.171	3,68		
Nigeria — 0,44% (28 de febrero de 2023: 0,42%)					
1.400	Bono internacional del Estado de Nigeria, 7,625 %, vencimiento 28/11/2047	970	0,44		
Omán — 0,18% (28 de febrero de 2023: 0,17%)					
390	Bono Internacional del Estado de Omán, 6,000 %, con vencimiento el 01/08/2029	393	0,18		
Polonia — 1,76% (28 de febrero de 2023: 1,46%)					
21.700	PLN Bono del Estado de la República de Polonia, Serie 0432, 1,750 %, con vencimiento el 25/04/2032	3.916	1,76		
Paraguay — 0,33% (28 de febrero de 2023: 0,29%)					
940	EUR Bono Internacional del Estado de Rumania, 2,000 %, con vencimiento el 14/04/2033	729	0,33		
Rusia — 0,80% (28 de febrero de 2023: 0,18%)					
288.495	RUB Bono Federal Ruso – OFZ, 0,000 %, con vencimiento el 19/01/2028 1y	903	0,41		
RUB	329.535 Bono Federal Ruso – OFZ, 0,000 %, con vencimiento el 10/05/2034 1y	876	0,39		
		1.779	0,80		
Sudáfrica — 1,63% (28 de febrero de 2023: 1,46%)					
ZAR 90.478	Bono del Estado de la República de Sudáfrica, Serie R214, 6,500 %, con vencimiento el 28/02/2041	2.828	1,27		
1.130	Bono Internacional del Estado de la República de Sudáfrica, 5,750 %, con vencimiento el 30/09/2049	803	0,36		
		3.631	1,63		
Estados Unidos — 20,22% (28 de febrero de 2023: 11,09%)					
6.240	United States Treasury Note/Bond, 2.000%, vencimiento el 30/04/2024	6.102	2,75		
4.310	United States Treasury Note/Bond, 2.000%, vencimiento el 15/11/2026	3.991	1,80		
2.250	United States Treasury Note/Bond, 0.625%, vencimiento el 31/03/2027	1.970	0,89		
11.820	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, vencimiento el 31/10/2027	11.712	5,27		
500	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, vencimiento el 31/03/2028	486	0,22		
30	United States Treasury Note/Bond, 0.625%, vencimiento el 15/08/2030	24	0,01		
5.680	United States Treasury Note/Bond, 1.375%, vencimiento el 15/11/2031	4.604	2,07		
290	United States Treasury Note/Bond, 2.750%, vencimiento el 15/08/2032	260	0,12		
3.320	United States Treasury Note/Bond, 4.125%, vencimiento el 15/11/2032	3.319	1,49		
120	United States Treasury Note/Bond, 1.750%, vencimiento el 15/08/2041	81	0,04		
140	United States Treasury Note/Bond, 2.000%, vencimiento el 15/11/2041	98	0,04		
600	United States Treasury Note/Bond, 3.375%, vencimiento el 15/08/2042	521	0,23		
2.320	United States Treasury Note/Bond, 4.000%, vencimiento el 15/11/2042	2.202	0,99		
1.650	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, vencimiento el 15/05/2045	1.323	0,59		
15	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, vencimiento el 15/11/2045	12	0,01		
500	United States Treasury Note/Bond, 2.250%, vencimiento el 15/08/2046	344	0,15		
360	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, vencimiento el 15/02/2047	286	0,13		
7.240	United States Treasury Note/Bond, 3.125%, vencimiento el 15/05/2048	5.882	2,65		
820	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, vencimiento el 15/02/2049	651	0,29		
430	United States Treasury Note/Bond, 2.875%, vencimiento el 15/05/2049	333	0,15		
40	United States Treasury Note/Bond, 1.250%, vencimiento el 15/05/2050	21	0,01		
200	United States Treasury Note/Bond, 1.375%, vencimiento el 15/08/2050	108	0,05		
270	United States Treasury Note/Bond, 3.000%, vencimiento el 15/08/2052	215	0,10		
410	United States Treasury Note/Bond, 3.625%, vencimiento el 15/05/2053	370	0,17		
		44.915	20,22		
		81.304	36,60		
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 100.042\$)					
Obligaciones de préstamo — 3,48% (28 de febrero de 2023: 3,84%)					
579	Alterra Mountain Co, 8,946 %, con vencimiento el 30/07/2028 *	581	0,26		
873	API Group Inc, 7,946 %, con vencimiento el 01/10/2026 *	876	0,40		
674	Asurion LLC, 9,681 %, con vencimiento el 19/08/2028 *	652	0,29		
626	Focus Financial Partners LLC, 8,581 %, con vencimiento el 30/06/2028 *	625	0,28		
463	Grifols Worldwide Operations USA Inc, 7,481 %, con vencimiento el 15/11/2027 *	458	0,21		
1.166	Hilton Worldwide Finance LLC, 7,165 %, con vencimiento el 21/06/2026 *	1.167	0,53		
138	Nexstar Broadcasting Inc, 7,946 %, con vencimiento el 19/09/2026 *	138	0,06		
269	Nord Anglia Education, 9,922 %, con vencimiento el 25/01/2028 *	270	0,12		
584	Prime Security Installations Ltd, 8,182 %, con vencimiento el 23/09/2026 *	585	0,26		
926	Sedgwick CMS Inc, 9,081 %, con vencimiento 17/02/2028 *	929	0,42		
600	Sotera Health, 8,196 %, con vencimiento el 13/12/2026 *	595	0,27		
643	Ternier Media Buyer, Inc., 8,842 %, con vencimiento el 17/12/2026 *	600	0,27		
245	UFC Holdings LLC, 8,369 %, con vencimiento el 29/04/2026 *	245	0,11		
		7.721	3,48		
Total de obligaciones de préstamo (coste: 7.792\$)					
Organismos de inversión colectiva — 1,36% (28 de febrero de 2023: 1,77%)					
22	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – LM Class US\$ Accumulating	3.032	1,36		
		3.032	1,36		
Total de organismos de inversión colectiva (coste: 2.474\$)					
Acciones ordinarias — 0,17% (28 de febrero de 2023: 0,18%)					
Suiza — 0,00% (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
1.760	Credit Suisse Group AG Escrow 1	–	–		
Estados Unidos — 0,17% (28 de febrero de 2023: 0,18%)					
44	cuerpo de bayas	376	0,17		

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte		Moneda de compra (en miles)			Moneda de venta (en miles)		Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
05-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	USD	15	Venta	EUR	14	USD	-
06-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	USD	-	Venta	SGD	-		-
06-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	SGD	4	Venta	USD	3		-
13-Sep-2023	Citi	Compra	USD	1.450	Venta	IDR	21.548.873		35
13-Sep-2023	Citi	Compra	USD	1.630	Venta	INR	134.728		2
13-Sep-2023	Morgan Stanley	Compra	USD	3.267	Venta	TWD	99.169		148
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	USD	652	Venta	CHF	572		4
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	USD	130	Venta	EUR	118		-
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	USD	-	Venta	EUR	-		-
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	USD	8	Venta	GBP	6		-
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	USD	10	Venta	GBP	8		-
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	USD	34	Venta	PLN	138		-
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	USD	3	Venta	SGD	4		-
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	USD	1	Venta	SGD	1		-
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	ZAR	6	Venta	USD	-		-
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	ZAR	6.128	Venta	USD	322		3
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	CHF	51.864	Venta	USD	59.386		(577)
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	AUD	560	Venta	USD	362		1
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	AUD	90.618	Venta	USD	59.245		(496)
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	PLN	11.606	Venta	USD	2.847		(37)
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	SGD	1.279	Venta	USD	952		(5)
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	SGD	-	Venta	USD	-		-
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	GBP	2	Venta	USD	3		-
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	EUR	5.901	Venta	USD	6.492		(88)
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	EUR	3	Venta	USD	3		-
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	GBP	1.334	Venta	USD	1.698		(8)
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	USD	3	Venta	ZAR	62		-
15-Sep-2023	BNY Mellon	Compra	USD	2	Venta	ZAR	41		-
16 nov. 2023	BNP Paribas	Compra	USD	1.901	Venta	PLN	7.723		36
16 nov. 2023	BNP Paribas	Compra	JPY	965.332	Venta	USD	6.854		(136)
16 nov. 2023	Citi	Compra	USD	8.106	Venta	GBP	6.381		22
16 nov. 2023	Goldman Sachs	Compra	USD	5.245	Venta	EUR	4.772		51
16 nov. 2023	Goldman Sachs	Compra	USD	1.802	Venta	GBP	1.418		5
16 nov. 2023	Goldman Sachs	Compra	USD	2.051	Venta	MXN	35.905		(25)
16 nov. 2023	HSBC	Compra	USD	21.021	Venta	EUR	19.127		202
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	USD	3.490	Venta	GBP	2.747		9
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	ZAR	5.000	Venta	USD	264		(1)
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	AUD	3.230	Venta	USD	2.127		(29)
16 nov. 2023	Morgan Stanley	Compra	CAD	1.230	Venta	USD	921		(9)
16 nov. 2023	UBS	Compra	USD	7.002	Venta	GBP	5.513		17
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): 775\$								USD	535
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(4.011)									(1.411)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(3.236))								USD	(876)

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico(en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Euro-Bobl Diciembre de 2023	Bank of America Merrill Lynch	(5)	USD (637)	USD (4)
Euro-Bund diciembre de 2023	Bank of America Merrill Lynch	89	12.800	127
Bonos Euro-Buxl a 30 años Diciembre de 2023	Bank of America Merrill Lynch	(1)	(145)	(2)
Long Gilt Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	40	4.843	87
U.S. 10 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(39)	(4.330)	(39)
U.S. 2 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	12	2.445	7
U.S. Long Bond (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(23)	(2.799)	(40)
U.S. Ultra Bond (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(30)	(3.884)	(81)
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): 74\$				USD 221
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(29)				(166)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): 45\$				USD 55

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo
Valores garantizados por activos — 7,24% (28 de febrero de 2023: 6,50%)					
500 522 Funding CLO 2018-3A Ltd, Serie 2018 3A, Clase DR, 144A, 8,688 %, vencimiento 20/10/2031 *	487	0,46	710 Altice France SA/France, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 15/05/2027	386	0,36
250 AB BSL CLO 2 Ltd, Serie 2021 2A, Clase D, 144A, 8,920 %, con vencimiento el 15/04/2034 *	239	0,23	600 ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 30/06/2027	483	0,46
310 AGL CLO 6 Ltd, Seriee 2020 6A, Clase ER, 144A, 12,088 %, vencimiento 20/07/2034 *	300	0,28		1.265	1,19
300 Apex Credit CLO 2022-1 Ltd, Serie 2022 1A, Clase D, 144A, 9,746 %, vencimiento 22/04/2033 *	292	0,28	Macao — 1,56% (28 de febrero de 2023: 1,80%)		
440 Ballyrock CLO 2018-1 Ltd, Serie 2018 1A, Clase C, 144A, 8,738 %, vencimiento 20/04/2031 *	432	0,41	200 Sands China Ltd, 4,300 %, con vencimiento el 08/01/2026	188	0,18
420 Canyon CLO 2020-1 Ltd, Serie 2020 1A, Clase ER, 144A, 11,920 %, con vencimiento el 15/07/2034 *	401	0,38	200 Sands China Ltd, 5,650 %, con vencimiento el 08/08/2028	189	0,18
250 CFC Funding 2017-1 Ltd, Serie 2017 1A, Clase D, 144A, 9,095 %, vencimiento 23/04/2029 *	250	0,24	450 Sands China Ltd, 3,500 %, con vencimiento el 08/08/2031	362	0,34
300 GoldenTree Loan Opportunities IX Ltd, Serie 2014 9A, Clase DR2, 144A, 8,631 %, vencimiento 29/10/2029 *	300	0,28	200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/01/2026	188	0,18
250 Greenwood Park CLO Ltd, Serie 2018 1A, Clase E, 144A, 10,520 %, vencimiento 15/04/2031 *	207	0,19	820 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 26/08/2028	724	0,68
510 Grippen Park CLO Ltd, Serie 2017 1A, Clase E, 144A, 11,288 %, con vencimiento 20/01/2030 *	465	0,44		1.651	1,56
250 Harriman Park CLO Ltd, Serie 2020 1A, Clase ER, 144A, 11,988 %, con vencimiento el 20/04/2034 *	234	0,22	Países Bajos — 0,35 % (28 de febrero de 2023: 0,30%)		
443 Magnetite XII-R Ltd, Serie 2015 12A, Clase ER, 144A, 11,250 %, con vencimiento el 15/10/2031 *	425	0,40	420 UPC Holdings BV, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/01/2028	374	0,35
500 Marble Point CLO XIV Ltd, Serie 2018 2A, Clase D, 144A, 9,118 %, con vencimiento 20/01/2032 *	467	0,44	Polonia — 0,28 % (28 de febrero de 2023: 0,36%)		
280 Mountain View CLO IX Ltd, Serie 2015 9A, Clase CR, 144A, 8,690 %, con vencimiento 15/07/2031 *	252	0,24	370 Canpack SA / Canpack US LLC, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/11/2029	299	0,28
500 Nassau 2021-I Ltd, Serie 2021 IA, Clase D, 144A, 9,320 %, con vencimiento 26/08/2034 *	479	0,45	Suiza — 0,60 % (28 de febrero de 2023: 2,04%)		
250 Neuberger Berman CLO XVIII Ltd, Serie 2014 18A, Clase DR2, 144A, 11,515 %, con vencimiento el 21/10/2030 *	232	0,22	210 Vistalet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 01/05/2027	190	0,18
500 Neuberger Berman Loan Advisers CLO 34 Ltd, Serie 2019 34A, Clase A, 144A, 11,826 %, con vencimiento el 20/01/2035 *	485	0,46	130 Vistalet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 9,500 %, con vencimiento 01/06/2028	120	0,12
300 Ocean Trails CLO V, Serie 2014 5A, Clase DRR, 144A, 9,013 %, con vencimiento 13/10/2031 *	271	0,25	390 Vistalet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 6,375 %, con vencimiento 01/02/2030	321	0,30
200 Ocean Trails CLO XIV Ltd, Serie 2023 14A, Clase D, 144A, 11,146 %, con vencimiento 20/01/2035 *	200	0,19		631	0,60
580 Saranac CLO III Ltd, Serie 2014 3A, Clase DR, 144A, 8,770 %, con vencimiento 22/06/2030 *	488	0,46	Reino Unido — 3,24 % (28 de febrero de 2023: 2,54%)		
280 Trinitas CLO X Ltd, Serie 2019 10A, Clase DR, 144A, 8,908 %, con vencimiento 15/01/2035 *	263	0,25	1.280 Barclays Plc, 8,000 %, Perpetuo *	1.257	1,19
320 Venture XVII CLO Ltd, Serie 2014 17A, Clase DRR, 144A, 8,390 %, con vencimiento 15/04/2027 *	311	0,29	800 HSBC Holdings Plc, 4,600 %, Perpetuo *	621	0,59
190 Warwick Capital CLO 1 Ltd, Serie 2023 1A, Clase D, 144A, 0,000 %, con vencimiento 20/10/2036 *	190	0,18	540 Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, Perpetuo *	490	0,46
			770 Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC, 144A, 5,000 %, con vencimiento 15/07/2028	683	0,64
			450 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/07/2031	376	0,36
	7.670	7,24		3.427	3,24
Total de valores garantizados por activos (coste 8.004\$)					
Bonos y obligaciones corporativos — 81,60% (28 de febrero de 2023: 84,70%)					
Bermuda — 0,53 % (28 de febrero de 2023: 0,65%)					
591 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, con vencimiento 15/10/2025	559	0,53	Estados Unidos — 64,31 % (28 de febrero de 2023: 67,88%)		
Canadá — 2,75 % (28 de febrero de 2023: 2,47%)					
230 ATS Corp, 144A, 4,125 %, con vencimiento al 15/12/2028	205	0,19	340 Academy Ltd, 144A, 6,000 %, con vencimiento 15/11/2027	326	0,31
180 Bombardier Inc, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 15/04/2027	180	0,17	742 Accelerate360 Holdings LLC, 144A, 8,000 %, con vencimiento 01/03/2028	770	0,73
200 Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,375 %, con vencimiento 15/01/2028	188	0,18	550 AdaptHealth LLC, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 01/08/2029	450	0,42
440 Empire Communities Corp, 144A, 7,000 %, con vencimiento 15/12/2025	425	0,40	120 AdaptHealth LLC, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 01/03/2030	99	0,09
420 GFL Environmental Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/06/2029	381	0,36	290 Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 6,375 %, con vencimiento 15/06/2030	286	0,27
700 Highbay Minerals Inc, 144A, 6,125 %, con vencimiento 01/04/2029	659	0,62	500 Akuminc Inc, 144A, 7,000 %, con vencimiento 01/11/2025	378	0,36
550 Open Text Corp, 144A, 6,900 %, con vencimiento 01/12/2027	558	0,53	1.830 Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144A, 10,500 %, con vencimiento 15/02/2028	1.049	0,99
310 Toronto-Dominion Bank/The, 8,125 %, con vencimiento 31/10/2082 *	312	0,30	370 Alta Equipment Group Inc, 144A, 5,625 %, con vencimiento 15/04/2026	343	0,32
	2.908	2,75	910 AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 7,500 %, con vencimiento 15/02/2029	622	0,59
Islas Caimán — 0,94 % (28 de febrero de 2023: 0,91%)					
1.059 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 15/09/2024	996	0,94	480 American Airlines Inc, 144A, 11,750 %, con vencimiento 15/07/2025	526	0,50
Francia — 1,20 % (28 de febrero de 2023: 0,28%)					
240 Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/01/2028	180	0,17	310 American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, con vencimiento 15/02/2028	305	0,29
670 Altice France SA/France, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 15/07/2029	474	0,45	340 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 20/04/2029	326	0,31
310 BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, Perpetuo *	302	0,28	460 American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2029	379	0,36
320 Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Perpetuo*	320	0,30	490 American News Co LLC, 144A, 8,500 %, con vencimiento 01/09/2026	553	0,52
	1.276	1,20	95 Anagram International Inc / Anagram Holdings LLC, 144A, 10,000 %, con vencimiento 15/08/2026	67	0,06
Alemania — 0,47 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
490 ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 14/04/2030	497	0,47	930 Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento 15/06/2029	730	0,69
Hong Kong — 0,36% (28 de febrero de 2023: 0,45%)					
450 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, con vencimiento 04/12/2029	378	0,36	200 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 01/09/2029	163	0,15
India — 0,29 % (28 de febrero de 2023: 0,25%)					
340 CA Magnum Holdings, 144A, 5,375 %, con vencimiento 31/10/2026	304	0,29	510 AthenHealth Group Inc, 144A, 6,500 %, con vencimiento 15/02/2030	443	0,42
Israel — 1,15% (28 de febrero de 2023: 1,26%)					
500 Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, con vencimiento 01/02/2036	461	0,44	900 Bath & Body Works Inc, 7,500 %, con vencimiento 15/06/2029	908	0,86
300 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, con vencimiento 09/05/2029	278	0,26	180 Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, con vencimiento 01/10/2030	176	0,17
450 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, con vencimiento el 15/09/2031	477	0,45	110 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 01/02/2027	72	0,07
	1.216	1,15	690 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/02/2029	303	0,29
Italia — 1,48 % (28 de febrero de 2023: 0,70%)					
700 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, con vencimiento 15/01/2026	673	0,64	400 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 30/01/2030	169	0,16
380 Telecom Italia Capital SA, 6,000 %, con vencimiento el 30/09/2034	319	0,30	170 Beacon Roofing Supply Inc, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 01/08/2030	168	0,16
660 Unicredit SpA, 144A, 5,459 %, con vencimiento 30/06/2035 *	574	0,54	400 Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, con vencimiento 15/02/2026	385	0,36
	1.566	1,48	700 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,625 %, con vencimiento 15/07/2026	689	0,65
Luxemburgo — 1,19% (28 de febrero de 2023: 1,51%)					
500 Altice France SA, 144A, 5,750 %, con vencimiento 15/08/2029	396	0,37	370 Boyne USA Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento 15/05/2029	334	0,32
			600 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/04/2028	553	0,52
			330 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/04/2030	303	0,29
			350 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 9,250 %, con vencimiento 01/07/2031	354	0,33
			280 Caesars Entertainment Inc, 144A, 8,125 %, con vencimiento 01/07/2027	285	0,27
			640 Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2030	643	0,61
			400 Cane Health LLC, 144A, 6,250 %, con vencimiento 01/10/2028	136	0,13
			100 Carnival Corp, 144A, 7,625 %, con vencimiento 01/03/2026	100	0,09
			230 Carnival Corp, 144A, 7,000 %, con vencimiento 15/08/2029	234	0,22
			570 Carnival Corp, 144A, 10,500 %, con vencimiento 01/06/2030	608	0,57
			220 Carnival Holdings Bermuda Ltd, 144A, 10,375 %, con vencimiento el 01/05/2028	239	0,23
			800 Carriage Purchaser Inc, 144A, 7,875 %, con vencimiento 15/10/2029	601	0,57
			210 Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 15/05/2029	217	0,21
			370 Carrols Restaurant Group Inc, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 01/07/2029	319	0,30
			740 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2032	613	0,58
			550 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, con vencimiento el 01/05/2032	446	0,42

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles)	% del valor liquidativo	
94 Bono Internacional de la República Argentina, 3,625 %, vencimiento 09/07/2035	28	0,02	
60 Bonos del Gobierno de la Provincia de Buenos Aires, 6,375 %, con vencimiento el 01/09/2037	23	0,02	
190 Bonos del Gobierno de la Provincia de Buenos Aires, 144A, 6,375 %, vencimiento 01/09/2037	73	0,07	
	279	0,26	
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 3785)	279	0,26	
Obligaciones de préstamo — 6,55% (28 de febrero de 2023: 5,28%)			
178 19th Holdings Golf, LLC, 8,666 %, con vencimiento el 07/02/2029 *	175	0,16	
322 Adtalem Global Education Inc, 9,446 %, con vencimiento el 12/02/2028	322	0,30	
150 Elevance Health Inc, 8,247 %, con vencimiento el 01/05/2030 *	150	0,14	
427 Asurion LLC, 9,431 %, con vencimiento el 17/08/2028 *	412	0,39	
250 Clarios Global LP, 9,081 %, con vencimiento el 20/04/2030 *	250	0,24	
570 DCert Buyer, Inc., 12,331 %, con vencimiento el 16/02/2029 *	535	0,51	
190 Deerfield Dakota Holding LLC, 12,288 %, con vencimiento el 14/04/2028 *	180	0,17	
340 Equinox Holdings Inc, 14,731 %, vencimiento 08/03/2024 * †	329	0,31	
388 Eyecare Partners LLC, 9,253 %, con vencimiento el 05/02/2027 *	309	0,29	
494 Focus Financial Partners LLC, 8,581 %, con vencimiento el 30/06/2028 *	493	0,47	
231 Global Tel'Link Corp, 9,769 %, con vencimiento el 29/11/2025 *	218	0,21	
351 Great Outdoors Group LLC, 9,196 %, con vencimiento el 05/03/2028 *	351	0,33	
203 Magenta Buyer LLC, 10,631 %, con vencimiento el 03/05/2028 *	153	0,14	
82 MRI Funding LLC, 10,842 %, con vencimiento el 10/02/2026 *	80	0,08	
47 MRI Funding LLC, 10,842 %, con vencimiento el 10/02/2026 *	46	0,04	
160 Neptune Bidco U.S. Inc, 10,398 %, con vencimiento el 11/04/2029 *	146	0,14	
461 Phoenix Guarantor Inc, 8,696 %, con vencimiento el 05/03/2026 *	459	0,43	
417 R.R. Donnelley, 14,500 %, vencimiento 08/03/2028 *	418	0,40	
183 Redstone Holdco 2 LP, 10,179 %, vencimiento 27/04/2028 *	143	0,14	
660 Rent-A-Center Inc/TX, 8,881 %, con vencimiento el 17/02/2028 *	659	0,62	
410 Spencer Spirit IH LLC, 11,429 %, con vencimiento el 14/06/2026 *	408	0,39	
140 TruGreen LP, 14,131 %, vencimiento 30/10/2028 * †	88	0,08	
332 U.S. Renal Care Inc, 10,346 %, con vencimiento el 28/06/2028 *	214	0,20	
392 Vercend Holding Corp., 9,446 %, con vencimiento el 27/08/2025 *	392	0,37	
Total de obligaciones de préstamo (coste 7.2305)	6.930	6,55	
Organismos de inversión colectiva — 0,14% (28 de febrero de 2023: 1,33%)			
143 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	143	0,14	
Total de organismos de inversión colectiva (coste: 1435)	143	0,14	
Acciones ordinarias — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)			
Suiza — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)			
2,640 Credit Suisse Group AG Escrow †	–	–	
Total de acciones ordinarias (coste de – USD)	–	–	
Acciones preferentes — 0,28% (28 de febrero de 2023: 0,51%)			
Estados Unidos — 0,28 % (28 de febrero de 2023: 0,51%)			
9 MPLX LP, Serie A ∞	292	0,28	
Total de acciones preferentes (coste de 2865)	292	0,28	
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 112.4495)	101.700	96,07	
Swaps de incumplimiento de crédito — (0,09%) (28 febrero de 2023: 0,08%)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	101	0,09	
Contratos de divisas a plazo: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	–	–	
Futuros — 0,05% (28 de febrero de 2023: 0,00%)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	50	0,05	
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	101.851	96,21	
Swaps de incumplimiento de crédito: (0,05%) (28 febrero de 2023: 0,09%)			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(58)	(0,05)	
Contratos de divisas a plazo — (0,03%) (28 de febrero de 2023: 0,03%)			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(30)	(0,03)	
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	(88)	(0,08)	
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	101.763	96,13	
Excedente de otros activos respecto a los pasivos	4.096	3,87	
Patrimonio	105.859\$	100,00	

- Los importes designados como "–" son 0 EUR, menos de 1000 EUR, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.
- 144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. Al 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 76 170 000 USD o el 71,94 % del patrimonio neto.
- * Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.
- † Poca liquidez.
- ∞ El título es valorado de buena fe y a un valor razonable por el Comité de Valoración o según el criterio de este.
- ε El valor se encuentra en mora a 31 de agosto de 2023 (ya sea capital y/o interés).

ABREVIATURAS:

- Perpetuo – Un bono sin fecha de vencimiento. Los bonos perpetuos no son rescatables, pero pagan un flujo constante de intereses.

Análisis del total de activos

	% del total de activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	88,76
Otros valores mobiliarios negociables en otro mercado regulado	6,50
Organismos de inversión colectiva	0,13
Instrumentos financieros derivados	0,14
Otros activos	4,47
Total de activos	100,00

Listado de swaps de incumplimiento de crédito

Contraparte	Entidad de Referencia – Protección Compra/Venta	Fecha de vencimiento	Importe	
			teórico (miles)	Valor (miles)
Goldman Sachs	Ford Motor Co, 5,000 % - Venta	20 dic. 2026	900	USD 77
Goldman Sachs	Nova Chemicals Corp, 5,000 % - Compra	20 jun. 2027	429	(16)
Goldman Sachs	Occidental Petroleum Corporation, 1,000 % - Venta	20-Jun-2026	920	11
Goldman Sachs	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5,000 % - Compra	20 jun. 2027	580	(42)
Goldman Sachs	Xerox Holdings Corp, 1,000 % - Compra	20 jun. 2027	231	13
Apreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 febrero de 2023 [miles]: 102\$)				USD 101
Depreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(116))				(58)
Apreciación neta de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(14))				USD 43

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)		Moneda de venta (en miles)		Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)			
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	5	Venta	HKD	40	USD	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	19	Venta	EUR	17		-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	8	Venta	GBP	6		-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	4	Venta	SGD	6		-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	1.651	Venta	USD	1.816		(24)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	-	Venta	USD	-		-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	1	Venta	USD	1		-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	537	Venta	USD	399		(2)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	578	Venta	USD	737		(4)
20 oct. 2023	BNP Paribas	Compra	USD	6	Venta	CAD	8		-
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): 1\$								USD	-
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(35))									(30)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(34))								USD	(30)

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico(en miles)		Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
U.S. 5 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Goldman Sachs	76	USD	8.126	USD	50
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): - USD)					USD	50
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(31))						-
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(31))					USD	50

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo
Bonos y pagarés corporativos (continuación)					
Estados Unidos — (continuación)					
320 Southwestern Energy Co, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2032	284	0,55	360 Bono internacional del Estado de Nigeria, 144A, 7,143 %, con vencimiento 23/02/2030	295	0,57
250 Spirit Airlines Inc, 1,000 %, con vencimiento 15/05/2026	212	0,41	300 Bono internacional del Estado de Nigeria, 144A, 7,875 %, con vencimiento 16/02/2032	245	0,47
80 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 20/09/2025	80	0,16		540	1,04
360 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 20/09/2025	361	0,70	Panamá — 0,96 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)		
300 StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, con vencimiento 15/05/2029	251	0,49	650 Bono Internacional del Estado de Panamá, 2,252 %, con vencimiento el 29/09/2032	495	0,96
150 Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp, 5,875 %, con vencimiento 01/03/2027	147	0,28	Rusia — 0,80% (28 de febrero de 2023: 0,15%)		
520 Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 01/09/2026	458	0,89	69.969 RUB Bono Federal Ruso – OFZ, 0,000 %, con vencimiento el 19/01/2028	219	0,43
190 Tenet Healthcare Corp, 6,250 %, con vencimiento el 01/02/2027	187	0,36	61.500 RUB Bono Federal Ruso – OFZ, 0,000 %, con vencimiento el 23/05/2029	192	0,37
170 Titan International Inc, 7,000 %, con vencimiento el 30/04/2028	162	0,31		411	0,80
250 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, con vencimiento el 15/04/2026	232	0,45	Senegal — 0,31 % (28 de febrero de 2023: 0,28%)		
450 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, con vencimiento el 15/02/2029	390	0,75	230 Bono internacional del Estado de Senegal, 144A, 6,750 %, con vencimiento 13/03/2048	161	0,31
400 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento 15/04/2029	356	0,69	Sudáfrica — 0,34% (28 de febrero de 2023: 0,32%)		
550 United Rentals North America Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/11/2027	510	0,99	250 Bono Internacional del Estado de la República de Sudáfrica, 5,650 %, con vencimiento el 27/09/2047	178	0,34
50 Venture Global LNG Inc, 144A, 8,375 %, con vencimiento 01/06/2031	50	0,10	Turquía — 1,03 % (28 de febrero de 2023: 1,46%)		
120 Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 15/02/2029	112	0,22	360 Bono internacional del Estado de Turquía, 4,250 %, con vencimiento 14/04/2026	333	0,64
230 WW International Inc, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 15/04/2029	159	0,31	300 Bono internacional del Estado de Turquía, 4,875 %, con vencimiento 16/04/2043	200	0,39
90 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 15/02/2031	88	0,17		533	1,03
	19.781	38,27	Ucrania — 0,25 % (28 de febrero de 2023: 0,15%)		
Zambia — 0,39% (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
200 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, con vencimiento 01/06/2031	204	0,39	450 Bono internacional del Estado de Ucrania, 144A, 7,750 %, con vencimiento 01/09/2028	131	0,25
	39.143	75,74	Estados Unidos — 5,16 % (28 de febrero de 2023: 4,50%)		
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 44.2575)					
Bonos y obligaciones del Estado — 21,43% (28 de febrero de 2023: 17,71%)					
Angola — 0,53 % (28 de febrero de 2023: 0,52%)					
330 Bono Internacional del Estado de Angola, 144A, 8,750 %, con vencimiento el 14/04/2032	272	0,53	250 United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento 05/09/2023	250	0,48
Argentina — 2,31 % (28 de febrero de 2023: 2,30%)					
161 Bono Internacional de la República Argentina, 1,000 %, con vencimiento 09/07/2029	53	0,10	650 United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, con vencimiento 30/04/2026	588	1,14
297 Bono Internacional de la República Argentina, 0,750%, con vencimiento 09/07/2030	100	0,19	750 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, con vencimiento 31/05/2029	693	1,34
944 Bono Internacional de la República Argentina, 3,625 %, con vencimiento 09/07/2035	281	0,55	700 United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, con vencimiento 31/08/2029	659	1,28
1.271 Bonos del Gobierno de la Provincia de Buenos Aires, 144A, 6,375 %, con vencimiento 01/09/2037	484	0,94	500 United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, con vencimiento 15/02/2033	476	0,92
340 Provincia de Córdoba, 144A, 6,990 %, con vencimiento 01/06/2027	275	0,53		2.666	5,16
	1.193	2,31	Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 14.1885)		
Bahamas — 0,38 % (28 de febrero de 2023: 0,34%)					
200 Bono internacional del Estado de Bahamas, 144A, 5,750 %, con vencimiento 16/01/2024	198	0,38	Obligaciones de préstamo — 0,44% (28 de febrero de 2023: 0,31%)		
Baréin — 0,48 % (28 de febrero de 2023: 0,43%)					
310 Bono Internacional del Estado de Baréin, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 19/09/2044	250	0,48	300 WW International Inc, 8,946 %, con vencimiento 13/04/2028 *	227	0,44
Colombia — 0,52% (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
350 Bono internacional del Estado de Colombia, 3,125 %, con vencimiento 15/04/2031	271	0,52	Total de obligaciones de préstamo (coste 2295)		
Costa Rica — 0,39 % (28 de febrero de 2023: 0,34%)					
200 Bono internacional del Estado de Costa Rica, 6,125 %, con vencimiento 19/02/2031	200	0,39	Acciones ordinarias — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)		
Costa de Marfil — 0,68 % (28 de febrero de 2023: 0,62%)					
410 Bono Internacional del Estado de Costa de Marfil, 144A, 6,125 %, con vencimiento 15/06/2033	352	0,68	Suiza — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)		
República Dominicana — 1,78 % (28 de febrero de 2023: 1,60%)					
380 Bono internacional de la República Dominicana, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 30/01/2030	332	0,65	1.680 Credit Suisse Group AG Escrow †	-	-
400 Bono internacional de la República Dominicana, 144A, 7,050 %, con vencimiento 03/02/2031	399	0,77	Total de acciones ordinarias (coste de - USD)		
220 Bono internacional de la República Dominicana, 4,875 %, con vencimiento el 23/09/2032	187	0,36		-	-
	918	1,78			
Ecuador — 0,36 % (28 de febrero de 2023: 0,58%)					
660 Bono internacional del Gobierno de Ecuador, 144A, cupón cero, con vencimiento 31/07/2030	186	0,36			
Paraguay — 0,82% (28 de febrero de 2023: 0,89%)					
300 Bono internacional del Estado de Egipto, 6,588 %, con vencimiento el 21/02/2028	197	0,38			
350 Bono internacional del Estado de Egipto, 144A, 7,600 %, con vencimiento 01/03/2029	226	0,44			
	423	0,82			
Jordania — 0,88% (28 de febrero de 2023: 0,79%)					
440 Bono internacional del Estado de Jordania, 144A, 7,750 %, con vencimiento 15/01/2028	452	0,88			
Kenia — 0,33 % (28 de febrero de 2023: 0,30%)					
200 Bono internacional de la República de Kenia, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 28/02/2028	170	0,33			
México — 2,08 % (28 de febrero de 2023: 1,29%)					
550 Bonos Mexicanos, Serie M, 7,750 %, con vencimiento el 29/05/2031	29	0,06			
MXN 10.720 Bonos Mexicanos, Series M, 7,750 %, con vencimiento el 23/11/2034	563	1,09			
MXN 4.680 Bonos Mexicanos, Series M, 7,750 %, con vencimiento 13/11/2042	235	0,45			
300 Bono internacional del Estado de México, 2,659 %, con vencimiento el 24/05/2031	249	0,48			
	1.076	2,08			
Nigeria — 1,04% (28 de febrero de 2023: 0,40%)					

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor liquidativo
Warrants — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)		
Estados Unidos — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)		
4 EG Acquisition Corp	1	-
Total de warrants (coste 4\$)	1	-
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 58,925\$)		
	50,686	98,07
Contratos de divisas a plazo — 0,06 % (28 de febrero de 2023: 0,10%)		
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	32	0,06
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	50,718	98,13
Contratos de divisas a plazo — (0,20%) (28 de febrero de 2023: 0,47%)		
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(105)	(0,20)
Futuros — (0,02%) (28 de febrero de 2023: 0,00%)		
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(10)	(0,02)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	(115)	(0,22)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	50,603	97,91
Excedente de otros activos respecto a los pasivos	1,080	2,09
Patrimonio	51,683\$	100,00

ABREVIATURAS:

Perpetuo	- Un bono sin fecha de vencimiento. Los bonos perpetuos no son rescatables, pero pagan un flujo constante de intereses.
EUR	- euro
GBP	- libra esterlina
MXN	- peso mexicano
RUB	- Rublo ruso

Análisis del total de activos

	% del total de activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	95,35
Otros valores mobiliarios negociables en otro mercado regulado	0,43
Instrumentos financieros derivados	0,06
Otros activos	4,16
Total de activos	100,00

- Los importes designados como "-" son 0 EUR, menos de 1000 EUR, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.

144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. Al 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 28,353,000 USD o el 54,87 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.

† Poca liquidez.

γ El valor ya no acumula ingresos durante y/o después del periodo financiero finalizado el 31 de agosto de 2023 debido a la incertidumbre de los pagos de intereses.

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)			Moneda de venta (en miles)			Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	4	Venta	GBP	3	USD	-
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	2	Venta	SGD	3	-	-
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	-	Venta	USD	-	-	-
06 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	2	Venta	SGD	2	-	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	82	Venta	AUD	126	-	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	62	Venta	AUD	97	-	(1)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	28	Venta	EUR	27	-	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	203	Venta	GBP	160	-	1
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	124	Venta	SGD	166	-	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	10	Venta	SGD	14	-	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	AUD	6.716	Venta	USD	4.391	-	(37)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	AUD	73	Venta	USD	47	-	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	105	Venta	USD	132	-	1
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	2.414	Venta	USD	1.796	-	(9)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	1.719	Venta	USD	1.893	-	(26)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	1	Venta	USD	-	-	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	3.091	Venta	USD	3.936	-	(20)
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	2.048	Venta	GBP	1.592	-	30
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	GBP	306	Venta	USD	400	-	(12)
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	EUR	8	Venta	USD	9	-	-
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): 60\$								USD	32
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(271)									(105)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(211))								USD	(73)

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico(en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
Euro FX Currency Septiembre 2023	UBS	(23)	USD (3.120)	USD (10)	
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): 38\$				USD	-
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): - USD					(10)
Depreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): 38\$				USD	(10)

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos — 13,21% (28 de febrero de 2023: 14,21%)					
Francia — 1,46 % (28 de febrero de 2023: 1,32%)					
8.000	SGD Credit Agricole SA, 3,800 %, con vencimiento el 30/04/2031 *	5,744	1,46		
Hong Kong — 0,45% (28 de febrero de 2023: 0,46%)					
3.000	Panther Ventures Ltd, 3,500 %, Perpetuo	1,785	0,45		
India — 0,92 % (28 de febrero de 2023: 0,80%)					
4.000	REC Ltd, 2,250 %, vencimiento 01/09/2026	3,611	0,92		
Indonesia — 1,76 % (28 de febrero de 2023: 2,30%)					
3.350	Pelabuhan Indonesia Persero PT, 5,375 %, vencimiento 05/05/2045	3,134	0,80		
4.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 4,125 %, vencimiento 15/05/2027	3,796	0,96	42.670	10,85
		6.930	1,76		
Malasia — 0,56% (28 de febrero de 2023: 0,51%)					
3.000	SGD Cagamas Global Plc, 3,850 %, vencimiento 11/09/2023	2,220	0,56		
Warrants — 2,32 % (28 de febrero de 2023: 2,05%)					
140.000.000	IDR QNB Finance Ltd, 6,900 %, vencimiento 23/01/2025	9,123	2,32		
Singapur — 1,68 % (28 de febrero de 2023: 3,78%)					
SGD	11.500 Temasek Financial I Ltd, 2,800 %, con vencimiento el 17/08/2071	6,593	1,68		
Supranacional — 4,06% (28 de febrero de 2023: 1,46%)					
INR	800.000 European Bank for Reconstruction & Development, 5,150 %, vencimiento 16/02/2024	9,578	2,44		
IDR	20.000.000 International Bank for Reconstruction & Development, 4,300 %, vencimiento 13/09/2023	1,312	0,33		
IDR	77.000.000 International Finance Corp, 8,000 %, vencimiento 09/10/2023	5,062	1,29		
		15,952	4,06		
		51.958	13,21		
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 57.0375)					
Bonos y obligaciones del Estado — 85,50% (28 de febrero de 2023: 83,94%)					
Australia — 1,57% (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
AUD	10000 Bono Internacional del Estado de Australia, 3,750 %, con vencimiento el 21/04/2037	6,192	1,57		
China — 18,85 % (28 de febrero de 2023: 17,35%)					
110.000	CNY Agricutural Development Bank of China, Serie 1806, 4,650 %, vencimiento 11/05/2028	16,480	4,19		
7.500	HKD China Development Bank/Hong Kong, 5,710 %, con vencimiento el 24/01/2024 *	957	0,24		
33.000	CNY Bono Internacional del Estado de China, 3,380 %, con vencimiento el 21/11/2024	4,593	1,17		
50.000	CNY Bono Internacional del Estado de China, Serie INBK, 2,680 %, con vencimiento el 21/05/2030	6,914	1,76		
96.500	CNY Bono Internacional del Estado de China, 3,600 %, con vencimiento el 21/05/2030	13,979	3,55		
100.000	CNY Bono Internacional del Estado de China, Serie INBK, 3,390 %, con vencimiento el 16/03/2050	14,877	3,78		
5.000	CNY Export-Import Bank of China/The, 4,400 %, vencimiento 14/05/2024	695	0,18		
40.000	CNY Export-Import Bank of China/The, Serie 2007, 3,260 %, con vencimiento el 24/02/2027	5,622	1,43		
30.000	CNY Export-Import Bank of China/The, Serie 1910, 3,860%, vencimiento 20/05/2029	4,380	1,11		
40.000	CNY Export-Import Bank of China/The, Serie 2010, 3,230%, vencimiento 23/03/2030	5,669	1,44		
		74,166	18,85		
India — 7,40 % (28 de febrero de 2023: 7,70%)					
280.000	INR Bono del Estado de la India, 8,150 %, con vencimiento el 24/11/2026	3,480	0,88		
750.000	INR Bono del Estado de la India, Serie SPB, 8,240 %, vencimiento 15/02/2027	9,354	2,38		
450.000	INR Bono del Estado de la India, 7,170 %, con vencimiento el 08/01/2028	5,433	1,38		
700.000	INR Bono del Estado de la India, 7,610 %, con vencimiento el 09/05/2030	8,667	2,20		
190.000	INR Bono del Estado de la India, 6,570 %, con vencimiento el 05/12/2033	2,196	0,56		
		29,130	7,40		
Indonesia — 11,51 % (28 de febrero de 2023: 10,13%)					
108.875.000	IDR Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR59, 7,000 %, con vencimiento el 15/05/2027	7,328	1,86		
20.000.000	IDR Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR47, 10,000 %, con vencimiento el 15/02/2028	1,490	0,38		
27.500.000	IDR Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR64, 6,125 %, con vencimiento el 15/05/2028	1,799	0,46		
100.000.000	IDR Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR87, 6,500 %, con vencimiento el 15/02/2031	6,611	1,68		
114.000.000	IDR Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR54, 9,500 %, con vencimiento el 15/07/2031	8,862	2,25		
25.000.000	IDR Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR58, 8,250 %, con vencimiento el 15/06/2032	1,820	0,46		
160.000.000	IDR Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR89, 6,875 %, con vencimiento el 15/08/2051	10,681	2,72		
100.000.000	IDR Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia, Serie OB, 8,250 %, con vencimiento 15/08/2024	6,685	1,70		
		45,276	11,51		
Malasia — 10,85% (28 de febrero de 2023: 11,48%)					
25.000	MYR Bono del Estado de Malasia, Serie 0115, 3,955 %, con vencimiento el 15/09/2025	5,438	1,38		
1.200	MYR Bono del Estado de Malasia, Serie 0308, 5,248 %, con vencimiento el 15/09/2028	277	0,07		
26.850	MYR Bono del Estado de Malasia, Serie 0219, 3,885 %, con vencimiento el 15/08/2029	5,824	1,48		
50.000	MYR Bono del Estado de Malasia, Serie 0411, 4,232 %, con vencimiento el 30/06/2031	11,051	2,81		
51.780	MYR Bono del Estado de Malasia, Serie 0122, 3,582 %, con vencimiento el 15/07/2032	10,920	2,78		
22.510	MYR Bono del Estado de Malasia, Serie 0413, 3,844 %, con vencimiento el 15/04/2033	4,833	1,23		
20.360	MYR Bono del Estado de Malasia, Serie 0419, 3,828 %, con vencimiento 05/07/2034	4,327	1,10		
		42,670	10,85		
Filipinas — 5,46% (28 de febrero de 2023: 4,92%)					
1.256.000	PHP Bono Internacional del Estado de Filipinas, 6,250 %, con vencimiento el 14/01/2036	21,486	5,46		
Singapur — 5,22 % (28 de febrero de 2023: 6,16%)					
2.000	SGD Housing & Development Board, 3,995 %, con vencimiento 06/12/2029	1,509	0,38		
4.000	SGD Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, cupón cero, con vencimiento el 15/09/2023	2,955	0,75		
4.600	SGD Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, cupón cero, con vencimiento 13/10/2023	3,388	0,86		
8.250	SGD National Environment Agency, 2,500 %, con vencimiento 15/09/2051	4,858	1,24		
11.000	SGD Bono del Estado de Singapur, 2,625 %, con vencimiento 01/08/2032	7,814	1,99		
		20,524	5,22		
Corea del Sur — 17,49 % (28 de febrero de 2023: 18,25%)					
50.000.000	IDR Export-Import Bank of Korea, 144A, 6,700 %, con vencimiento 02/12/2024	3,285	0,84		
	2,600 Korea Electric Power Corp, 5,375 %, con vencimiento 31/07/2026	2,602	0,66		
25.000.000	KRW Bono del Tesoro de Corea, serie 2912, 1,375 %, con vencimiento el 10/12/2029	16,424	4,17		
46.300.000	KRW Bono del Tesoro de Corea, serie 3006, 1,375 %, con vencimiento el 10/06/2030	30,062	7,64		
13.200.000	KRW Bono del Tesoro de Corea, serie 3206, 3,375 %, con vencimiento el 10/06/2032	9,721	2,47		
13.000.000	KRW Bono del Tesoro de Corea, serie 3909, 1,125 %, con vencimiento el 10/09/2039	6,731	1,71		
		68,825	17,49		
Tailandia — 6,03% (28 de febrero de 2023: 5,38%)					
801 030 THB	Bono Internacional del Estado de Tailandia, 3,300 %, con vencimiento el 17/06/2038	23,744	6,03		
Warrants — 1,12 % (28 de febrero de 2023: 0,34%)					
	4.500 Bono Internacional de Estado de Vietnam, 4,800 %, con vencimiento 19/11/2024	4,413	1,12		
		336,426	85,50		
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 389.2225)					
Organismos de inversión colectiva — 0,67% (28 de febrero de 2023: 0,88%)					
	2.645 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	2,645	0,67		
		2,645	0,67		
Total de organismos de inversión colectiva (coste: 2.6455)					
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 448.9045)					
Contratos de divisas a plazo — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,04%)					
	Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		6		–
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias					
			391,035		99,38
Contratos de divisas a plazo — (0,16%) (28 de febrero de 2023: 0,26%)					
	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(618)		(0,16)
Futuros — (0,07%) (28 de febrero de 2023: 0,09%)					
	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(269)		(0,07)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias					
			(887)		(0,23)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias					
			390,148		99,15
Excedente de otros activos respecto a los pasivos					
			3,317		0,85
Patrimonio					
			393,465\$		100,00
– Los importes designados como “–” son 0 EUR, menos de 1000 EUR, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.					
144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. Al 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 3,285,000 USD o el 0,84 % del patrimonio neto.					
* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.					

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

ABREVIATURAS:

Perpetuo	- Un bono sin fecha de vencimiento. Los bonos perpetuos no son rescatables, pero pagan un flujo constante de intereses.
AUD	- dólar australiano
CNY	- renminbi chino
HKD	- dólar de Hong Kong
IDR	- rupia indonesia
INR	- rupia india
KRW	- won surcoreano
MYR	- ringgit malasio
PHP	- peso filipino
SGD	- dólar de Singapur
THB	- baht tailandés

	% del total de activos
Análisis del total de activos	
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	97,90
Organismos de inversión colectiva	0,67
Instrumentos financieros derivados	-
Otros activos	1,43
Total de activos	100,00

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)		Moneda de venta (en miles)		Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)			
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	34	Venta	CNH	250	USD	-
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	-	Venta	EUR	-	-	-
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	-	Venta	USD	-	-	-
06 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	-	Venta	SGD	-	-	-
06 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	AUD	2	Venta	USD	1	-	-
06 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	-	Venta	USD	-	-	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	38	Venta	AUD	60	-	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	316	Venta	AUD	487	-	3
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	4	Venta	CHF	3	-	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	30	Venta	CNH	215	-	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	289	Venta	CNH	2.107	-	(1)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	304	Venta	EUR	277	-	3
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	-	Venta	SGD	-	-	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	27	Venta	SGD	36	-	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	AUD	18.993	Venta	USD	12.417	-	(142)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	AUD	20	Venta	USD	13	-	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CHF	269	Venta	USD	308	-	(4)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CNH	48.745	Venta	USD	6.762	-	(60)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CNH	450	Venta	USD	62	-	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	3.174	Venta	USD	2.362	-	(18)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	11	Venta	USD	9	-	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	13.712	Venta	USD	15.087	-	(274)
25 sep. 2023	Citi	Compra	SGD	5.500	Venta	USD	4.146	-	(83)
28 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	16.150	Venta	USD	11.970	-	(36)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): 162\$							USD	6	-
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(1.130))									(618)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(968))							USD		(612)

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico(en miles)		Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)		
Bono a 10 años de Korea Septiembre 2023	UBS	234	USD	19.400	USD	(269)	
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): - USD)						USD	-
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(373))							(269)
Depreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(373))						USD	(269)

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor neto de los activos
Bonos y pagarés corporativos (continuación)			251 Walmart Inc, 2,375 %, con vencimiento el 24/09/2029		
Reino Unido — (continuación)			224 0,05		
2.200	1.939	0,41	Total de bonos y pagarés corporativos (coste 459.427\$)		
5.220	5.154	1,09	197.365 41,62		
340	330	0,07	Bonos y obligaciones del Estado — 7,37% (28 de febrero de 2023: 14,70%)		
1.520	1.530	0,32	Canadá — 1,08 % (28 de febrero de 2023: 0,94%)		
1.500	1.722	0,36	1.200	1.430	0,30
2.500	2.713	0,57	3.000	3.711	0,78
800	850	0,18	Países Bajos — 2,31 % (28 de febrero de 2023: 2,02%)		
4.800	4.622	0,97	8.800	10.936	2,31
5.200	5.120	1,08	Corea del Sur — 0,15 % (28 de febrero de 2023: 0,13%)		
3.000	2.981	0,63	660	692	0,15
530	549	0,12	Suecia — 1,59 % (28 de febrero de 2023: 1,40%)		
2.550	2.522	0,53	6.100	7.547	1,59
2.000	2.050	0,43	Estados Unidos — 2,24 % (28 de febrero de 2023: 10,21%)		
1.276	1.247	0,26	11.180 United States Treasury Note/Bond, 1.000%, vencimiento 15/12/2024		
588	545	0,11	Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 34.555\$)		
4.000	3.949	0,83	Organismos de inversión colectiva — 0,83% (28 de febrero de 2023: 3,25%)		
1.360	1.476	0,31	3.957 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)		
3.000	2.640	0,56	Total de organismos de inversión colectiva (coste: 3.957\$)		
2.400	2.259	0,48	Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 497.939\$)		
1.300	1.267	0,27	464.179 97,89		
800	788	0,17	Contratos de divisas a plazo — 0,52 % (28 de febrero de 2023: 0,71%)		
230	288	0,06	2.481 0,52		
3.420	3.306	0,70	Futuros — 0,15% (28 de febrero de 2023: 0,92%)		
2.900	2.396	0,50	718 0,15		
5.000	4.536	0,96	Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
2.600	2.604	0,55	467.378 98,56		
1.300	1.312	0,28	Swaps de incumplimiento de crédito: (0,07%) (28 febrero de 2023: 0,00%)		
2.890	2.761	0,58	Depreciación latente de contratos (véase más abajo) (326) (0,07)		
1.800	1.592	0,34	Contratos de divisas a plazo — (0,68%) (28 de febrero de 2023: 0,62%)		
2.900	2.632	0,55	Depreciación latente de contratos (véase más abajo) (3.247) (0,68)		
7.000	5.705	1,20	Futuros — (0,15%) (28 de febrero de 2023: 0,01%)		
2.000	1.716	0,36	Depreciación latente de contratos (véase más abajo) (705) (0,15)		
1.440	1.645	0,35	Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
2.200	2.131	0,45	(4.278) (0,90)		
780	745	0,16	Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
1.830	1.761	0,37	463.100 97,66		
4.500	3.800	0,80	Excedente de otros activos respecto a los pasivos		
180	158	0,03	11.108 2,34		
110	110	0,02	Patrimonio		
3.090	3.074	0,65	474.208\$ 100,00		
4.400	3.969	0,84	— Los importes designados como "-" son 0 EUR, menos de 1000 EUR, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.		
240	207	0,04	144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. Al 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 14,370,000 USD o el 3,03 % del patrimonio neto.		
910	883	0,19	* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.		
2.100	2.087	0,44	ABREVIATURAS:		
2.800	3.027	0,64	EUR – euro		
1.150	1.104	0,23	GBP – libra esterlina		
1.700	1.632	0,34			
280	276	0,06			
2.000	1.912	0,40			
2.550	2.562	0,54			
4.340	3.774	0,80			
570	552	0,12			
2.400	2.252	0,47			
330	331	0,07			
2.040	2.264	0,48			
2.790	2.508	0,53			
320	402	0,08			
680	659	0,14			
3.000	3.014	0,64			
2.900	2.776	0,59			
1.600	1.437	0,30			
310	307	0,06			
3.000	2.862	0,60			
1.260	1.437	0,30			
8.000	7.878	1,66			
1.250	1.308	0,28			
350	336	0,07			
2.200	2.006	0,42			
2.600	2.195	0,46			
3.500	3.800	0,80			
4.200	3.636	0,77			
400	417	0,09			
1.040	1.005	0,21			
4.900	4.778	1,01			
2.400	2.557	0,54			
560	529	0,11			
1.150	1.071	0,23			
3.850	3.833	0,81			
1.630	1.311	0,28			
1.340	1.467	0,31			
5.320	5.296	1,12			
2.000	2.078	0,44			
2.800	2.875	0,61			
540	518	0,11			
4.000	3.627	0,76			

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

	% del total de activos
Análisis del total de activos	
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	95,59
Organismos de inversión colectiva	0,82
Instrumentos financieros derivados	0,66
Otros activos	2,93
Total de activos	100,00

Listado de swaps de incumplimiento de crédito

Contraparte	Entidad de Referencia – Protección Compra/Venta	Fecha de vencimiento	Importe teórico (miles)	Valor (miles)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000 % - Comprar	20 jun. 2028	23.140	USD (326)
Apreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 febrero de 2023 [miles]: 213\$)				USD -
Depreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 [miles]: - USD)				(326)
Depreciación neta de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 [miles]: 213\$)				USD (326)

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)		Moneda de venta (en miles)		Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD 56	Venta	EUR 51	USD -
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD 141	Venta	GBP 111	1
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SEK 130	Venta	USD 12	-
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP 42	Venta	USD 54	-
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR 55	Venta	USD 60	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD 1.077	Venta	EUR 995	(4)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD 28.831	Venta	EUR 26.487	87
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD 578	Venta	GBP 458	(2)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD 2.050	Venta	GBP 1.613	10
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD 165	Venta	SEK 1.819	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD 100	Venta	SEK 1.077	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR 16	Venta	USD 17	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	AUD 14.578	Venta	USD 9.531	(80)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CHF 4.000	Venta	USD 4.580	(45)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR 88.023	Venta	USD 96.841	(1.320)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP 1.165	Venta	USD 1.472	5
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP 214.727	Venta	USD 273.454	(1.422)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SEK 121	Venta	USD 11	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SEK 131.492	Venta	USD 12.329	(310)
16 nov. 2023	BNP Paribas	Compra	USD 8.148	Venta	EUR 7.411	82
16 nov. 2023	BNP Paribas	Compra	USD 19.786	Venta	GBP 15.572	57
16 nov. 2023	BNP Paribas	Compra	GBP 743	Venta	USD 945	(3)
16 nov. 2023	Citi	Compra	USD 34.253	Venta	EUR 31.171	325
16 nov. 2023	Citi	Compra	USD 11.668	Venta	GBP 9.184	32
16 nov. 2023	Citi	Compra	EUR 602	Venta	USD 666	(11)
16 nov. 2023	Goldman Sachs	Compra	USD 34.018	Venta	EUR 30.951	329
16 nov. 2023	Goldman Sachs	Compra	USD 6.415	Venta	GBP 5.048	19
16 nov. 2023	Goldman Sachs	Compra	USD 568	Venta	JPY 79.998	11
16 nov. 2023	HSBC	Compra	USD 29.035	Venta	EUR 26.419	279
16 nov. 2023	HSBC	Compra	USD 543	Venta	EUR 500	(2)
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	USD 38.225	Venta	EUR 34.772	377
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	USD 10.441	Venta	GBP 8.220	27
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	EUR 9.000	Venta	USD 9.818	(22)
16 nov. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD 34.696	Venta	EUR 31.568	336
16 nov. 2023	Morgan Stanley	Compra	EUR 2.000	Venta	USD 2.180	(3)
16 nov. 2023	Royal Bank of Canada	Compra	USD 16.646	Venta	GBP 13.106	40
16 nov. 2023	UBS	Compra	USD 37.727	Venta	EUR 34.331	359
16 nov. 2023	UBS	Compra	USD 42.615	Venta	GBP 33.552	105
16 nov. 2023	UBS	Compra	EUR 5.032	Venta	USD 5.500	(23)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): 3.707\$						USD 2.481
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(3.219)						(3.247)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 488\$)						USD (766)

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico(en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Euro-Bobl Diciembre de 2023	Bank of America Merrill Lynch	(631)	USD (80.376)	(469)
Euro-Bund diciembre de 2023	Bank of America Merrill Lynch	(174)	(25.024)	(229)
Bono a 10 años de Japón (OSE) Septiembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(12)	(12.110)	91
Long Gilt Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	99	11.986	215
U.S. 10 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	354	39.305	412
U.S. 5 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(10)	(1.069)	(7)
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): 4.839\$				USD 718
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(61)				(705)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): 4.778\$				USD 13

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) \$	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) \$	% del valor neto de los activos
130	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2029	114	0,07	945	Bank of America Corp, 2,592 %, con vencimiento el 29/04/2031 *	787	0,51
750	EUR Bank of Montreal, 2,750 %, con vencimiento el 15/06/2027	783	0,51	610	Bank of America Corp, 5,015 %, con vencimiento el 22/07/2033 *	587	0,38
540	GBP Royal Bank of Canada, 3,625 %, con vencimiento el 14/06/2027	629	0,41	27	Becton Dickinson and Co, 3,734 %, con vencimiento el 15/12/2024	26	0,02
		1.644	1,06	220	BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, con vencimiento el 06/04/2030	203	0,13
China — 0,01 % (28 de febrero de 2023: 0,01%)				130	CommScope Inc, 144A, 3,137 %, con vencimiento el 15/11/2035	99	0,06
		19	0,01	330	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 15/01/2034	253	0,16
Dinamarca — 0,51 % (28 de febrero de 2023: 0,54%)				130	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, con vencimiento el 23/07/2025	128	0,08
		791	0,51	60	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, con vencimiento el 15/03/2028	56	0,04
Francia — 1,12 % (28 de febrero de 2023: 0,92%)				290	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, con vencimiento el 01/04/2048	276	0,18
		187	0,12	140	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, con vencimiento el 01/04/2048	118	0,08
300	GBP BNP Paribas SA, 1,875 %, con vencimiento el 14/12/2027	318	0,21	110	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,250 %, con vencimiento el 01/04/2053	87	0,06
Bonos y pagarés corporativos (continuación)				110	Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, con vencimiento el 31/01/2032	91	0,06
Francia — (continuación)				420	Cigna Group/The, 4,375 %, con vencimiento el 15/10/2028	405	0,26
1.000	EUR BNP Paribas SA, 0,500 %, con vencimiento el 30/05/2028 *	946	0,61	230	Cigna Group/The, 3,200 %, con vencimiento el 15/03/2040	172	0,11
		137	0,09	130	Cigna Group/The, 4,900 %, con vencimiento el 15/12/2048	116	0,07
		136	0,09	EUR Citigroup Inc, 1,750 %, con vencimiento el 28/01/2025	305	0,20	
		1.724	1,12	130	Citigroup Inc, 5,500 %, con vencimiento el 13/09/2025	129	0,08
Alemania — 0,53 % (28 de febrero de 2023: 1,15%)				120	Citigroup Inc, 4,600 %, con vencimiento el 09/03/2026	117	0,08
250	GBP E.ON International Finance BV, 5,625 %, con vencimiento 06/12/2023	316	0,21	350	Citigroup Inc, 4,300 %, con vencimiento el 20/11/2026	336	0,22
500	EUR Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250 %, con vencimiento el 26/05/2049 *	500	0,32	260	Citigroup Inc, 4,450 %, con vencimiento el 29/09/2027	249	0,16
		816	0,53	230	Citigroup Inc, 3,785 %, con vencimiento el 17/03/2033 *	200	0,13
Israel — 0,58 % (28 de febrero de 2023: 0,58%)				93	Citigroup Inc, 5,300 %, con vencimiento el 06/05/2044	85	0,05
		27	0,02	85	Citigroup Inc, 4,650 %, con vencimiento 30/07/2045	73	0,05
		200	0,13	120	Comcast Corp, 4,000 %, con vencimiento el 01/03/2048	97	0,06
		667	0,43	66	Comcast Corp, 3,999 %, con vencimiento el 01/11/2049	53	0,03
		894	0,58	360	Comcast Corp, 2,887 %, con vencimiento el 01/11/2051	231	0,15
Italia — 0,74 % (28 de febrero de 2023: 0,74%)				51	Comcast Corp, 4,049 %, con vencimiento el 01/12/2052	41	0,03
1.100	EUR UniCredit SpA, 1,200 %, con vencimiento el 20/01/2026 *	1.139	0,74	57	Comcast Corp, 2,987 %, con vencimiento el 01/11/2063	35	0,02
Luxemburgo — 0,58 % (28 de febrero de 2023: 0,42%)				200	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, con vencimiento 01/02/2029	166	0,11
		262	0,17	360	CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 15/11/2031	256	0,17
620	EUR Logicor Financing Sarl, 1,625 %, con vencimiento el 15/07/2027	565	0,36	180	CVS Health Corp, 3,750 %, con vencimiento el 01/04/2030	164	0,10
100	EUR Logicor Financing Sarl, 2,000 %, con vencimiento el 17/01/2034	71	0,05	200	CVS Health Corp, 2,700 %, con vencimiento el 21/08/2040	134	0,09
		898	0,58	390	CVS Health Corp, 5,050 %, con vencimiento el 25/03/2048	342	0,22
Macao — 0,11 % (28 de febrero de 2023: 0,12%)				40	Diamondback Energy Inc, 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2029	36	0,02
		177	0,11	20	DISH DBS Corp, 5,875 %, con vencimiento el 15/11/2024	112	0,07
Países Bajos — 0,81 % (28 de febrero de 2023: 0,97%)				60	DISH Finance Corp, 144A, 5,750 %, con vencimiento 01/12/2028	47	0,03
900	EUR ING Groep NV, 2,500 %, con vencimiento el 15/02/2029 *	962	0,62	70	DISH DBS Corp, 5,125 %, con vencimiento el 01/06/2029	38	0,02
		70	0,05	180	Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, con vencimiento el 31/01/2030	156	0,10
		174	0,11	330	Enterprise Products Operating LLC, 5,100 %, con vencimiento el 15/02/2045	303	0,20
		43	0,03	6	EQT Corp, 6,125 %, con vencimiento 01/02/2025	6	—
		1.249	0,81	10	Exelon Corp, 5,625 %, con vencimiento el 15/06/2035	10	0,01
España — 0,28 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)				10	Exxon Mobil Corp, 3,452 %, con vencimiento el 15/04/2051	75	0,05
500	EUR Cellnex Finance Co SA, 2,000 %, con vencimiento 15/09/2032	432	0,28	310	Ford Motor Co, 3,250 %, con vencimiento el 12/02/2032	242	0,16
Suiza — 1,43 % (28 de febrero de 2023: 1,41%)				520	Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, con vencimiento el 13/11/2030	440	0,28
1.470	EUR UBS Group AG, 1,500 %, con vencimiento el 30/11/2024	1.577	1,02	20	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, con vencimiento el 15/03/2043	18	0,01
290	EUR UBS Group AG, 3,250 %, con vencimiento el 02/04/2026 *	308	0,20	70	General Motors Co, 6,600 %, con vencimiento 01/04/2036	70	0,05
100	EUR UBS Group AG, 1,000 %, con vencimiento el 24/06/2027 *	98	0,06	10	General Motors Co, 5,200 %, con vencimiento 01/04/2045	8	0,01
		225	0,15	70	General Motors Co, 6,750 %, con vencimiento 01/04/2046	69	0,04
		2.208	1,43	150	Gilead Sciences Inc, 4,800 %, con vencimiento el 01/04/2044	138	0,09
Emiratos Árabes Unidos — 0,48 % (28 de febrero de 2023: 0,50%)				30	Gilead Sciences Inc, 4,750 %, con vencimiento el 01/03/2046	27	0,02
		420	0,27	110	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, con vencimiento el 01/04/2025	106	0,07
400	EUR MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000 %, con vencimiento el 10/03/2034	320	0,21	620	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,750 %, con vencimiento el 01/10/2037	658	0,43
		740	0,48	300	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, con vencimiento el 01/02/2041	317	0,21
Reino Unido — 2,51 % (28 de febrero de 2023: 2,96%)				280	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, con vencimiento el 22/05/2045	258	0,17
670	GBP Aviva Plc, 6,125 %, con vencimiento 14/11/2036 *	840	0,54	280	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/12/2028	245	0,16
100	GBP Aviva Plc, 5,125 %, con vencimiento el 04/06/2050 *	112	0,07	EUR Haleon Netherlands Capital BV, 1,750 %, con vencimiento el 29/03/2030	134	0,09	
		545	0,35	260	Haleon US Capital LLC, 3,625 %, con vencimiento el 24/03/2032	231	0,15
550	EUR HSBC Holdings Plc, 4,250 %, con vencimiento el 18/08/2025	545	0,35	340	HCA Inc, 5,000 %, con vencimiento 15/03/2024	338	0,22
		575	0,37	380	HCA Inc, 5,250 %, con vencimiento 15/06/2026	375	0,24
GBP	1.000	Lloyds Banking Group Plc, 7,625 %, con vencimiento el 22/04/2025	1.291	200	HCA Inc, 4,500 %, con vencimiento 15/02/2027	193	0,13
140	EUR Segro Capital Sarl, 1,875 %, con vencimiento el 23/03/2030	131	0,09	130	Home Depot Inc/The, 3,300 %, con vencimiento el 15/04/2040	103	0,07
		385	0,25	70	Home Depot Inc/The, 3,350 %, con vencimiento el 15/04/2050	51	0,03
		3.879	2,51	230	Home Depot Inc/The, 4,950 %, con vencimiento el 15/09/2052	220	0,14
Estados Unidos — 14,68 % (28 de febrero de 2023: 15,12%)				20	Humana Inc, 2,150 %, con vencimiento el 03/02/2032	16	0,01
100	3M Co, 3,700 %, con vencimiento el 15/04/2050	77	0,05	430	Humana Inc, 5,875 %, con vencimiento el 01/03/2033	445	0,29
120	EUR AbbVie Inc, 1,500 %, con vencimiento el 15/11/2023	129	0,08	70	JPMorgan Chase & Co, 4,125 %, con vencimiento 15/12/2026	67	0,04
		97	0,06	1.080	JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, con vencimiento 22/04/2031 *	906	0,59
		72	0,05	440	JPMorgan Chase & Co, 2,956 %, con vencimiento 13/05/2031 *	374	0,24
		111	0,07	280	JPMorgan Chase & Co, 5,717 %, con vencimiento 14/09/2033 *	280	0,18
		270	0,17	30	McDonald's Corp, 3,625 %, con vencimiento el 01/09/2049	23	0,01
		69	0,04	110	McDonald's Corp, 4,200 %, con vencimiento el 01/04/2050	91	0,06
		33	0,02	29	Medtronic Inc, 4,625 %, con vencimiento 15/03/2045	27	0,02
		117	0,08				
		147	0,10				
		22	0,01				
		470	0,30				
		154	0,10				

[^] No está autorizada para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor neto de los activos		
Bonos y pagarés corporativos (continuación)							
Estados Unidos — (continuación)							
	40	0,03	14.850	JPY	Bono del Estado de Japón a 30 años, serie 59, 0,700 %, con vencimiento el 20/06/2048	85	0,05
	10	0,01	485.000	JPY	Bono del Estado de Japón a 30 años, serie 66, 0,400 %, con vencimiento el 20/03/2050	2.500	1,62
	760	0,44				2.585	1,67
	290	0,20	México — 3,82 % (28 de febrero de 2023: 4,03%)				
EUR	850	0,58	77.520	MXN	Bonos Mexicanos, Series M, 7,750 %, vencimiento 13/11/2042	3.885	2,51
	70	0,04	360	EUR	Bono Internacional del Estado de México, 2,875 %, con vencimiento el 08/04/2039	287	0,19
EUR	380	0,19	830	EUR	Bono internacional del Estado de México, 5,550 %, con vencimiento el 21/01/2045	777	0,50
EUR	271	0,14	1.180	EUR	Bono internacional del Estado de México, 4,600 %, con vencimiento el 23/01/2046	958	0,62
	180	0,10				5.907	3,82
	10	0,01	Países Bajos — 0,52 % (28 de febrero de 2023: 0,51%)				
	4	—	970	EUR	BNG Bank NV, 0,010 %, con vencimiento el 05/10/2032	796	0,52
	90	0,05	Polonia — 1,35 % (28 de febrero de 2023: 1,32%)				
	100	0,07	11.570	PLN	Bono del Estado de la República de Polonia, Serie 0432, 1,750 %, con vencimiento el 25/04/2032	2.088	1,35
	40	0,02	Sudáfrica — 1,35 % (28 de febrero de 2023: 1,55%)				
	30	0,02	66.492	ZAR	Bono del Estado de la República de Sudáfrica, Serie R214, 6,500 %, con vencimiento el 28/02/2041	2.078	1,35
	90	0,05	Corea del Sur — 1,18 % (28 de febrero de 2023: 1,23%)				
	240	0,14	2.533.840	KRW	Bono del Tesoro de Corea, serie 2606, 1,875 %, con vencimiento el 10/06/2026	1.825	1,18
	60	0,03	España — 0,71 % (28 de febrero de 2023: 1,44%)				
	100	0,06	500	EUR	Bono del Estado de España, 144A, 5,150 %, con vencimiento el 31/10/2044	638	0,42
	150	0,08	520	EUR	Bono del Estado de España, Serie 30Y, 144A, 2,700 %, con vencimiento el 31/10/2048	453	0,29
	140	0,06				1.091	0,71
	50	0,03	Emiratos Árabes Unidos — 0,46 % (28 de febrero de 2023: 0,50%)				
	80	0,05	890	EUR	Bono Internacional del Estado Abu Dhabi, 3,875 %, con vencimiento el 16/04/2050	718	0,46
	320	0,18	Reino Unido — 5,33 % (28 de febrero de 2023: 5,56%)				
	70	0,04	4.290	GBP	United Kingdom Gilt, 4,250 %, con vencimiento el 07/06/2032	5.429	3,51
	70	0,04	100	GBP	United Kingdom Gilt, 3,750 %, con vencimiento el 29/01/2038	116	0,08
	440	0,29	1.290	GBP	United Kingdom Gilt, 4,250 %, con vencimiento el 07/12/2040	1.565	1,01
	380	0,19	550	GBP	United Kingdom Gilt, 2,500 %, con vencimiento el 22/07/2065	446	0,29
	190	0,11	490	GBP	United Kingdom Inflation-Linked Gilt, Serie 3MO, 0,125 %, con vencimiento el 22/03/2068 β	675	0,44
	50	0,03				8.231	5,33
	10	0,01	Estados Unidos — 20,84 % (28 de febrero de 2023: 19,91%)				
	90	0,04	9.130	USD	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, vencimiento 15/04/2024	8.848	5,73
	340	0,20	5.000	USD	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, vencimiento 28/02/2025	4.717	3,05
	180	0,09	3.000	USD	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, vencimiento 30/04/2025	2.780	1,80
	220	0,11	42	USD	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, vencimiento 30/06/2025	39	0,02
	840	0,51	9.820	USD	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, vencimiento 31/08/2025	8.968	5,81
	810	0,47	3.680	USD	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, vencimiento 31/10/2028	3.191	2,07
			130	USD	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, vencimiento 15/05/2043	121	0,08
			20	USD	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, vencimiento 15/11/2047	15	0,01
			2.300	USD	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, vencimiento 15/05/2049	1.783	1,15
			2.110	USD	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, vencimiento 15/05/2052	1.638	1,06
			20	USD	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, vencimiento 15/08/2052	16	0,01
			80	USD	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, vencimiento 15/02/2053	72	0,05
						32.188	20,84
						85.881	55,60
			Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 95.271\$)				
			Organismos de inversión colectiva — 7,95 % (28 de febrero de 2023: 7,65%)				
			852	EUR	Franklin Templeton China Funds - Western Asset China Bond Fund - Clase LM	11.973	7,75
			2	EUR	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc - Western Asset India Bond Fund - LM Class US\$ Accumulating	310	0,20
						12.283	7,95
			Total de organismos de inversión colectiva (coste: 12.184\$)				
			Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 179.023\$)				
			Swaps de inflación — 0,04 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)				
						61	0,04
			Contratos de divisas a plazo: 0,61 % (28 de febrero de 2023: 0,69%)				
						937	0,61
			Futuros — 0,26 % (28 de febrero de 2023: 0,23%)				
						404	0,26
			Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias				
						164.966	106,80
			Contratos de divisas a plazo — (0,84%) (28 de febrero de 2023: 1,43%)				
						(1.300)	(0,84)
			Futuros — (0,16%) (28 de febrero de 2023: 0,71%)				
						(245)	(0,16)
			Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias				
						(1.545)	(1,00)
			Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias				
						163.421	105,80
			Excedente de pasivos respecto a otros activos				
						(8.957)	(5,80)
			Patrimonio				
						154.464\$	100,00

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

- Los importes designados como “-” son 0 EUR, menos de 1000 EUR, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.
- 144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. Al 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 7,257,000 USD o el 4,69 % del patrimonio neto.
- * Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.
- ± Títulos adquiridos siguiendo la norma “se anunciará”.
- β El tipo de interés sobre esta clase de título está vinculado al índice de precios de consumo (IPC)/índice de precios minoristas (Retail Price Index, RPI). El tipo del cupón es el tipo a 31 de agosto de 2023.

ABREVIATURAS:

TBA	– Pendiente de anuncio.
BRL	– Real brasileño
CAD	– dólar canadiense
EUR	– euro
GBP	– libra esterlina
IDR	– rupia indonesia
JPY	– yen japonés
KRW	– won surcoreano
MXN	– peso mexicano
PLN	– zloty polaco
ZAR	– Rand sudafricano

	% del total de activos
Análisis del total de activos	
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	86,82
Organismos de inversión colectiva	7,05
Instrumentos financieros derivados	0,80
Otros activos	5,33
Total de activos	100,00

Listado de swaps de inflación

Contraparte	Tipo	Fecha de vencimiento	Importe teórico (miles)	Valor (miles)
Bank of America Merrill Lynch	USD - IPC Consumidores urbanos	08 mar. 2053	1.490	USD –
Bank of America Merrill Lynch	EUR - Índice Armonizado de Precios de Consumo	15 mar. 2053	2.850	61
Apreciación latente de swaps de inflación (28 de febrero de 2023 [miles]: - USD)				USD 61
Apreciación latente de swaps de inflación (28 de febrero de 2023 [miles]: - USD)				–
Apreciación neta de swaps de inflación (28 de febrero de 2023 [miles]: - USD)				USD 61

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)		Moneda de venta (en miles)		Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
13 sep. 2023	Citi	Compra	USD 9.218	Venta	CNH 64.960	USD 286	
13 sep. 2023	Citi	Compra	USD 300	Venta	INR 24.760	-	
13 sep. 2023	Citi	Compra	CNH 5.890	Venta	USD 816	(7)	
13 sep. 2023	Goldman Sachs	Compra	USD 2.057	Venta	CNH 14.460	69	
13 sep. 2023	JP Morgan	Compra	USD 1.581	Venta	CNH 11.110	54	
13 sep. 2023	JP Morgan	Compra	USD 1.965	Venta	KRW 2.554.455	34	
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD 912	Venta	CAD 1.227	4	
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD 896	Venta	CAD 1.214	(2)	
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD 44	Venta	EUR 40	-	
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD 829	Venta	EUR 759	6	
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD -	Venta	GBP -	-	
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD 41	Venta	NZD 69	-	
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD 42	Venta	NZD 70	-	
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP -	Venta	USD -	-	
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NZD 7.027	Venta	USD 4.251	(62)	
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CAD 122.816	Venta	USD 91.475	(560)	
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CAD 1.665	Venta	USD 1.231	2	
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR 34.731	Venta	USD 38.206	(518)	
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP 2	Venta	USD 2	-	
19 sep. 2023	Goldman Sachs	Compra	JPY 12.443	Venta	USD 86	-	
16 nov. 2023	BNP Paribas	Compra	USD 10.299	Venta	EUR 9.367	103	
16 nov. 2023	BNP Paribas	Compra	PLN 1.355	Venta	USD 334	(6)	
16 nov. 2023	Citi	Compra	USD 4.480	Venta	EUR 4.077	USD 43	
16 nov. 2023	Citi	Compra	USD 3.726	Venta	GBP 2.933	10	
16 nov. 2023	Citi	Compra	SEK 16.710	Venta	USD 1.573	(41)	
16 nov. 2023	Goldman Sachs	Compra	USD 1.077	Venta	CAD 1.438	11	
16 nov. 2023	Goldman Sachs	Compra	USD 132	Venta	EUR 120	1	
16 nov. 2023	Goldman Sachs	Compra	USD 79	Venta	MXN 1.386	(1)	
16 nov. 2023	Goldman Sachs	Compra	JPY 182.572	Venta	USD 1.295	(25)	
16 nov. 2023	Goldman Sachs	Compra	NOK 16.400	Venta	USD 1.607	(61)	
16 nov. 2023	HSBC	Compra	USD 12.196	Venta	EUR 11.098	117	
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	USD 1.271	Venta	CAD 1.698	13	

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Listado de contratos de divisas a plazo (continuación)

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)		Moneda de venta (en miles)		Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)		
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	USD	2.981	Venta	CNH	21.360	32
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	USD	106	Venta	EUR	97	-
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	USD	10.807	Venta	GBP	8.508	27
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	AUD	46	Venta	USD	31	(1)
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	ZAR	2.721	Venta	USD	144	-
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	EUR	46	Venta	USD	50	-
16 nov. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	118	Venta	CAD	158	1
16 nov. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	2.957	Venta	EUR	2.690	29
16 nov. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	1.749	Venta	GBP	1.376	5
16 nov. 2023	Morgan Stanley	Compra	AUD	1.800	Venta	USD	1.186	(16)
16 nov. 2023	UBS	Compra	USD	9.469	Venta	EUR	8.617	90
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): 1.011\$							USD	937
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(2.097)								(1.300)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(1.086)							USD	(363)

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico(en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Bono a 10 años de Australia Septiembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	18	USD 1.355	USD (17)
Euro-Bobl Diciembre de 2023	Bank of America Merrill Lynch	9	1.146	7
Euro-Bund diciembre de 2023	Bank of America Merrill Lynch	62	8.917	89
Bonos Euro-Buxl a 30 años Diciembre de 2023	Bank of America Merrill Lynch	(1)	(145)	(2)
Euro-Schatz diciembre de 2023	Bank of America Merrill Lynch	63	7.206	18
ICE 3 Month SONIA Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	86	25.681	(42)
ICE 3 Month SONIA Junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	87	26.009	16
Bono a 10 años de Japón (OSE) Septiembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(11)	(11.100)	84
U.S. 10 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	48	5.329	56
U.S. 10 Year Ultra Note Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(103)	(11.959)	(177)
U.S. 2 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	71	14.470	35
U.S. 5 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	130	13.900	86
U.S. Long Bond (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(4)	(487)	(7)
U.S. Ultra Bond (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	5	647	13
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): 338\$				USD 404
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(1.043)				(245)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(705)				USD 159

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Global Credit Fund^Λ

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) \$	% del valor neto de los activos
Bonos y pagarés corporativos (continuación)			140 Workday Inc, 3,800 %, con vencimiento el 01/04/2032		
Estados Unidos — (continuación)			124 0,40		
100 Centene Corp, 4,625 %, con vencimiento el 15/12/2029	92	0,29	Total de bonos y pagarés corporativos (coste 30,455\$)		
80 Charles Schwab Corp/The, Serie H, 4,000 %, Perpetuo *	61	0,19	26.556 84,68		
420 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2041	279	0,89	Bonos y obligaciones del Estado — 8,56% (28 de febrero de 2023: 13,07%)		
20 Chevron USA Inc, 3,850 %, con vencimiento el 15/01/2028	19	0,06	Alemania — 4,50 % (28 de febrero de 2023: 6,86%)		
160 Cigna Group/The, 2,400 %, con vencimiento el 15/03/2030	135	0,43	100 EUR Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,100 %, con vencimiento el 15/11/2029	106	0,34
220 Cigna Group/The, 3,400 %, con vencimiento el 15/03/2050	154	0,49	280 EUR Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, con vencimiento el 15/02/2031	255	0,81
100 Citigroup Inc, 6,174 %, con vencimiento el 25/05/2034 *	100	0,32	380 EUR Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, con vencimiento el 15/08/2031	342	1,09
200 Citigroup Inc, 8,125 %, con vencimiento el 15/07/2039	249	0,79	110 EUR Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,300 %, con vencimiento el 15/02/2033	118	0,38
70 Comcast Corp, 4,950 %, con vencimiento el 15/10/2058	65	0,21	130 EUR Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Serie 05, 4,000 %, con vencimiento el 04/01/2037	163	0,52
170 ConocoPhillips Co, 5,550 %, con vencimiento el 15/03/2054	171	0,54	150 EUR Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Serie 2007, 4,250 %, con vencimiento el 04/07/2039	197	0,63
80 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/01/2031	77	0,24	110 EUR Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Serie 08, 4,750 %, con vencimiento el 04/07/2040	154	0,49
150 Coterra Energy Inc, 3,900 %, con vencimiento el 15/05/2027	143	0,45	90 EUR Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,250 %, con vencimiento el 15/08/2048	75	0,24
110 CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 30/06/2028	96	0,31	1.410 4,50		
160 CVS Health Corp, 5,050 %, con vencimiento el 25/03/2048	140	0,45	Indonesia — 0,96 % (28 de febrero de 2023: 0,63%)		
70 DCP Midstream Operating LP, 5,625 %, con vencimiento el 15/07/2027	70	0,22	350 EUR Bono internacional del Estado de Indonesia, 1,400 %, con vencimiento el 30/10/2031	301	0,96
38 Devon Energy Corp, 4,500 %, con vencimiento el 15/01/2030	36	0,11	México — 1,11 % (28 de febrero de 2023: 1,10%)		
130 Frontera Energy Corp, 5,000 %, con vencimiento el 15/06/2045	111	0,36	420 Bono Internacional del Estado de México, 3,500 %, con vencimiento el 12/02/2034	349	1,11
90 Elevance Health Inc, 3,650 %, con vencimiento el 01/12/2027	85	0,27	Panamá — 0,49% (28 de febrero de 2023: 0,33%)		
40 Energy Transfer LP, 6,500 %, con vencimiento el 01/02/2042	40	0,13	200 Bono Internacional del Estado de Panamá, 2,252 %, con vencimiento el 29/09/2032	152	0,49
130 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, con vencimiento el 15/02/2078 *	108	0,34	Reino Unido — 1,11 % (28 de febrero de 2023: 0,54%)		
40 Exelon Corp, 3,400 %, con vencimiento el 15/04/2026	38	0,12	100 GBP United Kingdom Gilt, 0,125 %, con vencimiento el 30/01/2026	114	0,36
50 Fidelity & Guaranty Life Holdings Inc, 5,500 %, con vencimiento el 01/05/2025	49	0,16	180 GBP United Kingdom Gilt, 4,125 %, con vencimiento el 29/01/2027	223	0,71
180 EUR Ford Motor Credit Co LLC, 2,386 %, con vencimiento el 17/02/2026	184	0,59	GBP 10 United Kingdom Gilt, 0,125 %, con vencimiento el 31/01/2028	11	0,04
100 EUR General Electric Co, 4,125 %, con vencimiento el 19/09/2035	109	0,35	348 1,11		
110 General Motors Co, 6,125 %, con vencimiento el 01/10/2025	110	0,35	Estados Unidos — 0,39 % (28 de febrero de 2023: 3,61%)		
128 General Motors Co, 6,750 %, con vencimiento el 01/04/2046	128	0,41	130 United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, con vencimiento el 15/05/2033	122	0,39
16 Goldman Sachs Capital II, 6,439 %, Perpetuo *	13	0,04	Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 2,962\$)		
170 EUR Goldman Sachs Group Inc/The, 2,875 %, con vencimiento el 03/06/2026	181	0,58	Organismos de inversión colectiva — 0,71% (28 de febrero de 2023: 1,21%)		
110 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,800 %, con vencimiento el 15/03/2030	100	0,32	222 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	222	0,71
120 EUR Haleon Netherlands Capital BV, 1,750 %, con vencimiento el 29/03/2030	18	0,06	Total de organismos de inversión colectiva (coste: 222\$)		
70 Halliburton Co, 5,000 %, con vencimiento el 15/11/2045	63	0,20	Acciones ordinarias — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)		
130 HCA Inc, 3,500 %, con vencimiento el 01/09/2030	114	0,36	680 Credit Suisse Group AG Escrow †	–	–
50 HEICO Corp, 5,250 %, con vencimiento el 01/08/2028	50	0,16	Total de acciones ordinarias (coste de – USD)		
20 HEICO Corp, 5,350 %, con vencimiento el 01/08/2033	20	0,06	Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 33,639\$)		
100 Humana Inc, 3,125 %, con vencimiento el 15/08/2029	89	0,28	29.460 93,95		
90 Humana Inc, 5,875 %, con vencimiento el 01/03/2033	93	0,30	Contratos de divisas a plazo: 0,69 % (28 de febrero de 2023: 0,74%)		
20 Intercontinental Exchange Inc, 4,250 %, con vencimiento el 21/09/2048	17	0,05	Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		
500 EUR JPMorgan Chase & Co, 0,389 %, con vencimiento el 24/02/2028 *	478	1,53	Futuros — 0,35% (28 de febrero de 2023: 0,44%)		
30 Lowe's Cos Inc, 3,000 %, con vencimiento el 15/10/2050	19	0,06	Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		
20 Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 3,375 %, con vencimiento el 15/04/2050	14	0,04	Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
100 McDonald's Corp, 3,700 %, con vencimiento el 30/01/2026	97	0,31	29.786 94,99		
270 McDonald's Corp, 5,450 %, con vencimiento el 14/08/2053	270	0,86	Swaps de incumplimiento de crédito: (0,29%) (28 febrero de 2023: 0,17%)		
150 Microsoft Corp, 2,921 %, con vencimiento el 17/03/2052	106	0,34	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		
340 EUR Morgan Stanley, 4,656 %, con vencimiento el 02/03/2029 *	373	1,19	Contratos de divisas a plazo — (0,25%) (28 de febrero de 2023: 0,19%)		
50 Morgan Stanley, 5,948 %, con vencimiento el 19/01/2038 *	49	0,16	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		
100 MPLX LP, 4,500 %, con vencimiento el 15/04/2038	85	0,27	Futuros — (0,13%) (28 de febrero de 2023: 0,08%)		
130 EUR Netflix Inc, 3,625 %, con vencimiento el 15/06/2030	137	0,44	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		
60 NRG Energy Inc, 144A, 2,450 %, con vencimiento el 02/12/2027	51	0,16	Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
50 Nuveen LLC, 4,000 %, con vencimiento el 01/11/2028	47	0,15	(212) (0,67)		
100 Olin Corp, 5,000 %, con vencimiento el 01/02/2030	92	0,29	Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
50 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,750 %, con vencimiento el 19/05/2033	49	0,16	29.574 94,32		
110 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 5,300 %, con vencimiento el 19/05/2053	110	0,35	Excedente de otros activos respecto a los pasivos		
170 EUR Prologis Euro Finance LLC, 0,625 %, con vencimiento el 10/09/2031	140	0,45	1.785 5,68		
120 Prudential Financial Inc, 3,000 %, con vencimiento el 10/03/2040	89	0,28	Patrimonio		
100 Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/02/2030	90	0,29	31.359\$ 100,00		
120 Service Corp International/US, 3,375 %, con vencimiento el 15/08/2030	99	0,32	– Los importes designados como “–” son 0 EUR, menos de 1000 EUR, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.		
100 Southwestern Energy Co, 5,375 %, con vencimiento el 15/03/2030	94	0,30	144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. Al 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 1,484,000 USD o el 4,72 % del patrimonio neto.		
40 Targa Resources Corp, 4,200 %, con vencimiento el 01/02/2033	35	0,11	* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.		
40 Targa Resources Corp, 4,950 %, con vencimiento el 15/04/2052	33	0,10	† Poca liquidez.		
130 Texas Instruments Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/03/2039	113	0,36			
100 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, con vencimiento el 01/07/2038	101	0,32			
50 T-Mobile USA Inc, 5,650 %, con vencimiento el 15/01/2053	49	0,16			
30 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, con vencimiento el 01/02/2026	31	0,10			
19 American Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, 4,875 %, con vencimiento el 15/01/2026	19	0,06			
120 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 15/04/2026	113	0,36			
130 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, con vencimiento el 15/12/2048	114	0,36			
50 Verizon Communications Inc, 5,250 %, con vencimiento el 16/03/2037	49	0,16			
120 VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2030	105	0,34			
110 Warnermedia Holdings Inc, 5,050 %, con vencimiento el 15/03/2042	91	0,29			
210 EUR Wells Fargo & Co, 1,000 %, con vencimiento el 02/02/2027	205	0,65			
150 Wells Fargo & Co, 5,389 %, con vencimiento el 24/04/2034 *	146	0,47			
100 GBP Wells Fargo & Co, 4,875 %, con vencimiento el 29/11/2035	108	0,35			
60 Western Midstream Operating LP, 5,450 %, con vencimiento el 01/04/2044	50	0,16			
130 Western Midstream Operating LP, 5,250 %, con vencimiento el 01/02/2050	105	0,34			
50 Williams Cos Inc/The, 5,300 %, con vencimiento el 15/08/2028	50	0,16			
90 Williams Cos Inc/The, 5,750 %, con vencimiento el 24/06/2044	85	0,27			
20 Williams Cos Inc/The, 3,500 %, con vencimiento el 15/10/2051	13	0,04			

^Λ No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Listado de swaps de incumplimiento de crédito

Contraparte	Entidad de Referencia – Protección Compra/Venta	Fecha de vencimiento	Importe teórico (miles)	Valor (miles)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1.000 % - Compra	20 jun. 2028	4.200	USD (65)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000 % - Comprar	20 jun. 2028	1.940	(27)
Apreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 febrero de 2023 [miles]: - USD)				USD -
Depreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(76))				(92)
Depreciación neta de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(76))				USD (92)

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)		Moneda de venta (en miles)		Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD 63	Venta	EUR 57	USD -
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD -	Venta	GBP -	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP 15	Venta	USD 19	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR 4.386	Venta	USD 4.825	(65)
16 nov. 2023	BNP Paribas	Compra	USD 550	Venta	EUR 500	6
16 nov. 2023	BNP Paribas	Compra	USD 48	Venta	GBP 38	-
16 nov. 2023	BNP Paribas	Compra	USD 63	Venta	JPY 9.130	(1)
16 nov. 2023	BNP Paribas	Compra	JPY 3.867	Venta	USD 28	(1)
16 nov. 2023	Citi	Compra	USD 665	Venta	EUR 606	6
16 nov. 2023	Citi	Compra	USD 360	Venta	GBP 284	1
16 nov. 2023	Citi	Compra	EUR 50	Venta	USD 55	(1)
16 nov. 2023	Goldman Sachs	Compra	USD 6.743	Venta	EUR 6.135	66
16 nov. 2023	Goldman Sachs	Compra	USD 392	Venta	GBP 309	1
16 nov. 2023	Goldman Sachs	Compra	EUR 343	Venta	USD 380	(6)
16 nov. 2023	Goldman Sachs	Compra	JPY 33.510	Venta	USD 238	(5)
16 nov. 2023	HSBC	Compra	USD 66	Venta	EUR 60	1
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	USD 4.385	Venta	EUR 3.989	43
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	USD 2.481	Venta	GBP 1.953	6
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	EUR 276	Venta	USD 300	-
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	GBP 556	Venta	USD 700	5
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	EUR 2.954	Venta	USD 3.200	16
16 nov. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD 1.875	Venta	EUR 1.706	18
16 nov. 2023	Royal Bank of Canada	Compra	USD 811	Venta	EUR 738	8
16 nov. 2023	UBS	Compra	USD 3.697	Venta	EUR 3.364	35
16 nov. 2023	UBS	Compra	USD 1.661	Venta	GBP 1.307	4
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): 343\$						USD 216
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(90))						(79)
Apreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [en miles]: 253\$)						USD 137

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico(en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Mini Bono del Estado Japonés a 10 años Septiembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(5)	USD (505)	USD 3
Euro-Bobl Diciembre de 2023	Bank of America Merrill Lynch	(21)	(2.675)	(15)
Euro-BTP Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(10)	(1.252)	(10)
Euro-Bund diciembre de 2023	Bank of America Merrill Lynch	4	575	6
Bono a 10 años de Japón (OSE) Septiembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(2)	(2.018)	15
U.S. 10 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	20	2.221	23
U.S. 5 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	24	2.566	15
U.S. Long Bond (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(9)	(1.095)	(16)
U.S. Ultra Bond (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	16	2.071	48
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): 202\$				USD 110
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(34)				(41)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): 168\$				USD 69

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y pagarés corporativos (continuación)					
Estados Unidos — (continuación)					
1.830 Amazon.com Inc, 2,700 %, con vencimiento el 03/06/2060	1.132	0,07	730 Energy Transfer LP, 6,250 %, con vencimiento el 15/04/2049	700	0,05
12.480 Alphabet Inc, 4,100 %, con vencimiento el 13/04/2062	10.364	0,69	4.018 Energy Transfer LP, Serie H, 6,500 %, Perpetuo *	3.675	0,24
18.226 Comcast Corp, 5,100 %, con vencimiento el 01/09/2040	15.171	1,00	12.990 Energy Transfer LP, Serie B, 6,625 %, Perpetuo *	10.478	0,69
140 Apache Corp, 7,375 %, con vencimiento el 15/08/2047	135	0,01	11.260 Energy Transfer LP, Serie F, 6,750 %, Perpetuo *	10.380	0,69
1.933 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 15/08/2027	1.658	0,11	8.650 Energy Transfer LP, Serie G, 7,125 %, Perpetuo *	7.676	0,51
4.500 BAC Capital Trust XIV, Serie G, 5,952 %, Perpetuo *	3.562	0,24	828 Enterprise Products Operating LLC, 6,125 %, con vencimiento el 15/10/2039	861	0,06
19.930 Bank of America Corp, Serie FF, 5,875 %, Perpetuo *	18.418	1,22	1 Enterprise Products Operating LLC, 6,450 %, con vencimiento el 01/09/2040	1	-
1.719 Bank of America Corp, Serie AA, 6,100 %, Perpetuo *	1.694	0,11	1.670 Enterprise Products Operating LLC, 5,100 %, con vencimiento el 15/02/2045	1.534	0,10
210 Bank of America Corp, Serie X, 6,250 %, Perpetuo *	209	0,01	111 EQT Corp, 6,125 %, con vencimiento el 01/02/2025	111	0,01
1.300 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 01/11/2025	1.172	0,08	510 EQT Corp, 144A, 3,125 %, con vencimiento el 15/05/2026	475	0,03
2.978 Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2026	2.867	0,19	730 EQT Corp, 7,000 %, con vencimiento el 01/02/2030	765	0,05
2.510 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, con vencimiento el 15/12/2025	2.520	0,17	1.510 EQT Corp, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 15/05/2031	1.306	0,09
2.050 Boeing Co/The, 3,250 %, con vencimiento 01/02/2035	1.648	0,11	90 FirstEnergy Corp, Serie C, 5,100 %, con vencimiento el 15/07/2047	78	-
780 Boeing Co/The, 3,550 %, con vencimiento 01/03/2038	599	0,04	360 General Motors Co, 3,250 %, con vencimiento el 12/02/2032	281	0,02
1.130 Boeing Co/The, 5,805 %, con vencimiento 01/05/2050	1.101	0,07	5.500 Ford Motor Co, 6,100 %, con vencimiento el 19/08/2032	5.260	0,35
992 Boeing Co/The, 5,930 %, con vencimiento 01/05/2060	959	0,06	200 Ford Motor Credit Co LLC, 3,375 %, con vencimiento el 13/11/2025	187	0,01
130 Builders FirstSource Inc, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 01/02/2032	111	0,01	840 Ford Motor Credit Co LLC, 4,389 %, con vencimiento el 08/01/2026	795	0,05
2.320 California Institute of Technology, 3,650 %, con vencimiento el 01/09/2119	1.508	0,10	200 Ford Motor Credit Co LLC, 4,542 %, con vencimiento el 01/08/2026	189	0,01
430 Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, con vencimiento el 15/01/2035	356	0,02	200 Ford Motor Credit Co LLC, 2,700 %, con vencimiento el 10/08/2026	179	0,01
5.250 Carnival Corp, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 01/05/2029	4.745	0,31	4.120 Ford Motor Credit Co LLC, 4,271 %, con vencimiento el 09/01/2027	3.813	0,25
7.320 Carnival Corp, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 01/06/2030	7.803	0,52	200 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, con vencimiento el 10/02/2029	165	0,01
320 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2032	265	0,02	760 Ford Motor Credit Co LLC, 5,113 %, con vencimiento e03/05/2029	700	0,05
2.100 Charter Communications Operating LLC / Capital operativo de Charter Communications, 5,375 %, con vencimiento el 01/04/2038	1.780	0,12	620 Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, con vencimiento el 01/08/2030	574	0,04
540 Charter Communications Operating LLC / Capital operativo de Charter Communications, 4,800 %, con vencimiento el 01/03/2050	400	0,03	675 Goldman Sachs Capital II, 6,439 %, Perpetuo *	544	0,04
780 Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 5,125 %, con vencimiento el 30/06/2027	772	0,05	4.620 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,750 %, con vencimiento el 01/10/2037	4.902	0,32
700 Cheniere Energy Inc., 4,625 %, con vencimiento el 15/10/2028	660	0,04	1.420 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, con vencimiento el 22/05/2045	1.306	0,09
800 Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, con vencimiento el 31/01/2032	662	0,04	300 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/12/2028	262	0,02
6.095 Citigroup Inc, 8,125 %, con vencimiento el 15/07/2039	7.593	0,50	2.440 Hackensack Meridian Health Inc, 4,211 %, con vencimiento el 01/07/2048	2.073	0,14
11.765 Citigroup Inc, Series P, 5,950 %, Perpetuo *	11.358	0,75	610 HCA Inc, 3,500 %, con vencimiento el 01/09/2030	533	0,04
15.510 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,544 %, con vencimiento el 15/11/2053	15.871	1,05	4.401 HCA Inc, 7,500 %, con vencimiento el 15/11/2095	4.855	0,32
1.019 CommonSpirit Health, 4,350 %, con vencimiento el 01/11/2042	852	0,06	6.290 ILFC E-Capital Trust II, 144A, 7,064 %, con vencimiento el 21/12/2065 *	4.566	0,30
960 CommonSpirit Health, 3,817 %, con vencimiento el 01/10/2049	721	0,05	1.089 Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,500 %, con vencimiento el 01/09/2039	1.098	0,07
330 CommScope Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 01/09/2029	246	0,02	400 Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,550 %, con vencimiento el 15/09/2040	398	0,03
900 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/01/2031	861	0,06	1.180 Kraft Heinz Foods Co, 4,375 %, con vencimiento el 01/06/2046	977	0,06
3.290 Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, con vencimiento el 01/06/2044	2.526	0,17	2.840 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, con vencimiento el 08/08/2024	2.751	0,18
5.110 CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 01/02/2029	4.229	0,28	610 Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, con vencimiento el 25/06/2025	576	0,04
2.150 CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/01/2030	1.191	0,08	1.670 Las Vegas Sands Corp, 3,500 %, con vencimiento el 18/08/2026	1.550	0,10
3.390 CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 01/12/2030	2.420	0,16	1.392 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 20/06/2027	1.389	0,09
2.405 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, con vencimiento el 03/11/2036	2.457	0,16	860 MPLX LP, 5,500 %, con vencimiento el 15/02/2049	767	0,05
1.160 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 15/09/2037	1.226	0,08	2.490 Northern Oil and Gas Inc, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 01/03/2028	2.498	0,16
2.640 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, con vencimiento el 15/01/2026	2.719	0,18	6.760 Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, con vencimiento el 01/09/2030	6.986	0,46
264 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 4,500 %, con vencimiento el 20/10/2025	258	0,02	4.070 Occidental Petroleum Corp, 6,125 %, con vencimiento el 01/01/2031	4.105	0,27
2.264 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 20/10/2025	2.214	0,15	5.220 Occidental Petroleum Corp, 4,300 %, con vencimiento el 15/08/2039	3.992	0,26
354 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 4,750 %, con vencimiento el 20/10/2028	340	0,02	11.725 Occidental Petroleum Corp, 4,500 %, con vencimiento el 15/07/2044	8.542	0,56
2.370 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 20/10/2028	2.277	0,15	7.150 Occidental Petroleum Corp, 4,625 %, con vencimiento el 15/06/2045	5.447	0,36
866 Devon Energy Corp, 5,850 %, con vencimiento el 15/12/2025	871	0,06	8.980 Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, con vencimiento el 15/03/2046	9.251	0,61
1.736 Devon Energy Corp, 5,250 %, con vencimiento el 15/10/2027	1.723	0,11	4.520 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, con vencimiento el 15/04/2046	3.473	0,23
1.670 Devon Energy Corp, 5,875 %, con vencimiento el 15/06/2028	1.673	0,11	2.360 Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, con vencimiento el 15/02/2047	1.630	0,11
1.436 Devon Energy Corp, 4,500 %, con vencimiento el 15/01/2030	1.345	0,09	16.140 Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, con vencimiento el 15/03/2048	11.889	0,79
1.690 Devon Energy Corp, 7,875 %, con vencimiento el 30/09/2031	1.907	0,13	2.572 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, con vencimiento el 15/08/2049	1.842	0,12
1.440 Devon Energy Corp, 7,950 %, con vencimiento el 15/04/2032	1.636	0,11	890 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, con vencimiento el 01/08/2040	598	0,04
805 Devon Energy Corp, 5,000 %, con vencimiento el 15/06/2045	690	0,05	2.280 Plains All American Pipeline LP, Serie B, 9,736 %, Perpetuo *	2.103	0,14
3.720 Dignity Health, 5,267 %, con vencimiento el 01/11/2064	3.344	0,22	2.180 Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 6,700 %, con vencimiento el 15/05/2036	2.164	0,14
170 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 01/12/2026	144	0,01	4.800 Range Resources Corp, 8,250 %, con vencimiento el 15/01/2029	4.988	0,33
90 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 01/12/2028	70	-	6.910 Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/04/2040	6.245	0,41
1.220 DISH DBS Corp, 5,125 %, con vencimiento el 01/06/2029	661	0,04	7.540 Royal Caribbean Cruises Ltd., 144A, 5,375 %, con vencimiento el 15/07/2027	7.102	0,47
1.530 Energy Transfer LP, 6,850 %, con vencimiento el 15/02/2040	1.530	0,10			
2.135 Energy Transfer LP, 6,100 %, con vencimiento el 15/02/2042	2.014	0,13			
412 Energy Transfer LP, 5,400 %, con vencimiento el 01/10/2047	355	0,02			
410 Energy Transfer LP, 6,000 %, con vencimiento el 15/06/2048	379	0,02			

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos					
Bonos y pagarés corporativos (continuación)										
Estados Unidos — (continuación)										
670	Southwestern Energy Co, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2032	594	0,04	3.360	0,22					
2.262	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 20/09/2025	2.267	0,15	536	0,04					
560	Sprint Capital Corp, 8,750 %, con vencimiento el 15/03/2032	668	0,04	7.540	0,43					
210	Sprint LLC, 7,875 %, con vencimiento el 15/09/2023	210	0,01	4.164	0,24					
1.530	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500 %, con vencimiento el 01/03/2030	1.468	0,10	3.574	0,24					
360	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, con vencimiento el 01/02/2031	331	0,02	17.311	1,15					
280	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, con vencimiento el 15/01/2032	242	0,02	República Dominicana — 0,35 % (28 de febrero de 2023: 0,35%)						
11.910	The Vanguard Group Inc, 3,050 %, con vencimiento el 22/08/2050 ⁺	7.340	0,49	6.920	Dominican Republic International Bond, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 30/01/2060	5.336	0,35			
1.300	Time Warner Cable LLC, 7,300 %, con vencimiento el 01/07/2038	1.318	0,09	Paraguay — 0,28 % (28 de febrero de 2023: 0,24%)						
120	T-Mobile USA Inc, 2,250 %, con vencimiento el 15/02/2026	111	0,01	EGP	22.000	Egypt Government Bond, Serie 7YR, 18,400 %, con vencimiento el 30/05/2024	679	0,04		
2.100	T-Mobile USA Inc, 2,625 %, con vencimiento el 15/02/2029	1.820	0,12	4.620	Egypt Government International Bond, 5,250 %, con vencimiento el 06/10/2025	3.592	0,24			
				4.271		0,28				
				Hungría — 1,32 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)						
90	T-Mobile USA Inc, 3,375 %, con vencimiento el 15/04/2029	81	0,01	HUF	2.116.280	Hungary Government Bond, Serie 25/C, 1,000 %, con vencimiento el 26/11/2025	5.151	0,34		
200	T-Mobile USA Inc, 3,500 %, con vencimiento el 15/04/2031	175	0,01	HUF	6.112.350	Hungary Government Bond, Serie 26/E, 1,500 %, con vencimiento el 22/04/2026	14.782	0,98		
5.160	Toll Road Investors Partnership II LP, 144A, cupón cero, con vencimiento el 15/02/2024	4.997	0,33				19.933	1,32		
2.100	Toll Road Investors Partnership II LP, 144A, cupón cero, vencimiento 15/02/2038	760	0,05	India — 7,53 % (28 de febrero de 2023: 5,07%)						
9.590	United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 15/04/2026	9.047	0,60	INR	1.050.000	India Government Bond, 8,830 %, con vencimiento el 25/11/2023	12.754	0,84		
340	United Rentals North America Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/02/2031	291	0,02	INR	800.000	India Government Bond, 6,180 %, con vencimiento el 04/11/2024	9.584	0,63		
5.130	Warnermidia Holdings Inc, 5,141 %, con vencimiento el 15/03/2052	4.092	0,27	INR	900.000	India Government Bond, 5,630 %, con vencimiento el 12/04/2026	10.500	0,69		
6.590	Warnermidia Holdings Inc, 5,391 %, con vencimiento el 15/03/2062	5.235	0,35	INR	1.300.000	India Government Bond, 8,150 %, con vencimiento el 24/11/2026	16.156	1,07		
1.926	Wells Fargo & Co, Series U, 5,875 %, Perpetuo *	1.914	0,13	INR	270.000	India Government Bond, 7,170 %, con vencimiento el 08/01/2028	3.260	0,22		
1.630	Wesleyan University, 4,781 %, con vencimiento el 01/07/2116	1.298	0,09	INR	1.150.000	India Government Bond, 7,590 %, con vencimiento el 20/03/2029	14.185	0,94		
2.530	Western Midstream Operating LP, 3,950 %, con vencimiento el 01/06/2025	2.444	0,16	INR	1.350.000	India Government Bond, 5,790 %, con vencimiento el 11/05/2030	15.169	1,00		
2.770	Western Midstream Operating LP, 4,500 %, con vencimiento el 01/03/2028	2.609	0,17	INR	2.900.000	India Government Bond, 6,190 %, con vencimiento el 16/09/2034	32.326	2,14		
5.274	Western Midstream Operating LP, 5,450 %, con vencimiento el 01/04/2044	4.436	0,29				113.934	7,53		
6.980	Western Midstream Operating LP, 5,500 %, con vencimiento el 15/08/2048	5.813	0,38	Indonesia — 7,40 % (28 de febrero de 2023: 7,79%)						
1.330	Western Midstream Operating LP, 5,250 %, con vencimiento el 01/02/2050	1.078	0,07	IDR	18.941.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR56, 8,375 %, con vencimiento el 15/09/2026	1.317	0,09		
130	Williams Cos Inc/The, 3,750 %, con vencimiento el 15/06/2027	122	0,01	IDR	482.620.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR78, 8,250 %, con vencimiento el 15/05/2029	34.604	2,29		
2.790	Williams Cos Inc/The, Serie A, 7,500 %, con vencimiento el 15/01/2031	3.057	0,20	IDR	500.248.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR87, 6,500 %, con vencimiento el 15/02/2031	33.073	2,19		
3.400	Williams Cos Inc/The, 8,750 %, con vencimiento el 15/03/2032	3.986	0,26	IDR	222.343.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR96, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2033	15.246	1,01		
1.770	Williams Cos Inc/The, 6,300 %, con vencimiento el 15/04/2040	1.816	0,12	IDR	187.046.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR72, 8,250 %, con vencimiento el 15/05/2036	13.957	0,92		
665	Williams Cos Inc/The, 5,100 %, con vencimiento el 15/09/2045	587	0,04	IDR	75.986.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR92, 7,125 %, con vencimiento el 15/06/2042	5.179	0,34		
2.070	Willis-Knighton Medical Center, Serie 2018, 4,813 %, con vencimiento el 01/09/2048	1.768	0,12	IDR	120.448.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR76, 7,375 %, con vencimiento el 15/05/2048	8.484	0,56		
7.313	XPO CNW Inc, 6,700 %, con vencimiento el 01/05/2034	7.277	0,48				111.860	7,40		
		405.718	26,83	Kenia — 0,22 % (28 de febrero de 2023: 0,22%)						
							3.870	Republic of Kenya Government International Bond, 7,250 %, con vencimiento el 28/02/2028	3.293	0,22
Zambia — 0,60 % (28 de febrero de 2023: 0,01%)										
220	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/10/2027	215	0,02	México — 5,99 % (28 de febrero de 2023: 5,39%)						
8.640	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, con vencimiento el 01/06/2031	8.803	0,58	MXN	1.344.674	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, con vencimiento el 13/11/2042	67.399	4,46		
		9.018	0,60	MXN	453.610	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, con vencimiento el 07/11/2047	23.148	1,53		
							90.547	5,99		
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 686.474\$)										
		610.374	40,36	Nigeria — 0,18 % (28 de febrero de 2023: 0,14%)						
Bonos y obligaciones del Estado — 40,49 % (28 de febrero de 2023: 40,57%)										
Angola — 0,20 % (28 de febrero de 2023: 0,17%)										
2.000	Angolan Government International Bond, 8,250 %, con vencimiento el 09/05/2028	1.754	0,12				3.240	Nigeria Government International Bond, 6,125 %, con vencimiento el 28/09/2028	2.682	0,18
1.450	Angolan Government International Bond, 144A, 8,750 %, con vencimiento el 14/04/2032	1.196	0,08	Polonia — 3,56 % (28 de febrero de 2023: 2,62%)						
		2.950	0,20	PLN	298.370	Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750 %, con vencimiento el 25/04/2032	53.849	3,56		
Australia — 0,63 % (28 de febrero de 2023: 0,74%)										
AUD	18.430	Australia Government Bond, Serie 150, 3,000 %, con vencimiento el 21/03/2047	9.494	0,63	Rusia — 1,51 % (28 de febrero de 2023: 0,25%)					
Brasil — 1,32 % (28 de febrero de 2023: 1,07%)										
BRL	21.530	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2027	4.304	0,28	RUB	354.791	Russian Federal Bond – OFZ, 0,000 %, con vencimiento el 03/02/2027ty	1.110	0,07	
BRL	81.647	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2031	15.710	1,04	RUB	1.685.880	Russian Federal Bond – OFZ, 0,000 %, con vencimiento el 23/05/2029ty	5.275	0,35	
		20.014	1,32	RUB	287.190	Russian Federal Bond – OFZ, 0,000 %, con vencimiento el 10/04/2030ty	899	0,06		
Costa de Marfil — 1,15 % (28 de febrero de 2023: 1,01%)										
EUR	4.020	Ivory Coast Government International Bond, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 30/01/2032	3.369	0,22	RUB	4.428.300	Russian Federal Bond – OFZ, 0,000 %, con vencimiento el 10/05/2034ty	11.778	0,78	
				RUB	1.407.660	Russian Federal Bond – OFZ, 0,000 %, con vencimiento el 16/03/2039ty	3.744	0,25		
							22.806	1,51		
Sudáfrica — 3,03 % (28 de febrero de 2023: 1,46%)										
ZAR	1.101.930	Republic of South Africa Government Bond, Serie R209, 6,250 %, con vencimiento el 31/03/2036	37.388	2,47	Zambia — 0,60 % (28 de febrero de 2023: 0,01%)					
ZAR	271.600	Republic of South Africa Government Bond, Serie R214, 6,500 %, con vencimiento el 28/02/2041	8.488	0,56						

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos			
	45.876	3,03			
Bonos y obligaciones del Estado (continuación)					
Estados Unidos — (continuación)					
Estados Unidos — 5,82 % (28 de febrero de 2023: 14,05%)					
1.820 Morongo Band of Mission Indians/The, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 01/10/2039	1.895	0,13			
3.500 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, con vencimiento el 15/05/2043	3.256	0,22			
11.250 United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, con vencimiento el 15/08/2043	11.222	0,74			
1.320 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, con vencimiento el 15/02/2049	1.048	0,07			
2.570 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, con vencimiento el 15/11/2051	1.580	0,11			
18.446 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, con vencimiento el 15/02/2052	12.450	0,82			
16.910 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, con vencimiento el 15/08/2052	13.481	0,89			
27.000 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, con vencimiento el 15/11/2052 [#]	26.060	1,72			
14.474 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 15/02/2053	13.044	0,86			
2.900 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 15/05/2053 [#]	2.616	0,17			
1.400 United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2053	1.381	0,09			
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 747.016\$)	612.189	40,49			
Obligaciones de préstamo — 1,87% (28 de febrero de 2023: 1,98%)					
3.991 1011778 BC ULC, 7,196 %, con vencimiento el 14/11/2026 *	3.975	0,26			
1.421 Alterra Mountain Co, 8,946 %, con vencimiento el 30/07/2028 *	1.426	0,09			
2.745 Asurion LLC, 9,681 %, con vencimiento el 19/08/2028 *	2.657	0,17			
6.033 Charter Communications Operating LLC, 7,116 %, con vencimiento el 30/04/2025 *	6.042	0,40			
1.807 Hunter Douglas Inc, 8,891 %, con vencimiento el 09/02/2029 *	1.761	0,12			
1.600 Jane Street Group, LLC, 8,196 %, con vencimiento el 21/01/2027 *	1.599	0,11			
1.315 Phoenix Guarantor Inc, 8,696 %, con vencimiento el 05/03/2026 *	1.309	0,09			
5.685 Prime Security Installations Ltd, 8,182 %, con vencimiento el 23/09/2026 *	5.693	0,38			
2.358 RegionalCare Hospital Partners Holding, 9,377 %, con vencimiento el 16/11/2025 *	2.342	0,15			
1.550 Virgin Media Bristol LLC, 7,925 %, con vencimiento el 04/01/2028 *	1.510	0,10			
Total de obligaciones de préstamo (coste 28.551\$)	28.314	1,87			
Municipal Bonds — 0,86 % (28 de febrero de 2023: 0,61%)					
4.240 City of Detroit MI, 4,000 %, con vencimiento el 01/04/2044	3.173	0,21			
950 Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue, 3,706 %, con vencimiento el 15/05/2120	617	0,04			
9.530 State of Illinois, 5,100 %, con vencimiento el 01/06/2033	9.257	0,61			
Total Municipal Bonds (coste de 13.943 USD)	13.047	0,86			
Organismos de inversión colectiva — 0,11% (28 de febrero de 2023: 0,87%)					
1.606 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	1.606	0,11			
Total de organismos de inversión colectiva (coste: 1.606\$)	1.606	0,11			
Acciones ordinarias — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
Suiza — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
41.200 Credit Suisse Group AG Escrow †	–	–			
Total de acciones ordinarias (coste USD–)	–	–			
Total de inversiones e inversiones pignoradas a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 1 708 031 USD)					
	1.489.432	98,50			
Contratos (miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos			
Opciones compradas — 1,42% (28 de febrero de 2023: 0,28%)					
1 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures diciembre 2023 Put 95.8750, con vencimiento el 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	662	0,04			
2 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures diciembre 2023 Put 96.00, con vencimiento el 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	1.834	0,12			
1 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures octubre 2023 Put 97.00, con vencimiento el 13/10/2023 – Bank of America Merrill Lynch	3.806	0,25			
– Australian Dollar Currency Future octubre 2023 Call 65.00, con vencimiento el 06/10/2023 – Bank of America Merrill Lynch	171	0,01			
– Precio de compra futuro de divisas en dólares australianos de septiembre de 2023 a 65,50, con vencimiento el 08/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	32	–			
– Precio de compra futuro de divisas en dólares australianos de septiembre de 2023 a 66,00, con vencimiento el 08/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	21	–			
– Precio de compra futuro de divisas en dólares australianos de septiembre de 2023 a 67,00, con vencimiento el 08/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	1	–			
Contratos (miles)					
EUR					
– Euro Currency Future septiembre 2023 Put 1.1050, con vencimiento el 08/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	247	0,02			
– Euro-Bund octubre 2023 Call 132.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	312	0,02			
– Japanese Yen Currency Future septiembre 2023 Call 69.50, con vencimiento el 08/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	106	0,01			
1 Precio futuro del yen japonés de septiembre de 2023 a 70,00, con vencimiento el 08/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	69	0,01			
1 Japanese Yen FX Currency octubre 2023 Call 70.00, con vencimiento el 06/10/2023 – Bank of America Merrill Lynch	584	0,04			
1 U.S. 10 Year octubre 2023 Call 110.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	1.381	0,09			
– U.S. 10 Year octubre 2023 Call 110.50, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	207	0,01			
1 U.S. 10 Year octubre 2023 Call 111.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	605	0,04			
– U.S. 10 Year octubre 2023 Put 110.75, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	247	0,02			
1 U.S. 10 Year septiembre 2023 Call 109.75, con vencimiento el 01/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	1.271	0,09			
1 U.S. 5 Year octubre 2023 Call 106.25, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	1.099	0,07			
2 U.S. 5 Year octubre 2023 Call 106.75, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	1.036	0,07			
1 U.S. 5 Year septiembre 2023 Call 106.25, con vencimiento el 01/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	1.033	0,07			
1 U.S. 5 Year septiembre 2023 Call 106.50, con vencimiento el 01/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	585	0,04			
1 U.S. 5 Year septiembre 2023 Put 106.25, con vencimiento el 01/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	21	–			
– U.S. Bond octubre 2023 Call 119.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	948	0,06			
– U.S. Bond octubre 2023 Call 120.50, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	633	0,04			
– U.S. Bond octubre 2023 Call 121.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	357	0,02			
– U.S. Bond octubre 2023 Call 122.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	255	0,02			
1 U.S. Bond octubre 2023 Call 123.50, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	561	0,04			
1 U.S. Bond octubre 2023 Call 126.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	187	0,01			
– U.S. Long Bond septiembre 2023 Call 119.00, con vencimiento el 01/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	1.064	0,07			
1 U.S. Long Bond septiembre 2023 Call 119.50, con vencimiento el 01/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	1.306	0,09			
16.066 USD Put/INR Call 82.00, con vencimiento el 16/09/2023 – JP Morgan	6	–			
16.066 USD Put/INR Call 82.00, con vencimiento el 19/12/2023 – JP Morgan	58	–			
Total de opciones compradas (coste 19.225\$)	21.526	1,42			
Swaps sobre índices — 6,68% (28 de febrero de 2023: 6,92%)					
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	100.987	6,68			
Swaps de tasas de interés — 0,83 % (28 de febrero de 2023: 0,12%)					
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	12.503	0,83			
Contratos de divisas a plazo — 0,89 % (28 de febrero de 2023: 1,01%)					
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	13.409	0,89			
Futuros — 3,64% (28 de febrero de 2023: 0,96%)					
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	54.997	3,64			
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias					
	1.692.854	111,96			
Contratos (miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos			
Opciones suscritas — (3,03%) (28 de febrero de 2023: 2,17%)					
– 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures diciembre 2023 Call 96.75, con vencimiento el 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(51)	–			
(7) 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures diciembre 2023 Call 97.00, con vencimiento el 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(1.023)	(0,07)			
(2) 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures diciembre 2023 Put 95.25, con vencimiento el 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(385)	(0,03)			
(3) 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures diciembre 2023 Put 95.3750, con vencimiento el 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(1.165)	(0,08)			
(1) 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures octubre 2023 Put 96.25, con vencimiento el 13/10/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(1.608)	(0,11)			

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Contratos (miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Contratos (miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Opciones escritas — (continuación)					
(1) 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures octubre 2023 Put 96.50, con vencimiento el 13/10/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(2.303)	(0,15)	– U.S. Bond octubre 2023 Put 117.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(40)	–
(2) CME 3 Month SOFR Futures diciembre 2023 Call 94.75, con vencimiento el 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(517)	(0,03)	(1) U.S. Bond octubre 2023 Put 118.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(324)	(0,02)
(1) CME 3 Month SOFR Futures diciembre 2023 Call 95.00, con vencimiento el 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(202)	(0,01)	– U.S. Bond octubre 2023 Put 119.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(51)	–
(3) CME 3 Month SOFR Futures diciembre 2023 Call 95.50, con vencimiento el 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(341)	(0,02)	– U.S. Bond octubre 2023 Put 120.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(309)	(0,02)
– CME 3 Month SOFR Futures diciembre 2023 Call 95.75, con vencimiento el 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(11)	–	– U.S. Bond octubre 2023 Put 121.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(199)	(0,01)
(4) CME 3 Month SOFR Futures diciembre 2023 Call 97.25, con vencimiento el 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(136)	(0,01)	(1) U.S. Long Bond septiembre 2023 Call 120.00, con vencimiento el 01/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(1.698)	(0,11)
(6) CME 3 Month SOFR Futures diciembre 2023 Call 98.1250, con vencimiento el 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(156)	(0,01)	(15.910) USD Call/BRL Put 4,9620, con vencimiento el 20/09/2023 - Morgan Stanley	(193)	(0,01)
(1) CME 3 Month SOFR Futures diciembre 2023 Put 94.50, con vencimiento el 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(175)	(0,01)	(15.910) USD Put/BRL Call 4,9620, con vencimiento el 20/09/2023 - Morgan Stanley	(187)	(0,01)
(8) CME 3 Month SOFR Futures diciembre 2023 Put 95.50, con vencimiento el 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(18.997)	(1,26)	Total de opciones suscritas (coste: [48.781] USD)	(45.858)	(3,03)
(1) CME 3 Month SOFR Futures marzo 2024 Put 95.00, con vencimiento el 15/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(852)	(0,06)	Swaps de incumplimiento de crédito — (0,11%) (28 febrero de 2023: 0,03%)		
– Euro Currency Future octubre 2023 Call 1.09, con vencimiento el 06/10/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(120)	(0,01)	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(1.582)	(0,11)
– Euro Currency Future octubre 2023 Call 1.10, con vencimiento el 06/10/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(67)	–	Swaps sobre índices — (1,60 %) (28 de febrero de 2023: 0,92%)		
EUR – Euro-Bund octubre 2023 Put 130.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(121)	(0,01)	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(24.167)	(1,60)
EUR (1) Euro-Bund octubre 2023 Put 131.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(518)	(0,03)	Swaps de tasas de interés — (1,82%) (28 de febrero de 2023: 1,07%)		
EUR (1) Euro-Bund octubre 2023 Put 132.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(698)	(0,05)	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(27.540)	(1,82)
– Futuro Divisa Yen Japonés Septiembre 2023 Call 71,00, vencimiento 08/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(2)	–	Contratos de divisas a plazo — (0,95%) (28 de febrero de 2023: 2,05%)		
– Futuro Divisa Yen Japonés Septiembre 2023 Call 71,50, vencimiento 08/09/2023 - Bank of America Merrill Lynch	(1)	–	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(14.349)	(0,95)
(1) U.S. 10 Year noviembre 2023 Call 111.00, con vencimiento el 27/10/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(1.195)	(0,08)	Contratos de divisas a plazo — (0,95%) (28 de febrero de 2023: 2,05%)		
(1) U.S. 10 Year noviembre 2023 Call 112.50, con vencimiento el 27/10/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(601)	(0,04)	Futuros — (3,58%) (28 de febrero de 2023: 2,21%)		
(1) U.S. 10 Year noviembre 2023 Call 113.00, con vencimiento el 27/10/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(370)	(0,02)	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(54.049)	(3,58)
(1) U.S. 10 Year octubre 2023 Call 112.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(210)	(0,01)	Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	(167.545)	(11,09)
– U.S. 10 Year octubre 2023 Call 112.50, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(93)	(0,01)	Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	1.525.309	100,87
(5) U.S. 10 Year octubre 2023 Call 113.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(704)	(0,05)	Excedente de pasivos respecto a otros activos	(13.149)	(0,87)
– U.S. 10 Year octubre 2023 Put 109.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(31)	–	Patrimonio	1.512.160\$	100,00
(1) U.S. 10 Year octubre 2023 Put 110.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(392)	(0,03)	– Los importes designados como “-” son 0 \$, menos de 1000 \$, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.		
(1) U.S. 10 Year octubre 2023 Put 110.50, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(408)	(0,03)	144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. El 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 265 530 000 USD o el 17,57 % del patrimonio neto.		
(1) U.S. 10 Year octubre 2023 Put 111.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(433)	(0,03)	* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.		
(2) U.S. 2 Year octubre 2023 Call 102.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(592)	(0,04)	† Poca liquidez.		
(1) U.S. 5 Year noviembre 2023 Call 107.50, con vencimiento el 27/10/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(555)	(0,04)	∞ El título es valorado de buena fe y a un valor razonable por el Comité de Valoración o según el criterio de este.		
(2) U.S. 5 Year octubre 2023 Call 106.50, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(1.334)	(0,09)	± Valor (total o parcial) pignorado como garantía para la negociación de derivados a 31 de agosto de 2023.		
(1) U.S. 5 Year octubre 2023 Call 107.75, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(133)	(0,01)	‡ Títulos adquiridos siguiendo la norma “se anunciará”.		
(1) U.S. 5 Year octubre 2023 Call 108.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(266)	(0,02)	γ El valor ya no acumula ingresos durante y/o después del periodo financiero finalizado el 31 de agosto de 2023 debido a la incertidumbre de los pagos de intereses.		
– U.S. 5 Year octubre 2023 Put 105.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(19)	–			
(2) U.S. 5 Year octubre 2023 Put 106.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(446)	(0,03)	ABREVIATURAS:		
(1) U.S. 5 Year octubre 2023 Put 106.50, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(231)	(0,01)	Perpetuo – Un bono sin fecha de vencimiento. Los bonos perpetuos no son rescatables, pero pagan un flujo constante de intereses.		
(3) U.S. 5 Year septiembre 2023 Call 106.00, con vencimiento el 01/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(2.718)	(0,18)	REMIC – Conducto de inversiones hipotecarias inmobiliarias.		
(1) U.S. Bond noviembre 2023 Put 118.00, con vencimiento el 27/10/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(581)	(0,04)	TBA – Pendiente de anuncio.		
– U.S. Bond octubre 2023 Call 120.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(239)	(0,02)	AUD – dólar australiano		
(1) U.S. Bond octubre 2023 Call 123.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(508)	(0,03)	BRL – real brasileño		
(1) U.S. Bond octubre 2023 Call 124.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(330)	(0,02)	EGP – Libra egipcia		
(2) U.S. Bond octubre 2023 Call 125.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(854)	(0,06)	EUR – euro		
– U.S. Bond octubre 2023 Call 130.00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(19)	–	GBP – libra esterlina		
			HUF – Florinto húngaro		
			IDR – rupia indonesia		
			INR – rupia india		
			MXN – peso mexicano		
			PLN – zloty polaco		
			RUB – rublo ruso		
			ZAR – Rand sudafricano		
			Análisis del total de activos		
			Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado		77,03
			Otros valores mobiliarios negociables en otro mercado regulado		1,49
			Organismos de inversión colectiva		0,08
			Instrumentos financieros derivados		10,74
			Otros activos		10,66
			Total de activos		100,00

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Listado de swaps de incumplimiento de crédito

Contraparte	Entidad de Referencia – Protección Compra/Venta	Fecha de vencimiento	Importe teórico (miles)	Valor (miles)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000 % - Comprar	20 de junio de 2028	9.923	USD (278)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % - Comprar	20 de junio de 2028	71.900	(1.111)
Bank of America Merrill Lynch	Teva Pharmaceutical Industries Ltd, 1,000 % - Vender	20 jun. 2026	12.479	(193)
Apreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 febrero de 2023 [miles]: 5.762\$)				USD –
Depreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(520))				(1.582)

Contraparte	Entidad de Referencia – Protección Compra/Venta	Fecha de vencimiento	Importe teórico (miles)	Valor (miles)
Depreciación neta de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 [miles]: 5.242\$)				USD (1.582)

Listado de swaps de tipos de interés

Contraparte	Tipo	Fecha de vencimiento	Importe teórico (miles)	Valor (miles)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 3,550 %	01 mar. 2025	2.219.704	USD (26.833)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 11,993 %	04 ene. 2027	496.488	2.559
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 9,260%	25 oct. 2032	1.009.497	1.912
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 8,450%	01 mar. 2033	640.415	(707)
BNP Paribas	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 12,610 %	02 ene. 2029	679.541	7.142
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 12,893 %	02 ene. 2029	73.048	890
Apreciación latente de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 [miles]: 2.585\$)				USD 12.503
Depreciación latente de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(22.883))				(27.540)
Depreciación neta de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(20.298))				USD (15.037)

Listado de swaps de inflación

Contraparte	Entidad de referencia	Fecha de vencimiento	Importe teórico (miles)	Valor (miles)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,520%, Receive Floating USD Sofr Compound	15 feb. 2047	26.146	USD 8.742
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,500%, Receive Floating USD Sofr Compound	21 abr. 2052	111.770	20.918
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,600%, Receive Floating USD Sofr Compound	15 feb. 2048	261.696	43.970
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,850%, Receive Floating USD Sofr Compound	15 feb. 2029	25.846	1.425
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,050%, Receive Floating USD Sofr Compound	15 feb. 2048	38.696	3.730
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,150%, Receive Floating USD Sofr Compound	15 mayo 2048	44.912	3.597
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,220%, Receive Floating USD Sofr Compound	15 mar. 2032	230.335	10.330
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,270%, Receive Floating USD Sofr Compound	30 abr. 2029	116.556	4.097
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,850%, Receive Floating USD Sofr Compound	30 jun. 2029	23.101	129
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 1,396 %	13 oct. 2025	582.851	(14.081)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 3,400 %	21 jun. 2025	826.407	(7.760)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 4,000 %	29 feb. 2028	531.450	305
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 4,180 %	29 feb. 2028	498.040	3.744
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 4,600 %	04 jun. 2024	354.373	(2.326)
Apreciación latente de swaps de inflación (28 de febrero de 2023 [miles]: 147.520\$)				USD 100.987
Depreciación latente de swaps de inflación (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(19.599))				(24.167)
Depreciación neta de swaps de inflación (28 de febrero de 2023 [miles]: 127.921\$)				USD 76.820

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)		Moneda de venta (en miles)		Apreciación / (Depreciación) latente de contratos (en miles)		
05 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	39.976	Venta	BRL	195.607	USD 508
05 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	1.440	Venta	BRL	7.175	(8)
05 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	4	Venta	CHF	4	–
05 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	354	Venta	EUR	324	2
05 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	–	Venta	GBP	–	–
05 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	56	Venta	GBP	44	–
05 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	11	Venta	NOK	116	–
05 sep.2023	BNY Mellon	Compra	AUD	74	Venta	USD	48	–
05 sep.2023	BNY Mellon	Compra	EUR	62	Venta	USD	67	–
05 sep.2023	BNY Mellon	Compra	SGD	72	Venta	USD	53	–
05 sep.2023	BNY Mellon	Compra	NOK	23	Venta	USD	2	USD –
05 sep.2023	BNY Mellon	Compra	BRL	202.782	Venta	USD	42.695	(1.780)
05 sep.2023	BNY Mellon	Compra	GBP	30	Venta	USD	38	–
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	76	Venta	AUD	116	–
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	1.591	Venta	AUD	2.479	(13)
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	901	Venta	CHF	793	6
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	166	Venta	CHF	147	–
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	29	Venta	CNH	211	–
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	85	Venta	CNH	627	–
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	21.893	Venta	EUR	20.043	142
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	1.673	Venta	EUR	1.546	(6)
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	5.084	Venta	GBP	3.993	21
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	132	Venta	GBP	104	–
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	631	Venta	JPY	90.997	3
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	1.549	Venta	JPY	225.757	(6)
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	143	Venta	NOK	1.486	1

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Listado de contratos de divisas a plazo (continuación)

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)		Moneda de venta (en miles)		Apreciación / (Depreciación) latente de contratos (en miles)		
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	76	Venta	NOK	801	-
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	48	Venta	PLN	199	-
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	40	Venta	SEK	444	-
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	20	Venta	SEK	226	-
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	53	Venta	SGD	72	-
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	1.911	Venta	SGD	2.588	(6)
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	JPY	7.368.520	Venta	USD	51.522	(755)
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	GBP	12	Venta	USD	14	-
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	EUR	377.463	Venta	USD	415.138	(5.537)
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	SGD	46.660	Venta	USD	34.721	(173)
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	SGD	1.280	Venta	USD	948	1
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	CNH	497	Venta	USD	68	-
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	CHF	-	Venta	USD	1	-
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	AUD	47.263	Venta	USD	30.900	(259)
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	AUD	1.147	Venta	USD	741	1
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	EUR	417	Venta	USD	451	1
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	NOK	193	Venta	USD	18	-
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	PLN	5.067	Venta	USD	1.243	(16)
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	SEK	4	Venta	USD	-	-
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	SEK	15.069	Venta	USD	1.410	(35)
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	NOK	37.670	Venta	USD	3.687	(141)
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	GBP	61.363	Venta	USD	78.143	(405)
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	CNH	19.036	Venta	USD	2.641	(23)
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	CHF	18.402	Venta	USD	21.068	(204)
20 sep.2023	Goldman Sachs	Compra	USD	4.667	Venta	RUB	338.380	1.159
20 sep.2023	JP Morgan	Compra	USD	7.381	Venta	INR	606.961	46
03 oct. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	2.644	Venta	BRL	13.000	33
03 oct. 2023	BNY Mellon	Compra	BRL	187.700	Venta	USD	38.175	(470)
20 oct. 2023	Bank of America Merrill Lynch	Compra	USD	3.253	Venta	EUR	3.000	(8)
20 oct. 2023	Bank of America Merrill Lynch	Compra	USD	4.345	Venta	GBP	3.410	26
20 oct. 2023	Bank of America Merrill Lynch	Compra	USD	1.507	Venta	JPY	219.000	(11)
20 oct. 2023	Bank of America Merrill Lynch	Compra	USD	53.026	Venta	PLN	218.312	247
20 oct. 2023	Bank of America Merrill Lynch	Compra	USD	36.723	Venta	TWD	1.138.961	730
20 oct. 2023	Bank of America Merrill Lynch	Compra	AUD	8.600	Venta	USD	5.660	(78)
20 oct. 2023	Bank of America Merrill Lynch	Compra	GBP	8.010	Venta	USD	10.343	(195)
20 oct. 2023	Bank of America Merrill Lynch	Compra	EUR	2.950	Venta	USD	3.281	(74)
20 oct. 2023	Bank of America Merrill Lynch	Compra	TWD	19.728	Venta	USD	621	3
20 oct. 2023	Bank of America Merrill Lynch	Compra	JPY	1.155.000	Venta	USD	8.017	(14)
20 oct. 2023	BNP Paribas	Compra	USD	8.726	Venta	NOK	88.076	429
20 oct. 2023	BNP Paribas	Compra	NOK	360.721	Venta	USD	33.945	35
20 oct. 2023	BNP Paribas	Compra	KRW	43.312.887	Venta	USD	33.439	(661)
20 oct. 2023	BNP Paribas	Compra	CAD	56.254	Venta	USD	42.447	(784)
20 oct. 2023	BNP Paribas	Compra	AUD	67.276	Venta	USD	44.966	(1.293)
20 oct. 2023	Goldman Sachs	Compra	USD	63.100	Venta	MXN	1.096.623	(630)
20 oct. 2023	Goldman Sachs	Compra	MXN	16.381	Venta	USD	961	(9)
20 oct. 2023	JP Morgan	Compra	USD	3.116	Venta	CNH	22.291	45
20 oct. 2023	JP Morgan	Compra	USD	18.586	Venta	HUF	6.687.871	(242)
20 oct. 2023	JP Morgan	Compra	USD	99.676	Venta	IDR	1.505.267.629	911
20 oct. 2023	JP Morgan	Compra	USD	17.115	Venta	MXN	290.466	235
20 oct. 2023	JP Morgan	Compra	CNH	22.291	Venta	USD	3.117	(45)
20 oct. 2023	JP Morgan	Compra	COP	32.482.100	Venta	USD	7.648	174
20 oct. 2023	JP Morgan	Compra	USD	19.111	Venta	ZAR	362.607	(3)
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	15.185	Venta	CNH	109.335	120
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	7.871	Venta	COP	32.482.100	49
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	20.624	Venta	EUR	18.679	320
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	66.150	Venta	GBP	51.499	USD 901
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	43.434	Venta	INR	3.589.152	92
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	19.501	Venta	INR	1.616.645	(22)
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	195.080	Venta	JPY	27.183.749	6.708
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	16.964	Venta	MXN	287.712	244
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	16.462	Venta	MYR	75.281	175
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	BRL	101.634	Venta	USD	20.537	(167)
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	CNH	109.335	Venta	USD	15.261	(196)
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	MYR	75.281	Venta	USD	16.310	(23)
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	GBP	8.750	Venta	USD	11.143	(57)
20 dic. 2023	JP Morgan	Compra	USD	6.783	Venta	INR	559.782	41
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): 21.504\$							USD	13.409
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(43.616)								(14.349)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles)): \$(22.112)							USD	(940)

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico (miles)	Apreciación / (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(2.417)	USD (571.620)	USD 896
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	935	224.003	(937)
Índice SOFR de 3 meses marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	1.591	377.067	(809)
Índice SOFR de 3 meses Septiembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(4.585)	(1.084.209)	4.224
Dólar australiano Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(50)	(3.250)	-
Dólar australiano Septiembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	922	59.727	(1.286)
Libra esterlina Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(100)	(7.916)	37
Libra esterlina Septiembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(292)	(23.114)	177
Dólar canadiense Septiembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(590)	(43.651)	735

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Listado de contratos de futuros (continuación)

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico (miles)	Apreciación / (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Euribor 3 Meses Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	1.788	465.995	(257)
Euro FX Currency Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(24)	(3.270)	15
Euro FX Currency Septiembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(416)	(56.433)	1.206
Euro-Bund Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(756)	(108.726)	(979)
Euro-Buxl 30 Year Bond Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	161	23.352	349
Euro-Buxl 30 Year Bond Septiembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	40	5.803	230
Fod Fund 30 dias Agosto 2023	Bank of America Merrill Lynch	(7.532)	(2.971.298)	199
Fed Fund 30 días Septiembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(56)	(22.089)	1
ICE 3 Month SONIA Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	1.330	397.160	(1.287)
ICE 3 Month SONIA Junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	1.352	404.179	100
Japan 10 Year Bond (OSE) Septiembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(661)	(667.020)	4.925
Yen Japonés Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(278)	(24.301)	(47)
Yen Japonés Septiembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	2.826	243.460	(12.122)
Long Gilt Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	338	40.921	724
Peso Mexicano Septiembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	3.062	89.946	1.416
U.S. 10 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(16.133)	(1.791.267)	(15.224)
U.S. 10 Year Ultra Note Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(8.421)	(977.757)	(14.383)
U.S. 2 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	3.662	746.333	2.480
U.S. 5 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(9.577)	(1.023.991)	(6.718)
U.S. Long Bond (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	14.987	1.823.731	30.929
U.S. Ultra Bond (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	2.496	323.154	6.354
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): 20.467\$				USD 54.997
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(47.194)				(54.049)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(26.727)				USD 948

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por activos — 12,81% (28 de febrero de 2023: 14,21%)					
140	AB BSL CLO 4 Ltd, Serie 2023 4A, Clase A, 144A, 6,957 %, con vencimiento el 20/04/2036 *	0,05	790	National Collegiate Student Loan Trust 2006-3, Serie 2006 3, Clase B, 5,789 %, con vencimiento el 26/01/2032 *	0,21
68	ABFC 2003-OPT1 Trust, Serie 2003 OPT1, Clase A3, 6,109 %, con vencimiento el 25/04/2033 *	0,02	730	National Collegiate Student Loan Trust 2007-2, Serie 2007 2, Clase A4, 5,719 %, con vencimiento el 25/01/2033 *	0,24
1.274	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Serie 2005-HE3, Serie 2005 HE3, Clase M4, 6,374 %, con vencimiento el 25/05/2035 *	0,40	1.302	National Collegiate V Commutation Trust, Serie 2007 33A6, Clase 10, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 25/03/2038 *	0,11
617	Aegis Asset Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Cfts Ser 2005-4, Serie 2005 4, Clase M2, 6,134 %, con vencimiento el 25/10/2035 *	0,20	2.291	National Collegiate VI 2007-4 Class A-3L Commutation Trust, Serie 2007 4VI, Clase O, 144A, 6,279 %, con vencimiento el 29/03/2038 *†	0,14
950	AGL CLO 12 Ltd, Serie 2021 12A, Clase D, 144A, 8,438 %, con vencimiento el 20/07/2034 *	0,32	1.000	Ocean Trails CLO V, Serie 2014 5A, Clase DRR, 144A, 9,013 %, con vencimiento el 13/10/2031 *	0,32
450	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd, Serie 2014 3RA, Clase E, 144A, 11,127 %, con vencimiento el 28/01/2031 *	0,15	600	Ocean Trails CLO X, Serie 2020 10A, Clase AR, 144A, 6,790 %, con vencimiento el 15/10/2034 *	0,21
480	Bain Capital Credit CLO 2022-2 Ltd, Serie 2022 2A, Clase D1, 144A, 8,996 %, con vencimiento el 22/04/2035 *	0,16	650	OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 35 Ltd, Serie 2018 1A, Clase C, 144A, 8,188 %, con vencimiento el 20/01/2031 *	0,21
660	Bain Capital Credit CLO 2023-1 Ltd, Serie 2023 1A, Clase AN, 144A, 6,573 %, con vencimiento el 16/04/2036 *	0,23	940	Option One Mortgage Loan Trust 2005-3, Serie 2005 3, Clase M4, 6,359 %, con vencimiento el 25/08/2035 *	0,26
1.380	Ballyrock CLO 19 Ltd, Serie 2022 19A, Clase D, 144A, 12,436 %, con vencimiento el 20/04/2035 *	0,46	256	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Serie 2007 FXD1, Clase 1A1, 5,866 %, con vencimiento el 25/01/2037 *	0,07
1.225	Ballyrock CLO 2018-1 Ltd, Serie 2018 1A, Clase C, 144A, 8,738 %, con vencimiento el 20/04/2031 *	0,42	516	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Serie 2007 FXD1, Clase 2A1, 5,866 %, con vencimiento el 25/01/2037 *	0,15
720	Barings CLO Ltd 2016-II, Serie 2016 2A, Clase ER2, 144A, 12,088 %, con vencimiento el 20/01/2032 *	0,24	618	RAMP Series 2006-NC3 Trust, Serie 2006 NC3, Clase M1, 5,939 %, con vencimiento el 25/03/2036 *	0,21
447	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-CL1, Serie 2005 CL1, Clase A1, 3,646 %, con vencimiento el 25/09/2034 *	0,15	1.320	Saranac CLO III Ltd, Serie 2014 3A, Clase DR, 144A, 8,770 %, con vencimiento el 22/06/2030 *	0,39
520	Birch Grove CLO 6 Ltd, Serie 2023 6A, Clase D, 144A, 11,119 %, con vencimiento el 20/07/2035 *	0,18	320	SMB Private Education Loan Trust 2015-C, Serie 2015 C, Clase C, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 17/09/2046	0,10
500	Black Diamond CLO 2019-2 Ltd, Serie 2019 2A, Clase A1A, 144A, 7,037 %, con vencimiento el 23/07/2032 *	0,17	1.153	Sunrun Athena Issuer 2018-1 LLC, Serie 2018 1, Clas A, 144A, 5,310 %, con vencimiento el 30/04/2049	0,38
1.000	BlueMountain CLO XXII Ltd, Serie 2018 22A, Clase A1, 144A, 6,650 %, con vencimiento el 15/07/2031 *	0,35	540	Symphony CLO 37 Ltd, Serie 2022 37A, Clase A1A, 144A, 7,626 %, con vencimiento el 20/10/2034 *	0,19
720	CarVal CLO VII-C Ltd, Serie 2023 1A, Clase A1, 144A, 7,526 %, con vencimiento el 20/01/2035 *	0,25	750	Voya CLO 2016-3 Ltd, Serie 2016 3A, Clase A1R, 144A, 6,762 %, con vencimiento el 18/10/2031 *	0,26
850	CIFC Funding 2018-I Ltd, Serie 2018 1A, Clase C, 144A, 7,322 %, con vencimiento el 18/04/2031 *	0,29	639	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Serie 2007-HE4 Trust, Serie 2007 HE4, Clase 1A, 5,599 %, con vencimiento el 25/07/2047 *	0,16
17	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Serie 2005-D, Serie 2005 D, Clase 2A, 5,615 %, con vencimiento el 15/11/2035 *	0,01	600	Warwick Capital CLO 1 Ltd, Serie 2023 1A, Clase D, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 20/10/2036 *	0,21
493	Educational Funding Co LLC/The, Serie 2006 1A, Clase A3, 144A, 5,963 %, con vencimiento el 25/04/2033 *	0,12	Total de valores garantizados por activos (coste 38.754\$)		36.735
660	Encore Credit Receivables Trust 2005-2, Serie 2005 2, Clase M4, 6,359 %, con vencimiento el 25/11/2035 *	0,21	Valores garantizados por hipotecas — 11,72 % (28 de febrero de 2023: 12,42%)		12,81
74	First Franklin Mortgage Loan Trust 2003-FF4, Serie 2003 FF4, Clase M1, 7,233 %, con vencimiento el 25/10/2033 *	0,02	271	Alternative Loan Trust 2007-4CB, Serie 2007 4CB, Clase 1A5, 5,750 %, con vencimiento el 25/04/2037	0,08
1.125	FOCUS Brands Funding LLC, Serie 2017 1A, Clase A2II, 144A, 5,093 %, con vencimiento el 30/04/2047	0,37	167	BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Serie 2016 GG10, Clase AJA, 144A, 5,810 %, con vencimiento el 10/08/2045 *	0,01
540	FS Rialto 2022-FL6 Issuer LLC, Serie 2022 FL6, Clase A, 144A, 7,894 %, con vencimiento el 17/08/2037 *	0,19	546	Banc of America Funding Corp, Serie 2015 R3, Clas 1A2, 144A, 2,951 %, con vencimiento el 27/03/2036 *	0,15
850	Goldentree Loan Management US Clo 3 Ltd, Serie 2018 3A, Clase D, 144A, 8,438 %, con vencimiento el 20/04/2030 *	0,29	780	BANK 2017-BNK7, Serie 2017 BNK7, Clase A4, 3,175 %, con vencimiento el 15/09/2060	0,25
1.000	Golub Capital Partners CLO 21M Ltd, Serie 2014 21A, Clase CR, 144A, 8,063 %, con vencimiento el 25/10/2031 *	0,33	140	BBCRE Trust 2015-GTP, Serie 2015 GTP, Clase D, 144A, 4,715 %, con vencimiento el 10/08/2033 *	0,04
1.000	Golub Capital Partners CLO 53B Ltd, Serie 2021 53A, Clase E, 144A, 12,288 %, con vencimiento el 20/07/2034 *	0,33	840	BBSG 2016-MRP Mortgage Trust, Serie 2016 MRP, Clase A, 144A, 3,275 %, con vencimiento el 05/06/2036	0,24
150	Golub Capital Partners CLO 66B Ltd, Serie 2023 66A, Clase A, 144A, 6,926 %, con vencimiento el 25/04/2036	0,05	510	BHMS 2018-ATLS, Serie 2018 ATLS, Clase C, 144A, 7,507 %, con vencimiento el 15/07/2035 *	0,17
132	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, serie 2021 4GS, clase A, 144A, 1,930 %, con vencimiento el 20/07/2048	0,03	520	BX Trust 2021-VIEW, Serie 2021 VIEW, Clas C, 144A, 7,774 %, con vencimiento el 15/06/2036 *	0,17
250	Greenwood Park CLO Ltd, Serie 2018 1A, Clase E, 144A, 10,520 %, con vencimiento el 15/04/2031 *	0,07	341	BXMT 2020-FL2 Ltd, Serie 2020 FL2, Clase A, 144A, 6,328 %, con vencimiento el 15/02/2038 *	0,11
1.000	Grippen Park CLO Ltd, Serie 2017 1A, Clase D, 144A, 8,888 %, con vencimiento el 20/01/2030 *	0,34	430	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, Serie 2014 GC23, Clas C, 4,572 %, con vencimiento el 10/07/2047 *	0,14
1.400	Harriman Park CLO Ltd, Serie 2020 1A, Clase ER, 144A, 11,988 %, con vencimiento el 20/04/2034 *	0,46	770	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Serie 2017 P8, Clase A3, 3,203 %, con vencimiento el 15/09/2050	0,25
145	HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Serie 2021 FL1, Clase C, 144A, 7,127 %, con vencimiento el 16/06/2036 *	0,05	11.041	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Serie 2017 P8, Clase XA, 1,010 %, con vencimiento el 15/09/2050 *	0,10
170	HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Serie 2021 FL1, Clase D, 144A, 7,777 %, con vencimiento el 16/06/2036 *	0,05	586	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2018-C5, Serie 2018 C5, Clase A3, 3,963 %, con vencimiento el 10/06/2051	0,19
537	Home Equity Asset Trust 2006-4, Serie 2006 4, Clase 2A4, 5,989 %, con vencimiento el 25/08/2036 *	0,18	710	COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Serie 2015 DC1, Clase C, 4,438 %, con vencimiento el 10/02/2048 *	0,20
703	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Serie INABS 2005-C, Serie 2005 C, Clase M2, 6,179 %, con vencimiento el 25/10/2035 *	0,24	520	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R03, Serie 2019 R03, Clase 1B1, 144A, 9,502 %, con vencimiento el 25/09/2031 *	0,19
225	Long Beach Mortgage Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Clase M4, 6,704 %, con vencimiento el 25/02/2035 *	0,08	360	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Serie 2019 R07, Clase 1B1, 144A, 8,802 %, con vencimiento el 25/10/2039 *	0,13
1.000	Magnetite XII Ltd, Serie 2015 12A, Clase ER, 144A, 11,250 %, con vencimiento el 15/10/2031 *	0,33	260	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Serie 2020 R01, Clase 1B1, 144A, 8,652 %, con vencimiento el 25/01/2040 *	0,09
1.270	Marble Point CLO XIV Ltd, Serie 2018 2A, Clase D, 144A, 9,118 %, con vencimiento el 20/01/2032 *	0,41	723	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Clase 1B1, 144A, 8,388 %, con vencimiento el 25/10/2041 *	0,25
533	Mastr Asset Backed Securities Trust 2007-HE2, Serie 2007 HE2, Clase A1, 6,579 %, con vencimiento el 25/08/2037 *	0,15	670	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Clase 1M2, 144A, 6,838 %, con vencimiento el 25/10/2041 *	0,23
322	Mosaic Solar Loan Trust 2018-1, Serie 2018 1A, Clase CERT, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 22/06/2043 ∞	0,07	190	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Serie 2021 R03, Clase 1B1, 144A, 8,038 %, con vencimiento el 25/12/2041 *	0,07
1.243	Mosaic Solar Loan Trust 2022-1, Serie 2022 1A, Clase B, 144A, 3,160 %, con vencimiento el 20/01/2053	0,34	700	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, Serie 2022 R04, Clase 1M2, 144A, 8,388 %, con vencimiento el 25/03/2042 *	0,25
710	National Collegiate II Commutation Trust, Serie 2005 AR15, Clase AR15, 0,000 %, con vencimiento el 01/06/2045	0,03	250	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05, Serie 2023 R05, Clase 1M2, 144A, 8,396 %, con vencimiento el 25/06/2043 *	0,09
600	National Collegiate Student Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Clase B, 5,809 %, con vencimiento el 26/03/2035 *	0,18	940	CSAIL 2016-C5 Commercial Mortgage Trust, Serie 2016 C5, Clase A5, 3,757 %, con vencimiento el 15/11/2048	0,31
65	National Collegiate Student Loan Trust 2006-1, Serie 2006 1, Clase A5, 5,779 %, con vencimiento el 25/03/2033 *	0,02	360	CSAIL 2017-C8 Commercial Mortgage Trust, Serie 2017 C8, Clase C, 4,432 %, con vencimiento el 15/06/2050 *	0,10
			1.480	CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Clase F, 144A, 4,373 %, con vencimiento el 15/09/2037	0,20

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	
Valores garantizados por hipotecas (continuación)						
630	CSMC Trust 2017-CHOP, Serie 2017 CHOP, Clase F, 144A, 9,794 %, con vencimiento el 15/07/2032 *	0,20	250	Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Clase C, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/11/2027 *	0,01	
585	DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Serie 2007 AR1, Clase 1A1B, 5,568 %, con vencimiento el 19/04/2047 *	0,17	410	Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Clase D, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/11/2027 *	0,01	
630	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C07, Clase 1B1, 9,402 %, con vencimiento el 25/05/2030 *	0,23	370	Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Clase E, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/11/2027 *	2	
556	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Clase 1B1, 8,952 %, con vencimiento el 25/07/2030 *	0,21	853	Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Serie 2018 THL, Clase D, 144A, 7,731 %, con vencimiento el 11/11/2034 *	0,29	
600	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,500% ±	0,20	834	Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Serie 2018 THL, Clase E, 144A, 8,911 %, con vencimiento el 11/11/2034 *	0,28	
91	Fannie Mae Pool 'CB3880', 5,000 %, con vencimiento el 01/06/2052	0,03	891	Tharaldson Hotel Portfolio Trust 2018-THPT, Serie 2018 THL, Clase F, 144A, 9,684 %, con vencimiento el 11/11/2034 *	0,30	
520	Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-DNA1, Serie 2020 DNA1, Clase B1, 144A, 7,702 %, con vencimiento el 25/01/2050 *	0,18	34	Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust Serie 2007-C33, Serie 2007 C33, Clase AJ, 5,926 %, con vencimiento el 15/02/2051 *	0,01	
500	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA5, Serie 2020 DNA5, Clase B1, 144A, 10,088 %, con vencimiento el 25/10/2050 *	0,19	99	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR17 Trust, Serie 2005 AR17, Clase A1C3, 6,389 %, con vencimiento el 25/12/2045 *	0,02	
680	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA6, Serie 2020 DNA6, Clase B1, 144A, 8,288 %, con vencimiento el 25/12/2050 *	0,23	2.284	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR2 Trust, Serie 2005 AR2, Clase B1, 6,224 %, con vencimiento el 25/01/2045 *	0,65	
580	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, Serie 2021 DNA3, Clase B1, 144A, 8,788 %, con vencimiento el 25/10/2033 *	0,21	320	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2006-AR13 Trust, Serie 2006 AR13, Clase 2A, 5,930 %, con vencimiento el 25/10/2046 *	0,10	
600	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Serie 2021 DNA5, Clase B1, 144A, 8,338 %, con vencimiento el 25/01/2034 *	0,21	127	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2006-AR3 Trust, Serie 2006 AR3, Clase A1B, 5,430 %, con vencimiento el 25/02/2046 *	0,04	
290	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Serie 2021 DNA6, Clase B1, 144A, 8,688 %, con vencimiento el 25/10/2041 *	0,10	651	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28, Serie 2015 C28, Clase D, 4,216 %, con vencimiento el 15/05/2048 *	0,18	
164	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2017 SP1, Clase B, 144A, 4,118 %, con vencimiento el 25/09/2047 *	0,04	724	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C38, Serie 2017 C38, Clase A4, 3,190 %, con vencimiento el 15/07/2050	0,23	
356	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2021 DNA2, Clase M2, 144A, 7,588 %, con vencimiento el 25/08/2033 *	0,12	Total de valores garantizados por hipotecas (coste 37 924 USD)			
590	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-375H, Serie 2017 375H, Clase A, 144A, 3,591 %, con vencimiento el 10/09/2037 *	0,18	33.630		11,72	
457	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Clase C, 144A, 9,675 %, con vencimiento el 15/09/2031 *	0,06	Bonos y obligaciones corporativos — 60,62% (28 de febrero de 2023: 59,17%)			
750	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC30, Serie 2015 GC30, Clase D, 3,384 %, con vencimiento el 10/05/2050	0,21	Argentina — 0,35 % (28 de febrero de 2023: 0,35%)			
58	GSMP5 Mortgage Loan Trust 2006-RP1, Serie 2006 RP1, Clase 1A2, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 25/01/2036	0,02	410	Transportadora de Gas del Sur SA, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 02/05/2025	0,13	
330	Hilton USA Trust 2016-HHV, Serie 2016 HHV, Clase D, 144A, 4,333 %, con vencimiento el 05/11/2038 *	0,11	290	YPF SA, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 28/07/2025	0,10	
1.199	Impac Secured Assets Trust 2006-3, Serie 2006 3, Clase A7, 5,969 %, con vencimiento el 25/11/2036 *	0,33	420	YPF SA, 144A, 6,950 %, con vencimiento el 21/07/2027	0,12	
340	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-NINE, Serie 2016 NINE, Clase A, 144A, 2,949 %, con vencimiento el 06/09/2038 *	0,11	Bélgica — 0,37% (28 de febrero de 2023: 0,37%)			
1.010	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Serie 2018 PHMZ, Clase M, 144A, 13,933 %, con vencimiento el 15/06/2035 *†	—	EUR	1.000	KBC Group NV, 4,750 %, Perpetuo *	
1	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-LDP12, Serie 2007 LD12, Clase AJ, 6,561 %, con vencimiento el 15/02/2051 *	—	Bermuda — 0,39 % (28 de febrero de 2023: 0,38%)			
900	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Serie 2018 WPT, Clase FFL, 144A, 8,705 %, con vencimiento el 05/07/2033 *	0,25	40	Aspen Insurance Holdings Ltd, 4,650 %, con vencimiento el 15/11/2023	0,02	
280	JP Morgan Resecuritization Trust Series 2009-10, Serie 2009 10, Clase 7A2, 144A, 5,018 %, con vencimiento el 26/02/2037 *	0,04	1.130	Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, con vencimiento 15/10/2025	0,37	
31	ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Clase AJ, 5,450 %, con vencimiento el 12/08/2048 *	—	Brasil — 0,88 % (28 de febrero de 2023: 1,03%)			
31	ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Clase AJFL, 144A, 5,450 %, con vencimiento el 12/08/2048 *	—	460	B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 20/09/2031	0,14	
500	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C27, Serie 2015 C27, Clase A4, 3,753 %, con vencimiento el 15/12/2047	0,17	350	Braskem Netherlands Finance BV, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 10/10/2028	0,11	
381	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP, Serie 2018 MP, Clase A, 144A, 4,419 %, con vencimiento el 11/07/2040 *	0,11	370	MercadoLibre Inc, 3,125 %, con vencimiento el 14/01/2031	0,10	
150	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2005-2AR, Serie 2005 2AR, Clase B1, 5,929 %, con vencimiento el 25/04/2035 *	0,04	490	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, con vencimiento el 05/06/2115	0,15	
880	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Clase D, 144A, 4,544 %, con vencimiento el 15/08/2036 *	0,20	800	Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125 %, con vencimiento el 15/01/2032	0,22	
361	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Clase E, 144A, 4,544 %, con vencimiento el 15/08/2036 *	0,07	450	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, con vencimiento el 10/11/2039	0,16	
687	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Serie 2016 3A, Clase B2, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 25/09/2056 *	0,22	Canadá — 2,90 % (28 de febrero de 2023: 2,18%)			
220	New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Serie 2021 NQ2R, Clase A3, 144A, 1,353 %, con vencimiento el 25/10/2058 *	0,07	780	Air Canada, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2026	0,25	
419	Nomura Resecuritization Trust 2015-4R, Serie 2015 4R, Clase 2A2, 144A, 2,903 %, con vencimiento el 26/10/2036 *	0,12	120	ATS Corp, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 15/12/2028	0,04	
242	PMT Credit Risk Transfer Trust, 144A, 8,883 %, con vencimiento el 29/10/2024 *	0,08	770	Bombardier Inc, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 15/04/2027	0,27	
391	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-1, Serie 2017 1, Clase M1, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 25/01/2056 *	0,13	250	Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 15/01/2028	0,08	
1.141	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-1, Serie 2018 1, Clase M, 4,750 %, con vencimiento el 25/05/2057 *	0,37	CAD	420	Doman Building Materials Group Ltd, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 15/05/2026	0,09
790	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-4, Serie 2018 4, Clase M, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 25/03/2058	0,24	600	GFL Environmental Inc, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 15/12/2026	0,20	
422	Sequoia Mortgage Trust 2007-2, Serie 2007 2, Clase 1A3, 6,068 %, con vencimiento el 20/06/2036 *	0,14	1.300	GFL Environmental Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/06/2029	1,179	
			280	Hudbay Minerals Inc, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 01/04/2026	0,09	
			390	Hudbay Minerals Inc, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 01/04/2029	0,13	
			440	MEG Energy Corp, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 01/02/2027	0,16	
			1.050	MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 01/02/2029	0,35	
			500	Open Text Corp, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/02/2028	0,15	
			270	Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 15/02/2030	0,08	
			250	Superior Plus LP / Superior General Partner Inc, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 15/03/2029	0,08	
			400	Toronto-Dominion Bank/The, 8,125 %, con vencimiento el 31/10/2082 *	0,04	
			250	TransAlta Corp, 7,750 %, con vencimiento el 15/11/2029	0,19	
			860	TransAlta Corp, 6,500 %, con vencimiento el 15/03/2040	0,29	

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
	8.330	2,90	Luxemburgo — 0,98% (28 de febrero de 2023: 0,94%)		
Bonos y pagarés corporativos (continuación)			370 Altice Financing SA, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 15/01/2028	301	0,11
Canadá — (continuación)			1.650 Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 15/05/2027	897	0,31
Islas Caimán — 0,42 % (28 de febrero de 2023: 0,42%)			500 ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 30/06/2027	402	0,14
1.274 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 15/09/2024	1.198	0,42	570 Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, con vencimiento el 01/04/2028	636	0,22
Chile — 0,17 % (28 de febrero de 2023: 0,21%)			587 FAGE International SA / FAGE USA Dairy Industry Inc, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 15/08/2026	565	0,20
803 VTR Comunicaciones SpA, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 15/01/2028	498	0,17		2.801	0,98
China — 0,18 % (28 de febrero de 2023: 0,30%)			Macao — 0,80% (28 de febrero de 2023: 0,82%)		
400 Country Garden Holdings Co Ltd, 8,000 %, con vencimiento el 27/01/2024	51	0,01	270 Sands China Ltd, 5,375%, con vencimiento el 08/08/2025	261	0,09
200 Prosperous Ray Ltd, 4,625 %, con vencimiento el 12/11/2023	199	0,07	200 Sands China Ltd, 5,650%, con vencimiento el 08/08/2028	189	0,06
370 Prosus NV, 144A, 3,061 %, con vencimiento el 13/07/2031	281	0,10	200 Sands China Ltd, 3,100%, con vencimiento el 08/03/2029	167	0,06
	531	0,18	200 Sands China Ltd, 3,500%, con vencimiento el 08/08/2031	161	0,06
Dinamarca — 0,28 % (28 de febrero de 2023: 0,29%)			1.550 Wynn Macau Ltd, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 01/10/2024	1.515	0,53
800 Danske Bank AVS, 144A, 6,466 %, con vencimiento el 09/01/2026 *	801	0,28		2.293	0,80
Francia — 0,76 % (28 de febrero de 2023: 0,74%)			Malasia — 0,11% (28 de febrero de 2023: 0,12%)		
200 Altice France SA/Francia, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 01/02/2027	169	0,06	490 Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064%, con vencimiento el 19/08/2050	327	0,11
550 BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, Perpetuo *	536	0,19	México — 0,32 % (28 de febrero de 2023: 0,35%)		
1.470 Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Perpetuo*	1.469	0,51	1.020 Banco Mercantil del Norte SA/Gran Caimán, 144A, 7,500 %, Perpetuo*	931	0,32
	2.174	0,76			
Alemania — 0,75 % (28 de febrero de 2023: 0,78%)			Países Bajos — 0,46 % (28 de febrero de 2023: 0,48%)		
320 Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/01/2028	290	0,10	EUR 1.000 Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, Perpetuo *	993	0,35
620 Mercer International Inc, 5,125 %, con vencimiento el 01/02/2029	508	0,18	EUR 310 Stichting AK Rabobank Certificaten, 6,500 %, Perpetuo	314	0,11
EUR 100 Nidda BondCo GmbH, 5,000 %, con vencimiento el 30/09/2025	108	0,04		1.307	0,46
800 ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 29/04/2025	778	0,27	Singapur — 0,08 % (28 de febrero de 2023: 0,08%)		
460 ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125%, vencimiento 14/04/2030	466	0,16	220 Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4,250 %, con vencimiento el 19/06/2024	217	0,08
	2.150	0,75	Sudáfrica — 0,09% (28 de febrero de 2023: 0,09%)		
Paraguay — 0,10% (28 de febrero de 2023: 0,11%)			310 Sasol Financing USA LLC, 5,500 %, con vencimiento el 18/03/2031	248	0,09
363 Millicom International Cellular SA, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 27/04/2031	287	0,10	Suiza — 1,53 % (28 de febrero de 2023: 1,75%)		
Hong Kong — 0,29% (28 de febrero de 2023: 0,29%)			720 Credit Suisse AG/New York NY, 4,750%, vencimiento 09/08/2024	710	0,25
230 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 06/06/2025	219	0,08	250 Credit Suisse AG/New York NY, 3,625%, vencimiento 09/09/2024	243	0,08
730 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 04/12/2029	613	0,21	500 Credit Suisse AG/New York NY, 7,950%, vencimiento 09/01/2025	510	0,18
	832	0,29	1.500 UBS Group AG, 144A, 7,000 %, Perpetuo *	1.491	0,52
Irlanda — 0,32 % (28 de febrero de 2023: 0,33%)			640 Vistalet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 01/05/2027	580	0,20
630 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, con vencimiento el 30/01/2032	512	0,18	920 Vistalet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 9,500%, vencimiento 01/06/2028	850	0,30
420 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 15/04/2026	397	0,14		4.384	1,53
	909	0,32	Emiratos Árabes Unidos — 0,08 % (28 de febrero de 2023: 0,23%)		
Israel — 0,70% (28 de febrero de 2023: 0,50%)			260 DP World Ltd/United Arab Emirates, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 25/09/2048	241	0,08
1.030 Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, con vencimiento el 01/02/2036	950	0,33	Reino Unido — 2,01 % (28 de febrero de 2023: 1,64%)		
500 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, con vencimiento el 09/05/2027	468	0,16	210 Barclays Plc, 7,750 %, Perpetuo *	211	0,07
550 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, con vencimiento el 15/09/2031	584	0,21	GBP 680 Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, con vencimiento el 07/04/2026	791	0,28
	2.002	0,70	EUR 320 Lloyds Banking Group Plc, 4,947 %, Perpetuo *	324	0,11
Italia — 0,45 % (28 de febrero de 2023: 0,46%)			250 Lloyds Banking Group Plc, 7,500 %, Perpetuo *	244	0,08
230 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, con vencimiento el 15/01/2026	221	0,08	480 Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, Perpetuo *	436	0,15
530 UniCredit SpA, 144A, 7,296 %, con vencimiento el 02/04/2034 *	511	0,18	442 Mclaren Finance Plc, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 01/08/2026	392	0,14
640 UniCredit SpA, 144A, 5,459 %, con vencimiento el 30/06/2035 *	556	0,19	970 NatWest Group Plc, 4,500 %, Perpetuo *	937	0,33
	1.288	0,45	690 Neptune Energy Bondco Plc, 144A, 6,625 %, con vencimiento el 15/05/2025	687	0,24
Kazajistán — 0,20 % (28 de febrero de 2023: 0,20%)			GBP 800 Saga Plc, 5,500 %, con vencimiento el 15/07/2026	775	0,27
380 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 19/04/2027	358	0,13	750 Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/05/2029	687	0,24
230 QazaqGaz NC JSC, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 26/09/2027	212	0,07	330 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/07/2031	276	0,10
	570	0,20		5.760	2,01
Kuwait — 0,19 % (28 de febrero de 2023: 0,27%)			Estados Unidos — 43,34 % (28 de febrero de 2023: 42,60%)		
530 MEGlobal Canada ULC, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 18/05/2030	536	0,19	574 Abercrombie & Fitch Management Co, 144A, 8,750 %, con vencimiento el 15/07/2025	585	0,20
			1.103 Accelerate360 Holdings LLC, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 01/03/2028	1.145	0,40
			330 Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 01/05/2028	268	0,09
			630 AdaptHealth LLC, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 01/08/2028	569	0,20
			286 Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 01/03/2028	267	0,09
			690 Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 6,375 %, con vencimiento el 15/06/2030	680	0,24
			447 Akumin Escrow Inc, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 01/08/2028	297	0,10
			300 Akumin Inc, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 01/11/2025	227	0,08
			240 Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 15/05/2028	237	0,08
			1.310 Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 15/02/2028	751	0,26
			300 Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,625 %, con vencimiento el 15/07/2026	286	0,10

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^A

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y pagarés corporativos (continuación)					
Estados Unidos — (continuación)					
340	Altria Group Inc, 5,950 %, con vencimiento el 14/02/2049	0,11	420	Charter Communications Operating LLC / Capital operativo de Charter Communications, 5,125 %, con vencimiento el 01/07/2049	0,11
300	AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 15/02/2029	0,07	1.020	Chord Energy Corp, 144A, 6,375 %, con vencimiento el 01/06/2026	0,35
293	American Airlines 2017-1 Clase B Pass Through Trust, Serie B, 4,950 %, con vencimiento el 15/02/2025	0,10	430	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 15/03/2026	0,15
430	American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 15/02/2028	0,15	1.050	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 01/04/2030	0,21
28	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2026	0,01	490	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/02/2031	0,13
720	American Airlines Inc/AAAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 20/04/2029	0,24	470	Citigroup Inc, Series W, 4,000 %, Perpetuo *	0,15
1.220	American News Co LLC, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 01/09/2026	0,48	610	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/05/2027	0,22
190	Antero Resources Corp, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 01/03/2030	0,06	1.380	Comerica Bank, 2,500 %, con vencimiento el 23/07/2024	0,46
210	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 15/06/2027	0,07	450	CommScope Inc, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 01/03/2026	0,14
480	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 4,000 %, con vencimiento 01/09/2029	0,14	620	CommScope Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 01/09/2029	0,16
740	AthenaHealth Group Inc, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 15/02/2030	0,22	910	Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/01/2031	0,30
90	Aviation Capital Group LLC, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/12/2024	0,03	910	CoreCivic Inc, 8,250 %, con vencimiento el 15/04/2026	0,32
350	Ball Corp, 2,875 %, con vencimiento el 15/08/2030	0,10	350	Crescent Energy Finance LLC, 144A, 9,250 %, con vencimiento el 15/02/2028	0,13
340	Ball Corp, 3,125 %, con vencimiento el 15/09/2031	0,10	310	CrowdStrike Holdings Inc, 3,000 %, con vencimiento el 15/02/2029	0,09
320	Bath & Body Works Inc, 5,250 %, con vencimiento el 01/02/2028	0,11	450	CSC Holdings LLC, 5,250 %, con vencimiento el 01/06/2024	0,15
510	Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, con vencimiento el 01/10/2030	0,17	1.260	CSC Holdings LLC, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 01/04/2028	0,28
340	Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 01/11/2025	0,11	1.190	CSC Holdings LLC, 144A, 11,250 %, con vencimiento el 15/05/2028	0,41
280	Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 01/02/2027	0,06	670	CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 01/12/2030	0,17
140	Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/01/2028	0,02	300	Cushman & Wakefield US Borrower LLC, 144A, 8,875 %, con vencimiento el 01/09/2031	0,11
70	Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 30/01/2028	0,01	520	CVS Health Corp, 5,250 %, con vencimiento el 21/02/2033	0,18
280	Beacon Roofing Supply Inc, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 01/08/2030	0,10	1.000	Darling Ingredients Inc, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 15/06/2030	0,34
1.540	Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2026	0,52	470	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 15/09/2037	0,17
320	Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 01/09/2028	0,10	1.430	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 15/08/2027	0,44
1.140	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, con vencimiento el 15/12/2025	0,40	800	DISH DBS Corp, 5,875 %, con vencimiento el 15/11/2024	0,26
360	Boeing Co/The, 3,250 %, con vencimiento 01/02/2035	0,10	400	DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 01/12/2028	0,11
500	Boeing Co/The, 5,805 %, con vencimiento 01/05/2050	0,17	1.210	DISH Network Corp, cupón cero, con vencimiento el 15/12/2025	0,27
480	Boyer USA Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/05/2029	0,15	116	Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, con vencimiento el 15/06/2025	0,04
520	Builders FirstSource Inc, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 01/02/2032	0,15	760	DraftKings Holdings Inc, cupón cero, con vencimiento el 15/03/2028	0,20
480	Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/04/2030	0,15	490	Earthstone Energy Holdings LLC, 144A, 9,875 %, con vencimiento el 15/07/2031	0,19
370	Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 9,250 %, con vencimiento el 01/07/2031	0,13	623	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 30/01/2028	0,21
1.220	Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2030	0,43	220	Energy Transfer LP, 5,350 %, con vencimiento el 15/05/2045	0,07
1.160	Carnival Corp, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 01/03/2027	0,38	260	Energy Transfer LP, 6,250 %, con vencimiento el 15/04/2049	0,09
290	Carnival Corp, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 01/08/2028	0,09	320	Energy Transfer LP, Serie G, 7,125 %, Perpetuo*	0,10
180	Carnival Corp, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/08/2029	0,06	260	Entegris Inc, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 15/04/2028	0,08
150	Carnival Corp, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 01/06/2030	0,06	330	Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, con vencimiento el 15/02/2078 *	0,10
160	Carriage Purchaser Inc, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 15/10/2029	0,04	170	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 01/07/2025	0,06
460	Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 15/05/2029	0,14	190	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 01/07/2027	0,07
1.330	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 7,375 %, con vencimiento el 01/03/2031	0,46	740	EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 01/06/2030	0,27
870	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, con vencimiento el 01/05/2032	0,25	360	EQT Corp, 6,125 %, con vencimiento el 01/02/2025	0,13
120	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 01/06/2033	0,03	80	EQT Corp, 7,000 %, con vencimiento el 01/02/2030	0,03
380	CDW LLC / CDW Finance Corp, 4,125 %, con vencimiento el 01/05/2025	0,13	770	FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 01/01/2030	0,24
170	CDW LLC / CDW Finance Corp, 3,250 %, con vencimiento el 15/02/2029	0,05	250	FirstEnergy Corp, Series B, 4,150 %, con vencimiento el 15/07/2027	0,08
1.290	Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 15/06/2029	0,44	220	FirstEnergy Corp, 2,650 %, con vencimiento el 01/03/2030	0,06
60	Charles Schwab Corp/The, 2,900 %, con vencimiento el 03/03/2032	0,02	426	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 15/11/2025	0,14
320	Charles Schwab Corp/The, 5,853 %, con vencimiento el 19/05/2034 *	0,11	830	Foot Locker Inc, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2029	0,22
320	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, con vencimiento el 15/03/2028	0,10	1.300	General Motors Co, 3,250 %, con vencimiento el 12/02/2032	0,35
680	Charter Communications Operating LLC / Capital operativo de Charter Communications, 4,400 %, con vencimiento el 01/04/2033	0,21	1.780	Ford Motor Co, 6,100 %, con vencimiento el 19/08/2032	0,59
210	Charter Communications Operating LLC / Capital operativo de Charter Communications, 5,375 %, con vencimiento el 01/04/2038	0,06	450	Ford Motor Credit Co LLC, 5,125 %, con vencimiento el 16/06/2025	0,15
			200	Ford Motor Credit Co LLC, 3,625 %, con vencimiento el 17/06/2031	0,06
			1.930	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, con vencimiento el 15/03/2043	0,60
			1.370	Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, con vencimiento el 15/02/2028	0,43
			480	Gannett Holdings LLC, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 01/11/2026	0,14
			220	Gartner Inc, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 15/06/2029	0,07
			1.440	Gen Digital Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 30/09/2030	0,51
			540	GEO Group Inc/The, 10,500 %, con vencimiento el 30/06/2028	0,19
			950	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/12/2028	0,29
			440	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 20/01/2026	0,14
			650	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/04/2032	0,21

^A No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y pagarés corporativos (continuación)					
Estados Unidos — (continuación)					
580	Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 15/01/2027	559	0,20	200	0,07
340	Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 8,875 %, vencimiento 15/07/2028	352	0,12	146	0,05
500	Humana Inc, 5,875 %, con vencimiento el 01/03/2033	518	0,18	1.185	0,41
1.120	IIP Operating Partnership LP, 5,500 %, con vencimiento el 25/05/2026	994	0,35	27	0,01
1.380	Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 15/11/2029	1.213	0,42	1.580	0,47
270	Jazz Securities DAC, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 15/01/2029	242	0,08	230	0,06
60	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 01/02/2027	54	0,02	590	0,20
220	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/06/2029	185	0,06	134	0,05
1.130	Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, con vencimiento el 08/08/2024	1.095	0,38	490	0,16
100	Las Vegas Sands Corp, 3,500 %, con vencimiento e 18/08/2026	93	0,03	310	0,12
300	Legacy LifePoint Health LLC, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 15/02/2027	260	0,09	280	0,10
620	Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-issuer Inc, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 01/02/2026	583	0,20	240	0,08
370	LifePoint Health Inc, 144A, 9,875 %, con vencimiento el 15/08/2030	366	0,13	970	0,34
490	LPL Holdings Inc, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 15/03/2029	436	0,15	200	0,07
290	Match Group Holdings II LLC, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 01/06/2028	268	0,09	900	0,28
302	McClatchy Co LLC/The, 144A, 11,000 %, con vencimiento el 15/07/2027	334	0,12	530	0,17
780	Medline Borrower LP, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 01/10/2029	693	0,24	550	0,18
660	Michaels Cos Inc/The, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 01/05/2029	458	0,16	1.240	0,45
560	Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 01/05/2028	499	0,17	880	0,27
160	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 20/06/2027	160	0,06	508	0,18
300	Minerals Technologies Inc, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 01/07/2028	276	0,10	610	0,21
930	Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 13,250 %, con vencimiento el 15/12/2027	990	0,35	500	0,15
670	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,500 %, con vencimiento el 15/03/2031	435	0,15	530	0,21
90	MSCI Inc, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/02/2031	79	0,03	565	0,20
1.480	NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 15/03/2026	1.397	0,49	320	0,11
410	NCR Corp, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 15/04/2029	373	0,13	490	0,15
300	Newell Brands Inc, 4,000 %, con vencimiento el 01/12/2024	292	0,10	260	0,08
410	Newell Brands Inc, 4,700 %, con vencimiento el 01/04/2026	393	0,14	144A, 6,000 %, con vencimiento el 31/12/2030	233
250	Newell Brands Inc, 5,875 %, con vencimiento el 01/04/2036	222	0,08	1.010	0,32
140	Newell Brands Inc, 6,000 %, con vencimiento el 01/04/2046	114	0,04	530	0,15
570	NMI Holdings Inc, 144A, 7,375 %, con vencimiento el 01/06/2025	574	0,20	565	0,20
300	Noble Finance II LLC, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 15/04/2030	310	0,11	320	0,11
900	Northern Oil and Gas Inc, 144A, 8,125 %, vencimiento 01/03/2028	903	0,32	490	0,15
2.790	Northwest Acquisitions ULC / Dominion Finco Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 01/11/2022	-	-	260	0,08
390	Occidental Petroleum Corp, 7,150 %, con vencimiento el 15/05/2028	403	0,14	780	0,23
690	Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, con vencimiento el 15/09/2036	706	0,25	710	0,25
1.380	Occidental Petroleum Corp, 7,950 %, con vencimiento el 15/06/2039	1.552	0,54	710	0,23
140	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, con vencimiento el 15/08/2049	100	0,04	780	0,23
120	Olin Corp, 5,000 %, con vencimiento el 01/02/2030	110	0,04	710	0,23
1.050	Option Care Health Inc, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 31/10/2029	925	0,32	710	0,23
210	Pactiv LLC, 8,375 %, con vencimiento el 15/04/2027	212	0,07	200	0,07
1.104	Park-Ohio Industries Inc, 6,625 %, con vencimiento el 15/04/2027	959	0,33	238	0,09
390	Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 15/06/2029	331	0,12	1.220	0,43
430	PECF USS Intermediate Holding III Corp, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 15/11/2029	275	0,10	300	0,10
1.580	Permian Resources Operating LLC, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 01/07/2029	1.525	0,53	410	0,14
570	Plains All American Pipeline LP, Serie B, 9,736 %, Perpetua*	526	0,18	1.660	0,52
1.090	PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500 %, con vencimiento el 01/10/2028	1.051	0,37	52	0,02
370	PNC Financial Services Group Inc/The, 6,037 %, con vencimiento el 28/10/2033 *	376	0,13	80	0,03
350	PNC Financial Services Group Inc/The, 5,068 %, con vencimiento el 24/01/2034 *	332	0,12	1.490	0,46
880	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 3,375 %, con vencimiento el 31/08/2027	783	0,27	280	0,10
350	QVC Inc, 4,850 %, con vencimiento el 01/04/2024	340	0,12	170	0,06
750	QVC Inc, 4,450 %, con vencimiento 15/02/2025	675	0,24	520	0,18
310	QVC Inc, 4,375 %, con vencimiento el 01/09/2028	176	0,06	930	0,31
				140	0,04
				310	0,10
				430	0,15
				154	0,03
				970	0,33
				180	0,05

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	
120	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 01/11/2033	98	0,03	IDR	15.502.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR87, 6,500 %, con vencimiento el 15/02/2031	1.025	0,36
410	Venture Global LNG Inc, 144A, 8,375 %, con vencimiento el 01/06/2031	414	0,14	IDR	721.000	Indonesia Treasury Bond, Serie FR68, 8,375 %, con vencimiento el 15/03/2034	54	0,02
170	Vericast Corp, 144A, 11,000 %, con vencimiento el 15/09/2026	178	0,06				3.304	1,15
200	Vericast Corp, 144A, 12,500 %, con vencimiento el 15/12/2027	227	0,08					
830	Vertiv Group Corp, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 15/11/2028	746	0,26	Jordania — 0,20% (28 de febrero de 2023: 0,21%)				
160	Viavi Solutions Inc, 144A, 3,750 %, con vencimiento el 01/10/2029	133	0,05		560	Bono Internacional del Estado de Jordania, 144A, 7,750 %, con vencimiento el 15/01/2028	576	0,20
490	Viking Cruises Ltd, 144A, 9,125 %, con vencimiento el 15/07/2031	507	0,18	México — 0,57 % (28 de febrero de 2023: 0,65%)				
190	Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 15/02/2029	177	0,06	MXN	8.010	Mexican Bonos, Serie M, 5,750 %, con vencimiento el 05/03/2026	425	0,15
880	Viper Energy Partners LP, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 01/11/2027	849	0,30	MXN	13.970	Mexican Bonos, Serie M, 8,500 %, con vencimiento el 31/05/2029	790	0,28
630	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 15/02/2028	585	0,20		480	Bono Internacional del Estado de México, 4,750 %, con vencimiento el 08/03/2044	404	0,14
340	Warnermidia Holdings Inc, 3,755 %, con vencimiento el 15/03/2027	319	0,11				1.619	0,57
450	Western Midstream Operating LP, 3,100 %, con vencimiento el 01/02/2025	431	0,15	Panamá — 0,15% (28 de febrero de 2023: 0,25%)				
990	Western Midstream Operating LP, 5,450 %, con vencimiento el 01/04/2044	833	0,29		580	Bono Internacional del Estado de Panamá, 4,500 %, con vencimiento el 01/04/2056	422	0,15
1.000	Western Midstream Operating LP, 5,300 %, con vencimiento el 01/03/2048	821	0,29	Perú — 0,20 % (28 de febrero de 2023: 0,21%)				
170	Williams Cos Inc/The, 8,750 %, con vencimiento el 15/03/2032	199	0,07		690	Bono Internacional del Estado de Perú, 2,783 %, con vencimiento el 23/01/2031	587	0,20
490	Winnegago Industries Inc, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/07/2028	477	0,17	Qatar — 0,08 % (28 de febrero de 2023: 0,20%)				
400	WW International Inc, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 15/04/2029	277	0,10		230	Bono Internacional del Estado de Qatar, 144A, 4,817 %, con vencimiento el 14/03/2049	215	0,08
217	XPO CNW Inc, 6,700 %, con vencimiento el 01/05/2034	216	0,08	Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 11.2375)			10.315	3,60
600	XPO Escrow Sub LLC, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 15/11/2027	611	0,21	Obligaciones de préstamo — 7,03% (28 de febrero de 2023: 5,09%)				
290	XPO Inc, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 01/06/2028	285	0,10		430	8Th Avenue Food & Provisions Inc, 13,196 %, con vencimiento el 01/10/2026 **	293	0,10
710	Ziff Davis Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 15/10/2030	611	0,21		458	Acisure LLC, 11.121 %, con vencimiento el 15/02/2027 *	460	0,16
		124.303	43,34		440	Agilitt Health Inc, 8,247 %, con vencimiento el 01/05/2030 *	439	0,15
					113	Allen Media LLC, 10,892 %, con vencimiento el 10/02/2027 *	98	0,03
					320	Allied Universal Holdco LLC, 9,881 %, con vencimiento el 04/05/2028 *	318	0,11
					3	Allied Universal Holdco LLC, 9,181 %, con vencimiento el 14/05/2028 *	3	-
					52	API Group Inc, 7,946 %, con vencimiento el 01/10/2026 *	5	0,02
					67	Apollo Group CMR, 8,196 %, con vencimiento el 15/05/2026 *	63	0,02
Zambia — 1,12% (28 de febrero de 2023: 0,83%)					248	Ascensus Holdings Inc, 8,946 %, con vencimiento el 02/08/2028 *	245	0,09
	207 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 01/04/2025	207	0,07		194	Asurion LLC, 9,431 %, con vencimiento el 17/08/2028 *	187	0,07
	610 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 01/03/2026	601	0,21		192	Asurion LLC, 8,788 %, con vencimiento el 18/12/2026 *	187	0,07
	1.600 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/10/2027	1.560	0,54		570	Asurion LLC, 9,681 %, con vencimiento el 19/08/2028 *	552	0,19
					248	Brown Group Holding LLC, 7,820 %, con vencimiento el 07/06/2028 *	245	0,09
					90	Brown Group Holding LLC, 9,172 %, con vencimiento el 02/07/2029 *	90	0,03
Bonos y pagarés corporativos (continuación)					219	Caesars Entertainment, 8,681 %, con vencimiento el 25/01/2030 *	220	0,08
Zambia — (continuación)					878	Cinemark USA Inc, 9,069 %, con vencimiento el 24/05/2030 *	878	0,31
	840 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, con vencimiento el 01/06/2031	856	0,30		630	Clarios Global LP, 9,081 %, con vencimiento el 20/04/2030 *	630	0,22
		3.224	1,12		470	Columbus McKinnon Corp, 8,230 %, con vencimiento el 14/05/2028 *	472	0,16
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 186.1505)		173.873	60,62		248	DCert Buyer, Inc, 9,331 %, con vencimiento el 16/10/2026 *	248	0,09
Bonos y obligaciones del Estado — 3,60% (28 de febrero de 2023: 5,45%)					340	Emerald Debt Merger Sub LLC, 8,331 %, con vencimiento el 05/05/2030 *	341	0,12
Angola — 0,06 % (28 de febrero de 2023: 0,07%)					640	Equinox Holdings Inc, 14,731 %, con vencimiento el 08/03/2024 **	621	0,22
	210 Angolan Government International Bond, 144A, 8,750 %, con vencimiento el 14/04/2032	173	0,06		104	Eyecare Partners LLC, 9,253 %, con vencimiento el 05/02/2027 *	83	0,03
					532	First Brands Group LLC, 10,881 %, con vencimiento el 24/03/2027 *	526	0,18
Argentina — 0,59 % (28 de febrero de 2023: 0,68%)					399	First Brands Group LLC, 10,881 %, con vencimiento el 30/03/2027*	394	0,14
	8 Bono Internacional de la República Argentina, 1,000 %, vencimiento 09/07/2029	2	-		4	Focus Financial Partners LLC, 8,581 %, con vencimiento el 30/06/2028 *	3	-
	47 Bono Internacional de la República Argentina, 0,750%, vencimiento 09/07/2030	16	-		790	Froneri Lux FinCo SARL, 6,097 %, con vencimiento el 30/01/2027 *	848	0,29
	300 Bonos del Gobierno/Ciudad autónoma de Buenos Aires, 7,500 %, con vencimiento el 01/06/2027	285	0,10		248	Gainwell Acquisition Corp, 9,342 %, con vencimiento el 01/10/2027 *	245	0,09
	2.248 Bonos del Gobierno de la Provincia de Buenos Aires, 144A, 6,375%, vencimiento 01/09/2037	857	0,30		208	Garda World Security Corp, 9,668 %, con vencimiento edue 30/10/2026 *	208	0,07
	665 Provincia de Cordoba, 144A, 6,990 %, con vencimiento el 01/06/2027	539	0,19		419	Geo Group Inc/The, 12,456 %, con vencimiento el 23/03/2027 *	426	0,15
		1.699	0,59		77	Global Medical Response, Inc, 9,780 %, con vencimiento el 24/09/2025 *	54	0,02
					202	Great Outdoors Group LLC, 9,196 %, con vencimiento el 05/03/2028	201	0,07
Bahamas — 0,19 % (28 de febrero de 2023: 0,19%)					624	Greystone Select Financial, 10,582 %, con vencimiento el 06/05/2028	602	0,21
	550 Bahamas Government International Bond, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 16/01/2024	544	0,19		888	Harbor Freight Tools USA Inc, 8,196 %, con vencimiento el 19/10/2027 *	885	0,31
					195	Hayward Industries Inc., 8,196 %, con vencimiento el 14/05/2028 *	193	0,07
Costa de Marfil — 0,19 % (28 de febrero de 2023: 0,26%)					228	Hayward Industries Inc., 8,681 %, con vencimiento el 28/05/2028 *	226	0,08
	EUR 180 Ivory Coast Government International Bond, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 30/01/2032	151	0,05		110	Hyperion Refinance S.a.r.l, 9,320 %, con vencimiento el 24/03/2030 *	110	0,04
	460 Ivory Coast Government International Bond, 6,125 %, con vencimiento el 15/06/2033	395	0,14		255	Jazz Financing Lux S.a.r.l., 8,946 %, con vencimiento el 22/04/2028 *	255	0,09
		546	0,19		359	Mavis Tire Express Services TopCo Corp., 9,446 %, con vencimiento 04/05/2028 *	359	0,12
					436	MRI Software LLC, 10,842 %, con vencimiento el 10/02/2026 *	427	0,15
República Dominicana — 0,22 % (28 de febrero de 2023: 0,23%)					113	MRI Software LLC, 10,842 %, con vencimiento el 10/02/2026 *	110	0,04
	740 Bono Internacional de República Dominicana, 4,875 %, con vencimiento el 23/09/2032	630	0,22		473	One Call Corp, 11,113 %, con vencimiento el 07/04/2027 *	375	0,13
					793	PECF USS Intermediate Holding Corp, 9,881 %, con vencimiento el 04/11/2028 *	636	0,22
Indonesia — 1,15 % (28 de febrero de 2023: 1,35%)								
	550 Bono internacional del Estado de Indonesia, 3,500 %, con vencimiento el 11/01/2028	515	0,18					
IDR	25.412.000 Indonesia Treasury Bond, Serie FR59, 7,000 %, con vencimiento el 15/05/2027	1.710	0,59					

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Contratos (miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
411 Peraton Corporation, 9,181 %, con vencimiento el 22/02/2028 *	407	0,14			
509 Planview Parent Inc, 9,503 %, con vencimiento el 18/12/2027 *	502	0,17			
734 Polyconcept North America Holdings Inc, 10,831 %, con vencimiento el 12/05/2029 *	701	0,24			
496 Prime Security Installations Ltd, 8,182 %, con vencimiento el 23/09/2026 *	497	0,17			
130 Project Sky Merger Sub, Inc., 11,431 %, con vencimiento el 10/08/2029 *	121	0,04			
248 Quikrete Holdings, Inc., 8,320 %, con vencimiento el 18/03/2029 *	249	0,09			
626 R.R. Donnelley, 14,500 %, con vencimiento el 08/03/2028 *	628	0,22			
196 Redstone Holdco 2 LP, 10,179 %, con vencimiento el 27/04/2028 *	153	0,05			
384 RegionalCare Hospital Partners Holding, 9,377 %, con vencimiento el 16/11/2025 *	382	0,13			
440 Scotera Health Holdings LLC, 9,068 %, con vencimiento el 13/12/2026 *	442	0,15			
369 Sedgwick CMS Inc, 9,081 %, con vencimiento el 17/02/2028 *	370	0,13			
547 Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 9,681 %, con vencimiento el 01/04/2029 *	550	0,19			
419 Topgolf Callaway Brands, 8,931 %, con vencimiento el 09/03/2030 *	419	0,15			
302 U.S. Renal Care Inc, 10,346 %, con vencimiento el 28/06/2028 *	194	0,07			
244 UFC Holdings LLC, 8,369 %, con vencimiento el 29/04/2026 *	244	0,08			
248 Vertex Aerospace Services Corp, 8,931 %, con vencimiento el 06/12/2028	248	0,09			
260 Virgin Media Bristol LLC, 7,925 %, con vencimiento el 04/01/2028 *	253	0,09			
Total de obligaciones de préstamo (coste 20.595\$)	20.168	7,03			
Acciones ordinarias — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
Suiza — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
1.310 Credit Suisse Group AG Escrow †	—	—			
Total de acciones ordinarias (coste USD—)	—	—			
Acciones preferentes — 0,39% (28 de febrero de 2023: 0,88%)					
Estados Unidos — 0,39 % (28 de febrero de 2023: 0,88%)					
34 MPLX LP, Serie A ∞	1.116	0,39			
Total de acciones preferentes (coste de 1,095\$)	1.116	0,39			
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste — 295.755\$)	275.837	96,17			
Contratos (miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos			
Opciones compradas — 0,10% (28 de febrero de 2023: 0,20%)					
– CME 3 Month SOFR Futures diciembre 2023 Call 99.25, con vencimiento el 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	—	—			
– iShares iBoxx USD High Yield Corporate Bond ETF septiembre 2023 Put 73,00, con vencimiento el 18/09/2023 - Goldman Sachs	2	—			
– S&P 500 E-mini diciembre 2023 Put 4,100,00, con vencimiento el 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	21	0,01			
– S&P 500 E-mini diciembre 2023 Put 4,200,00, con vencimiento el 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	48	0,02			
Contratos comprados - (continuación)					
– S&P 500 E-mini diciembre 2023 Put 4,300,00, con vencimiento el 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	44	0,02			
– S&P 500 E-mini diciembre 2023 Put 4,400,00, con vencimiento el 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	52	0,02			
– S&P 500 E-mini septiembre 2023 Put 3,900,00, con vencimiento el 15/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	1	—			
– S&P 500 E-mini septiembre 2023 Put 4,100,00, con vencimiento el 15/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	2	—			
– S&P 500 E-mini W3 octubre 2023 Put 4,300,00, con vencimiento el 20/10/2023 – Bank of America Merrill Lynch	28	0,01			
– U.S. 10 Year enero 2024 Call 118.50, con vencimiento el 22/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	—	—			
– U.S. 10 Year octubre 2023 Call 112,00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	14	0,01			
– U.S. 5 Year octubre 2023 Call 108,00, con vencimiento el 22/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	7	—			
4.100 USD Call/GBP Put 1,2640, con vencimiento el 13/10/2023 - JP Morgan	39	0,01			
3.220 USD Put/CAD Call 1,3295, con vencimiento el 09/11/2023 - BNP Paribas	12	—			
2.240 USD Put/CAD Call 1,3405, con vencimiento el 18/10/2023 - BNP Paribas	10	—			
6.460 USD Put/EUR Call 1,16, con vencimiento el 02/09/2023 - Goldman Sachs	—	—			
Total de opciones compradas (coste 589\$)	280	0,10			
Swaps de incumplimiento de crédito — (0,05%) (28 febrero de 2023: 0,06%)					
Apresiasi latente sobre contratos (véase más abajo)	150	0,05			
Swaps sobre índices — 0,20% (28 de febrero de 2023: 0,32%)					
Apresiasi latente sobre contratos (véase más abajo)	575	0,20			
Swaptions — 0,02 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
Apresiasi latente sobre contratos (véase más abajo)	47	0,02			
Contratos de divisas a plazo — 0,18 % (28 de febrero de 2023: 0,20%)					
Apresiasi latente sobre contratos (véase más abajo)	536	0,18			
Futuros — 0,51% (28 de febrero de 2023: 0,02%)					
Apresiasi latente sobre contratos (véase más abajo)	1.448	0,51			
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	278.873	97,23			
Contratos (miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos			
Opciones suscritas — (0,02%) (28 de febrero de 2023: 0,01%)					
– S&P 500 E-mini diciembre 2023 Put 3,700,00, con vencimiento el 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(8)	—			
– S&P 500 E-mini diciembre 2023 Put 4,000,00, con vencimiento el 15/12/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(38)	(0,02)			
– S&P 500 E-mini septiembre 2023 Put 3,500,00, con vencimiento el 15/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	—	—			
– S&P 500 E-mini septiembre 2023 Put 3,700,00, con vencimiento el 15/09/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(1)	—			
– S&P 500 E-mini W3 octubre 2023 Put 4,000,00, con vencimiento el 20/10/2023 – Bank of America Merrill Lynch	(9)	—			
Total de opciones suscritas (coste: [170] USD)	(56)	(0,02)			
Swaps de tasas de interés — (0,12%) (28 de febrero de 2023: 0,28%)					
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(353)	(0,12)			
Swaptions — (0,03 %) (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(73)	(0,03)			
Contratos de divisas a plazo — (0,82%) (28 de febrero de 2023: 1,08%)					
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(2.359)	(0,82)			
Futuros — (0,18%) (28 de febrero de 2023: 0,32%)					
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(504)	(0,18)			
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	(3.345)	(1,17)			
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	275.528	96,06			
Excedente de otros activos respecto a los pasivos	11.281	3,94			
Patrimonio	286.809\$	100,00			

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

- Los importes designados como “-” son 0 \$, menos de 1000 \$, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.
- 144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. El 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 164 009 000 USD o el 57,15 % del patrimonio neto.
- * Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.
- † Poca liquidez.
- ∞ El título es valorado de buena fe y a un valor razonable por el Comité de Valoración o según el criterio de este.
- ⊖ El valor está en mora a 31 de agosto de 2023 (capital o interés).
- ± Títulos adquiridos siguiendo la norma “se anunciará”.

ABREVIATURAS:

- ETF – Fondo cotizado.
- Perpetuo – Un bono sin fecha de vencimiento. Los bonos perpetuos no son rescatables, pero pagan un flujo constante de intereses.
- REMIC – Conducho de inversiones hipotecarias inmobiliarias.
- TBA – Pendiente de anuncio.
- CAD – dólar canadiense
- EUR – euro
- GBP – libra esterlina
- IDR – rupia indonesia
- MXN – peso mexicano

	% del total de activos
Análisis del total de activos	
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	87,00
Otros valores mobiliarios negociables en otro mercado regulado	6,86
Instrumentos financieros derivados	1,03
Otros activos	5,11
Total de activos	100,00

Listado de swaps de incumplimiento de crédito

Contraparte	Entidad de Referencia – Protección Compra/Venta	Fecha de vencimiento	Importe teórico (miles)	Valor (miles)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000 % - Vender	20 de junio de 2028	1.625	USD 45
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % - Vender	20 de junio de 2028	6.779	USD 105
Apreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 febrero de 2023 [miles]: 155\$)				
Depreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 [miles]: USD-)				
Apreciación neta de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 [miles]: 155\$)				

Listado de swaps de tipos de interés

Contraparte	Tipo	Fecha de vencimiento	Importe teórico (miles)	Valor (miles)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIE Banxico, Receive Fixed 7,450%	18 jul. 2029	80.214	USD (290)
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 10,230 %	02 ene. 2029	23.600	USD (63)
Apreciación latente de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 [miles]: USD-)				
Depreciación latente de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(756))				
Depreciación neta de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(756))				

Listado de swaps de inflación

Contraparte	Entidad de referencia	Fecha de vencimiento	Importe teórico (miles)	Valor (miles)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,600%, Receive Floating USD Sofr Compound	15 feb. 2048	663	USD 112
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,050%, Receive Floating USD Sofr Compound	15 feb. 2048	2.529	USD 244
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,150%, Receive Floating USD Sofr Compound	15 mayo 2048	2.739	USD 219
Apreciación latente de swaps de inflación (28 de febrero de 2023 [miles]: 878\$)				
Depreciación latente de swaps de inflación (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(5))				
Depreciación neta de swaps de inflación (28 de febrero de 2023 [miles]: 873\$)				

Calendario de swapstions

Contraparte	Descripción	Fecha efectiva	Importe teórico (miles)	Valor (miles)
JP Morgan	Swaption Receptor Strike 0,70 %	21 sep.2023	27.567	USD (73)
JP Morgan	Huelga del receptor de swaps 1,02 %.	21 sep.2023	5.513	USD 47
Apreciación latente de swaptions (28 febrero de 2023 [miles]: USD-)				
Depreciación latente de swaptions (28 de febrero de 2023 [miles]: USD-)				
Depreciación neta de swaptions (28 de febrero de 2023 [miles]: USD-)				

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)	Moneda de venta (en miles)	Apreciación / (Depreciación) latente de contratos (en miles)
05 sep.2023	BNY Mellon	Compra USD	5 Venta GBP	USD 4
05 sep.2023	BNY Mellon	Compra GBP	1 Venta USD	USD 2
05 sep.2023	BNY Mellon	Compra CAD	2.541 Venta USD	USD 1.878
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra USD	1.878 Venta CAD	USD 2.541
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra USD	45 Venta CHF	USD 40
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra USD	438 Venta EUR	USD 402
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra USD	10 Venta GBP	USD 8

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Listado de contratos de divisas a plazo (continuación)

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)		Moneda de venta (en miles)		Apreciación / (Depreciación) latente de contratos (en miles)		
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	905	Venta	GBP	712	4
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	GBP	852	Venta	USD	1.073	6
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	GBP	144.755	Venta	USD	184.348	(960)
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	EUR	55.940	Venta	USD	61.545	(844)
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	CHF	3.846	Venta	USD	4.403	(42)
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	CAD	24.361	Venta	USD	18.145	(111)
16 oct. 2023	JP Morgan	Compra	GBP	682	Venta	USD	886	(22)
18 oct. 2023	BNP Paribas	Compra	USD	784	Venta	CAD	1.061	(2)
20 oct. 2023	BNP Paribas	Compra	USD	659	Venta	AUD	960	36
20 oct. 2023	BNP Paribas	Compra	USD	3.042	Venta	CAD	4.123	(11)
20 oct. 2023	BNP Paribas	Compra	USD	1.138	Venta	CAD	1.508	21
20 oct. 2023	BNP Paribas	Compra	USD	741	Venta	EUR	680	2
20 oct. 2023	BNP Paribas	Compra	USD	2.498	Venta	NOK	25.330	112
20 oct. 2023	BNP Paribas	Compra	AUD	8.320	Venta	USD	5.553	(151)
20 oct. 2023	BNP Paribas	Compra	CAD	4.350	Venta	USD	3.208	14
20 oct. 2023	BNP Paribas	Compra	EUR	2.400	Venta	USD	2.628	(19)
20 oct. 2023	BNP Paribas	Compra	NOK	36.768	Venta	USD	3.460	3
20 oct. 2023	BNP Paribas	Compra	AUD	1.730	Venta	USD	1.122	1
20 oct. 2023	BNP Paribas	Compra	CAD	1.770	Venta	USD	1.319	(7)
20 oct. 2023	Citi	Compra	USD	8	Venta	AUD	12	-
20 oct. 2023	Citi	Compra	USD	387	Venta	GBP	295	13
20 oct. 2023	Goldman Sachs	Compra	USD	1.569	Venta	MXN	27.260	(16)
20 oct. 2023	JP Morgan	Compra	USD	960	Venta	AUD	1.420	38
20 oct. 2023	JP Morgan	Compra	USD	778	Venta	IDR	11.746.964	7
20 oct. 2023	JP Morgan	Compra	USD	564	Venta	NOK	5.720	25
20 oct. 2023	JP Morgan	Compra	USD	-	Venta	NZD	-	-
20 oct. 2023	JP Morgan	Compra	AUD	1.030	Venta	USD	680	(11)
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	5	Venta	BRL	23	-
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	711	Venta	CNH	5.070	13
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	7.955	Venta	EUR	7.228	99
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	8.264	Venta	GBP	6.436	110
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	388	Venta	MXN	6.740	(4)
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	GBP	128	Venta	USD	166	(4)
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	EUR	1.580	Venta	USD	1.712	5
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	GBP	1.830	Venta	USD	2.307	10
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	CNH	5.073	Venta	USD	705	(6)
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	CAD	3.348	Venta	USD	2.499	(19)
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	NOK	6.170	Venta	USD	608	(27)
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	MXN	6.740	Venta	USD	383	9
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	JPY	404.154	Venta	USD	2.900	(100)
09 nov. 2023	BNP Paribas	Compra	USD	1.127	Venta	CAD	1.516	4
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): 5365							USD	536
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(2.965)								(2.359)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(2.429))							USD	(1.823)

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico (miles)	Apreciación / (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(91)	USD (21.522)	USD 128
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	49	11.739	(101)
Índice SOFR de 3 meses Junio 2023	Bank of America Merrill Lynch	49	11.608	(33)
Bono a 10 años de Australia septiembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	20	1.505	(18)
Euro-Buxl 30 Year Bond Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(1)	(145)	(2)
ICE 3 Month SONIA Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	37	11.049	51
ICE 3 Month SONIA Diciembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	1	300	-
ICE 3 Month SONIA Junio 2023	Bank of America Merrill Lynch	22	6.613	(57)
ICE 3 Month SONIA Junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	38	11.360	2
ICE de 3 meses SONIA, septiembre 203	Bank of America Merrill Lynch	117	35.005	(293)
Long Gilt Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	24	2.906	52
U.S. 10 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	468	51.963	539
U.S. 10 Year Ultra Note Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	10	1.161	14
U.S. 2 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	180	36.685	89
U.S. 5 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	121	12.938	80
U.S. Long Bond (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	18	2.190	40
U.S. Ultra Bond (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	166	21.492	453
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): 535				USD 1.448
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(890)				(504)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(837)				USD 944

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos		
Valores garantizados por hipotecas (continuación)							
4.373	CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Clase B1, 144A, 2,963 %, con vencimiento el 25/07/2057 *	2.861	0,55	6.304	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2017 HRP1, Clase B2D, 8,402 %, con vencimiento el 25/12/2042 *	4.615	0,89
5.017	CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Clase B2, 144A, 2,963 %, con vencimiento el 25/07/2057 *	3.188	0,62	3.995	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2018 SPI1, Clase B, 144A, 3,784 %, con vencimiento el 25/02/2048 *	2.410	0,47
4.266	CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Clase B3, 144A, 2,963 %, con vencimiento el 25/07/2057 *	2.360	0,46	5.873	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2018 SPI2, Clase B, 144A, 3,836 %, con vencimiento el 25/05/2048 *	3.715	0,72
4.329	CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Clase B4, 144A, 2,963 %, con vencimiento el 25/07/2057 *	806	0,16	6.859	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2018 SPI3, Clase B, 144A, 4,159 %, con vencimiento el 25/08/2048 *	4.720	0,91
2.143	CSMC 2017-RPL3 Trust, Serie 2017 RPL3, Clase B3, 144A, 4,464 %, con vencimiento el 01/08/2057 *	1.964	0,38	25.814	FRESB 2018-SB48 Mortgage Trust, Serie 2018 SB48, Clase B, 144A, 4,285 %, con vencimiento el 25/02/2038 *	20.068	3,89
5.782	CSMC 2017-RPL3 Trust, Serie 2017 RPL3, Clase B4, 144A, 4,464 %, con vencimiento el 01/08/2057 *	5.246	1,02	713	Government National Mortgage Association, Serie 2010 102, Clase IO, 0,010 %, con vencimiento el 16/06/2052 *	–	–
7.888	CSMC Mortgage-Backed Trust 2006-7, Serie 2006 7, Clase 11A2, 1,071 %, con vencimiento el 25/08/2036 * †	1.046	0,20	3.851	Government National Mortgage Association, Serie 2010 13, Clase IO, 0,000 %, con vencimiento el 16/11/2051 *	–	–
98	CSMC Resecuritization Trust 2006-1R, Serie 2006 1R, Clase 1A2, 144A, 4,580 %, con vencimiento el 27/07/2036 *	125	0,02	497	Government National Mortgage Association, Serie 2011 127, Clase IO, 0,143 %, con vencimiento el 16/03/2047 *	–	–
4.374	CSMC Series 2015-2R, Serie 2015 2R, Clase 7A2, 144A, 4,259 %, con vencimiento el 27/08/2036 *	3.386	0,66	12.609	Government National Mortgage Association, Serie 2011 95, Clase IO, 0,007 %, con vencimiento el 16/04/2051 *	1	–
4.307	CSMC Trust 2013-IVR5, Serie 2013 IVR5, Clase B5, 144A, 3,622 %, con vencimiento el 25/10/2043 *	2.840	0,55	8.089	Government National Mortgage Association, Serie 2012 114, Clase IO, 0,620 %, con vencimiento el 16/01/2053 *	126	0,02
2.000	CSMC Trust 2017-CHOP, Serie 2017 CHOP, Clase H, 144A, 12,794 %, con vencimiento el 15/07/2032 *	1.838	0,36	3.206	Government National Mortgage Association, Serie 2013 163, Clase IO, 1,012 %, con vencimiento el 16/02/2046 *	47	0,01
307.495	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Clase AX1, 144A, 0,086 %, con vencimiento el 25/02/2048 *	747	0,14	5.581	Government National Mortgage Association, Serie 2014 16, Clase IO, 0,450 %, con vencimiento el 16/06/2055 *	77	0,01
4.225	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Clase B5, 144A, 3,586 %, con vencimiento el 25/02/2048 *	2.883	0,56	7.212	Government National Mortgage Association, Serie 2014 171, Clase IO, 0,414 %, con vencimiento el 16/11/2055 *	64	0,01
8.649	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Clase B6, 144A, 3,586 %, con vencimiento el 25/02/2048 *	4.331	0,84	732	Government National Mortgage Association, Serie 2014 47, Clase IA, 0,148 %, con vencimiento el 16/02/2048 *	3	–
–	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Clase SA, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 25/02/2048 *	–	–	3.538	Government National Mortgage Association, Serie 2014 50, Clase IO, 0,628 %, con vencimiento el 16/09/2055 *	89	0,02
4.000	CSWF 2018-TOP, Serie 2018 TOP, Clase H, 144A, 8,970 %, con vencimiento el 15/08/2035 *	3.634	0,70	688	Government National Mortgage Association, Serie 2016 135, Clase SB, 0,673 %, con vencimiento el 16/10/2046 *	90	0,02
581	DSLA Mortgage Loan Trust 2004-AR4, Serie 2004 AR4, Clase 2A2B, 6,268 %, con vencimiento el 19/01/2045 *	389	0,08	653	Government National Mortgage Association, Serie 2016 51, Clase NS, 0,622 %, con vencimiento el 20/04/2046 *	65	0,01
1.324	DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR3, Serie 2005 AR3, Clase 2A1B, 5,908 %, con vencimiento el 19/07/2045 *	1.235	0,24	3.316	Government National Mortgage Association, Serie 2018 125, Clase HS, 0,822 %, con vencimiento el 20/09/2048 *	276	0,05
2.350	DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR5, Serie 2005 AR5, Clase 2A1B, 6,108 %, con vencimiento el 19/09/2045 *	1.731	0,34	4.456	Government National Mortgage Association, Serie 2022 202, Clase Z, 3,000 %, con vencimiento el 16/10/2063 *	2.569	0,50
468	DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Serie 2007 AR1, Clase 2A1B, 5,608 %, con vencimiento el 19/04/2047 *	497	0,10	2.620	Government National Mortgage Association, Serie 2023 16, Clase Z, 3,500 %, con vencimiento el 16/07/2063 *	1.644	0,32
5.323	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C01, Clase 1B, 17,152 %, con vencimiento el 25/08/2028 *	6.020	1,17	25.698	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Clase D, 144A, 11,925 %, con vencimiento el 15/09/2031 *	4.870	0,94
3.661	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C02, Clase 1B, 17,652 %, con vencimiento el 25/09/2028 *	4.249	0,82	1.250	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC26, Serie 2014 GC26, Clase D, 144A, 4,662 %, con vencimiento el 10/11/2047 *	821	0,16
2.937	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C03, Clase 1B, 17,152 %, con vencimiento el 25/10/2028 *	3.361	0,65	3.200	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC28, Serie 2015 GC28, Clase D, 144A, 4,452 %, con vencimiento el 10/02/2048 *	2.725	0,53
4.874	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C04, Clase 1B, 15,652 %, con vencimiento el 25/01/2029 *	5.374	1,04	1.500	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC32, Serie 2015 GC32, Clase D, 3,345 %, con vencimiento el 10/07/2048 *	1.261	0,24
7.163	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C06, Clase 1B, 14,652 %, con vencimiento el 25/04/2029 *	7.720	1,50	4.871	GSR Mortgage Loan Trust 2006-1F, Serie 2006 1F, Clase 6A1, 5,829 %, con vencimiento el 25/02/2036 *	501	0,10
3.875	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C06, Clase 1B1, 9,152 %, con vencimiento el 25/03/2031 *	4.139	0,80	78	HarborView Mortgage Loan Trust 2004-11, Serie 2004 11, Clase 3A3, 6,188 %, con vencimiento el 19/01/2035 *	71	0,01
1.613	Fannie Mae REMICS, Series 2017 85, Clase SC, 0,798 %, con vencimiento el 25/11/2047 *	131	0,03	47	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Clase 2A1A, 5,968 %, con vencimiento el 19/03/2035 *	46	0,01
3.590	Freddie Mac Multifamily Structured Credit Risk, Serie 2021 MN2, Clase M2, 144A, 8,638 %, con vencimiento el 25/07/2041 *	3.273	0,63	123	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-10, Serie 2005 10, Clase 2A1A, 6,048 %, con vencimiento el 19/11/2035 *	87	0,02
6.605	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K038, Clase X3, 2,568 %, con vencimiento el 25/06/2042 *	93	0,02	415	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-2, Serie 2005 2, Clase 2A1A, 5,868 %, con vencimiento el 19/05/2035 *	378	0,07
19.370	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K052, Clase X3, 1,671 %, con vencimiento el 25/01/2044 *	590	0,11	180	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-3, Serie 2005 3, Clase 2A1A, 5,908 %, con vencimiento el 19/06/2035 *	171	0,03
6.000	Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-DNA1, Serie 2020 DNA1, Clase B2, 144A, 10,652 %, con vencimiento el 25/01/2050 *	6.023	1,17	1.880	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-8, Serie 2005 8, Clase 2A2, 5,930 %, con vencimiento el 19/09/2035 **	1.666	0,32
8.000	Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, Serie 2020 DNA2, Clase B2, 144A, 10,202 %, con vencimiento el 25/02/2050 *	7.856	1,52	448	HarborView Mortgage Loan Trust 2006-10, Serie 2006 10, Clase 2A1A, 5,608 %, con vencimiento el 19/11/2036 **	395	0,08
530	Freddie Mac STACR Remic Trust 2021-DNA5, Serie 2021 DNA5, Clase B2, 144A, 10,788 %, con vencimiento el 25/01/2034 *	499	0,10	744	Impac CMB Trust Series 2005-1, Serie 2005 1, Clase M1, 6,119 %, con vencimiento el 25/04/2035 *	685	0,13
5.020	Freddie Mac STACR Remic Trust 2021-DNA6, Serie 2021 DNA6, Clase B2, 144A, 12,788 %, con vencimiento el 25/10/2041 *	5.150	1,00	1.587	Impac CMB Trust Series 2005-3, Serie 2005 3, Clase A2, 6,029 %, con vencimiento el 25/08/2035 *	1.464	0,28
4.620	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA1, Serie 2019 DNA1, Clase B2, 144A, 16,152 %, con vencimiento el 25/01/2049 *	5.604	1,09	649	Impac CMB Trust Series 2005-4, Serie 2005 4, Clase 1M1, 6,074 %, con vencimiento el 25/05/2035 *	587	0,11
4.600	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Serie 2019 DNA3, Clase B1, 144A, 8,652 %, con vencimiento el 25/07/2049 *	4.789	0,93	996	Impac CMB Trust Series 2005-7, Serie 2005 7, Clase A1, 5,949 %, con vencimiento el 25/11/2035 *	870	0,17
3.100	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Serie 2019 DNA3, Clase B2, 144A, 13,552 %, con vencimiento el 25/07/2049 *	3.394	0,66	1.268	Impac Secured Assets Trust 2006-2, Serie 2006 2, Clase 2B, 7,079 %, con vencimiento el 25/08/2036 *	1.256	0,24
5.550	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA4, Serie 2019 DNA4, Clase B2, 144A, 11,652 %, con vencimiento el 25/10/2049 *	5.805	1,12	33	Impac Secured Assets Trust 2006-2, Serie 2006 2, Clase 2M3, 7,079 %, con vencimiento el 25/08/2036 *	33	0,01
4.000	Freddie Mac Stacr Trust 2019-FTR4, Serie 2019 FTR4, Clase B2, 144A, 10,402 %, con vencimiento el 25/11/2047 *	3.863	0,75	623	ndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR13, Serie 2005 AR13, Clase 1A1, 3,921 %, con vencimiento el 25/08/2035 *	315	0,06
4.925	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2016 DNA1, Clase B, 15,402 %, con vencimiento el 25/07/2028 *	5.485	1,06	628	ndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR2, Serie 2005 AR2, Clase 2A1B, 6,209 %, con vencimiento el 25/02/2035 *	449	0,09
2.507	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2016 DNA2, Clase B, 15,902 %, con vencimiento el 25/12/2028 *	2.821	0,55	1.853	ndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR6, Serie 2005 AR6, Clase 2A2, 6,089 %, con vencimiento el 25/04/2035 *	1.447	0,28
2.541	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2016 DNA3, Clase B, 16,652 %, con vencimiento el 25/10/2028 *	2.912	0,56	2.395	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, Serie 2017 FL11, Clase E, 144A, 9,464 %, con vencimiento el 15/10/2032 *	2.392	0,46
5.482	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2016 DNA4, Clase B, 14,002 %, con vencimiento el 25/03/2029 *	5.916	1,15	2.250	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, Serie 2017 FL11, Clase F, 144A, 10,764 %, con vencimiento el 15/10/2032 *	2.238	0,43
3.943	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2017 DNA2, Clase B2, 16,652 %, con vencimiento el 25/10/2029 *	4.578	0,89				

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)					
28.545			12.909		
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Serie 2018 PHMZ, Clase M, 144A, 13,933 %, con vencimiento el 15/06/2035 *†e					
4.022			20.889		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-FL7, Serie 2015 FL7, Clase D, 144A, 9,193 %, con vencimiento el 15/05/2028 *					
3.600	3.583	0,69	410.106		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1, Serie 2015 JP1, Clase C, 4,881 %, con vencimiento el 15/01/2049 *					
1.800	3.029	0,59	2.539		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Serie 2018 WPT, Clase GFL, 144A, 9,205 %, con vencimiento el 05/07/2033 *					
6.574	1.342	0,26	11.444		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Serie 2020 MKST, Clase G, 144A, 9,924 %, con vencimiento el 15/12/2036 *					
6.867	1.139	0,22	16.035		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Serie 2020 MKST, Clase H, 144A, 12,424 %, con vencimiento el 15/12/2036 *					
4.000	727	0,14	2.630		
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2021-NYMZ, Serie 2021 NYMZ, Clase M, 144A, 12,675 %, con vencimiento el 15/06/2026 *					
9.436	3.880	0,75	3.000		
JP Morgan Mortgage Trust 2018-4, Serie 2018 4, Clase AX1, 144A, 0,214 %, con vencimiento el 25/10/2048 *††					
10.471	43	0,01	650		
JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Serie 2018 5, Clase AX1, 144A, 0,228 %, con vencimiento el 25/10/2048 *††					
1.952	64	0,01	12.909		
JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Serie 2018 5, Clase B5, 144A, 3,728 %, con vencimiento el 25/10/2048 *					
2.632	1.147	0,22	49		
JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Serie 2018 5, Clase B6, 144A, 3,728 %, con vencimiento el 25/10/2048 *					
5.420	1.303	0,25	3.900		
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C25, Serie 2014 C25, Clase D, 144A, 4,082 %, con vencimiento el 15/11/2047 *					
11	2.290	0,44	7.118		
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-15, Serie 2004 15, Clase 6A1, 5,759 %, con vencimiento el 25/12/2034 *					
1.657	10	-	4.000		
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-6, Serie 2004 6, Clase B1, 5,252 %, con vencimiento el 25/07/2034 *					
1.206	1.516	0,29	3.432		
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-8, Serie 2004 8, Clase B1, 5,292 %, con vencimiento el 25/09/2034 *					
698	1.067	0,21	2.770		
MASTR Reperforming Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Clase 1A1, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 25/08/2034 *					
825	447	0,09	3.326		
MASTR Reperforming Loan Trust 2005-2, Serie 2005 2, Clase 1A1F, 144A, 5,779 %, con vencimiento el 25/05/2035 *					
377	437	0,08	983		
ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Clase AJ, 5,450 %, con vencimiento el 12/08/2048 *					
186	95	0,02	1.343		
ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Serie 2007 5, Clase AJFL, 144A, 5,450 %, con vencimiento el 12/08/2048 *					
5.000	47	0,01	2.500		
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32, Serie 2016 C32, Clase D, 144A, 3,396 %, con vencimiento el 15/12/2049 *					
1.532	3.294	0,64	1.252		
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2004-11AR, Serie 2004 11AR, Clase 1B1, 6,029 %, con vencimiento el 25/01/2035 *					
3.310	1.233	0,24	Total de valores garantizados por hipotecas (coste 560 346 USD)		
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2006-8AR, Serie 2006 8AR, Clase 1A3, 5,749 %, con vencimiento el 25/06/2036 *					
515	703	0,14	412.814		79,99
Multifamily Trust 2016-1, Serie 2016 1, Clase B, 144A, 2,446 %, con vencimiento el 25/04/2046 *					
5.308	515	0,10	Bonos y obligaciones corporativos — 0,72% (28 de febrero de 2023: 0,48%)		
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Clase D, 144A, 4,544 %, con vencimiento el 15/08/2036 *					
4.870	3.404	0,66	Estados Unidos — 0,72 % (28 de febrero de 2023: 0,48%)		
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Clase E, 144A, 4,544 %, con vencimiento el 15/08/2036 *					
3.000	2.614	0,51	4.000		
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2022-JERI, Serie 2022 JERI, Clase G, 144A, 12,768 %, con vencimiento el 15/01/2039 *					
3.539	2.474	0,48	Two Harbors Investment Corp, 6,250 %, con vencimiento el 15/01/2026		
New Residential Mortgage Loan Trust 2016-4, Serie 2016 4A, Clase B5, 144A, 4,844 %, con vencimiento el 25/11/2056 *					
3.000	3.154	0,61	Total de bonos y pagarés corporativos (coste 3.5875)		
New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM3, Serie 2021 NQM3, Clase B2, 144A, 4,051 %, con vencimiento el 27/11/2056 *					
480	1.935	0,37	Obligaciones de préstamo — 3,49% (28 de febrero de 2023: 3,29%)		
Opteum Mortgage Acceptance Corp Trust 2006-1, Serie 2006 1, Clase M1, 5,984 %, con vencimiento el 25/04/2036 *					
3.481	1.098	0,21	30.000		
PMT Credit Risk Transfer Trust 2021-1R, Serie 2021 1R, Clase A, 144A, 8,343 %, con vencimiento el 27/02/2024 *					
2.910	3.464	0,67	1.613		
PMT Credit Risk Transfer Trust, 144A, 8,883 %, con vencimiento el 29/10/2024 *					
3.191	2.866	0,56	2.935		
PMT Credit Risk Transfer Trust, 144A, 8,533 %, con vencimiento el 27/02/2025 *					
599	3.103	0,60	American Dream, -, con vencimiento el 29/06/2024 *†∞		
RALI Series 2006-QA2 Trust, Serie 2006 QA2, Clase 1A1, 5,679 %, con vencimiento el 25/02/2036 *					
12.658	385	0,07	Freehand Hotel, 9,267 %, con vencimiento el 17/12/2024 *∞		
Redwood Funding Trust 2019-1, Serie 2019 1, Clase PT, 144A, 4,968 %, con vencimiento el 27/09/2024					
1.024	932	0,18	Freehand Hotel, 9,267 %, con vencimiento el 17/12/2024 *∞		
Reperforming Loan REMIC Trust 2006-R2, Serie 2006 R2, Clase AF1, 144A, 5,849 %, con vencimiento el 25/07/2036 *					
3.449	2.637	0,51			
Residential Asset Securitization Trust 2006-A7CB, Serie 2006 A7CB, Clase 1A3, 6,250 %, con vencimiento el 25/07/2036					
12.928	1.624	0,31			
Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, Serie 2017 4, Clase B, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 25/06/2057 †					
19.478	2.868	0,56			
Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, Serie 2017 4, Clase BIO, 144A, 1,677 %, con vencimiento el 25/06/2057 *†					
4.397	399	0,08			
Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2016-1, Serie 2016 1, Clase B, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 25/09/2055 †					
7.814	913	0,18			
Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2016-1, Serie 2016 1, Clase BIO, 144A, 0,809 %, con vencimiento el 25/09/2055 *†					
3.394	3.037	0,59			
Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-1, Serie 2017 1, Clase M2, 144A, 3,750 %, con vencimiento el 25/09/2055 *					
50.342	222	0,04			
Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2016-1, Serie 2016 1, Clase XSIO, 144A, 0,075 %, con vencimiento el 25/09/2055 *†					

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Notas de préstamo - (continuación)			Patrimonio		
5.452 Freehand Hotel, 9,267 %, con vencimiento el 17/12/2024 * [∞]	5.337	1,03		516.066\$	100,00
5.551 Préstamo minorista Sono, 8,696 %, con vencimiento el 06/06/2024 * [∞]	5.514	1,07			
Total de obligaciones de préstamo (coste 45.454\$)	17.995	3,49			
Organismos de inversión colectiva — 3,08% (28 de febrero de 2023: 3,08%)					
15.887 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	15.887	3,08			
Total de organismos de inversión colectiva (coste: 15.887\$)	15.887	3,08			
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 709.844\$)					
	512.999	99,41			
Contratos de divisas a plazo — 0,11 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	577	0,11			
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	513.576	99,52			
Contratos de divisas a plazo — (0,13%) (28 de febrero de 2023: 0,30%)					
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(664)	(0,13)			
Futuros — (0,10%) (28 de febrero de 2023: 0,01%)					
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(538)	(0,10)			
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	(1.202)	(0,23)			
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	512.374	99,29			
Excedente de otros activos respecto a los pasivos	3.692	0,71			

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
144A		
Los importes designados como "-" son 0 \$, menos de 1000 \$, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.		
Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. El 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 324 155 000 USD o el 62,83 % del patrimonio neto.		
* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.		
† Poca liquidez.		
∞ El título es valorado de buena fe y a un valor razonable por el Comité de Valoración o según el criterio de este.		
ε El valor está en mora a 31 de agosto de 2023 (capital o interés).		

ABREVIATURAS:		
REMIC	-	Conducto de inversiones hipotecarias inmobiliarias.

Análisis del total de activos		% del total de activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado		92,55
Otros valores mobiliarios negociables en otro mercado regulado		3,48
Organismos de inversión colectiva		3,07
Instrumentos financieros derivados		0,11
Otros activos		0,79
Total de activos		100,00

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)	Moneda de venta (en miles)	Apreciación / (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
05 sep.2023	BNY Mellon	Compra	EUR 1	Venta USD 1	USD -
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD 10	Venta EUR 9	-
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD 38.993	Venta JPY 5.575.971	577
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	CHF 282	Venta USD 323	(3)
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	JPY 5.575.971	Venta USD 38.998	(581)
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	GBP 9	Venta USD 11	-
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	EUR 5.242	Venta USD 5.767	(80)
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	GBP -	Venta USD -	-
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 8\$)				USD	577
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(1.683)					(664)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(1.675))				USD	(87)

Listado de contratos de futuros

Contraparte	Valor nominal	Valor teórico (miles)	Apreciación / (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	(206)	USD (49.353)	USD (91)
Índice SOFR de 3 meses Septiembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	(204)	(48.697)	(67)
U.S. 10 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(42)	(4.663)	(42)
U.S. 10 Year Ultra Note Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(84)	(9.753)	(144)
U.S. Long Bond (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(112)	(13.629)	(194)
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): 317\$			USD	-
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(73)				(538)
Depreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: 244\$)			USD	(538)

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

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

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos		
Valores garantizados por hipotecas (continuación)							
225	Fannie Mae Pool 'MA4175', 1.500%, con vencimiento el 01/11/2040	183	0,02				
649	Fannie Mae Pool 'MA4204', 2.000%, con vencimiento el 01/12/2040	546	0,05				
5.448	Fannie Mae Pool 'MA4208', 2.000%, con vencimiento el 01/12/2050	4.367	0,39				
7.728	Fannie Mae Pool 'MA4325', 2.000%, con vencimiento el 01/05/2051	6.163	0,55				
464	Fannie Mae Pool 'MA4342', 1.500%, con vencimiento el 01/05/2041	373	0,03				
420	Fannie Mae Pool 'MA4387', 2.000%, con vencimiento el 01/07/2041	353	0,03				
1.328	Fannie Mae Pool 'MA4500', 1.500%, con vencimiento el 01/12/2041	1.066	0,09				
2.788	Fannie Mae Pool 'MA4570', 2.000%, con vencimiento el 01/03/2042	2.318	0,21				
876	Fannie Mae REMICS, Series 2010 2, Class AI, 5.500%, con vencimiento el 25/02/2040	147	0,01				
910	Fannie Mae REMICS, Series 2012 124, Class SD, 0.748%, con vencimiento el 25/11/2042 *	93	0,01				
1.280	Fannie Mae REMICS, Series 2012 22, Class SM, 1.098%, con vencimiento el 25/03/2042 *	138	0,01				
587	Fannie Mae REMICS, Series 2012 9, Class PT, 11.414%, con vencimiento el 25/07/2036 *	694	0,06				
735	Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Class BC, 6.500%, con vencimiento el 25/07/2042	775	0,07				
3.451	Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Class CB, 5.500%, con vencimiento el 25/04/2042	3.487	0,31				
134	Fannie Mae REMICS, Series 2015 39, Class LZ, 3.000%, con vencimiento el 25/06/2045	116	0,01				
5.604	Fannie Mae REMICS, Series 2016 48, Class IA, 4.500%, con vencimiento el 25/06/2038	806	0,07				
2.091	Fannie Mae REMICS, Series 2017 74, Class PZ, 3.500%, con vencimiento el 25/10/2047	1.647	0,15				
3.527	Fannie Mae REMICS, Series 2018 3, Class IO, 4.000%, con vencimiento el 25/02/2048	680	0,06				
1.145	Fannie Mae REMICS, Series 2018 74, Class AB, 3.500%, con vencimiento el 25/10/2048	1.040	0,09				
896	Fannie Mae REMICS, Series 2019 25, Class PI, 5.000%, con vencimiento el 25/05/2048	174	0,02				
3.882	Fannie Mae REMICS, Series 2019 38, Class SH, 0.867%, con vencimiento el 25/07/2049 *	357	0,03				
1.944	Fannie Mae REMICS, Series 2019 44, Class SM, 0.648%, con vencimiento el 25/08/2049 *	249	0,02				
2.106	Fannie Mae REMICS, Series 2019 45, Class BS, 0.648%, con vencimiento el 25/08/2049 *	228	0,02				
3.741	Fannie Mae REMICS, Series 2019 5, Class IO, 4.500%, con vencimiento el 25/03/2049	720	0,06				
1.155	Fannie Mae REMICS, Series 2019 57, Class NS, 0.598%, con vencimiento el 25/10/2049 *	121	0,01				
1.414	Fannie Mae REMICS, Series 2019 58, Class HS, 0.598%, con vencimiento el 25/10/2049 *	144	0,01				
2.895	Fannie Mae REMICS, Series 2019 59, Class SH, 0.598%, con vencimiento el 25/10/2049 *	319	0,03				
1.219	Fannie Mae REMICS, Series 2020 26, Class SA, 0.548%, con vencimiento el 25/05/2050 *	119	0,01				
959	Fannie Mae REMICS, Series 2020 47, Class GZ, 2.000%, con vencimiento el 25/07/2050	558	0,05				
1.651	Fannie Mae REMICS, Series 2020 62, Class BI, 2.000%, con vencimiento el 25/09/2050	198	0,02				
2.472	Fannie Mae REMICS, Series 2020 67, Class IH, 2.000%, con vencimiento el 25/09/2050	318	0,03				
151	Fannie Mae REMICS, Series 2020 74, Class EI, 2.500%, con vencimiento el 25/10/2050	24	-				
13.235	Fannie Mae REMICS, Series 2020 88, Class GI, 2.500%, con vencimiento el 25/12/2050	1.973	0,17				
1.055	Fannie Mae REMICS, Series 2020 89, Class DI, 2.500%, con vencimiento el 25/12/2050	159	0,01				
8.668	Fannie Mae REMICS, Series 2020 91, Class IO, 2.500%, con vencimiento el 25/12/2050	1.323	0,12				
6.250	Fannie Mae REMICS, Series 2020 93, Class LI, 2.500%, con vencimiento el 25/01/2051	891	0,08				
24.912	Fannie Mae REMICS, Series 2021 42, Class NI, 2.500%, con vencimiento el 25/11/2048	3.235	0,29				
7.755	Fannie Mae REMICS, Series 2021 46, Class BI, 2.500%, con vencimiento el 25/12/2048	1.066	0,09				
5.153	Fannie Mae REMICS, Series 2021 49, Class GI, 2.500%, con vencimiento el 25/10/2048	677	0,06				
1.185	Fannie Mae REMICS, Series 2021 54, Class KI, 2.500%, con vencimiento el 25/05/2049	164	0,01				
9.457	Fannie Mae REMICS, Series 2021 59, Class TI, 2.500%, con vencimiento el 25/09/2051	1.432	0,13				
1.508	Fannie Mae REMICS, Series 2021 61, Class KI, 2.500%, con vencimiento el 25/04/2049	210	0,02				
5.825	Fannie Mae REMICS, Series 2021 85, Class IN, 2.500%, con vencimiento el 25/02/2050	946	0,08				
13.174	Fannie Mae REMICS, Series 2021 91, Class IG, 2.500%, con vencimiento el 25/01/2052	1.937	0,17				
11.514	Fannie Mae REMICS, Series 2022 29, Class KZ, 1.500%, con vencimiento el 25/06/2042	7.975	0,71				
732	Fannie Mae REMICS, Series 2022 57, Class BC, 4.000%, con vencimiento el 25/09/2052	689	0,06				
286	Fannie Mae-Aces, Serie 2016 M11, Clase AL, 2,944 %, con vencimiento el 25/07/2039	254	0,02				
15.530	Fannie Mae-Aces, Serie 2019 M11, Clase X1, 1,187 %, con vencimiento el 25/06/2029 *	705	0,06				
14.864	Fannie Mae-Aces, Serie 2019 M13, Clase X1, 0,940 %, con vencimiento el 25/06/2034 *	603	0,05				
37.401	Fannie Mae-Aces, Serie 2019 M14, Clase X1, 0,671 %, con vencimiento el 25/06/2029 *	946	0,08				
5.450	Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M11, Clase IO, 1,872 %, con vencimiento el 25/01/2029 *	397	0,04				
33.662	Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M16, Clase X1, 0,538 %, con vencimiento el 25/04/2032 *	897	0,08				
4.471	Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M24, Clase X1, 1,703 %, con vencimiento el 25/01/2037 *	412	0,04				
				15.192	Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M31, Clase X2, 1,333 %, con vencimiento el 25/12/2032 *	899	0,08
				36	Freddie Mac Gold Pool 'A29586', 5,000 %, con vencimiento el 01/01/2035	36	-
				9	Freddie Mac Gold Pool 'A30703', 5,500%, con vencimiento el 01/12/2034	9	-
				96	Freddie Mac Gold Pool 'A35950', 5,000%, con vencimiento el 01/07/2035	96	0,01
				12	Freddie Mac Gold Pool 'A36526', 5,000%, con vencimiento el 01/08/2035	12	-
				37	Freddie Mac Gold Pool 'A39036', 5,000%, con vencimiento el 01/05/2035	37	-
				6	Freddie Mac Gold Pool 'A39302', 5,500%, con vencimiento el 01/11/2035	6	-
				-	Freddie Mac Gold Pool 'A84166', 6,500%, con vencimiento el 01/01/2039	-	-
				1	Freddie Mac Gold Pool 'C00556', 8,000%, con vencimiento el 01/10/2027	1	-
				-	Freddie Mac Gold Pool 'C01025', 8,000%, con vencimiento el 01/07/2030	-	-
				-	Freddie Mac Gold Pool 'C01051', 8,000%, con vencimiento el 01/09/2030	-	-
				1	Freddie Mac Gold Pool 'C46047', 8,000%, con vencimiento el 01/12/2030	1	-
				3	Freddie Mac Gold Pool 'C55319', 8,000%, con vencimiento el 01/08/2031	3	-
				-	Freddie Mac Gold Pool 'C57324', 8,000%, con vencimiento el 01/09/2031	-	-
				2	Freddie Mac Gold Pool 'C91046', 6,500%, con vencimiento el 01/05/2027	2	-
				1.014	Freddie Mac Gold Pool 'C91981', 3,000%, con vencimiento el 01/02/2038	920	0,08
				-	Freddie Mac Gold Pool 'G00556', 8,000%, con vencimiento el 01/09/2026	-	-
				1	Freddie Mac Gold Pool 'G00726', 8,000%, con vencimiento el 01/06/2027	1	-
				-	Freddie Mac Gold Pool 'G00931', 8,000%, con vencimiento el 01/11/2026	-	-
				5	Freddie Mac Gold Pool 'G02427', 5,500%, con vencimiento el 01/12/2036	5	-
				26	Freddie Mac Gold Pool 'G04581', 6,500%, con vencimiento el 01/08/2038	26	-
				1	Freddie Mac Gold Pool 'G04947', 6,500%, con vencimiento el 01/04/2038	1	-
				4	Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500%, con vencimiento el 01/09/2039	4	-
				94	Freddie Mac Gold Pool 'G07335', 7,000%, con vencimiento el 01/03/2039	100	0,01
				213	Freddie Mac Gold Pool 'G07509', 6,500%, con vencimiento el 01/09/2039	219	0,02
				903	Freddie Mac Gold Pool 'G08700', 4,500%, con vencimiento el 01/03/2046	876	0,08

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

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

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)					
151	143	0,01	2.428	2.273	0,20
1.179	1.203	0,11	475	450	0,04
3.502	3.328	0,30	825	782	0,07
4.856	4.426	0,39	89	78	0,01
8.558	7.559	0,67	319	289	0,03
1	1	-	75	61	0,01
43	43	-	2.972	2.587	0,23
1	1	-	118	104	0,01
279	261	0,02	190	168	0,01
169	158	0,01	444	374	0,03
164	156	0,01	303	254	0,02
1.298	1.228	0,11	75	61	0,01
59	56	-	139	113	0,01
360	341	0,03	71	58	-
306	289	0,03	76	61	0,01
32	30	-	223	181	0,02
79	72	0,01	152	124	0,01
31	28	-	84	67	0,01
63	58	-	66	53	-
78	72	0,01	78	63	0,01
143	131	0,01	82	67	0,01
107	98	0,01	73	59	0,01
112	103	0,01	160	136	0,01
127	116	0,01	551	481	0,04
3.658	3.349	0,30	424	356	0,03
1.795	1.700	0,15	423	355	0,03
57.021	1.143	0,10	446	374	0,03
82.417	1.024	0,09	351	294	0,03
54.532	301	0,03	521	437	0,04
57.720	298	0,03	3.871	3.250	0,29
881	23	-	1.861	1.562	0,14
6.975	533	0,05	3.690	3.095	0,27
1.200	984	0,09	944	792	0,07
9.945	841	0,07	3.998	3.237	0,29
3.984	279	0,02	89	78	0,01
7.951	588	0,05	84	73	0,01
987	54	-	7056	6.175	0,55
85.160	3.670	0,33	254	214	0,02
2.989	122	0,01	548	439	0,04
12.496	405	0,04	654	523	0,05
63.985	1.410	0,12	92	74	0,01
61.465	1.313	0,12	842	674	0,06
85.311	2.131	0,19	527	421	0,04
17.889	374	0,03	3.315	2.783	0,25
28.473	947	0,08	277	233	0,02
4.173	469	0,04	181	156	0,01
6.499	194	0,02	272	220	0,02
1.300	1.267	0,11	195	180	0,02
5.243	4.916	0,44	2.766	2.770	0,25
			2.810	2.799	0,25
			5.719	5.549	0,49
			1.968	1.964	0,17
			839	849	0,08
			178	182	0,02
			173	176	0,02
			192	195	0,02
			299	304	0,03
			3.786	3.850	0,34
			1.039	1.009	0,09
			1.175	1.032	0,09
			6.693	5.874	0,52
			367	307	0,03
			394	318	0,03
			5.594	4.711	0,42
			18.153	15.282	1,36
			1.757	1.475	0,13
			66	55	-
			441	369	0,03
			2.169	1.892	0,17
			72	60	0,01
			552	445	0,04
			1.485	1.193	0,11
			171	137	0,01
			3.428	3.171	0,28
			2.748	2.545	0,23
			8.267	6.903	0,61
			2.209	1.774	0,16
			281	226	0,02
			3.412	2.827	0,25
			10.777	9.300	0,83
			1.592	1.329	0,12
			3.155	2.644	0,23
			144	136	0,01
			228	217	0,02
			143	117	0,01
			336	292	0,03
			4.744	4.451	0,40
			2.504	2.006	0,18
			7.055	5.889	0,52
			3.684	3.182	0,28
			877	736	0,07
			376	327	0,03

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

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

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)					
6.579	5.954	0,53	2.233		
15.539	14.955	1,33	Freddie Mac REMICS 5058, Clase IL, 2,500 %, con vencimiento el 25/01/2051	390	0,03
13.668	12.802	1,14	675		
3.718	3.372	0,30	Freddie Mac REMICS 5059, Clase IB, 2,500 %, con vencimiento el 25/01/2051	107	0,01
4.473	4.435	0,39	5.069		
17.561	17.371	1,54	Freddie Mac REMICS 5070, Clase NI, 2,000 %, con vencimiento el 25/02/2051	704	0,06
6.913	6.961	0,62	8.953		
954	971	0,09	Freddie Mac REMICS 5078, Clase EI, 1,500 %, con vencimiento el 25/01/2051	881	0,08
4.072	4.027	0,36	20.786		
3.960	2.998	0,27	Freddie Mac REMICS 5085, Clase IK, 2,500 %, con vencimiento el 25/03/2051	3.361	0,30
6.991	6.786	0,60	10.866		
2.986	2.833	0,25	Freddie Mac REMICS 5092, Clase IU, 2,500 %, con vencimiento el 25/02/2051	1.274	0,11
606	531	0,05	3.533		
4.412	3.711	0,33	Freddie Mac REMICS 5113, Clase NI, 2,500 %, con vencimiento el 25/06/2051	437	0,04
211	177	0,02	11.609		
3.743	3.149	0,28	Freddie Mac REMICS 5134, Clase KI, 2,500 %, con vencimiento el 25/07/2048	1.545	0,14
671	569	0,05	10.811		
23.062	19.365	1,72	Freddie Mac REMICS 5135, Clase DI, 2,500 %, con vencimiento el 25/05/2048	1.412	0,13
4.735	3.788	0,34	1.432		
9.957	8.333	0,74	Freddie Mac REMICS 5149, Clase NI, 2,500 %, con vencimiento el 25/01/2051	208	0,02
1.132	1.076	0,10	9.330		
1.528	1.409	0,12	Freddie Mac REMICS 5160, Clase IU, 2,500 %, con vencimiento el 25/11/2050	1.275	0,11
251	236	0,02	9.576		
229	228	0,02	Freddie Mac REMICS 5162, Clase DI, 2,500 %, con vencimiento el 25/11/2051	1.284	0,11
2.093	1.907	0,17	7.700		
363	332	0,03	Freddie Mac REMICS 5169, Clase PW, 2,000 %, con vencimiento el 25/09/2051	5.015	0,45
796	728	0,06	7.200		
2.042	1.868	0,17	Freddie Mac REMICS 5178, Clase CY, 2,000 %, con vencimiento el 25/01/2042	4.791	0,43
88	81	0,01	4.900		
83	76	0,01	Freddie Mac REMICS 5209, Clase EQ, 3,000 %, con vencimiento el 25/04/2052	3.576	0,32
55	53	–	1.901		
10	10	–	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA5, Serie 2022 DNA5, Clase M1A, 144A, 8,238 %, con vencimiento el 25/06/2042 *	1.944	0,17
310	320	0,03	1.124		
5	6	–	Freddie Mac Strips 312, Clase S1, 0,647 %, con vencimiento el 15/09/2043 *	109	0,01
8	8	–	3.743		
128	130	0,01	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2021 DNA2, Clase M2, 144A, 7,588 %, con vencimiento el 25/08/2033 *	3.753	0,33
9.787	8.903	0,79	–		
141	134	0,01	–		
220	193	0,02	–		
37	36	–	–		
2.106	1.872	0,17	–		
743	680	0,06	–		
132	121	0,01	–		
137	122	0,01	–		
34	33	–	–		
137	131	0,01	–		
1.732	1.575	0,14	–		
4.600	4.567	0,41	–		
2.806	314	0,03	23		
2.085	342	0,03	Ginnie Mae I Pool '646044', 6,500 %, con vencimiento el 15/10/2037	23	–
607	10	–	1		
4.800	3.740	0,33	Ginnie Mae I Pool '652203', 5,000 %, con vencimiento el 15/03/2036	1	–
208	6	–	3		
1.140	129	0,01	Ginnie Mae I Pool '658182', 6,000 %, con vencimiento el 15/11/2036	3	–
284	19	–	1		
1.234	147	0,01	Ginnie Mae I Pool '675375', 5,000 %, con vencimiento el 15/05/2038	1	–
181	158	0,01	1		
1.513	276	0,02	Ginnie Mae I Pool '676940', 5,000 %, con vencimiento el 15/04/2038	1	–
807	82	0,01	4		
1.656	171	0,02	Ginnie Mae I Pool '683926', 5,000 %, con vencimiento el 15/02/2038	4	–
2.376	254	0,02	6		
1.098	879	0,08	Ginnie Mae I Pool '684334', 5,000 %, con vencimiento el 15/02/2038	6	–
1.278	132	0,01	2		
2.876	1.678	0,15	Ginnie Mae I Pool '684754', 5,000 %, con vencimiento el 15/04/2038	2	–
2.226	327	0,03	1		
9.646	1.497	0,13	Ginnie Mae I Pool '684848', 5,000 %, con vencimiento el 15/04/2038	1	–
4.900	607	0,05	2		
3.879	672	0,06	Ginnie Mae I Pool '686062', 5,000 %, con vencimiento el 15/05/2038	2	–
1.625	218	0,02	51		
3.069	2.164	0,19	Ginnie Mae I Pool '698086', 6,000 %, con vencimiento el 15/04/2039	52	–
142	25	–	9		
			Ginnie Mae I Pool '701501', 5,000 %, con vencimiento el 15/12/2038	9	–
			257		
			Ginnie Mae I Pool '701947', 5,000 %, con vencimiento el 15/06/2039	256	0,02
			113		
			Ginnie Mae I Pool '733600', 5,000 %, con vencimiento el 15/04/2040	112	0,01
			250		
			Ginnie Mae I Pool '733627', 5,000 %, con vencimiento el 15/05/2040	248	0,02
			1		
			Ginnie Mae I Pool '780732', 7,000 %, con vencimiento el 15/03/2028	1	–
			1		
			Ginnie Mae I Pool '781001', 7,500 %, con vencimiento el 15/03/2029	1	–
			46		
			Ginnie Mae I Pool '781590', 5,500 %, con vencimiento el 15/04/2033	46	–
			312		
			Ginnie Mae I Pool '781994', 5,500 %, con vencimiento el 15/11/2033	314	0,03
			2		
			Ginnie Mae I Pool '782198', 6,000 %, con vencimiento el 15/10/2037	2	–
			279		
			Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, con vencimiento el 15/06/2048	260	0,02
			122		
			Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, con vencimiento el 15/09/2042	110	0,01
			144		
			Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, con vencimiento el 15/09/2042	130	0,01
			43		
			Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, con vencimiento el 15/10/2042	39	–

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

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

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
232	Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000 %, con vencimiento el 15/10/2042	206	0,02	939	Ginnie Mae II Pool 'BW7384', 4,000 %, con vencimiento el 20/08/2050	880	0,08
201	Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000 %, con vencimiento el 15/11/2042	179	0,02	1.348	Ginnie Mae II Pool 'BX2423', 3,000 %, con vencimiento el 20/10/2050	1.189	0,11
1.635	Ginnie Mae I Pool 'BS8462', 3,500 %, con vencimiento el 15/06/2050	1.511	0,13	93	Ginnie Mae II Pool 'CK9592', 4,000 %, con vencimiento el 20/06/2052	87	0,01
7	Ginnie Mae II Pool '4040', 6,500 %, con vencimiento el 20/10/2037	7	-	88	Ginnie Mae II Pool 'CL5523', 3,000 %, con vencimiento el 20/04/2052	77	0,01
9	Ginnie Mae II Pool '4170', 6,000 %, con vencimiento el 20/06/2038	9	-	153	Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500 %, con vencimiento el 20/04/2046	141	0,01
633	Ginnie Mae II Pool '4245', 6,000 %, con vencimiento el 20/09/2038	665	0,06	84	Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500 %, con vencimiento el 20/05/2046	78	0,01
101	Ginnie Mae II Pool '4602', 6,000 %, con vencimiento el 20/12/2039	105	0,01	144	Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500 %, con vencimiento el 20/06/2046	133	0,01
106	Ginnie Mae II Pool '4617', 4,500 %, con vencimiento el 20/01/2040	103	0,01	87	Ginnie Mae II Pool 'MA3803', 3,500 %, con vencimiento el 20/07/2046	80	0,01
54	Ginnie Mae II Pool '4696', 4,500 %, con vencimiento el 20/05/2040	52	-	5.296	Ginnie Mae II Pool 'MA4003', 3,000 %, con vencimiento el 20/10/2046	4.736	0,42
33	Ginnie Mae II Pool '4747', 5,000 %, con vencimiento el 20/07/2040	33	-	744	Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000 %, con vencimiento el 20/02/2047	665	0,06
38	Ginnie Mae II Pool '4772', 5,000 %, con vencimiento el 20/08/2040	38	-	369	Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, con vencimiento el 20/06/2047	350	0,03
4	Ginnie Mae II Pool '4774', 6,000 %, con vencimiento el 20/08/2040	4	-	2.107	Ginnie Mae II Pool 'MA4586', 3,500 %, con vencimiento el 20/07/2047	1.944	0,17
80	Ginnie Mae II Pool '4802', 5,000 %, con vencimiento el 20/09/2040	80	0,01	76	Ginnie Mae II Pool 'MA4587', 4,000 %, con vencimiento el 20/07/2047	72	0,01
34	Ginnie Mae II Pool '4855', 5,000 %, con vencimiento el 20/11/2040	34	-	112	Ginnie Mae II Pool 'MA4654', 4,500 %, con vencimiento el 20/08/2047	109	0,01
13	Ginnie Mae II Pool '4923', 4,500 %, con vencimiento el 20/01/2041	12	-	151	Ginnie Mae II Pool 'MA4781', 5,000 %, con vencimiento el 20/10/2047	150	0,01
8	Ginnie Mae II Pool '4928', 6,000 %, con vencimiento el 20/01/2041	8	-	186	Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000 %, con vencimiento el 20/11/2047	176	0,02
429	Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500 %, con vencimiento el 20/03/2041	419	0,04	169	Ginnie Mae II Pool 'MA4901', 4,000 %, con vencimiento el 20/12/2047	160	0,01
943	Ginnie Mae II Pool '783050', 5,000 %, con vencimiento el 20/07/2040	940	0,08	14.538	Ginnie Mae II Pool 'MA4961', 3,000 %, con vencimiento el 20/01/2048	12.973	1,15
696	Ginnie Mae II Pool '783298', 4,500 %, con vencimiento el 20/04/2041	681	0,06	52	Ginnie Mae II Pool 'MA5020', 4,000 %, con vencimiento el 20/02/2048	50	-
65	Ginnie Mae II Pool '784106', 3,500 %, con vencimiento el 20/01/2046	60	0,01	83	Ginnie Mae II Pool 'MA5078', 4,000 %, con vencimiento el 20/03/2048	78	0,01
1.986	Ginnie Mae II Pool '784577', 4,000 %, con vencimiento el 20/07/2047	1.876	0,17	168	Ginnie Mae II Pool 'MA5138', 4,500 %, con vencimiento el 20/04/2048	163	0,01
60	Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000 %, con vencimiento el 20/01/2050	53	-	124	Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500 %, con vencimiento el 20/05/2048	119	0,01
507	Ginnie Mae II Pool '785360', 2,000 %, con vencimiento el 20/03/2051	406	0,04	96	Ginnie Mae II Pool 'MA5194', 5,000 %, con vencimiento el 20/05/2048	95	0,01
8.814	Ginnie Mae II Pool '785944', 3,000 %, con vencimiento el 20/02/2052	7.783	0,69	17	Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500 %, con vencimiento el 20/06/2048	17	-
2.107	Ginnie Mae II Pool '786077', 3,000 %, con vencimiento el 20/03/2052	1.856	0,16	131	Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, con vencimiento el 20/07/2048	126	0,01
2.934	Ginnie Mae II Pool '786082', 3,000 %, con vencimiento el 20/11/2051	2.594	0,23	1.761	Ginnie Mae II Pool 'MA5399', 4,500 %, con vencimiento el 20/08/2048	1.700	0,15
279	Ginnie Mae II Pool '786095', 3,000 %, con vencimiento el 20/04/2052	240	0,02	39	Ginnie Mae II Pool 'MA5467', 4,500 %, con vencimiento el 20/09/2048	38	-
1.493	Ginnie Mae II Pool '786107', 3,000 %, con vencimiento el 20/03/2052	1.319	0,12	6.359	Ginnie Mae II Pool 'MA5530', 5,000 %, con vencimiento el 20/10/2048	6.281	0,56
1.335	Ginnie Mae II Pool '786108', 3,500 %, con vencimiento el 20/03/2052	1.200	0,11	212	Ginnie Mae II Pool 'MA5597', 5,000 %, con vencimiento el 20/11/2048	209	0,02
418	Ginnie Mae II Pool '786134', 3,000 %, con vencimiento el 20/04/2052	361	0,03	61	Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500 %, con vencimiento el 20/12/2048	59	-
286	Ginnie Mae II Pool '786335', 4,500 %, con vencimiento el 20/09/2052	275	0,02	285	Ginnie Mae II Pool 'MA5653', 5,000 %, con vencimiento el 20/12/2048	281	0,02
8.783	Ginnie Mae II Pool '786348', 4,500 %, con vencimiento el 20/08/2052	8.391	0,74	194	Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500 %, con vencimiento el 20/01/2049	187	0,02
679	Ginnie Mae II Pool '786474', 5,000 %, con vencimiento el 20/01/2053	666	0,06	202	Ginnie Mae II Pool 'MA5712', 5,000 %, con vencimiento el 20/01/2049	199	0,02
1.549	Ginnie Mae II Pool '892346', 7,833 %, con vencimiento el 20/08/2059 *	1.567	0,14	201	Ginnie Mae II Pool 'MA5713', 5,500 %, con vencimiento el 20/01/2049	202	0,02
214	Ginnie Mae II Pool '892614', 7,225 %, con vencimiento el 20/08/2060 *	217	0,02	93	Ginnie Mae II Pool 'MA5764', 4,500 %, con vencimiento el 20/02/2049	90	0,01
863	Ginnie Mae II Pool 'AV0243', 3,500 %, con vencimiento el 20/08/2046	796	0,07	2.344	Ginnie Mae II Pool 'MA5766', 5,500 %, con vencimiento el 20/02/2049	2.360	0,21
1.048	Ginnie Mae II Pool 'AV8311', 3,500 %, con vencimiento el 20/08/2046	967	0,09	126	Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500 %, con vencimiento el 20/03/2049	122	0,01
1.215	Ginnie Mae II Pool 'AV8312', 3,500 %, con vencimiento el 20/08/2046	1.121	0,10	513	Ginnie Mae II Pool 'MA5820', 5,500 %, con vencimiento el 20/03/2049	516	0,05
406	Ginnie Mae II Pool 'AZ3074', 4,000 %, con vencimiento el 20/02/2047	383	0,03	11	Ginnie Mae II Pool 'MA5877', 4,500 %, con vencimiento el 20/04/2049	11	-
496	Ginnie Mae II Pool 'BC5293', 3,500 %, con vencimiento el 20/08/2047	457	0,04	135	Ginnie Mae II Pool 'MA5878', 5,000 %, con vencimiento el 20/04/2049	133	0,01
3.174	Ginnie Mae II Pool 'BC5429', 3,500 %, con vencimiento el 20/10/2047	2.924	0,26	494	Ginnie Mae II Pool 'MA5879', 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2049	498	0,04
252	Ginnie Mae II Pool 'BD3554', 3,500 %, con vencimiento el 20/10/2047	232	0,02	375	Ginnie Mae II Pool 'MA5934', 5,500 %, con vencimiento el 20/05/2049	378	0,03
1.308	Ginnie Mae II Pool 'BD3636', 3,500 %, con vencimiento el 20/10/2047	1.205	0,11	3.372	Ginnie Mae II Pool 'MA5989', 5,500 %, con vencimiento el 20/06/2049	3.396	0,30
31	Ginnie Mae II Pool 'BG7951', 4,500 %, con vencimiento el 20/06/2048	29	-	3.693	Ginnie Mae II Pool 'MA6157', 5,000 %, con vencimiento el 20/09/2049	3.651	0,32
718	Ginnie Mae II Pool 'BH1521', 4,500 %, con vencimiento el 20/07/2048	689	0,06	202	Ginnie Mae II Pool 'MA6217', 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2049	173	0,02
888	Ginnie Mae II Pool 'BH1870', 4,500 %, con vencimiento el 20/08/2048	857	0,08	116	Ginnie Mae II Pool 'MA6412', 4,500 %, con vencimiento el 20/01/2050	112	0,01
632	Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500 %, con vencimiento el 20/02/2050	574	0,05	81	Ginnie Mae II Pool 'MA6542', 3,500 %, con vencimiento el 20/03/2050	75	0,01
123	Ginnie Mae II Pool 'BM9734', 4,000 %, con vencimiento el 20/10/2049	117	0,01	119	Ginnie Mae II Pool 'MA6602', 4,500 %, con vencimiento el 20/04/2050	115	0,01
494	Ginnie Mae II Pool 'BS1728', 4,000 %, con vencimiento el 20/01/2050	473	0,04				
407	Ginnie Mae II Pool 'BS1742', 4,000 %, con vencimiento el 20/02/2050	389	0,03				
72	Ginnie Mae II Pool 'BS8546', 2,500 %, con vencimiento el 20/12/2050	60	0,01				
476	Ginnie Mae II Pool 'BT1888', 2,500 %, con vencimiento el 20/12/2050	405	0,04				
924	Ginnie Mae II Pool 'BT9472', 4,000 %, con vencimiento el 20/05/2050	876	0,08				
2.310	Ginnie Mae II Pool 'BU3196', 4,000 %, con vencimiento el 20/05/2050	2.154	0,19				
776	Ginnie Mae II Pool 'BW7380', 4,500 %, con vencimiento el 20/07/2050	744	0,07				

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

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

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)							
4.646	Ginnie Mae II Pool 'MA6657', 3,500 %, con vencimiento el 20/05/2050	4.262	0,38	3.666	Government National Mortgage Association, Serie 2015 177, Clase MI, 5,000 %, con vencimiento el 20/10/2044	746	0,07
3.936	Ginnie Mae II Pool 'MA6658', 4,000 %, con vencimiento el 20/05/2050	3.726	0,33	26.319	Government National Mortgage Association, Serie 2017 111, Clase IO, 0,526 %, con vencimiento el 16/02/2059 *	813	0,07
1.925	Ginnie Mae II Pool 'MA6869', 4,500 %, con vencimiento el 20/09/2050	1.859	0,16	1.843	Government National Mortgage Association, Serie 2017 19, Clase SE, 0,723 %, con vencimiento el 16/02/2047 *	159	0,01
2.473	Ginnie Mae II Pool 'MA6935', 4,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	2.389	0,21	3.695	Government National Mortgage Association, Serie 2017 26, Clase IQ, 5,000 %, con vencimiento el 20/02/2040	749	0,07
104	Ginnie Mae II Pool 'MA7194', 3,000 %, con vencimiento el 20/02/2051	93	0,01	6.944	Government National Mortgage Association, Serie 2017 8, Clase IO, 0,448 %, con vencimiento el 16/08/2058 *	170	0,01
15.743	Ginnie Mae II Pool 'MA7312', 2,500 %, con vencimiento el 20/04/2051	13.416	1,19	508	Government National Mortgage Association, Serie 2017 H22, Clase JF, 3,925 %, con vencimiento el 20/10/2067 *	502	0,04
2.195	Ginnie Mae II Pool 'MA7314', 3,500 %, con vencimiento el 20/04/2051	2.002	0,18	1.760	Government National Mortgage Association, Serie 2018 125, Clase HS, 0,822 %, con vencimiento el 20/09/2048 *	147	0,01
4.723	Ginnie Mae II Pool 'MA7316', 4,500 %, con vencimiento el 20/04/2051	4.565	0,41	2.739	Government National Mortgage Association, Serie 2018 134, Clase SM, 0,772 %, con vencimiento el 20/10/2048 *	241	0,02
4.625	Ginnie Mae II Pool 'MA7420', 3,500 %, con vencimiento el 20/06/2051	4.218	0,37	789	Government National Mortgage Association, Serie 2018 168, Clase PA, 4,000 %, con vencimiento el 20/08/2048	745	0,07
3.769	Ginnie Mae II Pool 'MA7475', 4,000 %, con vencimiento el 20/07/2051	3.552	0,32	643	Government National Mortgage Association, Serie 2018 37, Clase QA, 2,750 %, con vencimiento el 20/03/2048	564	0,05
5.426	Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, con vencimiento el 20/09/2051	4.793	0,43	550	Government National Mortgage Association, Serie 2018 H09, Clase FE, 5,495 %, con vencimiento el 20/06/2068 *	543	0,05
18.018	Ginnie Mae II Pool 'MA7768', 3,000 %, con vencimiento el 20/12/2051	15.888	1,41	580	Government National Mortgage Association, Serie 2018 H13, Clase DF, 5,401 %, con vencimiento el 20/07/2068 *	574	0,05
3.777	Ginnie Mae II Pool 'MA7883', 3,500 %, con vencimiento el 20/02/2052	3.431	0,30	500	Government National Mortgage Association, Serie 2019 128, Clase AL, 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2049	343	0,03
3.286	Ginnie Mae II Pool 'MA8045', 4,000 %, con vencimiento el 20/05/2052	3.063	0,27	566	Government National Mortgage Association, Serie 2019 18, Clase TP, 3,500 %, con vencimiento el 20/02/2049	513	0,05
2.887	Ginnie Mae II Pool 'MA8046', 4,500 %, con vencimiento el 20/05/2052	2.753	0,24	12.641	Government National Mortgage Association, Serie 2019 85, Clase LS, 0,000 %, con vencimiento el 20/07/2049 *	247	0,02
1.130	Ginnie Mae II Pool 'MA8100', 4,000 %, con vencimiento el 20/06/2052	1.053	0,09	244	Government National Mortgage Association, Serie 2019 H01, Clase FT, 5,618 %, con vencimiento el 20/10/2068 *	243	0,02
15.557	Ginnie Mae II Pool 'MA8197', 2,500 %, con vencimiento el 20/08/2052	13.255	1,18	271	Government National Mortgage Association, Serie 2019 H08, Clase FE, 3,869 %, con vencimiento el 20/01/2069 *	261	0,02
118	Ginnie Mae II Pool 'MA8263', 2,000 %, con vencimiento el 20/09/2052	97	0,01	302	Government National Mortgage Association, Serie 2019 H10, Clase FB, 4,874 %, con vencimiento el 20/06/2069 *	290	0,03
671	Ginnie Mae II Pool 'MA8348', 5,000 %, con vencimiento el 20/10/2052	654	0,06	5.198	Government National Mortgage Association, Serie 2020 116, Clase GI, 2,500 %, con vencimiento el 20/08/2050	707	0,06
620	Ginnie Mae II Pool 'MA8422', 2,000 %, con vencimiento el 20/11/2052	512	0,05	1.807	Government National Mortgage Association, Serie 2020 122, Clase IM, 2,500 %, con vencimiento el 20/08/2050	247	0,02
1.836	Ginnie Mae II Pool 'MA8428', 5,000 %, con vencimiento el 20/11/2052	1.789	0,16	3.839	Government National Mortgage Association, Serie 2020 123, Clase EI, 2,500 %, con vencimiento el 20/08/2050	522	0,05
1.340	Ginnie Mae II Pool 'MA8429', 5,500 %, con vencimiento el 20/11/2052	1.327	0,12	466	Government National Mortgage Association, Serie 2020 129, Clase IE, 2,500 %, con vencimiento el 20/09/2050	64	0,01
2.592	Ginnie Mae II Pool 'MA8484', 2,000 %, con vencimiento el 20/12/2052	2.142	0,19	160	Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Clase IH, 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	22	–
2.894	Ginnie Mae II Pool 'MA8492', 6,000 %, con vencimiento el 20/12/2052	2.906	0,26	5.357	Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Clase QI, 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	900	0,08
4.711	Ginnie Mae II Pool 'MA8647', 5,000 %, con vencimiento el 20/02/2053	4.586	0,41	232	Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Clase VI, 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	33	–
3.353	Ginnie Mae II Pool 'MA8725', 5,000 %, con vencimiento el 20/03/2053	3.265	0,29	705	Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Clase YI, 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	94	0,01
1.180	Ginnie Mae II Pool 'MA8727', 6,000 %, con vencimiento el 20/03/2053	1.185	0,11	4.249	Government National Mortgage Association, Serie 2020 181, Clase WI, 2,000 %, con vencimiento el 20/12/2050	462	0,04
2.154	Ginnie Mae II Pool 'MA8794', 2,000 %, con vencimiento el 20/03/2053	1.781	0,16	3.994	Government National Mortgage Association, Serie 2020 191, Clase IX, 2,500 %, con vencimiento el 20/12/2050	675	0,06
98	Ginnie Mae II Pool 'MA8798', 4,000 %, con vencimiento el 20/04/2053	92	0,01	4.606	Government National Mortgage Association, Serie 2020 36, Clase GS, 0,672 %, con vencimiento el 20/03/2050 *	577	0,05
1.925	Ginnie Mae II Pool 'MA8800', 5,000 %, con vencimiento el 20/04/2053	1.874	0,17	506	Government National Mortgage Association, Serie 2020 47, Clase MI, 3,500 %, con vencimiento el 20/04/2050	86	0,01
6.300	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,000% ±	5.198	0,46	1.385	Government National Mortgage Association, Serie 2020 47, Clase NI, 3,500 %, con vencimiento el 20/04/2050	230	0,02
100	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 4,500% ±	95	0,01	968	Government National Mortgage Association, Serie 2020 61, Clase CI, 4,000 %, con vencimiento el 20/03/2050	170	0,01
5.000	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,500% ±	4.950	0,44	828	Government National Mortgage Association, Serie 2020 85, Clase CI, 3,500 %, con vencimiento el 20/04/2050	137	0,01
1.000	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 6,000% ±	1.003	0,09	5.874	Government National Mortgage Association, Serie 2020 H08, Clase BI, 0,026 %, con vencimiento el 01/04/2070 *	189	0,02
645	Government National Mortgage Association, Serie 2004 81, Clase SK, 0,773 %, con vencimiento el 16/10/2034 *	23	–	1.298	Government National Mortgage Association, Serie 2020 H09, Clase FL, 4,850 %, con vencimiento el 20/05/2070 *	1.302	0,12
1.115	Government National Mortgage Association, Serie 2008 40, Clase SC, 0,923 %, con vencimiento el 16/05/2038 *	62	0,01	145	Government National Mortgage Association, Serie 2020 H12, Clase F, 5,530 %, con vencimiento el 20/07/2070 *	143	0,01
1.386	Government National Mortgage Association, Serie 2008 79, Clase ID, 1,372 %, con vencimiento el 20/06/2035 *	82	0,01	1.086	Government National Mortgage Association, Serie 2020 H13, Clase FA, 4,989 %, con vencimiento el 20/07/2070 *	1.062	0,09
264	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H02, Clase FA, 6,110 %, con vencimiento el 20/02/2060 *	264	0,02	28.431	Government National Mortgage Association, Serie 2021 110, Clase IO, 0,873 %, con vencimiento el 16/11/2063 *	1.837	0,16
599	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H20, Clase AF, 5,585 %, con vencimiento el 20/10/2060 *	595	0,05	1.088	Government National Mortgage Association, Serie 2021 14, Clase AB, 1,340 %, con vencimiento el 16/06/2063	815	0,07
232	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H22, Clase FE, 5,605 %, con vencimiento el 20/05/2059 *	230	0,02	6.567	Government National Mortgage Association, Serie 2021 156, Clase IE, 2,500 %, con vencimiento el 20/09/2051	937	0,08
287	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H28, Clase FE, 5,655 %, con vencimiento el 20/12/2060 *	286	0,03	13.466	Government National Mortgage Association, Serie 2021 158, Clase IN, 2,500 %, con vencimiento el 20/09/2051	1.851	0,16
637	Government National Mortgage Association, Serie 2011 146, Clase KS, 0,673 %, con vencimiento el 16/11/2041 *	57	–	3.508	Government National Mortgage Association, Serie 2021 180, Clase IO, 0,911 %, con vencimiento el 16/11/2063 *	241	0,02
856	Government National Mortgage Association, Serie 2011 79, Clase KS, 0,000 %, con vencimiento el 20/05/2041 *	55	–	16.081	Government National Mortgage Association, Serie 2021 191, Clase NI, 3,000 %, con vencimiento el 20/10/2051	2.727	0,24
2.616	Government National Mortgage Association, Serie 2012 H21, Clase FA, 5,755 %, con vencimiento el 20/07/2062 *	2.603	0,23	2.795	Government National Mortgage Association, Serie 2021 21, Clase AH, 1,400 %, con vencimiento el 16/06/2063	2.118	0,19
9.389	Government National Mortgage Association, Serie 2013 93, Clase SA, 0,773 %, con vencimiento el 16/06/2043 *	1.003	0,09	7.496	Government National Mortgage Association, Serie 2021 216, Clase NI, 3,000 %, con vencimiento el 20/12/2051	1.155	0,10
514	Government National Mortgage Association, Serie 2014 118, Clase HS, 0,772 %, con vencimiento el 20/08/2044 *	53	–	903	Government National Mortgage Association, Serie 2021 29, Clase AG, 5,000 %, con vencimiento el 20/02/2051	888	0,08
825	Government National Mortgage Association, Serie 2014 2, Clase CI, 4,500 %, con vencimiento el 20/01/2044	172	0,02	49.556	Government National Mortgage Association, Serie 2021 37, Clase IO, 0,805 %, con vencimiento el 16/01/2061 *	2.898	0,26
2.367	Government National Mortgage Association, Serie 2014 60, Clase SA, 0,673 %, con vencimiento el 16/04/2044 *	201	0,02	6.417	Government National Mortgage Association, Serie 2021 46, Clase NI, 2,500 %, con vencimiento el 20/03/2051	1.008	0,09
8.046	Government National Mortgage Association, Serie 2015 136, Clase IO, 0,409 %, con vencimiento el 16/08/2055 *	121	0,01				

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

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

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)					
21.408	Government National Mortgage Association, Serie 2021 5, Clase IO, 1,112 %, con vencimiento el 16/01/2061 *	1.574	0,14		
29.005	Government National Mortgage Association, Serie 2021 60, Clase IO, 0,826 %, con vencimiento el 16/05/2063 *	1.724	0,15		
5.217	Government National Mortgage Association, Serie 2021 7, Clase TI, 2,500 %, con vencimiento el 16/01/2051	884	0,08		
600	Government National Mortgage Association, Serie 2021 8, Clase AQ, 5,000 %, con vencimiento el 20/01/2051	603	0,05		
5.400	Government National Mortgage Association, Serie 2022 102, Clase CB, 2,250 %, con vencimiento el 16/06/2064 *	3.167	0,28		
1.100	Government National Mortgage Association, Serie 2022 139, Clase AL, 4,000 %, con vencimiento el 20/07/2051	992	0,09		
9.200	Government National Mortgage Association, Serie 2022 147, Clase B, 2,200 %, con vencimiento el 16/10/2063	6.748	0,60		
9.426	Government National Mortgage Association, Serie 2022 158, Clase AL, 2,100 %, con vencimiento el 16/08/2064	7.086	0,63		
4.369	Government National Mortgage Association, Serie 2022 3, Clase IO, 0,640 %, con vencimiento el 16/01/2061 *	221	0,02		
3.189	Government National Mortgage Association, Serie 2022 54, Clase Z, 2,000 %, con vencimiento el 16/10/2063 *	1.421	0,13		
39.048	Government National Mortgage Association, Serie 2022 55, Clase IO, 0,567 %, con vencimiento el 16/01/2063 *	1.786	0,16		
1.900	Government National Mortgage Association, Serie 2022 63, Clase LM, 3,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	1.580	0,14		
1.300	Government National Mortgage Association, Serie 2022 86, Clase C, 2,250 %, con vencimiento el 16/10/2063 *	669	0,06		
6.235	Government National Mortgage Association, Serie 2023 8, Clase AZ, 3,750 %, con vencimiento el 16/01/2065	4.763	0,42		
6.600	Government National Mortgage Association, Serie 2023 92, Clase AH, 2,000 %, con vencimiento el 16/06/2064	5.037	0,45		
6.000	Government National Mortgage Association, Serie 2023 92, Clase IA, 0,611 %, con vencimiento el 16/06/2064 *	373	0,03		
3.351	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Clase A, 144A, 7,225 %, con vencimiento el 15/09/2031 *	2.781	0,25		
3.477	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Clase B, 144A, 8,425 %, con vencimiento el 15/09/2031 *	1.879	0,17		
1.450	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20, Serie 2014 GC20, Clase A5, 3,998 %, con vencimiento el 10/04/2047	1.433	0,13		
2.120	GS Mortgage Securities Trust 2017-GS8, Serie 2017 GS8, Clase A4, 3,469 %, con vencimiento el 10/11/2050	1.937	0,17		
7.659	JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Serie 2018 5, Clase AX1, 144A, 0,228 %, con vencimiento el 25/10/2048 *†	47	-		
1.885	JPMD Commercial Mortgage Securities Trust 2018-C8, Serie 2018 C8, Clase A4, 4,211 %, con vencimiento el 15/06/2051	1.748	0,16		
1.059	New Residential Mortgage Loan Trust 2018-3, Serie 2018 3A, Clase A1, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 25/05/2058 *	1.012	0,09		
1.469	New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM3, Serie 2021 NQM3, Clase A1, 144A, 1,156 %, con vencimiento el 27/11/2056 *	1.201	0,11		
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 1.206,105 USD)		1.095.793	97,30		
Bonos y obligaciones corporativos — 0,17% (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
Estados Unidos — 0,17 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
2.000	PG&E Wildfire Recovery Funding LLC, Serie A-4, 5,212 %, con vencimiento el 01/12/2047	1.929	0,17		
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 2.038\$)		1.929	0,17		

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones del Estado — 1,00% (28 de febrero de 2023: 2,42%)		
Estados Unidos — 1,00 % (28 de febrero de 2023: 2,42%)		
7.300	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 21/09/2023	7.279
60	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, con vencimiento el 28/02/2025	57
4.320	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, con vencimiento el 30/04/2026	3.907
		11.243
		1,00
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 11.648\$)		11.243
Organismos de inversión colectiva — 0,33% (28 de febrero de 2023: 0,10%)		
3.712	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	3.712
		0,33
Total de organismos de inversión colectiva (coste: 3.712\$)		3.712
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 1.247.491\$)		1.134.430
Futuros — 0,10% (28 de febrero de 2023: 0,03%)		
	Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	1.098
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		1.135.528
Futuros — (0,01%) (28 de febrero de 2023: 0,06%)		
	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(94)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(94)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		1.135.434
Excedente de pasivos respecto a otros activos		(9.255)
Patrimonio		1.126.179\$
– Los importes designados como “-” son 0 \$, menos de 1000 \$, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.		
144A	Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. El 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 38,811,000 USD o el 3,43 % del patrimonio neto.	
*	Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.	
†	Poca liquidez.	
±	Títulos adquiridos siguiendo la norma “se anunciará”.	

ABREVIATURAS:	
REMIC	– Conducto de inversiones hipotecarias inmobiliarias.
TBA	– Pendiente de anuncio.

Análisis del total de activos		% del total de activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado		88,79
Organismos de inversión colectiva		0,29
Instrumentos financieros derivados		0,09
Otros activos		10,83
Total de activos		100,00

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico (miles)	Apreciación / (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	(138)	USD (33.061)	USD 53
Índice SOFR de 3 meses marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	(276)	(65.412)	28
Índice SOFR de 3 meses Septiembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	(223)	(53.233)	(9)
U.S. 10 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(90)	(9.993)	(85)
U.S. 5 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	543	58.058	359
U.S. Long Bond (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	305	37.115	658
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): 353\$				USD 1.098
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(731)				(94)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(378)				USD 1.004

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (miles) £	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (miles) £	% del valor neto de los activos
Bonos y pagarés corporativos (continuación)					
Reino Unido (continuación)					
360 Motability Operations Group Plc, Serie EMTN, 4,875 %, con vencimiento el 17/01/2043	336	0,75	250 Morgan Stanley, 5,789 %, con vencimiento el 18/11/2033 *	243	0,54
310 National Gas Transmission Plc, 1,375 %, con vencimiento el 07/02/2031	225	0,50	280 Netflix Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/11/2029	237	0,53
100 National Gas Transmission Plc, 5,750 %, con vencimiento 05/04/2035	97	0,22	290 New York Life Global Funding, 4,350 %, con vencimiento el 16/09/2025	281	0,63
275 National Grid Electricity Distribution East Midlands Plc, 6,250 %, con vencimiento el 10/12/2040	283	0,63	290 Omnicom Capital Holdings Plc, 2,250 %, con vencimiento el 22/11/2033	212	0,47
250 National Grid Electricity Transmission Plc, 2,000 %, con vencimiento el 17/04/2040	149	0,33	210 PepsiCo Inc, 3,200 %, con vencimiento el 22/07/2029	189	0,42
100 Nationwide Building Society, 3,000 %, con vencimiento el 06/05/2026	93	0,21	100 PepsiCo Inc, 3,550 %, con vencimiento el 22/07/2034	87	0,19
150 Nationwide Building Society, 6,178 %, con vencimiento el 07/12/2027 *	148	0,33	190 Realty Income Corp, 1,875 %, con vencimiento el 14/01/2027	165	0,37
206 Nationwide Building Society, 3,250 %, con vencimiento el 20/01/2028	186	0,41	265 Time Warner Cable LLC, 5,750 %, con vencimiento el 02/06/2031	247	0,55
230 NatWest Group Plc, 3,125 %, con vencimiento el 28/03/2027 *	211	0,47	200 Toyota Motor Credit Corp, 0,750 %, con vencimiento el 19/11/2026	173	0,38
270 NatWest Group Plc, 3,619 %, con vencimiento el 29/03/2029 *	238	0,53	590 Verizon Communications Inc, 1,875 %, con vencimiento el 19/09/2030	458	1,02
190 NatWest Group Plc, 2,105 %, con vencimiento el 28/11/2031 *	161	0,36	110 Verizon Communications Inc, 2,500 %, con vencimiento el 08/04/2031	88	0,20
190 NatWest Markets Plc, 6,375 %, con vencimiento el 08/11/2027	191	0,42	26 Walmart Inc, 5,250 %, con vencimiento el 28/09/2035	26	0,06
180 Northern Gas Networks Finance Plc, 6,125 %, con vencimiento el 02/06/2033	181	0,40	410 Wells Fargo & Co, 3,473 %, con vencimiento el 26/04/2028 *	369	0,82
110 Northern Powergrid Northeast Plc, 3,250 %, con vencimiento el 01/04/2052	74	0,17	650 Wells Fargo & Co, 4,875 %, con vencimiento el 29/11/2035	556	1,24
120 Notting Hill Genesis, 2,875 %, con vencimiento el 31/01/2029	104	0,23		8.115	18,07
140 Onward Homes Ltd, 2,125 %, con vencimiento el 25/03/2053	70	0,16	Total de bonos y pagarés corporativos (coste 49.272£)		
240 Paragon Treasury Plc, 2,000 %, con vencimiento el 07/05/2036	157	0,35	Bonos y obligaciones del Estado — 3,42% (28 de febrero de 2023: 1,62%)		
170 Rentokil Initial Plc, 5,000 %, con vencimiento el 27/06/2032	160	0,36	Reino Unido — 3,38 % (28 de febrero de 2023: 0,87%)		
190 Sanctuary Capital Plc, 2,375 %, con vencimiento el 14/04/2050	107	0,24	210 United Kingdom Gilt, 1,500 %, con vencimiento el 22/07/2026	193	0,43
440 Santander UK Group Holdings Plc, 2,920 %, con vencimiento el 08/05/2026 *	411	0,92	230 United Kingdom Gilt, 0,375 %, con vencimiento el 22/10/2026	202	0,45
170 Santander UK Plc, 5,750 %, con vencimiento el 02/03/2026	171	0,38	270 United Kingdom Gilt, 4,250 %, con vencimiento el 07/12/2027	267	0,59
198 Scottish Widows Ltd, 7,000 %, con vencimiento el 16/06/2043	193	0,43	160 United Kingdom Gilt, 0,125 %, con vencimiento el 31/01/2028	133	0,30
350 Segro Plc, 2,875 %, con vencimiento el 11/10/2037	250	0,56	140 United Kingdom Gilt, 1,625 %, con vencimiento el 22/10/2028	122	0,27
140 Severn Trent Utilities Finance Plc, 2,625 %, con vencimiento el 22/02/2033	108	0,24	220 United Kingdom Gilt, 0,500 %, con vencimiento el 31/01/2029	178	0,40
120 Severn Trent Utilities Finance Plc, 4,625 %, con vencimiento el 30/11/2034	108	0,24	190 United Kingdom Gilt, 4,250 %, con vencimiento el 07/12/2040	182	0,40
180 Severn Trent Utilities Finance Plc, 2,000 %, con vencimiento el 02/06/2040	105	0,23	620 United Kingdom Gilt, 0,625 %, con vencimiento el 22/10/2050	243	0,54
191 Southern Gas Networks Plc, 2,500 %, con vencimiento el 03/02/2025	182	0,41		1.520	3,38
430 Tesco Corporate Treasury Services Plc, 1,875 %, con vencimiento el 02/11/2028	354	0,79	Estados Unidos — 0,04 % (28 de febrero de 2023: 0,75%)		
170 Tesco Corporate Treasury Services Plc, 5,500 %, con vencimiento el 27/02/2035	159	0,35	USD 30 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, con vencimiento el 15/11/2041	17	0,04
199 Tesco Property Finance 3 Plc, 5,744 %, con vencimiento el 13/04/2040	186	0,41	Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 1.589£)	1.537	3,42
324 Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, con vencimiento el 13/07/2044	292	0,65	Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 50.861£)	43.046	95,87
190 UNITE Group Plc/The, 3,500 %, con vencimiento el 15/10/2028	166	0,37	Contratos de divisas a plazo — 0,02 % (28 de febrero de 2023: 0,06%)		
250 UNITE USAF II Plc, 3,921 %, con vencimiento el 30/06/2025	238	0,53	Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	8	0,02
140 United Utilities Water Finance Plc, 5,125 %, con vencimiento el 06/10/2038	129	0,29	Futuros — 0,20% (28 de febrero de 2023: 0,10%)		
170 Universidad de Oxford, 2,544 %, con vencimiento el 08/12/2117	86	0,19	Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	90	0,20
210 Vodafone Group Plc, 5,125 %, con vencimiento el 02/12/2052	178	0,40	Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	43.144	96,09
110 Weir Group Plc/The, 6,875 %, con vencimiento el 14/06/2028	111	0,25	Contratos de divisas a plazo — (0,03%) (28 de febrero de 2023: 0,02%)		
160 Wellcome Trust Ltd/The, 2,517 %, con vencimiento el 07/02/2118	81	0,18	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(11)	(0,03)
470 Whitbread Group Plc, 2,375 %, con vencimiento el 31/05/2027	403	0,90	Futuros — (0,05%) (28 de febrero de 2023: 0,07%)		
180 Yorkshire Building Society, 3,500 %, con vencimiento el 21/04/2026	169	0,38	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(24)	(0,05)
140 Yorkshire Building Society, 3,511 %, con vencimiento el 11/10/2030 *	117	0,26	Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	(35)	(0,08)
	18.317	40,79	Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	43.109	96,01
Estados Unidos — 18,07 % (28 de febrero de 2023: 18,87%)			Excedente de otros activos respecto a los pasivos	1.792	3,99
USD 100 Apache Corp, 4,750 %, con vencimiento el 15/04/2043	60	0,13	Patrimonio	44.901£	100,00
383 AT&T Inc, 4,250 %, con vencimiento el 01/06/2043	290	0,65			
USD 450 Bank of America Corp, 4,948 %, con vencimiento el 22/07/2028 *	348	0,78			
360 Bank of America Corp, 3,584 %, con vencimiento el 27/04/2031 *	310	0,69			
180 Becton Dickinson & Co, 3,020 %, con vencimiento el 24/05/2025	172	0,38			
260 Berkshire Hathaway Finance Corp, 2,625 %, con vencimiento el 19/06/2059	150	0,33			
329 Citigroup Inc, 7,375 %, con vencimiento el 01/09/2039	380	0,85			
170 Comcast Corp, 1,500 %, con vencimiento el 20/02/2029	140	0,31			
USD 60 CVS Health Corp, 4,125 %, con vencimiento el 01/04/2040	39	0,09			
220 Experian Finance Plc, 0,739 %, con vencimiento el 29/10/2025	198	0,44			
170 Experian Finance Plc, 3,250 %, con vencimiento el 07/04/2032	144	0,32			
240 GE Capital UK Funding Unlimited Co, 5,875 %, con vencimiento el 18/01/2033	237	0,53			
400 General Motors Financial Co Inc, 2,350 %, con vencimiento el 03/09/2025	371	0,83			
309 Goldman Sachs Group Inc/The, 7,125 %, con vencimiento el 07/08/2025	314	0,70			
280 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,125 %, con vencimiento el 25/07/2029	240	0,54			
110 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,875 %, con vencimiento el 18/01/2038	110	0,24			
210 Haleson UK Capital Plc, 3,375 %, con vencimiento el 29/03/2038	161	0,36			
USD 310 JPMorgan Chase & Co, 4,912 %, con vencimiento el 25/07/2033 *	236	0,52			
100 McDonald's Corp, 2,950 %, con vencimiento el 15/03/2034	80	0,18			
180 McDonald's Corp, Serie gmtn, 3,750 %, con vencimiento el 31/05/2038	145	0,32			
92 MetLife Inc, 5,375 %, con vencimiento el 09/12/2024	91	0,20			
230 Metropolitan Life Global Funding I, 5,000 %, con vencimiento eo 10/01/2030	222	0,49			
120 Mondelez International Inc, 4,500 %, con vencimiento el 03/12/2035	104	0,23			
USD 320 Morgan Stanley, 4,210 %, con vencimiento el 20/04/2028 *	242	0,54			

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)			Moneda de venta (en miles)			Apreciación / (Depreciación) latente de contratos (en miles)
16 nov. 2023	Citi	Compra	GBP	99	Venta	JPY	17.754	£ 2
16 nov. 2023	Citi	Compra	GBP	62	Venta	USD	80	–
16 nov. 2023	Goldman Sachs	Compra	GBP	1.195	Venta	USD	1.525	(9)
16 nov. 2023	JP Morgan	Compra	GBP	204	Venta	USD	260	(2)
16 nov. 2023	UBS	Compra	GBP	831	Venta	EUR	960	6
16 nov. 2023	UBS	Compra	GBP	24	Venta	USD	30	–
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): 27£								£ 8
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): £(7)								(11)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 20£)								£ (3)

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico (miles)	Apreciación / (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Euro-Bund Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	10	£ 1.135	£ 11
Japan 10 Year Bond (OSE) Septiembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(2)	(1.593)	12
Long Gilt Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	19	1.816	33
U.S. 10 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(23)	(2.016)	(17)
U.S. 5 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	44	3.714	22
U.S. Long Bond (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	7	672	12
U.S. Ultra Bond (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(3)	(306)	(7)
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): 45£				£ 90
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): £(29)				(24)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): 16£				£ 66

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por activos — 0,70% (28 de febrero de 2023: 0,19%)					
175 SMB Private Education Loan Trust 2020-A, Serie 2020 A, Clase A2A, 144A, 2,230 %, con vencimiento el 15/09/2037	161	0,29	840 ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750 %, vencimiento 29/04/2025	818	1,48
230 Texas Natural Gas Securitization Finance Corp, Serie 2023 1, Clase A1, 5,102 %, con vencimiento el 01/04/2035	229	0,41		842	1,52
Total de valores garantizados por activos (coste 4105)	390	0,70	Irlanda — 0,62 % (28 de febrero de 2023: 1,18%)		
Bonos y obligaciones corporativos — 102,56% (28 de febrero de 2023: 96,16%)					
Australia — 0,35 % (28 de febrero de 2023: 0,59%)					
60 CSL Finance Plc, 144A, 4,050 %, con vencimiento el 27/04/2029	57	0,10	150 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,500 %, con vencimiento el 15/09/2023	150	0,27
40 Westpac Banking Corp, 2,668 %, con vencimiento el 15/11/2035	31	0,06	180 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,850 %, con vencimiento el 29/10/2041	132	0,24
60 Westpac Banking Corp, 3,020 %, con vencimiento el 18/11/2036 *	46	0,08	60 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 5,125 %, vencimiento 01/10/2023	60	0,11
90 Westpac Banking Corp, 3,133 %, con vencimiento el 18/11/2041	58	0,11		342	0,62
	192	0,35	Israel — 0,10% (28 de febrero de 2023: 0,15%)		
Bélgica — 0,40% (28 de febrero de 2023: 0,22%)					
240 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, con vencimiento el 15/04/2048	214	0,38	60 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, con vencimiento el 01/10/2026	54	0,10
10 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, con vencimiento el 23/01/2049	10	0,02			
	224	0,40	Italia — 1,64 % (28 de febrero de 2023: 1,76%)		
Bermuda — 0,55 % (28 de febrero de 2023: 0,49%)					
290 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, vencimiento 15/10/2025	275	0,50	240 Enel Finance International NV, 144A, 6,800 %, con vencimiento el 14/10/2025	245	0,44
30 RenaissanceRe Holdings Ltd, 5,750 %, con vencimiento el 05/06/2033	29	0,05	260 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, con vencimiento el 26/06/2024	254	0,46
	304	0,55	200 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 21/11/2025	203	0,37
Brasil — 0,13 % (28 de febrero de 2023: 0,16%)					
90 Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125 %, con vencimiento el 15/01/2032	71	0,13	310 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,950 %, con vencimiento el 01/06/2042 *	205	0,37
				907	1,64
Canadá — 2,79 % (28 de febrero de 2023: 2,80%)					
59 Air Canada 2015-2 Class B Pass Through Trust, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 15/12/2023	59	0,11	Japón — 1,32 % (28 de febrero de 2023: 1,86%)		
100 Bank of Nova Scotia/The, 3,450 %, con vencimiento el 11/04/2025	97	0,17	550 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,043 %, vencimiento 15/09/2023	550	0,99
20 Bank of Nova Scotia/The, 4,588 %, con vencimiento el 04/05/2037 *	17	0,03	200 NTT Finance Corp, 144A, 1,162 %, con vencimiento el 03/04/2026	180	0,33
200 Bank of Nova Scotia/The, 8,625 %, con vencimiento el 27/10/2082 *	203	0,37		730	1,32
80 Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, con vencimiento el 30/05/2041	79	0,14	Kazajistán — 0,27 % (28 de febrero de 2023: 0,16%)		
70 Canadian Pacific Railway Co, 3,100 %, con vencimiento el 02/12/2051	47	0,08	200 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 3,500 %, con vencimiento el 14/04/2033	151	0,27
320 CI Financial Corp, 3,200 %, con vencimiento el 17/12/2030	246	0,44	Luxemburgo — 0,17% (28 de febrero de 2023: 0,15%)		
60 Element Fleet Management Corp, 144A, 1,600 %, con vencimiento el 06/04/2024	58	0,11	60 ArcelorMittal SA, 6,550 %, con vencimiento el 29/11/2027	61	0,11
40 GFL Environmental Inc, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 15/12/2026	39	0,07	30 ArcelorMittal SA, 7,000 %, con vencimiento el 15/10/2039	31	0,06
30 MEG Energy Corp, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 01/02/2027	30	0,06		92	0,17
300 Royal Bank of Canada, 1,150 %, con vencimiento el 14/07/2026	267	0,48	Macao — 2,35% (28 de febrero de 2023: 2,59%)		
30 Teck Resources Ltd, 3,900 %, con vencimiento el 15/07/2030	27	0,05	200 Sands China Ltd, 4,300 %, con vencimiento el 08/01/2026	188	0,34
120 Teck Resources Ltd, 6,250 %, con vencimiento el 15/07/2041	116	0,21	200 Sands China Ltd, 5,650 %, con vencimiento el 08/08/2028	190	0,34
20 TransAlta Corp, 6,500 %, con vencimiento el 15/03/2040	19	0,03	270 Sands China Ltd, 3,100 %, con vencimiento el 08/03/2029	225	0,41
140 Alphabet Inc, 4,625 %, con vencimiento el 15/12/2027	132	0,24	200 Sands China Ltd, 4,875 %, con vencimiento el 18/06/2030	176	0,32
140 Alphabet Inc, 2,630 %, con vencimiento el 15/08/2031	110	0,20	200 Sands China Ltd, 4,875 %, con vencimiento el 18/06/2030	176	0,32
	1.546	2,79	350 Wynn Macau Ltd, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 01/10/2024	343	0,62
				1.298	2,35
China — 1,00 % (28 de febrero de 2023: 0,77%)					
240 Alibaba Group Holdings Ltd, 3,150 %, vencimiento 09/02/2051	144	0,26	México — 0,68 % (28 de febrero de 2023: 0,62%)		
240 BOC Aviation USA Corp, 144A, 1,625 %, con vencimiento el 29/04/2024	233	0,42	200 Banco Mercantil del Norte SA/Gran Caimán, 144A, 8,375 %, Perpetuo *	195	0,35
260 Tencent Holdings Ltd, 144A, 3,840 %, con vencimiento el 22/04/2051	176	0,32	220 Fresnillo Plc, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 02/10/2050	161	0,29
	553	1,00	20 Southern Copper Corp, 5,250 %, con vencimiento el 08/11/2042	18	0,04
				374	0,68
Dinamarca — 2,08 % (28 de febrero de 2023: 1,82%)					
200 Danske Bank A/S, 144A, 0,976 %, con vencimiento el 10/09/2025 *	189	0,34	Países Bajos — 1,22 % (28 de febrero de 2023: 1,13%)		
200 Danske Bank A/S, 144A, 3,244 %, con vencimiento el 20/12/2025 *	191	0,35	250 Cooperatieve Rabobank UA, 4,375 %, con vencimiento el 04/08/2025	242	0,44
200 Danske Bank A/S, 144A, 6,466 %, con vencimiento el 09/01/2026 *	200	0,36	440 Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 3,758 %, con vencimiento el 06/04/2033 *	377	0,68
200 Danske Bank A/S, 144A, 1,549 %, con vencimiento el 10/09/2027 *	176	0,32	50 Shell International Finance BV, 4,375 %, con vencimiento el 11/05/2045	43	0,08
420 Danske Bank A/S, 144A, 4,298 %, con vencimiento el 01/04/2028 *	395	0,71	20 Shell International Finance BV, 3,250 %, con vencimiento el 06/04/2050	14	0,02
	1.151	2,08		676	1,22
Francia — 6,58 % (28 de febrero de 2023: 4,69%)					
200 BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, con vencimiento el 09/06/2026 *	187	0,34	Sudáfrica — 1,12% (28 de febrero de 2023: 0,44%)		
370 BNP Paribas SA, 144A, 1,675 %, con vencimiento el 30/06/2027 *	330	0,60	200 Anglo American Capital Plc, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 11/09/2024	196	0,35
340 BNP Paribas SA, 144A, 2,159 %, con vencimiento el 15/09/2029 *	284	0,51	240 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 15/03/2028	228	0,41
200 BNP Paribas SA, 144A, 8,500 %, Perpetuo *	200	0,36	200 Sasol Financing USA LLC, 144A, 8,750 %, con vencimiento el 03/05/2029	196	0,36
520 BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, Perpetuo *	504	0,91		620	1,12
200 BNP Paribas SA, 144A, 9,250 %, Perpetuo *	206	0,37	España — 1,01 % (28 de febrero de 2023: 0,56%)		
200 BPCE SA, 144A, 5,700 %, con vencimiento el 22/10/2023	199	0,36	200 Banco Santander SA, 1,722 %, con vencimiento el 14/09/2027 *	176	0,31
370 BPCE SA, 144A, 3,116 %, con vencimiento el 19/10/2032 *	285	0,52	200 Banco Santander SA, 4,175 %, con vencimiento el 24/03/2028 *	187	0,34
250 Credit Agricole SA, 144A, 5,589 %, con vencimiento el 05/07/2026	250	0,45	200 Banco Santander SA, 6,921 %, con vencimiento el 08/08/2033	199	0,36
250 Credit Agricole SA, 144A, 5,514 %, con vencimiento el 05/07/2033	247	0,45		562	1,01
400 Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Perpetuo *	400	0,72	Supranacional — 0,33% (28 de febrero de 2023: 0,19%)		
430 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 3,750 %, con vencimiento el 17/09/2024	410	0,74	200 African Export-Import Bank/The, 144A, 2,634 %, con vencimiento el 17/05/2026	180	0,33
200 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 17/09/2044	135	0,24	Suecia — 0,44 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)		
	3.637	6,58	250 Svenska Handelsbanken AB, 144A, 3,650 %, con vencimiento el 10/06/2025	241	0,44
Alemania — 1,52 % (28 de febrero de 2023: 0,89%)					
20 Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750 %, con vencimiento el 15/06/2030	24	0,04	Suiza — 1,61 % (28 de febrero de 2023: 5,06%)		
			300 UBS Group AG, 144A, 4,751 %, con vencimiento el 12/05/2028 *	288	0,52
			250 UBS Group AG, 144A, 9,016 %, con vencimiento el 15/11/2033 *	301	0,54
			200 UBS Group AG, 144A, 3,179 %, con vencimiento el 11/02/2043 *	137	0,25
			200 UBS Group AG, 144A, 4,875 %, Perpetuo *	167	0,30
				893	1,61

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y pagarés corporativos (continuación)					
Estados Unidos — (continuación)					
240 Metropolitan Life Global Funding I, 144A, 5,150 %, con vencimiento el 28/03/2033	233	0,42	220 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,750%, vencimiento 19/05/2033	215	0,39
110 Micron Technology Inc, 2,703 %, con vencimiento el 15/04/2032	86	0,16	190 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 5,110%, vencimiento 19/05/2043	183	0,33
40 Micron Technology Inc, 5,875 %, con vencimiento el 09/02/2033	39	0,07	100 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 5,300%, vencimiento 19/05/2053	99	0,18
44 Microsoft Corp, 3,450 %, con vencimiento el 08/08/2036	39	0,07	20 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 5,340%, vencimiento 19/05/2063	19	0,04
39 Microsoft Corp, 2,921 %, con vencimiento el 17/03/2052	27	0,05	90 Pilgrim's Pride Corp, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 30/09/2027	89	0,16
184 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 20/06/2027	183	0,33	50 Pioneer Natural Resources Co, 5,100 %, con vencimiento el 29/03/2026	50	0,09
20 Molson Coors Beverage Co, 3,000 %, con vencimiento el 15/07/2026	19	0,03	60 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, con vencimiento el 15/01/2031	48	0,09
30 Molson Coors Beverage Co, 4,200%, vencimiento 15/07/2046	23	0,04	50 Plains All American Pipeline LP, Serie B, 9,736%, Perpetuo*	46	0,08
20 Mondelez International Inc, 2,625 %, con vencimiento el 04/09/2050	12	0,02	40 Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 6,700%, vencimiento 15/05/2036	39	0,07
570 Morgan Stanley, Serie I, 0,864 %, con vencimiento el 21/10/2025 *	536	0,97	120 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,812 %, con vencimiento el 12/06/2026 *	120	0,22
130 Morgan Stanley, 2,188 %, con vencimiento el 28/04/2026 *	123	0,22	30 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,582 %, con vencimiento el 12/06/2029 *	30	0,05
390 Morgan Stanley, 0,985 %, con vencimiento el 10/12/2026 *	350	0,63	110 PNC Financial Services Group Inc/The, Serie W, 6,250 %, Perpetuo *	97	0,18
30 Morgan Stanley, 1,593 %, con vencimiento el 04/05/2027 *	27	0,05	70 Prologis LP, 1,250 %, con vencimiento el 15/10/2030	54	0,10
150 Morgan Stanley, 5,449 %, con vencimiento el 20/07/2029 *	149	0,27	10 Prudential Financial Inc, 6,750 %, con vencimiento el 01/03/2053 *	10	0,02
50 Morgan Stanley, 1,794 %, con vencimiento el 13/02/2032 *	38	0,07	30 QUALCOMM Inc, 4,500 %, con vencimiento el 20/05/2052	26	0,05
90 Morgan Stanley, 2,239 %, con vencimiento el 21/07/2032 *	70	0,13	210 QVC Inc, 4,850 %, con vencimiento el 01/04/2024	204	0,37
50 Morgan Stanley, 6,342 %, con vencimiento el 18/10/2033 *	52	0,09	61 Range Resources Corp, 4,875 %, con vencimiento el 15/05/2025	60	0,11
100 Morgan Stanley, 2,484 %, con vencimiento el 16/09/2036 *	75	0,14	80 Range Resources Corp, 8,250 %, con vencimiento el 15/01/2029	83	0,15
110 Morgan Stanley, 5,297 %, con vencimiento el 20/04/2037 *	102	0,18	50 Raymond James Financial Inc, 4,950 %, con vencimiento el 15/07/2046	43	0,08
110 Morgan Stanley, 5,948 %, con vencimiento el 19/01/2038 *	97	0,18	350 Regal Rexnord Corp, 144A, 6,050 %, con vencimiento el 15/02/2026	348	0,63
20 MPLX LP, 4,800 %, con vencimiento el 15/02/2029	19	0,03	50 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 2,875 %, con vencimiento el 15/10/2026	45	0,08
120 MPLX LP, 5,000 %, con vencimiento el 01/03/2033	112	0,20	30 S&P Global Inc, 1,250 %, con vencimiento el 15/08/2030	23	0,04
170 MPLX LP, 4,500 %, con vencimiento el 15/04/2038	143	0,26	20 S&P Global Inc, 3,250 %, con vencimiento el 01/12/2049	14	0,03
290 National General Holdings Corp, Serie 0000, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 15/05/2024	289	0,52	60 Salesforce Inc, 1,500 %, con vencimiento el 15/07/2028	52	0,09
60 New York Life Global Funding, 144A, 4,550 %, con vencimiento el 28/01/2033	57	0,10	80 San Diego Gas & Electric Co, Serie VVV, 1,700 %, con vencimiento el 01/10/2030	63	0,11
60 New York Life Insurance Co, 144A, 3,750 %, con vencimiento el 15/05/2050	44	0,08	80 San Diego Gas & Electric Co, Serie RRR, 3,750%, vencimiento 01/06/2047	60	0,11
140 Newell Brands Inc, 4,000 %, con vencimiento el 01/12/2024	136	0,25	170 SCE Recovery Funding LLC, Serie A-1, 4,697 %, con vencimiento el 15/06/2040	163	0,30
30 NextEra Energy Operating Partners LP, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 15/07/2024	29	0,05	90 Southern California Edison Co, 2,250 %, con vencimiento el 01/06/2030	74	0,13
170 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 1,050 %, con vencimiento el 08/03/2024	165	0,30	90 Southern California Edison Co, Serie G, 2,500 %, con vencimiento el 01/06/2031	74	0,13
60 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 2,750 %, con vencimiento el 09/03/2028	51	0,09	10 Southern California Edison Co, 4,000 %, con vencimiento el 01/04/2047	8	0,01
180 Nordstrom Inc, 2,300 %, con vencimiento el 08/04/2024	175	0,32	180 Southern California Edison Co, Serie C, 4,125 %, con vencimiento el 01/03/2048	140	0,25
120 Norfolk Southern Railway Co, 7,875 %, con vencimiento el 15/05/2043	143	0,26	70 Southern California Edison Co, 3,650 %, con vencimiento el 01/02/2050	50	0,09
80 Northwest Pipeline LLC, 7,125 %, con vencimiento el 01/12/2025	82	0,15	40 Southwestern Energy Co, 8,375 %, con vencimiento el 15/09/2028	42	0,08
260 Northwest Pipeline LLC, 4,000 %, con vencimiento el 01/04/2027	247	0,45	150 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 20/09/2025	150	0,27
60 Northwestern Mutual Life Insurance Co/The, 144A, 3,850 %, con vencimiento el 30/09/2047	45	0,08	110 Targa Resources Corp, 5,200 %, con vencimiento el 01/07/2027	109	0,20
10 Northwestern Mutual Life Insurance Co/The, 144A, 3,625%, vencimiento 30/09/2059	7	0,01	70 Targa Resources Corp, 4,200 %, con vencimiento el 01/02/2033	61	0,11
90 Nuveen LLC, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 01/11/2028	84	0,15	90 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 6,875 %, con vencimiento el 15/01/2029	91	0,16
20 NVIDIA Corp, 3,500 %, con vencimiento el 01/04/2040	16	0,03	70 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, con vencimiento el 01/02/2031	64	0,12
20 NVIDIA Corp, 3,700 %, con vencimiento el 01/04/2060	16	0,03	120 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, con vencimiento el 15/01/2032	104	0,19
50 Occidental Petroleum Corp, 3,400 %, con vencimiento el 15/04/2026	47	0,09	260 TD SYNEX Corp, 1,250 %, con vencimiento el 09/08/2024	248	0,45
90 Occidental Petroleum Corp, 7,875 %, con vencimiento el 15/09/2031	99	0,18	70 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 4,270 %, con vencimiento el 15/05/2047	56	0,10
50 Occidental Petroleum Corp, 7,950 %, con vencimiento el 15/06/2039	56	0,10	190 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 7,000 %, con vencimiento el 15/03/2027	198	0,36
30 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, con vencimiento el 15/04/2046	23	0,04	240 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 7,000 %, con vencimiento el 15/10/2028	254	0,46
100 Ohio Edison Co, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/01/2033	98	0,18	20 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, con vencimiento el 01/03/2030	17	0,03
110 Ohio Edison Co, 6,875 %, con vencimiento el 15/07/2036	119	0,22	40 Texas Instruments Inc, 2,250 %, con vencimiento el 04/09/2029	35	0,06
30 Oncor Electric Delivery Co LLC, 4,150 %, con vencimiento el 01/06/2032	28	0,05	144 Time Warner Cable Enterprises LLC, 8,375 %, con vencimiento el 15/07/2033	103	0,19
10 Oncor Electric Delivery Co LLC, 3,100 %, con vencimiento el 15/09/2049	7	0,01	150 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, con vencimiento el 01/07/2038	160	0,29
190 ONEOK Inc, 6,050 %, con vencimiento el 01/09/2033	191	0,34	90 Time Warner Cable LLC, 6,750 %, con vencimiento el 15/06/2039	151	0,27
150 ONEOK Inc, 6,625 %, con vencimiento el 01/09/2053	150	0,27	20 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, con vencimiento el 15/02/2029	17	0,03
160 Oracle Corp, 6,250 %, con vencimiento el 09/11/2032	166	0,30	110 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, con vencimiento el 15/02/2031	90	0,16
140 Oracle Corp, 4,000 %, con vencimiento el 15/07/2046	104	0,19	70 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, con vencimiento el 15/11/2031	55	0,10
40 Oracle Corp, 6,900 %, con vencimiento el 09/11/2052	43	0,08	280 T-Mobile USA Inc, 2,700 %, con vencimiento el 15/03/2032	226	0,41
140 Oracle Corp, 5,550 %, con vencimiento el 06/02/2053	129	0,23	20 T-Mobile USA Inc, 4,375 %, con vencimiento el 15/04/2040	17	0,03
210 Pacific Gas and Electric Co, 3,150 %, con vencimiento el 01/01/2026	196	0,35	80 T-Mobile USA Inc, 3,000 %, con vencimiento el 15/02/2041	56	0,10
70 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, con vencimiento el 01/08/2027	60	0,11	60 T-Mobile USA Inc, 3,300 %, con vencimiento el 15/02/2051	40	0,07
100 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, con vencimiento el 01/12/2027	89	0,16	270 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,250 %, con vencimiento el 01/12/2026	277	0,50
30 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2031	23	0,04	30 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 4,450 %, con vencimiento el 01/08/2042	25	0,04
10 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, con vencimiento el 01/08/2040	7	0,01	60 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,950 %, con vencimiento el 15/05/2050	44	0,08
60 Pacific Gas and Electric Co, 4,750 %, con vencimiento el 15/02/2044	45	0,08	130 Truist Financial Corp, 1,267 %, con vencimiento el 02/03/2027 *	116	0,21
40 Pacific Gas and Electric Co, 4,950 %, con vencimiento el 01/07/2050	31	0,06	70 Truist Financial Corp, 6,047 %, con vencimiento el 08/06/2027 *	70	0,13
80 Pacific Gas and Electric Co, 6,700 %, con vencimiento el 01/04/2053	77	0,14	60 Truist Financial Corp, 5,867 %, con vencimiento el 08/06/2034 *	59	0,11
170 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 15/02/2028	159	0,29			
120 PayPal Holdings Inc, 2,300 %, con vencimiento el 01/06/2030	100	0,18			
10 PayPal Holdings Inc, 4,400 %, con vencimiento el 01/06/2032	9	0,02			
10 PayPal Holdings Inc, 3,250 %, con vencimiento el 01/06/2050	7	0,01			
20 PayPal Holdings Inc, 5,250 %, con vencimiento el 01/06/2062	19	0,03			
40 Pennsylvania Electric Co, 144A, 5,150 %, con vencimiento el 30/03/2026	39	0,07			
40 Pfizer Inc, 2,550 %, con vencimiento el 28/05/2040	28	0,05			
30 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,450 %, con vencimiento el 19/05/2028	29	0,05			
60 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,650 %, con vencimiento 19/05/2030	59	0,11			

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y pagarés corporativos (continuación)			Estados Unidos — 0,27 % (28 de febrero de 2023: 0,05%)		
Estados Unidos — (continuación)			Estados Unidos — 0,27 % (28 de febrero de 2023: 0,05%)		
40 Union Pacific Corp, 2,973 %, con vencimiento el 16/09/2062	24	0,04	110 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2033	107	0,19
30 Union Pacific Corp, 3,750 %, con vencimiento el 05/02/2070	22	0,04	50 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 15/05/2053	45	0,08
129 United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, 4,875 %, con vencimiento el 15/01/2026	126	0,23		152	0,27
230 United Airlines 2023-1 Class A Pass Through Trust, 5,800 %, con vencimiento el 15/01/2036	229	0,41	Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 1.145\$)	1.028	1,86
50 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, con vencimiento el 15/05/2030	41	0,08	Obligaciones de préstamo — 0,49% (28 de febrero de 2023: 0,34%)		
310 UnitedHealth Group Inc, 5,350 %, con vencimiento el 15/02/2033	316	0,57	128 SkyMiles IP Ltd, 9,076 %, con vencimiento el 16/09/2027 *	133	0,24
90 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, con vencimiento el 15/05/2040	64	0,12	140 United Airlines Inc, 9,292 %, con vencimiento el 14/04/2028 *	140	0,25
40 UnitedHealth Group Inc, 4,750 %, con vencimiento el 15/07/2045	37	0,07	Total de obligaciones de préstamo (coste 266\$)	273	0,49
30 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, con vencimiento el 15/12/2048	26	0,05	Municipal Bonds — 1,23 % (28 de febrero de 2023: 0,74%)		
40 UnitedHealth Group Inc, 5,875 %, con vencimiento el 15/02/2053	42	0,08	50 Autoridad de Liquidación Económica de Alabama, 3,163 %, con vencimiento el 15/09/2025	49	0,09
171 US Airways 2012-2 Class A Pass Through Trust, 4,625 %, con vencimiento el 03/06/2025	165	0,30	150 American Municipal Power Inc, 7,834 %, con vencimiento el 15/02/2041	183	0,33
80 US Bancorp, 5,775 %, con vencimiento el 12/06/2029 *	80	0,14	150 Port Authority of New York & New Jersey, 4,458 %, con vencimiento el 01/10/2062	132	0,24
90 Verizon Communications Inc, 1,500 %, con vencimiento el 18/09/2030	70	0,13	160 Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue, 4,132%, vencimiento 15/05/2032	149	0,27
30 Verizon Communications Inc, 2,650 %, con vencimiento el 20/11/2040	20	0,04	100 Estado de California, 7,300 %, con vencimiento el 01/10/2039	117	0,21
40 Verizon Communications Inc, 6,550 %, con vencimiento el 15/09/2043	44	0,08	50 State of Illinois, 5,100 %, con vencimiento el 01/06/2033	48	0,09
30 Verizon Communications Inc, 4,000 %, con vencimiento el 22/03/2050	23	0,04	Total Municipal Bonds (coste de 735 USD)	678	1,23
30 Verizon Communications Inc, 2,987 %, con vencimiento el 30/10/2056	18	0,03	Organismos de inversión colectiva — 1,36% (28 de febrero de 2023: 0,00%)		
30 Visa Inc, 2,700 %, con vencimiento el 15/04/2040	22	0,04	750 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	750	1,36
90 Vontier Corp, 1,800 %, con vencimiento el 01/04/2026	81	0,15	Total de organismos de inversión colectiva (coste: 750\$)	750	1,36
180 Vontier Corp, 2,400 %, con vencimiento el 01/04/2028	150	0,27	Acciones ordinarias — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)		
60 Walmart Inc, 2,650 %, con vencimiento el 22/09/2051	40	0,07	Suiza — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)		
20 Walt Disney Co/The, 6,200 %, con vencimiento el 15/12/2034	22	0,04	1.570 Credit Suisse Group AG Escrow †	–	–
23 Walt Disney Co/The, 6,400 %, con vencimiento el 15/12/2035	25	0,05	Total de acciones ordinarias (coste USD–)	–	–
20 Walt Disney Co/The, 6,650 %, con vencimiento el 15/11/2037	22	0,04	Acciones preferentes — 0,35% (28 de febrero de 2023: 0,27%)		
30 Walt Disney Co/The, 5,400 %, con vencimiento el 01/10/2043	30	0,05	Estados Unidos — 0,35 % (28 de febrero de 2023: 0,27%)		
10 Walt Disney Co/The, 4,950 %, con vencimiento el 15/10/2045	9	0,02	8 KeyCorp	165	0,30
20 Warnermedia Holdings Inc, 4,279 %, con vencimiento el 15/03/2032	17	0,03	1 Prudential Financial Inc	27	0,05
100 Warnermedia Holdings Inc, 5,050 %, con vencimiento el 15/03/2042	81	0,15		192	0,35
80 Warnermedia Holdings Inc, 5,141 %, con vencimiento el 15/03/2052	62	0,11	Total de acciones preferentes (coste de 232\$)	192	0,35
110 Wells Fargo & Co, 2,406 %, con vencimiento el 30/10/2025 *	106	0,19	Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 66.471\$)		
120 Wells Fargo & Co, 4,540 %, con vencimiento el 15/08/2026 *	117	0,21	60.019	108,55	
10 Wells Fargo & Co, 3,000 %, con vencimiento el 23/10/2026	9	0,02	Contratos de divisas a plazo — 0,27 % (28 de febrero de 2023: 0,04%)		
10 Wells Fargo & Co, 3,196 %, con vencimiento el 17/06/2027 *	9	0,02	Apresiasi latente sobre contratos (véase más abajo)		
80 Wells Fargo & Co, 3,584 %, con vencimiento el 22/05/2028 *	74	0,13	Futuros — 0,09% (28 de febrero de 2023: 0,01%)		
50 Wells Fargo & Co, 5,574 %, con vencimiento el 25/07/2029 *	50	0,09	Apresiasi latente sobre contratos (véase más abajo)		
151 Wells Fargo & Co, 5,389 %, con vencimiento el 24/04/2034 *	146	0,26	50	0,09	
90 Wells Fargo & Co, 5,557 %, con vencimiento el 25/07/2034 *	88	0,16	Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
60 Wells Fargo & Co, 3,068 %, con vencimiento el 30/04/2041 *	43	0,08	60.216	108,91	
120 Wells Fargo & Co, 4,750 %, con vencimiento el 07/12/2046	99	0,18	Swaps de incumplimiento de crédito — (0,09%) (28 febrero de 2023: 0,08%)		
170 Wells Fargo & Co, 5,013 %, con vencimiento el 04/04/2051 *	152	0,27	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		
130 Wells Fargo & Co, 4,611 %, con vencimiento el 25/04/2053 *	108	0,20	(51)	(0,09)	
210 Wells Fargo & Co, Series S, 5,900 %, Perpetuo *	208	0,38	Contratos de divisas a plazo — (1,50%) (28 de febrero de 2023: 0,43%)		
10 Welltower OP LLC, 3,850 %, con vencimiento el 15/06/2032	9	0,02	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		
150 Western Midstream Operating LP, 3,100 %, con vencimiento el 01/02/2025	144	0,26	(827)	(1,50)	
60 Western Midstream Operating LP, 3,950 %, con vencimiento el 01/06/2025	58	0,10	Futuros — (0,03%) (28 de febrero de 2023: 0,11%)		
50 Western Midstream Operating LP, 4,050 %, con vencimiento el 01/02/2030	44	0,08	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		
80 Western Midstream Operating LP, 6,150 %, con vencimiento el 01/04/2033	79	0,14	(17)	(0,03)	
30 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, con vencimiento el 15/08/2048	25	0,04	Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
10 Williams Cos Inc/The, 3,500 %, con vencimiento el 15/10/2051	7	0,01	(895)	(1,62)	
30 Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 01/03/2025	30	0,05	Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
	38.887	70,33	59.321	107,29	
Zambia — 0,37% (28 de febrero de 2023: 0,43%)			Excedente de pasivos respecto a otros activos		
200 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, con vencimiento el 01/06/2031	204	0,37	(4.031)	(7,29)	
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 62.933\$)	56.708	102,56	Patrimonio		
Bonos y obligaciones del Estado — 1,86% (28 de febrero de 2023: 1,69%)			55.290\$ (100,00)		
Chile — 0,29 % (28 de febrero de 2023: 0,17%)			–		
200 Chile Government International Bond, 2,550 %, con vencimiento el 27/07/2033	160	0,29	– Los importes designados como “-” son 0 \$, menos de 1000 \$, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.		
México — 1,19 % (28 de febrero de 2023: 1,20%)			144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. El 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 18,877,000 USD o el 34,13 % del patrimonio neto.		
6.940 MXN Mexican Bonos, Serie M, 8,500 %, con vencimiento el 18/11/2038	377	0,68	* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.		
350 Mexico Government International Bond, 4,280 %, con vencimiento el 14/08/2041	280	0,51	† Poca liquidez.		
	657	1,19	ABREVIATURAS:		
Perú — 0,11 % (28 de febrero de 2023: 0,06%)			Perpetuo – Un bono sin fecha de vencimiento. Los bonos perpetuos no son rescatables, pero pagan un flujo constante de intereses.		
70 Bono Internacional del Estado de Perú, 2,783 %, con vencimiento el 23/01/2031	59	0,11	EUR – euro		
			GBP – libra esterlina		
			MXN – peso mexicano		
Análisis del total de activos			% del total de activos		

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund

Cartera de inversiones a 31 de agosto de 2023 (continuación)

Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	61,09
Otros valores mobiliarios negociables en otro mercado regulado	0,28
Organismos de inversión colectiva	0,78
Instrumentos financieros derivados	0,20
Otros activos	37,65
Total de activos	100,00

Listado de swaps de incumplimiento de crédito

Contraparte	Entidad de Referencia – Protección Compra/Venta	Fecha de vencimiento	Importe teórico (miles)	Valor (miles)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000 % – Comprar	20 de junio de 2028	870	USD (25)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1.000% – Comprar	20 de junio de 2028	1.673	(26)
Apreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 febrero de 2023 [miles]: USD-)				USD –
Depreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(74))				(51)
Depreciación neta de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(74))				USD (51)

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)		Moneda de venta (en miles)		Apreciación / (Depreciación) latente de contratos (en miles)
06 sep.2023	BNY Mellon	Compra	GBP	31.800	Venta	USD (120)
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	USD	42.061	Venta	GBP 33.194
15 sep.2023	BNY Mellon	Compra	GBP	64.458	Venta	USD 82.087 (669)
20 oct. 2023	Goldman Sachs	Compra	MXN	3.333	Venta	USD 192
20 oct. 2023	Goldman Sachs	Compra	JPY	35.284	Venta	USD 249 (6)
20 oct. 2023	JP Morgan	Compra	BRL	388	Venta	USD 79 (1)
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	191	Venta	BRL 951 (1)
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	298	Venta	EUR 274
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	450	Venta	GBP 350
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	289	Venta	JPY 41.766
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	146	Venta	MXN 2.507
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	JPY	64.420	Venta	USD 462 (19)
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	EUR	417	Venta	USD 460 (9)
20 oct. 2023	Morgan Stanley	Compra	BRL	1.950	Venta	USD 394 (2)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): 35\$						USD 147
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(404)						(827)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(369))						USD (680)

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico (miles)	Apreciación / (Depreciación) latente de contratos (en miles)
U.S. 10 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	6	USD 664	USD 4
U.S. 10 Year Ultra Note Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(8)	(923)	(9)
U.S. 2 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	(16)	(3.260)	(8)
U.S. 5 Year Note (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	46	4.909	25
U.S. Long Bond (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	20	2.407	16
U.S. Ultra Bond (CBT) Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	27	3.450	5
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: 4\$)				USD 50
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(103)				(17)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(99))				USD 33

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

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto
Valores garantizados por activos — 0,42 % (28 de febrero de 2023: 2,61 %)					
80 Soundview Home Loan Trust 2006-2, Serie 2006 2, Clase M2, 5,954 %, con vencimiento el 25/03/2036 *	78	0,42	20 Bank of Nova Scotia/The 1,300 %, con vencimiento el 11/06/2025	18	0,10
Total de valores garantizados por activos (coste 785)					
78	0,42		20 Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, con vencimiento el 30/05/2041	20	0,10
Valores garantizados por hipotecas — 20,74 % (28 de febrero de 2023: 19,86 %)					
100 BANK 2017-BNK7, Serie 2017 BNK7, Clase C, 4,145 %, con vencimiento el 15/09/2060 *	81	0,43	10 MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 01/02/2029	10	0,05
7.555 Benchmark 2018-B7 Mortgage Trust, Serie 2018 B7, Clase XA, 0,565 %, con vencimiento el 15/05/2053 *	116	0,62	40 Royal Bank of Canada, 1,150 %, 10/06/2025	37	0,20
100 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Clase 1B1, 144A, 8,388 %, con vencimiento el 25/10/2041 *	100	0,53	10 Teck Resources Ltd, 3,900 %, con vencimiento el 15/07/2030	9	0,05
100 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Serie 2021 R03, Clase 1B1, 144A, 8,038 %, con vencimiento el 25/12/2041 *	99	0,53	70 Toronto-Dominion Bank/The, 1,150 %, con vencimiento el 12/06/2025	65	0,35
121 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2015 C03, Clase 1M2, 10,402 %, con vencimiento el 25/07/2025 *	127	0,68		187	1,00
19 Fannie Mae Pool 'AM8700', 2,930 %, con vencimiento el 01/06/2030	17	0,09	Colombia — 0,38 % (28 de febrero de 2023: 0,36 %)		
19 Fannie Mae Pool 'AN5386', 3,250 %, con vencimiento el 01/05/2029	18	0,10	100 Ecopetrol SA, 5,875 %, con vencimiento el 28/05/2045	71	0,38
20 Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, con vencimiento el 01/07/2043	18	0,10	Francia: 1,02 % (28 de febrero de 2023: 1,03 %)		
40 Fannie Mae Pool 'BM6898', 2,149 %, con vencimiento el 01/02/2032 *	32	0,17	200 BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, con vencimiento el 14/08/2028	189	1,02
83 Fannie Mae Pool 'BR4393', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	66	0,36	Irlanda: 0,31 % (28 de febrero de 2023: 0,32 %)		
126 Fannie Mae Pool 'CA5220', 3,000 %, con vencimiento el 01/02/2050	109	0,59	59 Avolon TLB Borrower 1 (US) LLC, 7,664 %, con vencimiento el 01/12/2027 *	58	0,31
86 Fannie Mae Pool 'CB1878', 3,000 %, con vencimiento el 01/10/2051	74	0,40	Israel — 0,58 % (28 de febrero de 2023: 1,21 %)		
173 Fannie Mae Pool 'CB2164', 3,000 %, con vencimiento el 01/11/2051	150	0,81	120 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, con vencimiento el 01/10/2026	109	0,58
89 Fannie Mae Pool 'CB2375', 2,500 %, con vencimiento el 01/12/2051	75	0,40	Macao — 0,95 % (28 de febrero de 2023: 0,93 %)		
276 Fannie Mae Pool 'FM3445', 4,000 %, con vencimiento el 01/09/2048	259	1,39	200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 26/08/2028	177	0,95
86 Fannie Mae Pool 'FM9195', 2,500 %, con vencimiento el 01/10/2051	72	0,39	México: 0,50 % (28 de febrero de 2023: 0,51 %)		
85 Fannie Mae Pool 'FM9292', 3,000 %, con vencimiento el 01/11/2051	75	0,40	100 Southern Copper Corp, 5,250 %, con vencimiento el 08/11/2042	92	0,50
87 Fannie Mae Pool 'FM9579', 2,000 %, con vencimiento el 01/07/2051	69	0,37	Reino Unido: 1,11 % (28 de febrero de 2023: 1,25 %)		
88 Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2052	71	0,38	11 BAT Capital Corp, 3,557 %, con vencimiento el 15/08/2027	10	0,05
86 Fannie Mae Pool 'FS1107', 2,500 %, con vencimiento el 01/12/2051	72	0,39	40 BAT Capital Corp, 4,540 %, con vencimiento el 15/08/2047	29	0,16
179 Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2049	163	0,87	200 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/07/2031	168	0,90
73 Fannie Mae Pool 'MA4158', 2,000 %, con vencimiento el 01/10/2050	58	0,31		207	1,11
82 Fannie Mae Pool 'MA4305', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2051	66	0,35	Estados Unidos: 23,01 % (28 de febrero de 2023: 22,39 %)		
73 Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2050	61	0,33	10 Abbott Laboratories, 3,750 %, con vencimiento el 30/11/2026	10	0,05
83 Freddie Mac Pool 'RA5921', 2,500 %, con vencimiento el 01/09/2051	69	0,37	10 Abbott Laboratories, 4,750 %, con vencimiento el 30/11/2036	10	0,05
70 Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, con vencimiento el 01/10/2041	56	0,30	20 Abbott Laboratories, 4,900 %, con vencimiento el 30/11/2046	20	0,11
18 Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, con vencimiento el 01/11/2041	14	0,08	100 AbbVie Inc, 3,600 %, con vencimiento el 14/05/2025	97	0,52
329 Freddie Mac Pool 'SD0176', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2049	298	1,60	80 AbbVie Inc, 3,200 %, con vencimiento el 21/11/2029	72	0,39
88 Freddie Mac Pool 'SD0777', 3,500 %, con vencimiento el 01/11/2051	74	0,40	20 AbbVie Inc, 4,250 %, con vencimiento el 21/11/2049	17	0,09
82 Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, Serie 2020 DNA2, Clase M2, 144A, 7,252 %, con vencimiento el 25/02/2050 *	82	0,44	10 Air Lease Corp, 5,300 %, con vencimiento el 01/02/2028	10	0,05
90 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Serie 2021 DNA5, Clase M2, 144A, 6,938 %, con vencimiento el 25/01/2034 *	90	0,48	20 Alphabet Inc, 1,100 %, con vencimiento el 15/08/2030	16	0,09
100 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, Serie 2022 DNA3, Clase B1, 144A, 10,938 %, con vencimiento el 25/04/2042 *	105	0,57	20 Alphabet Inc, 2,050 %, con vencimiento el 15/08/2050	12	0,06
135 Ginnie Mae II Pool 'MA6658', 4,000 %, con vencimiento el 20/05/2050	128	0,68	32 Altria Group Inc, 4,400 %, con vencimiento el 14/02/2026	31	0,17
221 Ginnie Mae II Pool 'MA7473', 3,000 %, con vencimiento el 20/07/2051	196	1,05	8 Altria Group Inc, 4,800 %, con vencimiento el 14/02/2029	8	0,04
236 Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, con vencimiento el 20/09/2051	208	1,12	20 Altria Group Inc, 5,800 %, con vencimiento el 14/02/2039	20	0,11
90 Ginnie Mae II Pool 'MA7883', 3,500 %, con vencimiento el 20/02/2052	82	0,44	30 Altria Group Inc, 5,950 %, con vencimiento el 14/02/2049	28	0,15
100 Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 %±	97	0,52	40 Amazon.com Inc, 1,500 %, con vencimiento el 03/06/2030	33	0,18
97 Government National Mortgage Association, Serie 2022 3, Clase IO, 0,640 %, con vencimiento el 16/02/2061 *	5	0,03	50 Amazon.com Inc, 2,500 %, con vencimiento el 03/06/2050	32	0,17
31 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Serie 2021 NQ2R, Clase A3, 144A, 1,353 %, con vencimiento el 25/10/2058 *	28	0,15	50 AT&T Inc, 1,650 %, con vencimiento el 01/02/2028	43	0,23
250 Towd Point Mortgage Trust 2017-4, Serie 2017 4, Clase B2, 144A, 3,574 %, con vencimiento el 25/06/2057 *	191	1,02	10 Ball Corp, 3,125 %, con vencimiento el 15/09/2031	8	0,04
95 Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Clase A1, 144A, 5,811 %, con vencimiento el 25/05/2068	94	0,50	20 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, con vencimiento el 15/01/2049	18	0,09
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 4.319 USD)					
3.865	20,74		40 Boeing Co/The, 4,875 %, vencimiento 01/05/2025	39	0,21
Bonos y obligaciones corporativas — 30,95 % (28 de febrero de 2023: 31,20 %)					
Australia: 0,41 % (28 de febrero de 2023: 0,42 %)					
20 BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000 %, con vencimiento el 30/09/2043	20	0,10	50 Boeing Co/The, 5,150 %, vencimiento 01/05/2030	49	0,26
20 Glencore Finance Canada Ltd, 144A, 6,000 %, con vencimiento 15/11/2041	19	0,10	40 Boeing Co/The, 5,705 %, con vencimiento 01/05/2040	39	0,21
40 Glencore Funding LLC, 144A, 4,000 %, con vencimiento 27/03/2027	38	0,21	50 Boeing Co/The, 5,805 %, con vencimiento 01/05/2050	49	0,26
	77	0,41	40 BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, con vencimiento el 04/05/2026	38	0,20
Bélgica — 0,29 % (28 de febrero de 2023: 0,29 %)					
40 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2030	37	0,20	20 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, con vencimiento el 06/04/2030	19	0,10
20 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, con vencimiento el 01/06/2040	18	0,09	20 BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, con vencimiento el 24/02/2050	13	0,07
	55	0,29	13 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, con vencimiento el 26/07/2029	12	0,07
Brasil — 1,39 % (28 de febrero de 2023: 1,38 %)					
110 Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, con vencimiento 01/02/2029	107	0,58	260 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, con vencimiento el 01/05/2032	211	1,13
60 Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125 %, con vencimiento el 15/01/2032	48	0,25	10 Centene Corp, 4,250 %, con vencimiento el 15/12/2027	9	0,05
100 Vale Overseas Ltd, 6,875 %, con vencimiento el 21/11/2036	104	0,56	10 Centene Corp, 4,625 %, con vencimiento el 15/12/2029	9	0,05
	259	1,39	20 Charles Schwab Corp/The, 5,875 %, con vencimiento el 24/08/2026	20	0,11
Canadá: 1,00 % (28 de febrero de 2023: 1,11 %)					
30 Bank of Montreal, 1,850 %, con vencimiento el 01/05/2025	28	0,15	10 Charles Schwab Corp/The, 6,136 %, con vencimiento el 24/08/2034 *	10	0,06
			40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, con vencimiento el 23/07/2025	39	0,21
			80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, con vencimiento el 15/03/2028	75	0,40
			40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, con vencimiento el 01/04/2038	34	0,18
			10 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, con vencimiento el 01/07/2049	8	0,04
			40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, con vencimiento el 01/03/2050	30	0,16
			10 Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, con vencimiento el 31/01/2032	8	0,04
			40 Cigna Group/The, 4,375 %, con vencimiento el 15/10/2028	39	0,21

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

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

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto
Bonos y pagarés corporativos — (continuación)					
Estados Unidos — (continuación)					
20 Cigna Group/The, 4,800 %, con vencimiento el 15/08/2038	18	0,10	20 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 15/04/2029	18	0,10
20 Cigna Group/The, 4,900 %, con vencimiento el 15/12/2048	18	0,10	40 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, con vencimiento el 15/05/2030	33	0,18
150 Citigroup Inc, 5,500 %, con vencimiento el 13/09/2025	149	0,80	20 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, con vencimiento el 15/05/2040	14	0,08
200 Citigroup Inc, 2,572 %, con vencimiento el 03/06/2031 *	165	0,89	20 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, con vencimiento el 15/08/2049	16	0,08
10 Citigroup Inc, 8,125 %, con vencimiento el 15/07/2039	12	0,07	40 US Bancorp, 1,450 %, con vencimiento el 12/05/2025	37	0,20
50 Citigroup Inc, 4,650 %, con vencimiento el 23/07/2048	43	0,23	10 US Bancorp, 5,775 %, con vencimiento el 12/05/2029 *	10	0,05
50 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, con vencimiento el 15/03/2051	32	0,17	10 US Bancorp, 5,836 %, con vencimiento el 12/06/2034 *	10	0,05
30 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,036 %, con vencimiento el 15/11/2033	30	0,16	10 Verizon Communications Inc, 4,500 %, con vencimiento el 10/08/2033	9	0,05
40 Comcast Corp, 4,150 %, con vencimiento el 15/10/2028	39	0,21	20 Visa Inc, 2,050 %, con vencimiento el 15/04/2030	17	0,09
10 Consolidated Edison Co of New York Inc, Serie 20A, 3,350 %, con vencimiento el 01/04/2030	9	0,05	30 Visa Inc, 4,300 %, con vencimiento el 14/12/2045	27	0,15
60 Coterra Energy Inc, 4,375 %, con vencimiento el 15/03/2029	57	0,30	10 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 6,412 %, con vencimiento el 15/03/2026	10	0,05
30 Deere & Co, 3,750 %, con vencimiento el 15/04/2050	26	0,14	140 Western Midstream Operating LP, 5,250 %, con vencimiento el 01/02/2050	113	0,61
150 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, con vencimiento el 15/01/2026	155	0,83	20 Williams Cos Inc/The, 4,850 %, con vencimiento el 01/03/2048	17	0,09
160 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 20/10/2028	154	0,83	Total de bonos y pagarés corporativos (coste 6.911\$)	5.769	30,95
40 Devon Energy Corp, 5,850 %, con vencimiento el 15/12/2025	40	0,22	Bonos y obligaciones del Estado — 40,39 % (28 de febrero de 2023: 27,36 %)		
40 Devon Energy Corp, 5,000 %, con vencimiento el 15/06/2045	34	0,18	Brasil: 1,43 % (28 de febrero de 2023: 1,33 %)		
20 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2029	18	0,10	BRL 579 Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2033	110	0,59
10 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 01/12/2026	8	0,05	200 Brazilian Government International Bond, 5,000 %, con vencimiento el 27/01/2045	156	0,84
30 Elevance Health Inc, 3,650 %, con vencimiento el 01/12/2027	28	0,15		266	1,43
20 Energy Transfer LP, 5,250 %, con vencimiento el 15/04/2029	20	0,11	Indonesia: 2,35 % (28 de febrero de 2023: 2,35 %)		
20 Energy Transfer LP, 6,250 %, con vencimiento el 15/04/2049	19	0,10	200 Indonesia Government International Bond, 4,625 %, con vencimiento el 15/04/2043	184	0,99
10 Energy Transfer LP, Serie G, 7,125 %, Perpetua *	9	0,05	IDR Indonesia Treasury Bond, Serie FR59, 7,000 %, con vencimiento el 1.145.000 15/05/2027	77	0,41
20 EOG Resources Inc, 4,375 %, con vencimiento el 15/04/2030	19	0,10	IDR Indonesia Treasury Bond, Serie FR87, 6,500 %, con vencimiento el 2.677.000 15/02/2031	177	0,95
20 EOG Resources Inc, 4,950 %, con vencimiento el 15/04/2050	19	0,10		438	2,35
150 EQT Corp, 5,000 %, con vencimiento el 15/01/2029	142	0,76	México: 7,80 % (28 de febrero de 2023: 7,42 %)		
10 Exelon Corp, 5,625 %, con vencimiento el 15/06/2035	10	0,05	MXN 25.890 Bonos Mexicanos, Series M, 7,750 %, con vencimiento el 13/11/2042	1.298	6,96
10 Ford Motor Co, 6,100 %, con vencimiento el 19/08/2032	10	0,05	200 Bono internacional del Estado de México, 4,350 %, con vencimiento el 15/01/2047	156	0,84
230 Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, vencimiento 28/05/2027	216	1,16		1.454	7,80
220 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, vencimiento 13/11/2030	186	1,00	Perú: 0,18 % (28 de febrero de 2023: 0,17 %)		
20 General Motors Co, 5,950 %, vencimiento 01/04/2049	18	0,10	30 Bono Internacional del gobierno de Perú, 6,550 %, con vencimiento el 14/03/2037	33	0,18
20 Home Depot Inc/The, 3,250 %, con vencimiento el 15/04/2032	18	0,10	Rusia — 0,57 % (28 de febrero de 2023: 0,12 %)		
40 Home Depot Inc/The, 3,300 %, con vencimiento el 15/04/2040	32	0,17	RUB 33.741 Russian Federal Bond – OFZ, 0,000 %, con vencimiento el 23/05/2029 1y	106	0,57
20 Humana Inc, 3,700 %, con vencimiento el 23/03/2029	19	0,10	Estados Unidos: 28,06 % (28 de febrero de 2023: 15,97 %)		
10 Intel Corp, 5,125 %, con vencimiento el 10/02/2030	10	0,05	490 United States Treasury Inflation Index Bonds, 1,125 %, con vencimiento el 15/01/2033 β	468	2,51
10 JPMorgan Chase & Co, 3,897 %, con vencimiento el 23/01/2049 *	8	0,04	60 United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, con vencimiento el 31/12/2025	54	0,29
10 Kenvue Inc, 144A, 4,900 %, con vencimiento el 22/03/2033	10	0,05	10 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, con vencimiento el 30/04/2027	9	0,05
20 Kinder Morgan Inc, 5,200 %, con vencimiento el 01/03/2048	17	0,09	280 United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, con vencimiento el 31/12/2027	239	1,28
40 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, con vencimiento el 08/08/2024	39	0,21	210 United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, con vencimiento el 29/02/2028	183	0,98
10 MDC Holdings Inc, 6,000 %, con vencimiento el 15/01/2043	9	0,05	280 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 31/03/2028	272	1,46
30 Merck & Co Inc, 1,450 %, con vencimiento el 24/06/2030	24	0,13	250 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 31/03/2030	242	1,30
88 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 20/06/2027	88	0,47	120 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, con vencimiento el 31/07/2030	119	0,64
40 Mondelez International Inc, 1,500 %, con vencimiento el 04/05/2025	37	0,20	690 United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 31/08/2030	687	3,69
110 Morgan Stanley, 2,188 %, con vencimiento el 28/04/2026 *	104	0,56	10 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, con vencimiento el 15/02/2032	8	0,05
70 Morgan Stanley, 3,622 %, con vencimiento el 01/04/2031 *	62	0,33	230 United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, con vencimiento el 15/08/2041	155	0,83
20 MPLX LP, 4,800 %, con vencimiento el 15/02/2029	19	0,10	10 United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, con vencimiento el 15/02/2042	8	0,04
20 MPLX LP, 5,500 %, con vencimiento el 15/02/2049	18	0,10	90 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, con vencimiento el 15/11/2042	85	0,46
20 NIKE Inc, 3,375 %, con vencimiento el 27/03/2050	15	0,08	80 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, con vencimiento el 15/05/2043	74	0,40
40 Northrop Grumman Corp, 3,250 %, con vencimiento el 15/01/2028	37	0,20	160 United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, con vencimiento el 15/08/2043	160	0,86
20 Northrop Grumman Corp, 5,250 %, con vencimiento el 01/05/2050	20	0,11	110 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, con vencimiento el 15/02/2049	87	0,47
10 ONEOK Inc, 5,550 %, con vencimiento el 01/11/2026	10	0,05	50 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, con vencimiento el 15/05/2049	39	0,21
20 ONEOK Inc, 5,650 %, con vencimiento el 01/11/2028	20	0,11	50 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, con vencimiento el 15/08/2049	34	0,18
20 PepsiCo Inc, 1,625 %, con vencimiento el 01/05/2030	17	0,09	200 United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, con vencimiento el 15/08/2050	108	0,58
20 Philip Morris International Inc, 2,100 %, con vencimiento el 01/05/2030	16	0,09			
20 Philip Morris International Inc, 4,500 %, con vencimiento el 20/03/2042	17	0,09			
10 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,812 %, con vencimiento el 12/06/2026 *	10	0,05			
10 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,582 %, con vencimiento el 12/06/2029 *	10	0,05			
40 RTX Corp, 2,250 %, con vencimiento el 01/07/2030	33	0,18			
10 RTX Corp, 4,500 %, con vencimiento el 01/06/2042	9	0,05			
60 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 20/09/2025	60	0,32			
10 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, con vencimiento el 01/02/2031	9	0,05			
10 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, con vencimiento el 15/02/2026	9	0,05			
10 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, con vencimiento el 15/02/2029	9	0,05			
10 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/04/2030	9	0,05			
70 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, con vencimiento el 15/02/2031	58	0,31			
10 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, con vencimiento el 15/02/2031	8	0,05			
20 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, con vencimiento el 15/04/2031	18	0,09			
20 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, con vencimiento el 01/02/2026	21	0,11			
10 Truist Financial Corp, 6,047 %, con vencimiento el 08/06/2027 *	10	0,05			
50 Union Pacific Corp, 2,891 %, con vencimiento el 06/04/2036	40	0,21			
40 Union Pacific Corp, 3,839 %, con vencimiento el 20/03/2060	31	0,17			
10 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 15/04/2026	9	0,05			

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

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

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto	Contratos (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto
Bonos y obligaciones del Estado — (continuación)					
Estados Unidos — (continuación)					
230 United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, con vencimiento el 15/11/2050	133	0,71			
230 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, con vencimiento el 15/02/2051	142	0,76			
710 United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, con vencimiento el 15/05/2051	494	2,65			
50 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, con vencimiento el 15/08/2051	32	0,17			
370 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, con vencimiento el 15/11/2051	227	1,22			
152 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, con vencimiento el 15/02/2052	103	0,55			
257 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, con vencimiento el 15/05/2052	200	1,07			
160 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, con vencimiento el 15/08/2052	128	0,68			
40 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, con vencimiento el 15/11/2052	39	0,21			
158 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 15/02/2053	142	0,76			
610 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 15/05/2053	550	2,95			
10 United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2053	10	0,05			
	5.231	28,06			
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 9.1655)	7.528	40,39			
Obligaciones de préstamo — 5,19 % (28 de febrero de 2023: 5,39 %)					
51 1011778 BC ULC, 7,196 %, con vencimiento el 14/11/2026 *	51	0,27			
59 Allied Universal Holdco LLC, 9,181 %, con vencimiento el 14/05/2028 *	57	0,31			
10 AmWINS Group, Inc., 7,696 %, con vencimiento el 17/02/2028 *	10	0,05			
20 Brown Group Holding LLC, 7,820 %, con vencimiento el 07/06/2028 *	19	0,10			
68 Charter Communications Operating LLC, 7,116 %, con vencimiento el 30/04/2025 *	68	0,37			
49 Citadel Securities, 7,888 %, con vencimiento el 25/07/2030 *	49	0,26			
10 DCert Buyer, Inc., 9,331 %, con vencimiento el 16/10/2026 *	10	0,05			
41 Energizer Holdings, Inc., 7,679 %, con vencimiento el 16/12/2027 *	41	0,22			
20 Gainwell Acquisition Corp, 9,342 %, con vencimiento el 01/10/2027 *	19	0,10			
68 Genesee & Wyoming Inc, 7,342 %, con vencimiento el 30/12/2026 *	68	0,37			
65 Grifols Worldwide Operations USA Inc, 7,414 %, con vencimiento el 15/11/2027 *	65	0,35			
10 GVC Holdings Gibraltar Ltd, 7,437 %, con vencimiento el 16/03/2027 *	10	0,05			
58 Harbor Freight Tools USA Inc, 8,183 %, con vencimiento el 19/10/2027 *	58	0,31			
50 Hunter Douglas Inc, 8,891 %, con vencimiento el 09/02/2029 *	48	0,26			
22 ICON Luxembourg S.a.r.l., 7,753 %, con vencimiento el 01/07/2028 *	22	0,12			
5 Indigo Merger Sub, Inc., 7,753 %, con vencimiento el 01/07/2028 *	5	0,03			
35 Jazz Financing Lux S.a.r.l., 8,946 %, con vencimiento el 22/04/2028 *	35	0,19			
35 Nexstar Broadcasting Inc, 7,946 %, con vencimiento el 19/09/2026 *	36	0,19			
20 Quikrete Holdings, Inc., 8,320 %, con vencimiento el 11/06/2028 *	20	0,11			
8 Rackspace Technology Global, Inc, 8,177 %, con vencimiento el 09/02/2028 *	4	0,02			
60 Sotera Health, 8,196 %, con vencimiento el 13/12/2026 *	60	0,32			
29 Station Casinos LLC, 7,681 %, con vencimiento el 08/02/2027 *	29	0,16			
18 UFC Holdings LLC, 8,369 %, con vencimiento el 29/04/2026 *	18	0,09			
23 United Airlines Inc, 9,292 %, con vencimiento el 14/04/2028 *	23	0,13			
68 Versend Holding Corp., 9,446 %, con vencimiento el 27/08/2025 *	69	0,37			
60 Virgin Media Bristol LLC, 7,925 %, con vencimiento el 04/01/2028 *	58	0,31			
15 Zebra Buyer LLC, 8,753 %, con vencimiento 22/04/2028 *	15	0,08			
Total de obligaciones de préstamo (coste 9785)	967	5,19			
Organismos de inversión colectiva — 0,70 % (28 de febrero de 2023: 7,28 %)					
130 Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund — Clase WA (distribución)	130	0,70			
Total de organismos de inversión colectiva (coste: 1305)	130	0,70			
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 21.5815)					
	18.337	98,39			
Contratos (en miles)					
	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto		Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto
Opciones compradas — 0,47 % (28 de febrero de 2023: 0,11 %)					
– 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures December 2023 Put 95,8750, con vencimiento el 15/12/2023 – Morgan Stanley	6	0,03			
– 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures December 2023 Put 96,00, con vencimiento el 15/12/2023 – Morgan Stanley	18	0,10			
– 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures October 2023 Put 97,00, con vencimiento el 13/10/2023 – Morgan Stanley	50	0,27			
– U.S. 10 Year W1 September 2023 Call 109,75, con vencimiento el 01/09/2023 – Morgan Stanley	4	0,02			
– U.S. 10 Year W1 September 2023 Call 110,25, con vencimiento el 01/09/2023 – Morgan Stanley	1	–			
– U.S. 5 Year October 2023 Call 106,25, con vencimiento el 22/09/2023 – Morgan Stanley	4	0,02			
– U.S. 5 Year October 2023 Call 106,75, con vencimiento el 22/09/2023 – Morgan Stanley	2	0,01			
– U.S. 5 Year W1 September 2023 Call 106,25, con vencimiento el 01/09/2023 – Morgan Stanley	1	0,01			
210 USD Put/AUD Call 0,67, con vencimiento el 03/11/2023 - JP Morgan	1	0,01			
Total de opciones compradas (coste 505)	87	0,47			
Contratos (en miles)					
Swaps de incumplimiento de crédito — (0,39 %) (28 febrero de 2023: 0,31 %)					
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)				72	0,39
Swaps sobre índices — 2,37 % (28 de febrero de 2023: 4,56 %)					
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)				441	2,37
Contratos de divisas a plazo: 0,10 % (28 de febrero de 2023: 0,06 %)					
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)				18	0,10
Futuros — 1,15 % (28 de febrero de 2023: 0,85 %)					
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)				215	1,15
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias					
				19.170	102,87
Contratos (en miles)					
Opciones suscritas — (0,53 %) (28 de febrero de 2023: (0,21 %))					
– 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures December 2023 Put 95,25, con vencimiento el 15/12/2023 – Morgan Stanley	(4)	(0,02)			
– 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures December 2023 Put 95,3750, con vencimiento el 15/12/2023 – Morgan Stanley	(11)	(0,06)			
– 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures October 2023 Put 96,25, con vencimiento el 13/10/2023 – Morgan Stanley	(21)	(0,11)			
– 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures October 2023 Put 96,50, con vencimiento el 13/10/2023 – Morgan Stanley	(30)	(0,16)			
– U.S. 10 Year November 2023 Call 111,00, con vencimiento el 27/10/2023 – Morgan Stanley	(1)	(0,01)			
– U.S. 10 Year November 2023 Call 112,50, con vencimiento el 27/10/2023 – Morgan Stanley	(1)	–			
– U.S. 10 Year November 2023 Call 113,00, con vencimiento el 27/10/2023 – Morgan Stanley	–	–			
– U.S. 10 Year October 2023 Call 111,75, con vencimiento el 22/09/2023 – Morgan Stanley	(1)	(0,01)			
– U.S. 10 Year October 2023 Call 112,00, con vencimiento el 22/09/2023 – Morgan Stanley	(1)	–			
– U.S. 10 Year October 2023 Call 112,50, con vencimiento el 22/09/2023 – Morgan Stanley	(1)	(0,01)			
– U.S. 10 Year October 2023 Call 113,00, con vencimiento el 22/09/2023 – Morgan Stanley	(1)	(0,01)			
– U.S. 10 Year October 2023 Put 110,00, con vencimiento el 22/09/2023 – Morgan Stanley	(1)	–			
– U.S. 10 Year October 2023 Put 111,00, con vencimiento el 22/09/2023 – Morgan Stanley	(1)	–			
– U.S. 10 Year W1 September 2023 Call 110,00, con vencimiento el 01/09/2023 – Morgan Stanley	(2)	(0,01)			
– U.S. 5 Year November 2023 Call 107,50, con vencimiento el 27/10/2023 – Morgan Stanley	(1)	(0,01)			
– U.S. 5 Year October 2023 Call 108,00, con vencimiento el 22/09/2023 – Morgan Stanley	(1)	–			
– U.S. 5 Year October 2023 Call 109,00, con vencimiento el 22/09/2023 – Morgan Stanley	–	–			
– U.S. 5 Year October 2023 Put 105,00, con vencimiento el 22/09/2023 – Morgan Stanley	–	–			
– U.S. 5 Year October 2023 Put 106,50, con vencimiento el 22/09/2023 – Morgan Stanley	(3)	(0,02)			
– U.S. 5 Year W1 September 2023 Call 106,00, con vencimiento el 01/09/2023 – Morgan Stanley	(8)	(0,05)			
– U.S. Bond October 2023 Call 123,00, con vencimiento el 22/09/2023 – Morgan Stanley	(3)	(0,02)			
– U.S. Bond October 2023 Call 124,00, con vencimiento el 22/09/2023 – Morgan Stanley	(1)	–			
– U.S. Bond October 2023 Call 125,00, con vencimiento el 22/09/2023 – Morgan Stanley	(1)	(0,01)			
– U.S. Bond October 2023 Put 118,00, con vencimiento el 22/09/2023 – Morgan Stanley	(1)	–			
– U.S. Bond October 2023 Put 120,00, con vencimiento el 22/09/2023 – Morgan Stanley	(1)	(0,01)			
– U.S. Bond October 2023 Put 121,00, con vencimiento el 22/09/2023 – Morgan Stanley	(2)	(0,01)			
Total de opciones suscritas (coste: (74) USD)	(98)	(0,53)			
Swaps de tasas de interés: (0,05 %) (28 de febrero de 2023: 0,00 %)					
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)				(9)	(0,05)
Contratos de divisas a plazo — (0,35 %) (28 de febrero de 2023: (0,31 %))					
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)				(64)	(0,35)
Futuros — (0,40 %) (28 de febrero de 2023: (0,65 %))					
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)				(74)	(0,40)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias					
				(245)	(1,33)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias					
				18.925	101,54
Excedente de pasivos respecto a otros activos					
				(288)	(1,54)
Patrimonio				18.637\$	100,00

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

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

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

- Los importes designados como “-” son 0 USD, menos de 1000 USD, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.
- 144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. El 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban \$1 767 000 o el 9,48 % del patrimonio neto.
- * Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.
- † Poca liquidez.
- ± Títulos adquiridos siguiendo la norma “se anunciará”.
- β El tipo de interés sobre esta clase de título está vinculado al índice de precios de consumo (IPC)/ índice de precios minoristas (Retail Price Index, RPI). El tipo del cupón es el tipo a 31 de agosto de 2023.
- γ El valor ya no acumula ingresos durante y/o después del período financiero finalizado el 31 de agosto de 2023 debido a la incertidumbre de los pagos de intereses.

ABREVIATURAS:

- Perpetuo – Un bono sin fecha de vencimiento. Los bonos perpetuos no son rescatables, pero pagan un flujo constante de intereses.
- REMIC – Conducto de inversiones hipotecarias inmobiliarias.
- TBA – Pendiente de anuncio.
- BRL – Real brasileño
- IDR – Rupia indonesia
- MXN – peso mexicano
- RUB – Rublo ruso

	% del total de activos
Análisis del total de activos	
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	86,34
Otros valores mobiliarios negociables en otro mercado regulado	4,84
Organismos de inversión colectiva	0,65
Instrumentos financieros derivados	4,17
Otros activos	4,00
Total de activos	100,00

Listado de swaps de incumplimiento de crédito

Contraparte	Entidad de Referencia – Protección Compra/Venta	Fecha de vencimiento	Importe teórico (en miles)	Valor (en miles)
Morgan Stanley	CDX.NA.HY, 5,000 % – Vender	20 jun. 2028	490	USD 14
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % – Vender	20 jun. 2028	3.776	58
Apreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 febrero de 2023 [miles]: 57\$)				USD 72
Depreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2022 [miles]: USD–)				–
Apreciación neta de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 [miles]: 57\$)				USD 72

Listado de swaps de tipos de interés

Contraparte	Tipo	Fecha de vencimiento	Importe teórico (en miles)	Valor (en miles)
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI Banxico, Receive Fixed 10,230 %	02 ene. 2029	3.440	USD (9)
Apreciación latente de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 [miles]: USD–)				USD –
Depreciación latente de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 [miles]: USD–)				(9)
Depreciación neta de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 [miles]: USD–)				USD (9)

Listado de swaps de inflación

Contraparte	Entidad de referencia	Fecha de vencimiento	Importe teórico (en miles)	Valor (en miles)
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15 feb. 2047	325	USD 109
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,500 %, Receive Floating USD Sofr Compound	21 abr. 2052	150	28
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,600 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15 feb. 2048	285	48
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,850 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15 feb. 2029	377	21
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,050 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15 feb. 2048	1.466	141
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,250 %, Receive Floating USD Sofr Compound	30 sep. 2029	568	21
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,270 %, Receive Floating USD Sofr Compound	30 abr. 2029	1.901	67
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,850 %, Receive Floating USD Sofr Compound	30 jun. 2029	1.002	5
Morgan Stanley	Pay Fixed 5,410 %, Receive Floating USD Fed Funds Rate	31 ene. 2024	4.468	–
Morgan Stanley	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 4,000 %	29 feb. 2028	2.170	1
Apreciación latente de swaps de inflación (28 de febrero de 2023 [miles]: 842\$)				USD 441
Depreciación latente de swaps de inflación (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(2))				–
Depreciación neta de swaps de inflación (28 de febrero de 2023 [miles]: 840\$)				USD 441

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)	Moneda de venta (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
20-oct-2023	BNP Paribas	Compra NOK	1.919 Venta EUR	166 USD 1
20-oct-2023	BNP Paribas	Compra CAD	1.012 Venta USD	764 (14)
20-oct-2023	BNP Paribas	Compra AUD	971 Venta USD	648 (18)
20-oct-2023	Goldman Sachs	Compra USD	197 Venta MXN	3.418 (2)
20-oct-2023	JP Morgan	Compra USD	258 Venta CNH	1.846 4
20-oct-2023	JP Morgan	Compra IDR	439.327 Venta USD	29 –
20-oct-2023	Morgan Stanley	Compra USD	436 Venta CNH	3.125 4

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

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

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Listado de contratos de divisas a plazo — (continuación)

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)		Moneda de venta (en miles)		Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)			
20-oct-2023	Morgan Stanley	Compra	USD	189	Venta	EUR	171	USD	3
20-oct-2023	Morgan Stanley	Compra	USD	352	Venta	GBP	274		5
20-oct-2023	Morgan Stanley	Compra	JPY	119.577	Venta	USD	858		(29)
06-nov.-2023	JP Morgan	Compra	USD	79	Venta	AUD	120		1
06-nov.-2023	Morgan Stanley	Compra	AUD	120	Venta	USD	79		(1)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 11\$)								USD	18
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(58))									(64)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(47))								USD	(46)

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)					
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2023	Morgan Stanley	(40)	USD (9.460)	USD	88				
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2024	Morgan Stanley	20	4.792		(2)				
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2025	Morgan Stanley	4	964		–				
Índice SOFR de 3 meses Junio 2023	Morgan Stanley	(1)	(237)		–				
Índice SOFR de 3 meses Septiembre 2023	Morgan Stanley	(19)	(4.493)		12				
Bono a 10 años de Australia septiembre 2023	Morgan Stanley	5	376		(5)				
Dólar australiano Moneda septiembre 2023	Morgan Stanley	3	194		(7)				
Euro-Bund diciembre 2023	Morgan Stanley	1	144		2				
Bonos Euro-Buxl a 30 años diciembre de 2023	Morgan Stanley	(1)	(145)		(2)				
Euro-OAT diciembre de 2023	Morgan Stanley	2	276		3				
Fondo Fed 30 días agosto 2023	Morgan Stanley	(5)	(1.972)		–				
Fondo Fed 30 días septiembre 2023	Morgan Stanley	(14)	(5.522)		–				
Moneda Yen Japonés septiembre 2023	Morgan Stanley	6	517		(25)				
Long Gilt diciembre 2023	Morgan Stanley	2	242		4				
Moneda Peso Mexicano septiembre 2023	Morgan Stanley	7	206		7				
U.S. 10 Year Note (CBT) diciembre 2023	Morgan Stanley	8	888		8				
U.S. 10 Year Ultra Note diciembre 2023	Morgan Stanley	(10)	(1.161)		(16)				
U.S. 2 Year Note (CBT) diciembre 2023	Morgan Stanley	(16)	(3.261)		(6)				
U.S. 5 Year Note (CBT) diciembre 2023	Morgan Stanley	72	7.698		47				
U.S. Long Bond (CBT) diciembre 2023	Morgan Stanley	(7)	(852)		(11)				
U.S. Ultra Bond (CBT) diciembre 2023	Morgan Stanley	16	2.072		44				
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: 156\$)								USD	215
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(120))									(74)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: 36\$)								USD	141

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto
Bonos y obligaciones corporativos — 85,78 % (28 de febrero de 2023: 86,70 %)			Estados Unidos: 30,15 % (28 de febrero de 2023: 27,59 %)		
Australia: 1,19 % (28 de febrero de 2023: 1,16 %)			50 AbbVie Inc, 3,200 %, con vencimiento el 21/11/2029		
EUR	100	AusNet Services Holdings Pty Ltd, 1,625 %, con vencimiento el 11/03/2081 *		95	1,02
	20	Westpac Banking Corp, 2,668 %, con vencimiento el 15/11/2035 *		15	0,17
				110	1,19
Bélgica — 1,16 % (28 de febrero de 2023: 2,09 %)			60 AbbVie Inc, 4,875 %, con vencimiento el 14/11/2048		
EUR	100	Elia Transmission Belgium SA, 3,625 %, con vencimiento el 18/01/2033		100	0,97
				10	0,11
				20	0,22
				20	0,22
				20	0,22
				60	0,43
				100	1,08
				80	0,60
				19	0,19
				40	0,40
				60	0,55
				60	0,46
				30	0,32
				60	0,81
				50	0,35
				90	0,94
				80	0,76
				20	0,19
				30	0,31
				70	0,70
				58	0,63
				29	0,31
				75	0,82
				74	0,80
				70	0,76
				27	0,29
				10	0,11
				101	1,09
				32	0,35
				68	0,74
				130	1,41
				85	0,92
				110	1,19
				89	0,97
				10	0,11
				25	0,28
				49	0,53
				50	0,54
				106	1,15
				22	0,24
				106	1,15
				69	0,75
				86	0,93
				81	0,88
				17	0,18
				97	1,06
				39	0,42
				54	0,59
				87	0,95
				2.777	30,15
				7.900	85,78
Alemania: 10,04 % (28 de febrero de 2023: 9,60 %)			Total de bonos y pagarés corporativos (coste 9.0395)		
EUR	200	Allianz SE, 3,200 %, Perpetuo *			
EUR	100	altria office REIT-AG, 1,500 %, con vencimiento el 15/11/2027			
EUR	100	Amprion GmbH, 3,971 %, con vencimiento el 22/09/2032			
	60	Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750 %, con vencimiento el 15/06/2030			
EUR	100	E.ON SE, 3,750 %, con vencimiento el 01/03/2029			
EUR	100	Hannover Rueck SE, 1,125 %, con vencimiento el 09/10/2039 *			
EUR	100	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250 %, con vencimiento el 26/05/2049 *			
EUR	100	Sirius Real Estate Ltd, 1,125 %, con vencimiento el 22/06/2026			
EUR	120	Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, con vencimiento el 01/10/2024			
				925	10,04
Irlanda: 1,33 % (28 de febrero de 2023: 1,33 %)			Bonos y obligaciones del Estado — 6,91 % (28 de febrero de 2023: 8,26 %)		
	150	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, con vencimiento el 30/01/2032			
				122	1,33
Italia: 2,58 % (28 de febrero de 2023: 4,25 %)			Alemania: 2,07 % (28 de febrero de 2023: 3,90 %)		
	150	Enel Finance International NV, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 07/10/2039			
EUR	100	Terna – Rete Elettrica Nazionale, 2,375 %, Perpetuo *			
				144	1,56
				93	1,02
				237	2,58
Países Bajos: 4,04 % (28 de febrero de 2023: 4,04 %)			Estados Unidos: 4,84 % (28 de febrero de 2023: 4,36 %)		
EUR	80	ABN AMRO Bank NV, 1,000 %, con vencimiento el 16/04/2025			
EUR	200	Cooperatieve Rabobank UA, 3,250 %, Perpetuo *			
EUR	100	ING Groep NV, 2,500 %, con vencimiento el 15/02/2029 *			
				134	1,45
				132	1,43
				76	0,82
				31	0,34
				19	0,21
				54	0,59
				446	4,84
				637	6,91
				99	1,07
				92	1,00
				191	2,07
Portugal: 1,05 % (28 de febrero de 2023: 1,02 %)			Organismos de inversión colectiva — 3,96 % (28 de febrero de 2023: 0,33 %)		
EUR	100	EDP – Energias de Portugal SA, 1,875 %, con vencimiento el 02/08/2081 *			
				365	3,96
				365	3,96
Sudáfrica — 2,11 % (28 de febrero de 2023: 2,16 %)			Total de organismos de inversión colectiva (coste: 3655)		
	200	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 10/04/2027			
				191	2,07
España: 0,70 % (28 de febrero de 2023: 1,67 %)			Acciones ordinarias: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)		
	60	Telefonica Emisiones SA, 7,045 %, con vencimiento el 20/06/2036			
				200	0,00
				–	–
				–	–
Supranacional — 7,58 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			Total de acciones ordinarias (coste en USD)		
EUR	440	European Investment Bank, 0,050 %, con vencimiento el 15/11/2029			
	310	European Investment Bank, 3,750 %, con vencimiento el 14/02/2033			
				–	–
				–	–
				698	7,58
Suiza: 2,33 % (28 de febrero de 2023: 3,93 %)			Reino Unido: 11,07 % (28 de febrero de 2023: 13,16 %)		
EUR	200	UBS Group AG, 1,500 %, con vencimiento el 30/11/2024			
				105	1,14
				98	1,06
				108	1,17
				114	1,24
				108	1,17
				93	1,02
				100	1,09
				179	1,94
				115	1,24
				1.020	11,07

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto	
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 10.083\$)	8.902	96,65	
Contratos de divisas a plazo: 0,83 % (28 de febrero de 2023: 1,02 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	77	0,83	
Futuros — 0,29 % (28 de febrero de 2023: 0,66 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	26	0,29	
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	9.005	97,77	
Contratos de divisas a plazo — (1,74 %) (28 de febrero de 2023: (1,18 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(161)	(1,74)	
Futuros — (0,14 %) (28 de febrero de 2023: (0,05 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(13)	(0,14)	
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	(174)	(1,88)	
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	8.831	95,89	
Excedente de otros activos respecto a los pasivos	380	4,11	
Patrimonio	9.211\$	100,00	

— Los importes designados como “-” son 0 USD, menos de 1000 USD, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.

144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. El 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 517 000\$ o el 5,61 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.

† Poca liquidez.

ABREVIATURAS:

Perpetuo — Un bono sin fecha de vencimiento. Los bonos perpetuos no son rescatables, pero pagan un flujo constante de intereses.

EUR — euro

GBP — libra esterlina

	% del total de activos
Análisis del total de activos	
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	90,29
Organismos de inversión colectiva	3,86
Instrumentos financieros derivados	1,09
Otros activos	4,76
Total de activos	100,00

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)	Moneda de venta (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra USD 36	Venta BRL 178	USD -
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra USD 2.779	Venta BRL 13.605	33
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra BRL 13.782	Venta USD 2.904	(124)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra USD 2	Venta EUR 2	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra USD -	Venta GBP -	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra GBP -	Venta USD -	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra USD 32	Venta USD 40	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra EUR 74	Venta USD 82	(2)
03-oct-2023	BNY Mellon	Compra BRL 13.529	Venta USD 2.752	(34)
16-nov.-2023	BNP Paribas	Compra USD 207	Venta EUR 191	(1)
16-nov.-2023	BNP Paribas	Compra USD 155	Venta EUR 141	2
16-nov.-2023	BNP Paribas	Compra USD 6	Venta GBP 5	-
16-nov.-2023	Citi	Compra USD 1.948	Venta EUR 1.773	19
16-nov.-2023	Citi	Compra USD 468	Venta GBP 368	1
16-nov.-2023	Citi	Compra EUR 14	Venta USD 15	-
16-nov.-2023	Goldman Sachs	Compra USD 2.027	Venta EUR 1.844	20
16-nov.-2023	Goldman Sachs	Compra USD 4	Venta GBP 3	-
16-nov.-2023	JP Morgan	Compra USD 100	Venta EUR 91	1
16-nov.-2023	JP Morgan	Compra GBP 4	Venta USD 5	-
16-nov.-2023	Morgan Stanley	Compra USD 113	Venta EUR 103	1
16-nov.-2023	Morgan Stanley	Compra USD 30	Venta GBP 24	-
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 92\$)				USD 77
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(107))				(161)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(15))				USD (84)

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Euro-Bobl diciembre de 2023	Morgan Stanley	(8)	USD (1.019)	USD (6)
Euro-BTP diciembre de 2023	Morgan Stanley	(2)	(250)	(2)
Euro-Bund diciembre 2023	Morgan Stanley	2	288	3
Bonos Euro-Buxl a 30 años diciembre de 2023	Morgan Stanley	(1)	(145)	(2)
Long Gilt diciembre 2023	Morgan Stanley	2	242	4
U.S. 10 Year Note (CBT) diciembre 2023	Morgan Stanley	4	444	5
U.S. 5 Year Note (CBT) diciembre 2023	Morgan Stanley	8	855	5
U.S. Long Bond (CBT) diciembre 2023	Morgan Stanley	4	487	9
U.S. Ultra Bond (CBT) diciembre 2023	Morgan Stanley	(1)	(130)	(3)
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: 59\$)				USD 26
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(5))				(13)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: 54\$)				USD 13

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto
Bonos y obligaciones corporativos — 9,01 % (28 de febrero de 2023: 14,55 %)					
Supranacional — 9,01 % (28 de febrero de 2023: 9,22 %)					
RUB	368.000	International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, con vencimiento el 22/01/2026	2.670	1,73	
ZAR	56.200	International Bank for Reconstruction & Development, 6,500 %, con vencimiento el 21/01/2027	2.804	1,82	
RUB	349.000	International Bank for Reconstruction & Development, 6,750 %, con vencimiento el 21/01/2027	2.481	1,61	
MXN	51.300	International Bank for Reconstruction & Development, 7,250 %, con vencimiento el 21/01/2027	2.761	1,79	
BRL	15.600	International Bank for Reconstruction & Development, 9,500 %, con vencimiento el 09/02/2029	3.168	2,06	
			13.884	9,01	
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 17.9695)					
Bonos y obligaciones del Estado — 86,78 % (28 de febrero de 2023: 84,35 %)					
Australia: 3,30 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)					
AUD	7.900	Australia Government Bond, Series 137, 2,750 %, con vencimiento el 21/04/2024	5.078	3,30	
Brasil — 4,99 % (28 de febrero de 2023: 4,34 %)					
BRL	38.410	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2025	7.695	4,99	
Canadá: 3,00 % (28 de febrero de 2023: 2,83 %)					
CAD	6.500	Province of Manitoba Canada, 2,450 %, con vencimiento el 02/06/2025	4.617	3,00	
Chile: 3,02 % (28 de febrero de 2023: 0,87 %)					
	4.813	Chile Government International Bond, 4,950 %, con vencimiento el 05/01/2036	4.650	3,02	
Colombia — 5,97 % (28 de febrero de 2023: 4,89 %)					
COP	43.330.000	TES colombianos, Serie B, 9,250 %, con vencimiento el 28/05/2042	9.205	5,97	
Alemania: 3,48 % (28 de febrero de 2023: 5,44 %)					
EUR	4.960	German Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 20/09/2023	5.370	3,48	
México: 12,19 % (28 de febrero de 2023: 13,18 %)					
MXN	92.200	Bonos Mexicanos, Series M, 8,000 %, con vencimiento el 24/05/2035	4.933	3,20	
MXN	93.400	Bonos Mexicanos, Series M, 7,750 %, con vencimiento el 13/11/2042	4.681	3,04	
MXN	137.000	Bonos Mexicanos, Series M, 8,000 %, con vencimiento el 07/11/2047	6.991	4,54	
MXN	43.000	Bonos Mexicanos, Series M, 8,000 %, con vencimiento el 31/07/2053	2.176	1,41	
			18.781	12,19	
Nueva Zelanda: 1,24 % (28 de febrero de 2023: 1,27 %)					
NZD	2.370	New Zealand Government Bond, serie 0534, 4,250 %, con vencimiento el 15/05/2034	1.337	0,87	
NZD	1.480	New Zealand Government Bond, serie 0551, 2,750 %, con vencimiento el 15/05/2051	581	0,37	
			1.918	1,24	
Noruega — 3,44 % (28 de febrero de 2023: 3,78 %)					
NOK	56.800	Norway Government Bond, Serie 476, 144A, 3,000 %, con vencimiento 14/03/2024	5.308	3,44	
Sudáfrica — 3,75 % (28 de febrero de 2023: 4,06 %)					
ZAR	87.700	Republic of South Africa Government Bond, Serie R214, 6,500 %, con vencimiento el 28/02/2041	2.741	1,78	
ZAR	79.600	Republic of South Africa Government Bond, Serie R214, 8,750 %, con vencimiento el 28/02/2048	3.046	1,97	
			5.787	3,75	
Reino Unido: 10,32 % (28 de febrero de 2023: 4,35 %)					
GBP	7.230	United Kingdom Gilt, 3,250 %, con vencimiento el 31/01/2033	8.388	5,44	
GBP	12.350	United Kingdom Gilt, 1,250 %, con vencimiento el 31/07/2051	7.518	4,88	
			15.906	10,32	
Estados Unidos: 32,08 % (28 de febrero de 2023: 29,58 %)					
	1.880	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025 *	1.883	1,22	

880	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 5,498 %, con vencimiento el 31/07/2025 *	879	0,57
17.160	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2033	16.345	10,61
18.830	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, con vencimiento el 15/11/2051	11.574	7,51
14.050	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, con vencimiento el 15/02/2052	9.482	6,15
11.640	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, con vencimiento el 15/08/2052	9.280	6,02
		49.443	32,08
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 149.5655)			
Organismos de inversión colectiva — 2,83 % (28 de febrero de 2023: 2,53 %)			
4.355	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	4.355	2,83
Total de organismos de inversión colectiva (coste: 4.3555)			
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 171.8895)			
Contratos de divisas a plazo: 0,94 % (28 de febrero de 2023: 1,94 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)			
		1.454	0,94
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 171.8895)			
Contratos de divisas a plazo — (2,17 %) (28 de febrero de 2023: (2,45 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)			
		(3.353)	(2,17)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 3.353)			
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias			
		150.098	97,39
Excedente de otros activos respecto a los pasivos			
		4.028	2,61
Patrimonio			
		154.126\$	100,00
– Los importes designados como “-” son 0 USD, menos de 1000 USD, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.			
144A	Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. El 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 5 308 000\$ o el 3,44 % del patrimonio neto.		
*	Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.		

ABREVIATURAS:					
AUD	–	dólar australiano			
BRL	–	real brasileño			
CAD	–	dólar canadiense			
COP	–	peso colombiano			
EUR	–	euro			
GBP	–	libra esterlina			
MXN	–	peso mexicano			
NOK	–	corona noruega			
NZD	–	dólar neozelandés			
RUB	–	rublo ruso			
ZAR	–	Rand sudafricano			

Análisis del total de activos					
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado					
					92,78
Organismos de inversión colectiva					
					2,74
Instrumentos financieros derivados					
					0,91
Otros activos					
					3,57
Total de activos					
					100,00

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)	Moneda de venta (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
01 sep. 2023	JP Morgan	Compra USD	Venta GBP	(145)
01 sep. 2023	JP Morgan	Compra USD	Venta GBP	126
01 sep. 2023	JP Morgan	Compra GBP	Venta USD	132
01 sep. 2023	JP Morgan	Compra GBP	Venta USD	(2)
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra USD	Venta EUR	–
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra USD	Venta EUR	–

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Listado de contratos de divisas a plazo — (continuación)

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)			Moneda de venta (en miles)			Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	33	Venta	GBP	25	USD	—
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	—	Venta	GBP	—		—
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	30	Venta	USD	33		—
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	—	Venta	USD	—		—
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	—	Venta	USD	—		—
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	24	Venta	USD	33		—
11 sep. 2023	Barclays	Compra	INR	306.000	Venta	USD	3.715		(18)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	467	Venta	AUD	708		8
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	299	Venta	AUD	497		1
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	—	Venta	AUD	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	82	Venta	AUD	158		2
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	—	Venta	AUD	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	110	Venta	CAD	189		2
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	638	Venta	CAD	850		8
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	—	Venta	CAD	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	—	Venta	CAD	1		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	408	Venta	CAD	598		1
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	340	Venta	CNY	3.093		4
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	1.130	Venta	CNY	8.854		6
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	—	Venta	CNY	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	107	Venta	CNY	859		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	1.936	Venta	CNY	13.811		33
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	—	Venta	DKK	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	68	Venta	DKK	495		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	18	Venta	DKK	159		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	104	Venta	DKK	707		1
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	4	Venta	EUR	4		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NOK	14	Venta	EUR	1		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	32	Venta	EUR	38		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	1.830	Venta	EUR	2.122		15
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	—	Venta	EUR	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	AUD	2	Venta	EUR	1		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NZD	3	Venta	EUR	1		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	JPY	1.713	Venta	EUR	10		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SEK	4	Venta	EUR	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SEK	17	Venta	EUR	1		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NOK	2	Venta	EUR	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	JPY	16.065	Venta	EUR	103		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	ILS	—	Venta	EUR	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	MXN	13	Venta	EUR	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	MXN	153	Venta	EUR	8		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	ILS	10	Venta	EUR	1		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	5	Venta	EUR	4		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	PLN	4	Venta	EUR	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CNY	361	Venta	EUR	46		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	10.817	Venta	EUR	9.855		124
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NZD	—	Venta	EUR	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	DKK	—	Venta	EUR	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CNY	52	Venta	EUR	7		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	DKK	21	Venta	EUR	2		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	AUD	3	Venta	EUR	1		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CAD	4	Venta	EUR	2		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CAD	2	Venta	EUR	1		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	PLN	6	Venta	EUR	2		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CNY	16	Venta	GBP	1		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NZD	—	Venta	GBP	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NZD	—	Venta	GBP	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CAD	—	Venta	GBP	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	PLN	—	Venta	GBP	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	AUD	—	Venta	GBP	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NOK	—	Venta	GBP	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	ILS	—	Venta	GBP	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SEK	5	Venta	GBP	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CAD	—	Venta	GBP	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	1.024	Venta	GBP	883		(7)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	38	Venta	GBP	32		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	MXN	2	Venta	GBP	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NOK	4	Venta	GBP	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	MXN	50	Venta	GBP	2		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SEK	—	Venta	GBP	—		—
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	—	Venta	GBP	—		—

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Listado de contratos de divisas a plazo — (continuación)

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)			Moneda de venta (en miles)			Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	2	Venta	GBP	–	USD	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CNY	115	Venta	GBP	12		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	DKK	–	Venta	GBP	–		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	ILS	2	Venta	GBP	–		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	–	Venta	GBP	–		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	1.721	Venta	GBP	1.349		9
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	AUD	–	Venta	GBP	–		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	DKK	5	Venta	GBP	–		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	PLN	4	Venta	GBP	1		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	JPY	746	Venta	GBP	4		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	JPY	5.493	Venta	GBP	30		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	ILS	–		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	–	Venta	ILS	–		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	64	Venta	ILS	250		1
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	97	Venta	ILS	356		3
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	15	Venta	ILS	79		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	4.514	Venta	JPY	640.363		105
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	3	Venta	JPY	352		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	2.887	Venta	JPY	449.408		38
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	789	Venta	JPY	142.727		19
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	2	Venta	JPY	476		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	56	Venta	MXN	1.255		(2)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	208	Venta	MXN	3.954		(7)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	323	Venta	MXN	5.633		(6)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	–	Venta	MXN	2		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	MXN	3		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	–	Venta	NOK	–		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	54	Venta	NOK	550		2
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	35	Venta	NOK	386		1
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	9	Venta	NOK	122		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	NOK	–		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	NZD	–		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	72	Venta	NZD	118		2
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	47	Venta	NZD	84		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	–	Venta	NZD	–		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	12	Venta	NZD	27		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	162	Venta	PLN	658		2
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	102	Venta	PLN	454		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	27	Venta	PLN	146		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	PLN	–		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	–	Venta	PLN	–		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	–	Venta	SEK	–		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	65	Venta	SEK	687		2
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	42	Venta	SEK	484		1
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	11	Venta	SEK	153		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	SEK	–		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	144	Venta	SGD	192		2
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	–	Venta	SGD	–		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	SGD	–		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	25	Venta	SGD	44		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	93	Venta	SGD	136		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	43	Venta	USD	54		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	11	Venta	USD	9		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NZD	7	Venta	USD	4		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CNY	828	Venta	USD	115		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NOK	18	Venta	USD	2		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	DKK	22	Venta	USD	3		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CAD	24	Venta	USD	18		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	JPY	39.306	Venta	USD	270		2
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	MXN	324	Venta	USD	19		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	9.708	Venta	USD	10.658		(125)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	2.695	Venta	USD	3.429		(19)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	PLN	40	Venta	USD	10		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	AUD	21	Venta	USD	13		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NOK	16	Venta	USD	2		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	268	Venta	USD	291		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	DKK	20	Venta	USD	3		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	ILS	22	Venta	USD	6		–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SEK	42	Venta	USD	4		–
13 sep. 2023	Citi	Compra	USD	154	Venta	KRW	200.000		3
13 sep. 2023	Citi	Compra	USD	7.706	Venta	KRW	10.300.000		(83)
13 sep. 2023	Citi	Compra	KRW	10.500.000	Venta	USD	8.094		(153)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Listado de contratos de divisas a plazo — (continuación)

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)			Moneda de venta (en miles)			Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
		Compra		Venta	Compra		Venta		
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	7	Venta	AUD	10	USD	–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	2	Venta	EUR	1		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	104	Venta	EUR	95		1
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	60	Venta	GBP	48		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	561	Venta	GBP	441		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	2.635	Venta	USD	2.898		(40)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	1	Venta	USD	1		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	AUD	288	Venta	USD	188		(2)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	9.125	Venta	USD	11.620		(61)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	9	Venta	USD	11		–
19 sep. 2023	JP Morgan	Compra	JPY	4.729.000	Venta	USD	34.400		(1.798)
19 sep. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	802	Venta	JPY	113.000		23
19 sep. 2023	UBS	Compra	USD	332	Venta	JPY	47.000		8
22 sep. 2023	Citi	Compra	USD	795	Venta	NOK	8.000		43
22 sep. 2023	JP Morgan	Compra	NOK	40.200	Venta	USD	3.800		(17)
22 sep. 2023	JP Morgan	Compra	NOK	26.600	Venta	USD	2.474		30
22 sep. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	168	Venta	NOK	1.800		(1)
22 sep. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	2.563	Venta	NOK	25.600		153
26 sep. 2023	Barclays	Compra	USD	2.060	Venta	NZD	3.390		39
26 sep. 2023	Barclays	Compra	NZD	1.040	Venta	USD	645		(25)
26 sep. 2023	UBS	Compra	USD	160	Venta	NZD	260		5
17-oct-2023	Goldman Sachs	Compra	MYR	29.500	Venta	USD	6.529		(147)
19-oct-2023	HSBC	Compra	USD	6.626	Venta	BRL	32.300		151
25-oct-2023	Citi	Compra	USD	3.987	Venta	CAD	5.240		106
27-oct-2023	Citi	Compra	USD	21.376	Venta	MXN	365.200		181
27-oct-2023	Goldman Sachs	Compra	MXN	5.300	Venta	USD	309		(1)
27-oct-2023	Morgan Stanley	Compra	MXN	49.100	Venta	USD	2.867		(17)
30-oct-2023	JP Morgan	Compra	USD	1.915	Venta	COP	7.820.000		36
30-oct-2023	JP Morgan	Compra	USD	4.473	Venta	COP	18.960.000		(82)
07-nov.-2023	HSBC	Compra	EUR	3.400	Venta	USD	3.696		3
07-nov.-2023	JP Morgan	Compra	EUR	20.460	Venta	USD	22.634		(374)
07-nov.-2023	Morgan Stanley	Compra	USD	621	Venta	EUR	560		12
10-nov.-2023	HSBC	Compra	USD	1.254	Venta	THB	44.400		(23)
10-nov.-2023	HSBC	Compra	THB	44.400	Venta	USD	1.292		(15)
15-nov.-2023	HSBC	Compra	USD	8.503	Venta	ZAR	162.900		(65)
17-nov.-2023	JP Morgan	Compra	CNH	15.530	Venta	USD	2.157		(13)
06-dic.-2023	JP Morgan	Compra	AUD	1.530	Venta	USD	987		8
08-dic.-2023	JP Morgan	Compra	USD	13.705	Venta	GBP	10.900		(105)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 3.132\$)								USD	1.454
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(3.966))									(3.353)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(834))								USD	(1.899)

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto							
Valores garantizados por hipotecas — 22,12 % (28 de febrero de 2023: 21,89 %)			Perú: 4,10 % (28 de febrero de 2023: 3,69 %)									
4.950	COMMM 2017-PANW Mortgage Trust, Serie 2017 PANW, Clase D, 144A, 4,343 %, con vencimiento el 10/10/2029 *	4.347	1,70	PEN	39.970	Bono del Estado de Perú, 6,150 %, con vencimiento el 12/08/2032	10.491	4,10				
5.039	Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	4.781	1,87	Sudafrica — 3,74 % (28 de febrero de 2023: 2,91 %)								
2.618	Fannie Mae Pool 'MA4785', 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2052	2.541	0,99	ZAR	250.300	Republic of South Africa Government Bond, Serie R214, 8,750 %, con vencimiento el 28/02/2048	9.578	3,74				
4.797	Fannie Mae Pool 'MA4841', 5,000 %, con vencimiento el 01/12/2052	4.655	1,82	Reino Unido: 2,33 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)								
4.957	Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	4.901	1,91	GBP	9.790	United Kingdom Gilt, 1,250 %, con vencimiento el 31/07/2051	5.960	2,33				
2.201	Freddie Mac Pool 'RA7790', 5,000 %, con vencimiento el 01/08/2052	2.137	0,83	Estados Unidos: 38,05 % (28 de febrero de 2023: 32,72 %)								
3.679	Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	3.490	1,36	5.250	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025 *	5.258	2,05					
3.269	Freddie Mac Pool 'SD8257', 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2052	3.102	1,21	17.130	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 5,418 %, con vencimiento el 30/04/2025 *	17.138	6,70					
2.735	Freddie Mac Pool 'SD8267', 5,000 %, con vencimiento el 01/11/2052	2.654	1,04	83.550	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, con vencimiento el 15/08/2032	75.009	29,30					
7.021	Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	6.941	2,71	Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 175.7915)			174.669	68,23				
2.598	Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500 %, con vencimiento el 20/02/2053	2.573	1,01	Organismos de inversión colectiva — 3,01 % (28 de febrero de 2023: 5,67 %)								
4.899	Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2053	4.852	1,90	7.710	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	7.710	3,01					
3.356	Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, con vencimiento el 20/05/2053	3.324	1,30	Total de organismos de inversión colectiva (coste: 7.7105)			7.710	3,01				
3.845	Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000 %, con vencimiento el 20/06/2053	3.743	1,46	Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 263.1375)			260.160	101,62				
2.608	Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500 %, con vencimiento el 20/06/2053	2.583	1,01	Contratos de divisas a plazo: 2,94 % (28 de febrero de 2023: 2,41 %)								
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 58 067 USD)			56.624	22,12	Apresiasi latente sobre contratos (véase más abajo)			7.522	2,94			
Bonos y obligaciones corporativos — 8,26 % (28 de febrero de 2023: 7,26 %)			Australia: 2,46 % (28 de febrero de 2023: 4,87 %)			Futuros — 0,20 % (28 de febrero de 2023: 0,41 %)						
6.280	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,955 %, con vencimiento el 14/03/2025 *	6.291	2,46	Apresiasi latente sobre contratos (véase más abajo)			512	0,20				
México: 0,96 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			Estados Unidos: 4,84 % (28 de febrero de 2023: 2,39 %)			Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias			268.194	104,76		
3.990	Petróleos Mexicanos, 6,950 %, con vencimiento el 28/01/2060	2.472	0,96	Contratos de divisas a plazo — (6,46 %) (28 de febrero de 2023: (4,38 %))			Depreciación latente de contratos (véase más abajo)			(16.536)	(6,46)	
5.600	General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, con vencimiento el 06/04/2026	5.533	2,16	Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias			Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias			251.658	98,30	
1.905	Jabil Inc, 3,000 %, con vencimiento el 15/01/2031	1.593	0,62	Excedente de otros activos respecto a los pasivos			Patrimonio			4.352	1,70	
5.340	Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, con vencimiento el 18/05/2026	5.268	2,06	Los importes designados como "-" son 0 USD, menos de 1000 USD, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.			144A			256.010\$	100,00	
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 21.5695)			21.157	8,26	Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. El 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 10 638 000\$ o el 4,16 % del patrimonio neto.			* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.				
Bonos y obligaciones del Estado — 68,23 % (28 de febrero de 2023: 65,08 %)			Brazil: 4,74 % (28 de febrero de 2023: 7,30 %)			ABREVIATURAS:						
BRL	64.000	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2033	12.138	4,74	BRL	–	real brasileño					
Colombia — 6,70 % (28 de febrero de 2023: 5,75 %)			México: 6,13 % (28 de febrero de 2023: 5,75 %)			COP	–	peso colombiano				
COP	29.810.000	TES colombianos, Serie B, 9,250 %, con vencimiento el 28/05/2042	6.333	2,47	MXN	88.900	Bonos Mexicanos, Series M, 8,000 %, con vencimiento el 07/11/2047	4.537	1,77			
COP	64.550.000	TES colombianos, Serie B, 7,250 %, con vencimiento el 26/10/2050	10.832	4,23	MXN	220.200	Bonos Mexicanos, Series M, 8,000 %, con vencimiento el 31/07/2053	11.144	4,36			
			17.165	6,70	Nueva Zelanda: 2,44 % (28 de febrero de 2023: 2,68 %)							
						NZD	15.920	New Zealand Government Bond, serie 0551, 2,750 %, con vencimiento el 15/05/2051	6.251	2,44		

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)	Moneda de venta (en miles)	Apresiasi/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)				
01 sep. 2023	JP Morgan	USD	35.208	Venta	GBP	27.410	USD	485
01 sep. 2023	Morgan Stanley	Compra	GBP	10.570	Venta	USD	13.537	(147)
06 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	74	Venta	USD	55	–
11 sep. 2023	Barclays	Compra	USD	9.374	Venta	CHF	8.420	(169)
11 sep. 2023	Barclays	Compra	USD	4.369	Venta	INR	362.000	(4)
11 sep. 2023	Barclays	Compra	USD	5.385	Venta	INR	444.000	20
11 sep. 2023	Barclays	Compra	INR	1.903.000	Venta	USD	23.102	(110)
11 sep. 2023	Goldman Sachs	Compra	USD	83.623	Venta	CHF	74.550	(872)
11 sep. 2023	HSBC	Compra	CHF	1.050	Venta	USD	1.200	(10)
11 sep. 2023	Morgan Stanley	Compra	CHF	4.270	Venta	USD	4.821	19
11 sep. 2023	Morgan Stanley	Compra	CHF	14.900	Venta	USD	17.037	(149)

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Listado de contratos de divisas a plazo — (continuación)

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

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Bono a 10 años de Japón (OSE) septiembre de 2023	Morgan Stanley	(37)	USD (37.337)	USD 326
U.S. 10 Year Note (CBT) diciembre 2023	Morgan Stanley	195	21.651	186
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: 2.190\$)				USD 512
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: USD-)				-
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: 2.190\$)				USD 512

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto
Bonos y obligaciones corporativos — 94,90 % (28 de febrero de 2023: 95,87 %)					
Austria: 0,83 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)					
200 Benteler International AG, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 15/05/2028	202	0,83	150 Dream Finders Homes Inc, 144A, 8,250 %, con vencimiento el 15/08/2028	152	0,63
Canadá: 6,54 % (28 de febrero de 2023: 3,28 %)					
576 Athabasca Oil Corp, 144A, 9,750 %, con vencimiento el 01/11/2026	594	2,44	50 FirstCash Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 01/09/2028	45	0,18
310 Baytex Energy Corp, 144A, 8,750 %, con vencimiento el 01/04/2027	318	1,31	510 FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 01/01/2030	464	1,91
515 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2026	476	1,95	100 Freedom Mortgage Corp, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 15/11/2024	100	0,41
220 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/04/2029	204	0,84	380 Freedom Mortgage Corp, 7,625 %, con vencimiento el 01/05/2026	350	1,44
	1.592	6,54	625 GrubHub Holdings Inc, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 01/07/2027	433	1,78
Colombia — 1,10 % (28 de febrero de 2023: 1,29 %)					
200 Ecopetrol SA, 8,625 %, con vencimiento el 19/01/2029	204	0,84	270 Home BancShares Inc/AR, 3,125 %, con vencimiento el 30/01/2032 *	223	0,92
80 Ecopetrol SA, 4,625 %, con vencimiento el 02/11/2031	63	0,26	225 Horizon Therapeutics USA Inc, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 01/08/2027	230	0,95
	267	1,10	375 IRB Holding Corp, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/06/2025	375	1,54
República Checa — 2,62 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)					
EUR 575 Allwyn Entertainment Financing UK Plc, 7,250 %, con vencimiento el 30/04/2030	637	2,62	445 LCPR Secured Financing DAC, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 15/10/2027	419	1,72
Finlandia — 1,47 % (28 de febrero de 2023: 0,28 %)					
374 Nokia Oyj, 6,625 %, con vencimiento el 15/05/2039	356	1,47	275 Liberty Interactive LLC, 8,250 %, con vencimiento el 01/02/2030	107	0,44
Francia: 0,36 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)					
EUR 100 Altice France SA/France, 5,875 %, con vencimiento el 01/02/2027	88	0,36	165 Lindblad Expeditions LLC, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 15/02/2027	159	0,66
Israel — 7,58 % (28 de febrero de 2023: 3,42 %)					
370 Delek Overriding Royalty Leviathan Ltd, 144A, 7,494 %, con vencimiento el 30/12/2023	368	1,51	610 Motiv Holdings Inc, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 01/10/2026	553	2,27
440 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 30/03/2024	436	1,79	425 Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 01/05/2029	370	1,52
400 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 30/03/2026	376	1,55	100 New York Community Bancorp Inc, 5,900 %, con vencimiento el 06/11/2028 *	96	0,40
150 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 30/03/2028	137	0,56	145 Nissan Motor Acceptance Corp, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 21/09/2023	145	0,60
150 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 30/06/2025	147	0,61	175 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 15/02/2028	164	0,68
160 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 30/06/2027	155	0,64	320 PDC Energy Inc, 5,750 %, con vencimiento el 15/05/2026	319	1,31
239 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 30/06/2030	225	0,92	150 PennyMac Financial Services Inc, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 15/02/2029	124	0,51
	1.844	7,58	70 PennyMac Financial Services Inc, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/09/2031	59	0,24
Italia: 0,42 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)					
EUR 100 Itelyum Regeneration Spa, 4,625 %, con vencimiento el 01/10/2026	102	0,42	20 PRA Group Inc/The, 8,375 %, con vencimiento el 01/02/2028	18	0,07
Japón: 0,82 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)					
200 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,043 %, con vencimiento 15/09/2023	200	0,82	400 PRA Group Inc/The, 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2029	302	1,24
México: 3,15 % (28 de febrero de 2023: 1,49 %)					
370 Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, con vencimiento el 15/11/2029	235	0,97	225 PROG Holdings Inc, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 15/11/2029	202	0,83
300 Petróleos Mexicanos, 5,950 %, con vencimiento el 28/01/2031	217	0,89	145 QVC Inc, 4,750 %, con vencimiento el 15/02/2027	96	0,39
415 Petróleos Mexicanos, 6,700 %, con vencimiento el 16/02/2032	314	1,29	405 QVC Inc, 4,375 %, con vencimiento el 01/09/2028	230	0,94
	766	3,15	70 Radian Group Inc, 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2024	68	0,28
Nigeria — 0,67 % (28 de febrero de 2023: 1,58 %)					
200 IHS Holding Ltd, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 29/11/2028	162	0,67	95 Rocket Mortgage LLC, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 15/01/2028	89	0,37
Corea del Sur: 0,74 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)					
200 SK Hynix Inc, 144A, 1,500 %, con vencimiento el 19/01/2026	180	0,74	440 Sabre GILB Inc, 144A, 9,250 %, con vencimiento el 15/04/2025	434	1,78
Reino Unido: 1,74 % (28 de febrero de 2023: 2,55 %)					
150 BAT Capital Corp, 7,079 %, con vencimiento el 02/08/2043	149	0,61	150 Signature Bank/New York NY, 4,000 %, con vencimiento el 15/10/2030 *	2	0,01
138 British Airways 2019-1 Class AA Pass Through Trust, 144A, 3,300 %, con vencimiento el 15/12/2032	121	0,50	50 Solaris Midstream Holdings LLC, 144A, 7,625 %, con vencimiento el 01/04/2026	49	0,20
160 Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 6,750 %, con vencimiento el 01/10/2026	152	0,63	EUR 400 Standard Industries Inc/NJ, 2,250 %, con vencimiento el 21/11/2026	385	1,58
	422	1,74	405 Station Casinos LLC, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 01/12/2031	334	1,37
Estados Unidos: 65,22 % (28 de febrero de 2023: 77,01 %)					
150 Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 01/03/2028	140	0,57	55 Synchrony Financial, 7,250 %, con vencimiento el 02/02/2033	51	0,21
50 Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250 %, con vencimiento el 15/02/2026	50	0,21	95 Texas Capital Bancshares Inc, 4,000 %, con vencimiento el 06/05/2031 *	79	0,32
700 Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/12/2027	621	2,55	160 TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/03/2026	159	0,65
275 Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 15/08/2027	269	1,11	249 Turning Point Brands Inc, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 15/02/2026	233	0,96
445 ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2028	358	1,47	515 Uber Technologies Inc, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 15/05/2025	520	2,14
250 Arko Corp, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 15/11/2029	206	0,84	376 Uber Technologies Inc, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 01/11/2026	383	1,58
240 Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 01/02/2026	231	0,95	100 United States Cellular Corp, 6,700 %, con vencimiento el 15/12/2033	98	0,40
385 Burford Capital Finance LLC, 6,125 %, con vencimiento el 12/08/2025	371	1,53	450 United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/04/2029	391	1,61
620 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/04/2030	569	2,34	600 Valvoline Inc, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 15/02/2030	590	2,43
200 Capital One Financial Corp, 1,343 %, con vencimiento el 06/12/2024 *	197	0,81	755 Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 01/02/2029	658	2,70
150 Cargo Aircraft Management Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2028	136	0,56	200 Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 01/06/2028	202	0,83
475 Cimarex Energy Co, 3,900 %, con vencimiento el 15/05/2027	417	1,71	325 Viking Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/05/2025	320	1,32
280 Cimarex Energy Co, 4,375 %, con vencimiento el 15/03/2029	226	0,93	200 WESCO Distribution Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 15/06/2025	201	0,83
175 Concentrix Corp, 6,850 %, con vencimiento el 02/08/2033	168	0,69	150 Western Alliance Bancorp, 3,000 %, con vencimiento el 15/06/2031 *	119	0,49
200 Credit Acceptance Corp, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 31/12/2024	195	0,80	EUR 200 WMG Acquisition Corp, 2,250 %, con vencimiento el 15/08/2031	175	0,72
235 Credit Acceptance Corp, 6,625 %, con vencimiento el 15/03/2026	229	0,94	100 World Acceptance Corp, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 01/11/2026	87	0,36
150 Crocs Inc, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2031	119	0,49		15.864	65,22
Zambia — 1,64 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)					
			400 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 01/04/2025	400	1,64
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 23.138\$)				23.082	94,90
Organismos de inversión colectiva — 3,48 % (28 de febrero de 2023: 3,81 %)					
			846 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	846	3,48
Total de organismos de inversión colectiva (coste: 846\$)				846	3,48
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 23.984\$)					
Contratos de divisas a plazo: 0,05 % (28 de febrero de 2023: 0,10 %)					
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)					
				12	0,05
Futuros — 0,17 % (28 de febrero de 2023: 0,01 %)					
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)					
				42	0,17
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias				23.982	98,60

[^] No está autorizada para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto	
Contratos de divisas a plazo: (1,01 %) (28 de febrero de 2023: (1,94 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(245)	(1,01)	
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	(245)	(1,01)	
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	23.737	97,59	
Excedente de otros activos respecto a los pasivos	585	2,41	
Patrimonio	24.322\$	100,00	

Los importes designados como “-” son 0 USD, menos de 1000 USD, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.

144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. El 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 16 794 000\$ o el 69,05 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.

ABREVIATURAS:

EUR – euro

	% del total de activos
Análisis del total de activos	
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	92,00
Organismos de inversión colectiva	3,37
Instrumentos financieros derivados	0,22
Otros activos	4,41
Total de activos	100,00

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)	Moneda de venta (en miles)	Apresiasi/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
01 sep. 2023	Morgan Stanley	Compra GBP	330 Venta USD	410 USD 8
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra EUR	1 Venta CHF	2 –
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra CAD	3 Venta CHF	2 –
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra GBP	– Venta CHF	– –
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra CAD	2.456 Venta EUR	1.678 (3)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra GBP	10 Venta EUR	12 –
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra CAD	26 Venta EUR	17 –
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra CAD	268 Venta GBP	158 (2)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra EUR	146 Venta GBP	125 (1)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra CAD	3 Venta GBP	2 –
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra EUR	2 Venta SEK	18 –
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra GBP	– Venta SEK	– –
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra CAD	3 Venta SEK	22 –
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra EUR	6.137 Venta USD	6.737 (79)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra CAD	11.297 Venta USD	8.474 (111)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra CAD	118 Venta USD	87 –
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra GBP	46 Venta USD	60 –
07-nov.-2023	HSBC	Compra EUR	60 Venta USD	66 –
07-nov.-2023	JP Morgan	Compra EUR	2.670 Venta USD	2.954 (49)
07-nov.-2023	Morgan Stanley	Compra USD	87 Venta EUR	80 –
08-dic.-2023	JP Morgan	Compra GBP	370 Venta USD	465 4
Apresiasi latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 10\$)				USD 12
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(202))				(245)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(192))				USD (233)

Listado de contratos de futuros

Contraparte	Valor nominal	Valor teórico (en miles)	Apresiasi/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
U.S. 10 Year Note (CBT) diciembre 2023 Citi	44	USD 4.885	USD 42
Apresiasi latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: 2\$)			USD 42
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: USD-)			–
Apresiasi neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: 2\$)			USD 42

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto			
Valores garantizados por hipotecas — 13,61 % (28 de febrero de 2023: 13,19 %)			4.840	United States Treasury Floating Rate Note - Cuando se emita, 5,498 %, con vencimiento el 31/07/2025 *	4.836	2,33		
1.015	Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	963	0,46	5.860	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, con vencimiento el 15/02/2032	4.926	2,37	
1.561	Fannie Mae Pool 'MA4785', 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2052	1.515	0,73	26.690	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2033	25.422	12,24	
3.312	Fannie Mae Pool 'MA4841', 5,000 %, con vencimiento el 01/12/2052	3.215	1,55	9.140	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, con vencimiento el 15/11/2051	5.618	2,70	
3.725	Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	3.682	1,77	16.820	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, con vencimiento el 15/02/2052	11.352	5,46	
1.502	Freddie Mac Pool 'RA7790', 5,000 %, con vencimiento el 01/08/2052	1.459	0,70			9.607	4,62	
1.871	Freddie Mac Pool 'SD8257', 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2052	1.775	0,85			64.225	30,91	
1.845	Freddie Mac Pool 'SD8267', 5,000 %, con vencimiento el 01/11/2052	1.791	0,86			168.807	81,25	
4.493	Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	4.441	2,14	Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 183.459\$)				
9.137	Ginnie Mae II Pool 'MA8348', 5,000 %, con vencimiento el 20/10/2052	8.908	4,29	Organismos de inversión colectiva — 4,27 % (28 de febrero de 2023: 1,99 %)				
546	Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, con vencimiento el 20/05/2053	541	0,26	8.871	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Clase WA (distribución)	8.871	4,27	
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 28 546 USD)			28.290	13,61	Total de organismos de inversión colectiva (coste: 8.871\$)		8.871	4,27
Bonos y obligaciones corporativos — 0,93 % (28 de febrero de 2023: 6,05 %)					Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 222.833\$)		207.895	100,06
México: 0,93 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)					Contratos de divisas a plazo: 0,56 % (28 de febrero de 2023: 0,71 %)			
3.110	Petróleos Mexicanos, 6,950 %, con vencimiento el 28/01/2060	1.927	0,93	Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		1.150	0,56	
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 1.957\$)			1.927	0,93	Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		209.045	100,62
Bonos y obligaciones del Estado — 81,25 % (28 de febrero de 2023: 78,56 %)					Contratos de divisas a plazo — (2,23 %) (28 de febrero de 2023: (2,07 %))			
Australia: 3,97 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)					Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(4.628)	(2,23)
AUD	12.830	Australia Government Bond, Series 137, 2,750 %, con vencimiento el 21/04/2024	8.247	3,97	Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(4.628)	(2,23)
Brasil — 4,97 % (28 de febrero de 2023: 5,44 %)					Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		204.417	98,39
BRL	17.220	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2027	3.443	1,66	Excedente de otros activos respecto a los pasivos		3.357	1,61
BRL	8.110	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2029	1.587	0,76	Patrimonio		207.774\$	100,00
BRL	9.230	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2031	1.776	0,85	-			
BRL	18.590	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2033	3.526	1,70	Los importes designados como "-" son 0 USD, menos de 1000 USD, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.			
			10.332	4,97	144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. El 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 5 860 000\$ o el 4,26 % del patrimonio neto.			
Colombia — 5,85 % (28 de febrero de 2023: 5,87 %)					* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.			
COP	14.690.000	TES colombianos, Serie B, 7,000 %, con vencimiento el 26/03/2031	2.981	1,43	† Poca liquidez.			
COP	37.980.000	TES colombianos, Serie B, 9,250 %, con vencimiento el 28/05/2042	8.069	3,88	‡ El valor ya no acumula ingresos durante y/o después del período financiero finalizado el 31 de agosto de 2023 debido a la incertidumbre de los pagos de intereses.			
COP	6.640.000	TES colombianos, Serie B, 7,250 %, con vencimiento el 26/10/2050	1.114	0,54				
			12.164	5,85				
Alemania: 3,93 % (28 de febrero de 2023: 5,84 %)					ABREVIATURAS:			
EUR	7.540	German Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 20/09/2023	8.163	3,93	AUD	- dólar australiano		
México: 11,81 % (28 de febrero de 2023: 12,40 %)					BRL	- real brasileño		
MXN	120.200	Bonos Mexicanos, Series M, 8,500 %, con vencimiento el 18/11/2038	6.549	3,15	COP	- Peso colombiano		
MXN	120.900	Bonos Mexicanos, Series M, 7,750 %, con vencimiento el 13/11/2042	6.060	2,92	EUR	- euro		
MXN	84.600	Bonos Mexicanos, Series M, 8,000 %, con vencimiento el 07/11/2047	4.317	2,08	GBP	- libra esterlina		
MXN	150.200	Bonos Mexicanos, Series M, 8,000 %, con vencimiento el 31/07/2053	7.602	3,66	MXN	- peso mexicano		
			24.528	11,81	NOK	- Corona noruega		
Nueva Zelanda: 0,73 % (28 de febrero de 2023: 0,82 %)					NZD	- dólar neozelandés		
NZD	3.860	New Zealand Government Bond, serie 0551, 2,750 %, con vencimiento el 15/05/2051	1.516	0,73	RUB	- rublo ruso		
Noruega — 4,26 % (28 de febrero de 2023: 0,74 %)					ZAR	- Rand sudafricano		
NOK	94.800	Norway Government Bond, Serie 476, 144A, 3,000 %, con vencimiento 14/03/2024	8.860	4,26	Análisis del total de activos			
Rusia — 0,13 % (28 de febrero de 2023: 0,03 %)					Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado		93,53	
RUB	83.000	Russian Federal Bond - OFZ, 0,000 %, con vencimiento el 10/04/2030 ty	260	0,13	Organismos de inversión colectiva		4,17	
Sudáfrica — 4,55 % (28 de febrero de 2023: 3,69 %)					Instrumentos financieros derivados		0,54	
ZAR	108.600	Republic of South Africa Government Bond, Serie R214, 6,500 %, con vencimiento el 28/02/2041	3.394	1,64	Otros activos		1,76	
ZAR	158.100	Republic of South Africa Government Bond, Serie R214, 8,750 %, con vencimiento el 28/02/2048	6.050	2,91	Total de activos		100,00	
			9.444	4,55				
Reino Unido: 10,14 % (28 de febrero de 2023: 0,76 %)								
GBP	9.560	United Kingdom Gilt, 3,250 %, con vencimiento el 31/01/2033	11.090	5,34				
GBP	16.390	United Kingdom Gilt, 1,250 %, con vencimiento el 31/07/2051	9.978	4,80				
			21.068	10,14				
Estados Unidos: 30,91 % (28 de febrero de 2023: 28,57 %)								
	2.460	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025 *	2.464	1,19				

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)			Moneda de venta (en miles)			Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
		Compra	USD		Venta	GBP	USD	
01 sep. 2023	HSBC	Compra	USD	517	Venta	GBP	400	USD 10
01 sep. 2023	JP Morgan	Compra	USD	10.512	Venta	GBP	8.440	(180)
01 sep. 2023	JP Morgan	Compra	USD	18.481	Venta	GBP	14.430	202
01 sep. 2023	JP Morgan	Compra	GBP	670	Venta	USD	852	(3)
01 sep. 2023	JP Morgan	Compra	GBP	3.560	Venta	USD	4.425	85
01 sep. 2023	Morgan Stanley	Compra	GBP	3.350	Venta	USD	4.206	38
01 sep. 2023	National Australia Bank	Compra	USD	301	Venta	GBP	230	10
01 sep. 2023	UBS	Compra	GBP	370	Venta	USD	471	(3)
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	–	Venta	GBP	–	–
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	15	Venta	USD	16	–
11 sep. 2023	Barclays	Compra	INR	527.000	Venta	USD	6.397	(30)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	31	Venta	AUD	60	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NZD	329	Venta	AUD	304	(1)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	43	Venta	CAD	72	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NZD	450	Venta	CAD	366	(3)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NZD	1.365	Venta	CNY	5.941	(4)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	130	Venta	CNY	1.175	2
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	6	Venta	DKK	61	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NZD	73	Venta	DKK	304	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NZD	7.331	Venta	EUR	4.072	(46)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	694	Venta	EUR	805	6
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	ILS	1	Venta	GBP	–	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	AUD	5	Venta	GBP	3	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	ILS	3	Venta	GBP	1	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	71	Venta	GBP	61	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NZD	1	Venta	GBP	–	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	MXN	50	Venta	GBP	2	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	JPY	5.933	Venta	GBP	33	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SEK	7	Venta	GBP	–	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	1	Venta	GBP	1	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	DKK	7	Venta	GBP	1	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	PLN	–	Venta	GBP	–	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NZD	1.112	Venta	GBP	532	(11)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NOK	1	Venta	GBP	–	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	113	Venta	GBP	89	1
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NOK	4	Venta	GBP	–	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CNY	127	Venta	GBP	14	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	PLN	6	Venta	GBP	1	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CAD	6	Venta	GBP	3	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	6	Venta	ILS	30	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NZD	68	Venta	ILS	153	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	301	Venta	JPY	54.393	7
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NZD	3.180	Venta	JPY	275.031	2
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	22	Venta	MXN	479	(1)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NZD	228	Venta	MXN	2.422	(6)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	3	Venta	NOK	46	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NZD	38	Venta	NOK	237	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	DKK	50	Venta	NZD	12	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	87	Venta	NZD	186	(1)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CAD	–	Venta	NZD	–	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	JPY	45.839	Venta	NZD	533	(2)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	1.067	Venta	NZD	1.796	(3)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	AUD	43	Venta	NZD	46	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CAD	55	Venta	NZD	70	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CNY	989	Venta	NZD	230	(1)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	MXN	392	Venta	NZD	38	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	PLN	46	Venta	NZD	19	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	JPY	234	Venta	NZD	3	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NOK	40	Venta	NZD	6	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	14	Venta	NZD	17	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SEK	50	Venta	NZD	8	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	ILS	26	Venta	NZD	11	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	6	Venta	NZD	10	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	663	Venta	NZD	1.218	(8)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	AUD	–	Venta	NZD	–	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NZD	114	Venta	PLN	283	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	11	Venta	PLN	56	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NZD	46	Venta	SEK	296	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	4	Venta	SEK	58	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	9	Venta	SGD	15	–

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Listado de contratos de divisas a plazo — (continuación)

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)			Moneda de venta (en miles)			Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
		Compra		Venta	Compra		Venta		
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NZD	101	Venta	SGD	82	USD	–
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	NZD	10.687	Venta	USD	6.517		(144)
12 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	1.012	Venta	USD	1.288		(8)
13 sep. 2023	Citi	Compra	USD	13.380	Venta	KRW	17.882.700		(145)
13 sep. 2023	Citi	Compra	KRW	17.882.700	Venta	USD	13.781		(257)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	–	Venta	EUR	–		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	7	Venta	GBP	5		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	USD	–		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	1	Venta	USD	1		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	36	Venta	USD	46		–
19 sep. 2023	Goldman Sachs	Compra	JPY	124.000	Venta	USD	892		(37)
19 sep. 2023	JP Morgan	Compra	JPY	6.546.000	Venta	USD	47.617		(2.489)
19 sep. 2023	Morgan Stanley	Compra	JPY	160.000	Venta	USD	1.164		(61)
19 sep. 2023	UBS	Compra	JPY	122.000	Venta	USD	853		(12)
22 sep. 2023	HSBC	Compra	USD	2.353	Venta	NOK	25.200		(18)
22 sep. 2023	HSBC	Compra	USD	1.794	Venta	NOK	18.800		25
22 sep. 2023	JP Morgan	Compra	NOK	43.600	Venta	USD	4.055		49
22 sep. 2023	JP Morgan	Compra	NOK	66.300	Venta	USD	6.268		(27)
22 sep. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD	4.690	Venta	NOK	46.900		276
22 sep. 2023	Morgan Stanley	Compra	NOK	3.100	Venta	USD	300		(8)
26 sep. 2023	Barclays	Compra	USD	3.756	Venta	NZD	6.180		70
26 sep. 2023	Barclays	Compra	NZD	4.490	Venta	USD	2.784		(106)
29 sep. 2023	Morgan Stanley	Compra	NOK	6.100	Venta	USD	567		8
29 sep. 2023	Morgan Stanley	Compra	NOK	34.500	Venta	USD	3.321		(72)
17-oct-2023	Goldman Sachs	Compra	MYR	30.300	Venta	USD	6.706		(151)
19-oct-2023	HSBC	Compra	USD	4.938	Venta	BRL	24.070		113
19-oct-2023	HSBC	Compra	BRL	12.330	Venta	USD	2.571		(99)
27-oct-2023	Citi	Compra	USD	22.072	Venta	MXN	377.100		187
27-oct-2023	Morgan Stanley	Compra	MXN	62.400	Venta	USD	3.653		(32)
30-oct-2023	JP Morgan	Compra	USD	2.532	Venta	COP	10.340.000		48
30-oct-2023	JP Morgan	Compra	USD	4.380	Venta	COP	18.570.000		(81)
07-nov.-2023	JP Morgan	Compra	EUR	17.710	Venta	USD	19.592		(324)
07-nov.-2023	Standard Chartered Bank	Compra	EUR	6.600	Venta	USD	7.202		(21)
10-nov.-2023	HSBC	Compra	USD	2.310	Venta	THB	81.800		(42)
10-nov.-2023	HSBC	Compra	THB	81.800	Venta	USD	2.380		(28)
15-nov.-2023	HSBC	Compra	USD	1.065	Venta	ZAR	20.400		(8)
06-dic.-2023	JP Morgan	Compra	AUD	2.100	Venta	USD	1.355		11
08-dic.-2023	JP Morgan	Compra	USD	20.281	Venta	GBP	16.130		(155)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 1.448\$)								USD	1.150
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(4.239))									(4.628)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(2.791))								USD	(3.478)

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto
Valores garantizados por hipotecas — 9,94 % (28 de febrero de 2023: 17,87 %)			China: 0,05 % (28 de febrero de 2023: 1,27 %)		
1.945 Bellemeade Re 2020-3 Ltd, Serie 2020 3A, Clase M1C, 144A, 9,129 %, con vencimiento el 25/10/2030 *	1.966	0,17	705 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 3,400 %, con vencimiento el 01/05/2030	620	0,05
6.100 Bellemeade Re 2020-3 Ltd, Serie 2020 3A, Clase M2, 144A, 10,279 %, con vencimiento el 25/10/2030 *	6.363	0,54	Colombia — 1,00 % (28 de febrero de 2023: 0,95 %)		
3.429 Bellemeade Re Ltd, Serie 2021 2A, Clase M1A, 144A, 6,488 %, con vencimiento el 25/06/2031 *	3.422	0,29	3.715 Ecopetrol SA, 4,125 %, con vencimiento el 16/01/2025	3.604	0,30
220 COMM 2017-PANW Mortgage Trust, Serie 2017 PANW, Clase D, 144A, 4,343 %, con vencimiento el 10/10/2029 *	193	0,02	3.100 Ecopetrol SA, 8,875 %, con vencimiento el 13/01/2033	3.145	0,27
11.135 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Serie 2020 SBT1, Clase 1M2, 144A, 9,052 %, con vencimiento el 25/02/2040 *	11.529	0,97	1.860 Ecopetrol SA, 5,875 %, con vencimiento el 28/05/2045	1.313	0,11
12.085 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Serie 2020 SBT1, Clase 2M2, 144A, 9,052 %, con vencimiento el 25/02/2040 *	12.522	1,06	4.420 Geopark Ltd, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 17/01/2027	3.825	0,32
227 Eagle RE 2021-1 Ltd, Serie 2021 1, Clase M1C, 144A, 7,988 %, con vencimiento el 25/10/2033 *	228	0,02	República Checa — 0,42 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)		
7.602 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C02, Clase 2M2C, 9,052 %, con vencimiento el 25/09/2029 *	7.884	0,67	4.850 Allwyn Entertainment Financing UK Plc, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 30/04/2029	4.947	0,42
2.349 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C06, Clase 2M2, 8,202 %, con vencimiento el 25/02/2030 *	2.413	0,20	Alemania: 6,81 % (28 de febrero de 2023: 0,35 %)		
2.518 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA4, Serie 2020 HQA4, Clase B1, 144A, 10,652 %, con vencimiento el 25/09/2050 *	2.700	0,23	19.300 Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2,625 %, con vencimiento el 28/02/2024	19.036	1,61
3.000 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-HQA2, Serie 2021 HQA2, Clase B1, 144A, 8,438 %, con vencimiento el 25/12/2033 *	2.954	0,25	20.000 Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,250 %, 08/03/2024	19.481	1,64
1.666 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2019-DNA3, Serie 2019 DNA3, Clase M2, 144A, 7,452 %, con vencimiento el 25/07/2049 *	1.673	0,14	41.200 Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,375 %, con vencimiento el 18/07/2025	37.870	3,19
5.855 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2020 HQA5, Clase B1, 9,288 %, con vencimiento el 25/11/2050 *	6.098	0,51	4.485 Siemens Financieringsmaatschappij NV, 144A, 0,650 %, con vencimiento el 11/03/2024	4.372	0,37
11.538 Ginnie Mae II Pool 'MA8645', 4,000 %, con vencimiento el 20/02/2053	10.755	0,91	Irlanda: 1,34 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)		
24.124 Ginnie Mae II Pool 'MA8646', 4,500 %, con vencimiento el 20/02/2053	23.001	1,94	4.670 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 15/04/2026	4.407	0,37
20.742 Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2053	20.542	1,73	2.540 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 6,375 %, con vencimiento el 04/05/2028	2.522	0,21
29 Home RE 2021-1 Ltd, Serie 2021 1, Clase M1B, 144A, 6,979 %, con vencimiento el 25/07/2033 *	29	-	8.900 GGAM Finance Ltd, 144A, 7,750 %, con vencimiento el 15/05/2026	8.928	0,76
3.232 STACR 2018-HRP2, Serie 2018 HRP2, Clase B1, 144A, 9,602 %, con vencimiento el 25/02/2047 *	3.439	0,29	Israel — 1,35 % (28 de febrero de 2023: 0,76 %)		
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 118.663 USD)	117.711	9,94	6.120 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 30/03/2024	6.068	0,51
Bonos y obligaciones corporativos — 62,96 % (28 de febrero de 2023: 58,40 %)			6.925 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 30/03/2026	6.512	0,55
Argentina: 0,22 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			3.490 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 30/06/2025	3.425	0,29
2.662 YPF SA, 9,000 %, con vencimiento el 12/02/2026	2.627	0,22	Japón: 0,75 % (28 de febrero de 2023: 0,73 %)		
Australia: 0,03 % (28 de febrero de 2023: 0,40 %)			9.715 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 4,345 %, con vencimiento el 17/09/2027	8.908	0,75
AUD 730 NBN Co Ltd, 2,200 %, con vencimiento el 16/12/2030	380	0,03	Luxemburgo — 0,57 % (28 de febrero de 2023: 0,79 %)		
Bermuda: 0,20 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			2.535 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/08/2029	2.011	0,17
2.460 RenaissanceRe Holdings Ltd, 5,750 %, con vencimiento el 05/06/2033	2.392	0,20	10.770 Altice France Holding SA, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 15/02/2028	4.763	0,40
Brasil — 2,13 % (28 de febrero de 2023: 2,47 %)			México: 0,20 % (28 de febrero de 2023: 0,24 %)		
1.880 Amaggi Luxembourg International Sarl, 5,250 %, con vencimiento el 28/01/2028	1.715	0,14	3.770 Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, con vencimiento el 15/11/2029	2.390	0,20
4.710 Banco do Brasil SA/Cayman, 144A, 3,250 %, con vencimiento el 30/09/2026	4.340	0,37	Noruega — 0,39 % (28 de febrero de 2023: 0,37 %)		
1.200 Banco do Brasil SA/Cayman, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 18/04/2030	1.192	0,10	1.410 Var Energi ASA, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 15/01/2028	1.466	0,13
6.645 Rumo Luxembourg Sarl, 144A, 4,200 %, con vencimiento el 18/01/2032	5.401	0,46	2.915 Var Energi ASA, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 15/11/2032	3.109	0,26
13.775 XP Inc, 144A, 3,250 %, con vencimiento el 01/07/2026	12.544	1,06	Panamá — 0,29 % (28 de febrero de 2023: 0,29 %)		
	25.192	2,13	3.920 AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, con vencimiento el 31/05/2030	3.393	0,29
Canadá: 3,90 % (28 de febrero de 2023: 2,19 %)			Supranacional — 0,53 % (28 de febrero de 2023: 1,11 %)		
3.479 Air Canada 2015-1 Clase A Pass Through Trust, 144A, 3,600 %, con vencimiento el 15/03/2027	3.248	0,27	61.000 International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, con vencimiento el 22/01/2026	3.117	0,26
7.349 Air Canada 2020-2 Clase A Pass Through Trust, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 01/04/2029	7.162	0,61	BRL 17.100 International Bank for Reconstruction & Development, 5,000 %, con vencimiento el 22/01/2026	3.172	0,27
5.590 Antares Holdings LP, 144A, 2,750 %, con vencimiento el 15/01/2027	4.741	0,40	Suiza: 0,95 % (28 de febrero de 2023: 0,15 %)		
6.000 Baytex Energy Corp, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 30/04/2030	6.089	0,51	1.930 UBS AG/Londres, 144A, 0,700 %, con vencimiento el 09/08/2024	1.841	0,16
11.190 Hudbay Minerals Inc, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 01/04/2026	10.573	0,89	9.040 UBS Group AG, 144A, 6,537 %, con vencimiento el 12/08/2033 *	9.393	0,79
8.930 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2026	8.245	0,70	Reino Unido: 1,15 % (28 de febrero de 2023: 1,17 %)		
6.600 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/04/2029	6.134	0,52	2.220 Ashtead Capital Inc, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 11/08/2032	2.117	0,18
	46.192	3,90	5.610 HSBC Holdings Plc, 4,292 %, con vencimiento el 12/09/2026 *	5.413	0,46
Chile: 0,79 % (28 de febrero de 2023: 0,99 %)			1.075 Nationwide Building Society, 5,750 %, Perpetuo *	1.178	0,10
6.680 ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, con vencimiento el 27/04/2026	5.851	0,49	3.625 NatWest Group Plc, 4,600 %, Perpetuo *	2.477	0,21
4.219 Kenbourne Invest SA, 6,875 %, con vencimiento el 26/11/2024	3.551	0,30	2.900 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/07/2031	2.427	0,20
	9.402	0,79	13.612		
			1,15		

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto				
Estados Unidos: 38,11 % (28 de febrero de 2023: 42,28 %)									
3.665	Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250 %, con vencimiento el 15/02/2026	3.687	0,31	18.660	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 15/09/2025	18.054	1,52		
5.100	Air Lease Corp, 0,800 %, con vencimiento el 18/08/2024	4.853	0,41	4.880	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 30/09/2026	4.540	0,38		
6.857	Alaska Airlines 2020-1 Clase A Pass Through Trust, 144A, 4,800 %, con vencimiento el 15/08/2027	6.639	0,56	3.830	Nexstar Media Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 01/11/2028	3.364	0,28		
5.515	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2026	5.163	0,44	1.705	Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 2,750 %, con vencimiento el 09/03/2028	1.442	0,12		
435	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 15/08/2027	373	0,03	3.255	Nordstrom Inc, 2,300 %, con vencimiento el 08/04/2024	3.155	0,27		
1.890	Ares Capital Corp, 3,250 %, con vencimiento el 15/07/2025	1.774	0,15	5.345	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 15/10/2027	4.812	0,41		
9.063	Ares Capital Corp, 2,150 %, con vencimiento el 15/07/2026	7.972	0,67	7.265	PRA Group Inc/The, 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2029	5.486	0,46		
2.530	Ares Capital Corp, 2,875 %, con vencimiento el 15/06/2028	2.136	0,18	1.640	Regal Rexnord Corp, 144A, 6,300 %, con vencimiento el 15/02/2030	1.634	0,14		
11.980	Athene Global Funding, 144A, 0,914 %, con vencimiento el 19/08/2024	11.384	0,96	1.640	Regal Rexnord Corp, 144A, 6,400 %, con vencimiento el 15/04/2033	1.626	0,14		
7.945	Bain Capital Specialty Finance, Inc., 2,950 %, con vencimiento el 10/03/2026	7.118	0,60	4.430	ROBLOX Corp, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 01/05/2030	3.659	0,31		
9.170	Blackstone Secured Lending Fund, 2,125 %, con vencimiento el 15/02/2027	7.785	0,66	890	Seagate HDD Cayman, 4,125 %, con vencimiento el 15/01/2031	728	0,06		
2.645	Blackstone Secured Lending Fund, 2,850 %, con vencimiento el 30/09/2028	2.188	0,19	12.350	Sealed Air Corp, 144A, 1,573 %, con vencimiento el 15/10/2026	10.861	0,92		
4.645	Block Financial LLC, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2030	4.106	0,35	11.638	Sprint Spectrum Co. LLC / Sprint Spectrum Co. II LLC / Sprint Spectrum Co. III LLC, 144A, 5,152 %, con vencimiento el 20/03/2028	11.541	0,97		
1.160	Blue Owl Capital Corp, 4,000 %, con vencimiento el 30/03/2025	1.104	0,09	4.870	Stellantis Finance US Inc, 144A, 6,375 %, con vencimiento el 12/09/2032	4.875	0,41		
4.330	Blue Owl Capital Corp, 2,625 %, con vencimiento el 15/01/2027	3.757	0,32	5.954	Synchrony Bank, 5,625 %, con vencimiento el 23/08/2027	5.637	0,48		
5.515	Blue Owl Credit Income Corp, 3,125 %, con vencimiento el 23/09/2026	4.865	0,41	987	Synchrony Financial, 4,250 %, con vencimiento el 15/08/2024	962	0,08		
2.550	Blue Owl Credit Income Corp, 7,750 %, con vencimiento el 16/09/2027	2.537	0,21	4.515	Synchrony Financial, 4,875 %, con vencimiento el 13/06/2025	4.357	0,37		
4.040	Blue Owl Technology Finance Corp, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/12/2025	3.741	0,32	4.065	Synchrony Financial, 7,250 %, con vencimiento el 02/02/2033	3.741	0,32		
10.861	Blue Owl Technology Finance Corp, 144A, 3,750 %, con vencimiento el 17/06/2026	9.617	0,81	2.282	Syneos Health Inc, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 15/01/2029	2.278	0,19		
4.105	Broadcom Inc, 144A, 1,950 %, con vencimiento el 15/02/2028	3.563	0,30	5.600	Talos Production Inc, 12,000 %, con vencimiento el 15/01/2026	5.844	0,49		
2.170	Capital One Financial Corp, 6,312 %, con vencimiento el 08/06/2029 *	2.170	0,18	4.315	Travel + Leisure Co, 144A, 6,625 %, con vencimiento el 31/07/2026	4.286	0,36		
4.350	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 2,742 %, con vencimiento el 31/12/2039	3.373	0,29	3.399	Uber Technologies Inc, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 01/11/2026	3.464	0,29		
7.540	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 15/03/2026	7.369	0,62	4.080	Univision Communications Inc, 144A, 6,625 %, con vencimiento el 01/06/2027	3.954	0,33		
2.310	Citigroup Inc, 6,174 %, con vencimiento el 25/05/2034 *	2.303	0,19	8.100	Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 01/06/2028	8.178	0,69		
4.900	Civitas Resources Inc, 144A, 8,375 %, con vencimiento el 01/07/2028	5.053	0,43	7.940	Viasat Inc, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 15/04/2027	7.101	0,60		
11.635	CommScope Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 01/07/2028	6.494	0,55	4.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 15/06/2025	3.875	0,33		
6.860	Consolidated Communications Inc, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2028	5.147	0,43	7.500	Viking Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/05/2025	7.394	0,62		
1.800	Credit Acceptance Corp, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 31/12/2024	1.755	0,15	5.955	Vontier Corp, 1,800 %, con vencimiento el 01/04/2026	5.354	0,45		
10.105	Credit Acceptance Corp, 6,625 %, con vencimiento el 15/03/2026	9.847	0,83	5.240	Vontier Corp, 2,400 %, con vencimiento el 01/04/2028	4.375	0,37		
813	Dell International LLC / EMC Corp, 6,020 %, con vencimiento el 15/06/2026	822	0,07	13.920	Vontier Corp, 2,950 %, con vencimiento el 01/04/2031	11.044	0,93		
3.761	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 20/10/2025	3.678	0,31	2.531	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 01/03/2025	2.503	0,21		
12.530	Devon Energy Corp, 5,600 %, con vencimiento el 15/07/2041	11.650	0,98			451.531	38,11		
27.582	DISH Network Corp, 3,375 %, con vencimiento el 15/08/2026	16.825	1,42	Zambia — 1,78 % (28 de febrero de 2023: 1,50 %)					
2.670	Enviri Corp, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 31/07/2027	2.318	0,20	5.970	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 01/03/2026	5.890	0,50		
2.530	FedEx Corp, 0,450 %, con vencimiento el 04/05/2029	2.263	0,19	15.590	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/10/2027	15.198	1,28		
2.390	Ford Motor Credit Co LLC, 3,664 %, con vencimiento el 08/09/2024	2.321	0,20			21.088	1,78		
3.411	Ford Motor Credit Co LLC, 2,300 %, con vencimiento el 10/02/2025	3.208	0,27			746.054	62,96		
5.010	Ford Motor Credit Co LLC, 6,950 %, con vencimiento el 10/06/2026	5.021	0,42	Total de bonos y pagarés corporativos (coste 819.4275)					
6.000	Freedom Mortgage Corp, 144A, 8,250 %, con vencimiento el 15/04/2025	5.919	0,50	Bonos y obligaciones del Estado — 19,05 % (28 de febrero de 2023: 11,58 %)					
5.215	FS KKR Capital Corp, 3,125 %, con vencimiento el 12/10/2028	4.265	0,36	Brasil: 4,88 % (28 de febrero de 2023: 3,45 %)					
3.545	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, con vencimiento el 12/02/2026 *	3.291	0,28	BRL	305.120	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2033	57.868	4,88	
7.270	Golub Capital BDC Inc, 2,500 %, con vencimiento el 24/08/2026	6.395	0,54	Colombia — 4,77 % (28 de febrero de 2023: 2,95 %)					
6.560	Golub Capital BDC Inc, 2,050 %, con vencimiento el 15/02/2027	5.552	0,47	COP	278.653.000	TES colombianos, Serie B, 7,000 %, con vencimiento el 26/03/2031	56.547	4,77	
13.773	Graham Packaging Co Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 15/08/2028	12.026	1,02	Perú: 1,92 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)					
4.090	HCA Inc, 5,000 %, con vencimiento el 15/03/2024	4.067	0,34	PEN	86.490	Bono del Estado de Perú, 6,150 %, con vencimiento el 12/08/2032	22.700	1,92	
11.040	Hyundai Capital America, 144A, 2,000 %, con vencimiento el 15/06/2028	9.322	0,79	Estados Unidos: 7,48 % (28 de febrero de 2023: 0,56 %)					
2.247	IRB Holding Corp, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/06/2025	2.249	0,19			53.100	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025 *	53.183	4,49
7.470	KeyBank NA/Cleveland OH, Serie BKNT, 5,535 %, con vencimiento el 14/06/2024 *	7.320	0,62			37.200	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2033	35.433	2,99
6.580	Level 3 Financing Inc, 144A, 3,750 %, con vencimiento el 15/07/2029	3.932	0,33					88.616	7,48
1.025	Liberty Interactive LLC, 8,250 %, con vencimiento el 01/02/2030	399	0,03	Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 207.6355)			225.731	19,05	
12.100	Main Street Capital Corp, 3,000 %, con vencimiento el 14/07/2026	10.741	0,91	Obligaciones de préstamo — 0,44 % (28 de febrero de 2023: 0,43 %)					
4.633	MasTec Inc, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 15/08/2028	4.232	0,36			5.211	Flutter Financing BV, 8,753 %, con vencimiento el 04/07/2028 *	5.221	0,44
6.945	MicroStrategy Inc, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 15/06/2028	6.224	0,53	Total de obligaciones de préstamo (coste 5.1095)			5.221	0,44	
11.300	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 20/06/2027	11.272	0,95	Organismos de inversión colectiva — 5,18 % (28 de febrero de 2023: 7,05 %)					
8.820	Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 01/02/2026	8.222	0,69			61.400	Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Clase WA (distribución)	61.400	5,18
				Total de organismos de inversión colectiva (coste: 61.4005)			61.400	5,18	
				Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 1.212.2345)			1.156.117	97,57	

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto
Contratos de divisas a plazo: 0,22 % (28 de febrero de 2023: 0,29 %)		
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	2.658	0,22
Futuros — 0,52 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)		
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	6.156	0,52
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
	1.164.931	98,31
Swaps de incumplimiento de crédito: (0,82 %) (28 febrero de 2023: (0,07 %))		
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(9.769)	(0,82)
Contratos de divisas a plazo — (0,95 %) (28 de febrero de 2023: (1,02 %))		
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(11.294)	(0,95)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
	(21.063)	(1,77)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
	1.143.868	96,54
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		
	41.085	3,46
Patrimonio	1.184.953\$	100,00

– Los importes designados como “-” son 0 USD, menos de 1000 USD, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.

144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. El 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 481 610 000\$ o el 40,66 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.

ABREVIATURAS:

Perpetuo	– Un bono sin fecha de vencimiento. Los bonos perpetuos no son rescatables, pero pagan un flujo constante de intereses.
REMIC	– Conducto de inversiones hipotecarias inmobiliarias.
AUD	– dólar australiano
BRL	– real brasileño
COP	– Peso colombiano
EUR	– euro
GBP	– libra esterlina
MXN	– peso mexicano
PEN	– Nuevo Sol peruano

Análisis del total de activos

	% del total de activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	89,91
Otros valores mobiliarios negociables en otro mercado regulado	0,43
Organismos de inversión colectiva	5,07
Instrumentos financieros derivados	0,73
Otros activos	3,86
Total de activos	100,00

Listado de swaps de incumplimiento de crédito

Contraparte	Entidad de Referencia – Protección Compra/Venta	Fecha de vencimiento	Importe teórico (en miles)	Valor (en miles)
Citi	iTraxx Europe, 5,000 % – Comprar	20 jun. 2028	104.320	USD (4.546)
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 % – Vender	20 jun. 2026	15.700	(2.211)
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 % - Venta	20-dic.-2025	3.390	(379)
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 % – Vender	20-dic.-2025	1.605	(179)
JP Morgan	Altice Luxembourg S.A., 5,000 % – Vender	20-dic.-2025	1.605	(772)
JP Morgan	Altice Luxembourg S.A., 5,000 % - Venta	20-dic.-2025	3.495	(1.682)
Apreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 febrero de 2023 [miles]: 1.309\$)				USD –
Depreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2022 [miles]: \$(878))				(9.769)
Apreciación neta de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 [miles]: 431\$)				USD (9.769)

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)	Moneda de venta (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra USD 2.425	Venta BRL 11.875	USD 30
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra USD 64	Venta EUR 59	–
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra USD 204	Venta GBP 160	1
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra USD 13	Venta HKD 100	–
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra USD 78	Venta SGD 105	–
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra HKD –	Venta USD –	–
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra BRL 11.875	Venta USD 2.503	(107)
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra GBP 9	Venta USD 12	–
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra EUR 18	Venta USD 18	–
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra SGD 147	Venta USD 109	–
06 sep. 2023	BNY Mellon	Compra USD 9	Venta SGD 12	–
06 sep. 2023	BNY Mellon	Compra SGD 51	Venta USD 39	–
13 sep. 2023	Citi	Compra USD 24.086	Venta KRW 30.900.000	718
13 sep. 2023	Citi	Compra KRW 30.900.000	Venta USD 23.819	(451)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra USD 822	Venta EUR 759	(3)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra USD 3.301	Venta EUR 3.025	19
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra USD –	Venta GBP –	–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra USD 13	Venta GBP 10	–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra USD 516	Venta SGD 700	(2)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra USD 466	Venta SGD 626	1
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra SGD 461	Venta USD 341	–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra CNH 10.176	Venta USD 1.412	(12)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra CZK 710	Venta USD 32	–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra EUR 321	Venta USD 347	1
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra AUD 8.711	Venta USD 5.695	(48)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra GBP 32.035	Venta USD 40.791	(209)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra SGD 82.168	Venta USD 61.146	(304)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra SEK 25.741	Venta USD 2.414	(61)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra EUR 385.707	Venta USD 424.345	(5.799)
19 sep. 2023	Barclays	Compra JPY 5.335.000	Venta USD 37.488	(708)
19 sep. 2023	JP Morgan	Compra JPY 4.938.000	Venta USD 35.920	(1.877)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Listado de contratos de divisas a plazo — (continuación)

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)		Moneda de venta (en miles)		Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)		
03-oct-2023	BNY Mellon	Compra	BRL	11.655	Venta	USD	(29)	
19-oct-2023	HSBC	Compra	USD	62.800	Venta	BRL	307.530	1.156
19-oct-2023	HSBC	Compra	BRL	110.290	Venta	USD	22.315	(207)
27-oct-2023	Citi	Compra	USD	3.149	Venta	MXN	53.800	27
27-oct-2023	HSBC	Compra	USD	22.525	Venta	MXN	396.200	(469)
27-oct-2023	HSBC	Compra	USD	26.825	Venta	MXN	460.400	105
27-oct-2023	HSBC	Compra	MXN	495.600	Venta	USD	28.892	(129)
27-oct-2023	JP Morgan	Compra	MXN	414.800	Venta	USD	24.111	(38)
30-oct-2023	JP Morgan	Compra	USD	12.971	Venta	COP	55.490.000	(360)
30-oct-2023	JP Morgan	Compra	COP	55.490.000	Venta	USD	13.700	(369)
07-nov.-2023	JP Morgan	Compra	USD	36.319	Venta	EUR	32.830	600
07-nov.-2023	JP Morgan	Compra	EUR	32.830	Venta	USD	35.831	(112)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 3.510\$)						USD	2.658	
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(12.389))							(11.294)	
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(8.879))						USD	(8.636)	

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Bono a 10 años de Japón (OSE) septiembre de 2023	Citi	(125)	USD (126.138)	USD 1.104
U.S. 10 Year Ultra Note diciembre 2023	Citi	1.933	224.439	2.591
U.S. 5 Year Note (CBT) diciembre 2023	Citi	1.371	146.590	1.053
U.S. Ultra Bond (CBT) diciembre 2023	Citi	831	107.588	1.408
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: USD--)				USD 6.156
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(3.704))				—
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(3.704))				USD 6.156

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto
Valores garantizados por hipotecas — 54,40 % (28 de febrero de 2023: 81,49 %)			Zambia — 0,97 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)		
932 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R04, Serie 2019 R04, Clase 2B1, 144A, 10,652 %, con vencimiento el 25/06/2039 *	983	2,95	330 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/10/2027	322	0,97
1.354 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Serie 2019 R05, Clase 1B1, 144A, 9,502 %, con vencimiento el 25/07/2039 *	1.396	4,20	Total de bonos y pagarés corporativos (coste 7.5365)	7.544	22,68
570 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Serie 2020 R01, Clase 1B1, 144A, 8,652 %, con vencimiento el 25/01/2040 *	572	1,72	Bonos y obligaciones del Estado — 19,26 % (28 de febrero de 2023: 4,43 %)		
878 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C07, Clase 2M2, 9,752 %, con vencimiento el 25/05/2029 *	923	2,77	Brasil: 0,92 % (28 de febrero de 2023: 1,90 %)		
1.439 Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	1.423	4,28	BRL 1.620 Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2033	307	0,92
866 Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	821	2,47	Colombia — 0,94 % (28 de febrero de 2023: 1,72 %)		
1.428 Freddie Mac Pool 'SD8278', 6,000 %, con vencimiento el 01/12/2052	1.433	4,31	COP 1.870.000 TES colombianos, Serie B, 7,250 %, con vencimiento el 26/10/2050	314	0,94
1.724 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Serie 2020 DNA3, Clase B1, 144A, 10,502 %, con vencimiento el 25/06/2050 *	1.859	5,59	Estados Unidos: 17,40 % (28 de febrero de 2023: 0,81 %)		
1.054 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA4, Serie 2020 DNA4, Clase B1, 144A, 11,402 %, con vencimiento el 25/08/2050 *	1.173	3,52	3.290 United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025 *	3.295	9,91
1.425 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA3, Serie 2020 HQA3, Clase B1, 144A, 11,152 %, con vencimiento el 25/07/2050 *	1.547	4,65	2.490 United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 5,418 %, con vencimiento el 30/04/2025 *	2.491	7,49
1.550 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7, Serie 2021 DNA7, Clase M1, 144A, 6,138 %, con vencimiento el 25/11/2041 *	1.534	4,61	Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 6.3845)	6.407	19,26
29.940 GS Mortgage Securities Trust 2017-GS5, Serie 2017 GS5, Clase XA, 0,974 %, con vencimiento el 10/03/2050 *	711	2,14	Organismos de inversión colectiva — 1,89 % (28 de febrero de 2023: 4,74 %)		
EUR 600 IM Pastor 3 FTH 3, Clase B, 3,877 %, con vencimiento el 22/03/2043 *	335	1,01	630 Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Clase WA (distribución)	630	1,89
EUR 874 Landmark Mortgage Securities No 2 Plc 2, Clase BC, 4,147 %, con vencimiento el 17/06/2039 *	887	2,66	Total de organismos de inversión colectiva (coste: 6305)	630	1,89
316 STACR 2018-DNA3, Serie 2018 DNA3, Clase M2A, 144A, 7,502 %, con vencimiento el 25/09/2048 *	317	0,95	Acciones ordinarias: 0,05 % (28 de febrero de 2023: 0,05 %)		
1.015 STACR 2018-HRP2, Serie 2018 HRP2, Clase B1, 144A, 9,602 %, con vencimiento el 25/02/2047 *	1.080	3,25	Estados Unidos: 0,05 % (28 de febrero de 2023: 0,05 %)		
645 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28, Serie 2015 C28, Clase D, 4,216 %, con vencimiento el 15/05/2048 *	511	1,54	8 Danimer Scientific, Inc.	16	0,05
49.589 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-LC22, Serie 2015 LC22, Clase XA, 0,897 %, con vencimiento el 15/09/2058 *	592	1,78	Total de acciones ordinarias (coste de 534 \$)	16	0,05
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 17 907 USD)	18.097	54,40	Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 32.9915)		
Bonos y obligaciones corporativos — 22,68 % (28 de febrero de 2023: 7,23 %)			Swaps de incumplimiento de crédito — (0,20 %) (28 febrero de 2023: 0,00 %)		
Canadá: 1,72 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			Apresiasi latente sobre contratos (véase más abajo)		
250 Baytex Energy Corp, 144A, 8,750 %, con vencimiento el 01/04/2027	256	0,77	Contratos de divisas a plazo: 0,47 % (28 de febrero de 2023: 0,86 %)		
340 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2026	314	0,95	Apresiasi latente sobre contratos (véase más abajo)		
	570	1,72	Futuros — 0,05 % (28 de febrero de 2023: 0,15 %)		
Colombia — 1,01 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			Apresiasi latente sobre contratos (véase más abajo)		
330 Ecopetrol SA, 8,625 %, con vencimiento el 19/01/2029	337	1,01	Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
México: 0,95 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			32.937		
510 Petróleos Mexicanos, 6,950 %, con vencimiento el 28/01/2060	316	0,95	Contratos de divisas a plazo — (0,71 %) (28 de febrero de 2023: (0,81 %))		
Estados Unidos: 18,03 % (28 de febrero de 2023: 6,78 %)			Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		
270 Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/12/2027	239	0,72	236		
360 Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 15/08/2027	353	1,06	Futuros — (0,53 %) (28 de febrero de 2023: (0,38 %))		
170 ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2028	137	0,41	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		
270 Civitas Resources Inc, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 15/10/2026	256	0,77	177		
250 Credit Acceptance Corp, 6,625 %, con vencimiento el 15/03/2026	244	0,73	Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
410 Dream Finders Homes Inc, 144A, 8,250 %, vencimiento 15/08/2028	417	1,25	413		
400 FirstCash Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 01/09/2028	356	1,07	Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
350 Ford Motor Credit Co LLC, 5,584 %, vencimiento 18/03/2024	348	1,05	32.524		
420 Freedom Mortgage Corp, 7,625 %, con vencimiento el 01/05/2026	387	1,16	Excedente de otros activos respecto a los pasivos		
330 Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 8,875 %, con vencimiento el 15/07/2028	342	1,03	742		
170 IRB Holding Corp, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/06/2025	170	0,51	Patrimonio		
565 Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 01/08/2026	548	1,65	33.266\$		
1.030 PDC Energy Inc, 5,750 %, con vencimiento el 15/05/2026	1.028	3,09	100,00		
235 PROG Holdings Inc, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 15/11/2029	211	0,63			
290 Talos Production Inc, 12,000 %, con vencimiento el 15/01/2026	303	0,91			
170 Uber Technologies Inc, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 15/05/2025	172	0,52			
190 United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/04/2029	165	0,50			
170 Viasat Inc, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 15/04/2027	152	0,46			
170 WESCO Distribution Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 15/06/2025	171	0,51			
	5.999	18,03			

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Listado de swaps de incumplimiento de crédito

Contraparte	Entidad de Referencia – Protección Compra/Venta	Fecha de vencimiento	Importe teórico (en miles)	Valor (en miles)
Citi	iTraxx Europe, 1,000 % - Comprar	20 jun. 2028	3.030	USD 68
Apreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 febrero de 2023 [miles]: USD--)				USD 68
Depreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2022 [miles]: \$(37))				–
Apreciación neta de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(37))				USD 68

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)		Moneda de venta (en miles)		Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
01 sep. 2023	JP Morgan	Compra	USD 1.206	Venta	GBP 970	USD (23)
01 sep. 2023	Morgan Stanley	Compra	USD 51	Venta	GBP 40	–
01 sep. 2023	Morgan Stanley	Compra	GBP 780	Venta	USD 994	(5)
01 sep. 2023	UBS	Compra	GBP 230	Venta	USD 286	5
11 sep. 2023	Goldman Sachs	Compra	USD 460	Venta	CHF 410	(5)
19 sep. 2023	Barclays	Compra	USD 1.655	Venta	JPY 231.000	62
19 sep. 2023	JP Morgan	Compra	JPY 231.000	Venta	USD 1.680	(88)
17-oct-2023	Goldman Sachs	Compra	USD 795	Venta	SEK 8.500	17
17-oct-2023	Morgan Stanley	Compra	USD 385	Venta	SEK 4.200	1
17-oct-2023	Morgan Stanley	Compra	SEK 16.900	Venta	USD 1.657	(110)
19-oct-2023	HSBC	Compra	USD 603	Venta	BRL 2.940	14
19-oct-2023	HSBC	Compra	BRL 1.390	Venta	USD 276	2
27-oct-2023	Citi	Compra	USD 638	Venta	MXN 10.900	5
27-oct-2023	Morgan Stanley	Compra	MXN 5.700	Venta	USD 331	(1)
27-oct-2023	Morgan Stanley	Compra	MXN 5.200	Venta	USD 301	1
30-oct-2023	JP Morgan	Compra	USD 659	Venta	COP 2.690.000	13
30-oct-2023	JP Morgan	Compra	COP 1.280.000	Venta	USD 307	1
07-nov.-2023	JP Morgan	Compra	USD 1.836	Venta	EUR 1.660	30
17-nov.-2023	JP Morgan	Compra	USD 1.016	Venta	CNH 7.320	6
17-nov.-2023	National Australia Bank	Compra	USD 662	Venta	CNH 4.830	(4)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 403\$)						USD 157
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(379))						(236)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 24\$)						USD (79)

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Índice E-Mini Nasdaq 100 septiembre 2023	Citi	(11)	USD (3.419)	USD (97)
Euro-Bobl septiembre de 2023	Citi	15	1.889	(10)
Bono a 10 años de Japón (OSE) septiembre de 2023	Citi	(2)	(2.018)	18
S&P 500 Index septiembre de 2023	Citi	(14)	(3.161)	(70)
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: 69\$)				USD 18
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(175))				(177)
Depreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(106))				USD (159)

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto
Valores garantizados por hipotecas — 21,15 % (28 de febrero de 2023: 13,31 %)					
1.551	Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	4,500	1.472	2,12	
477	Fannie Mae Pool 'MA4785', 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2052	5,000	463	0,67	
1.142	Fannie Mae Pool 'MA4841', 5,000 %, con vencimiento el 01/12/2052	5,000	1.108	1,60	
1.289	Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	5,500	1.274	1,84	
548	Freddie Mac Pool 'RA7790', 5,000 %, con vencimiento el 01/08/2052	5,000	532	0,77	
1.120	Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	4,500	1.062	1,53	
728	Freddie Mac Pool 'SD8257', 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2052	4,500	690	1,00	
587	Freddie Mac Pool 'SD8267', 5,000 %, con vencimiento el 01/11/2052	5,000	569	0,82	
1.795	Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	5,500	1.775	2,56	
882	Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500 %, con vencimiento el 20/02/2053	5,500	874	1,26	
1.590	Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2053	5,500	1.575	2,27	
1.102	Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, con vencimiento el 20/05/2053	5,500	1.092	1,58	
1.305	Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000 %, con vencimiento el 20/06/2053	5,000	1.270	1,83	
906	Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500 %, con vencimiento el 20/06/2053	5,500	897	1,30	
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 14 820 USD)		14.653	21,15		
Bonos y obligaciones corporativos — 9,58 % (28 de febrero de 2023: 7,90 %)					
Australia: 2,13 % (28 de febrero de 2023: 4,12 %)					
1.470	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,955 %, con vencimiento el 14/03/2025 *	5,955	1.473	2,13	
México: 3,03 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)					
3.390	Petróleos Mexicanos, 6,950 %, con vencimiento el 28/01/2060	6,950	2.100	3,03	
Estados Unidos: 4,42 % (28 de febrero de 2023: 3,78 %)					
1.420	General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, con vencimiento el 06/04/2026	5,400	1.403	2,02	
370	Jackson National Life Global Funding, 144A, 6,403 %, con vencimiento el 28/06/2024 *	6,403	370	0,53	
1.310	Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, con vencimiento el 18/05/2026	4,450	1.293	1,87	
		3.066	4,42		
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 6.686\$)		6.639	9,58		
Bonos y obligaciones del Estado — 60,90 % (28 de febrero de 2023: 73,60 %)					
Brasil: 12,72 % (28 de febrero de 2023: 11,00 %)					
BRL	25.420	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2029	4.976	7,18	
BRL	19.930	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2031	3.835	5,54	
		8.811	12,72		
Colombia — 9,64 % (28 de febrero de 2023: 7,24 %)					
COP	11.660.000	TES colombianos, Serie B, 6,000 %, con vencimiento el 28/04/2028	2.442	3,53	
COP	21.610.000	TES colombianos, Serie B, 7,000 %, con vencimiento el 30/06/2032	4.235	6,11	
		6.677	9,64		
República Checa — 5,01 % (28 de febrero de 2023: 4,84 %)					
CZK	94.610	Bono del Estado de República Checa, Serie 138, 1,750 %, con vencimiento el 23/06/2032	3.472	5,01	
México: 17,35 % (28 de febrero de 2023: 20,07 %)					
MXN	36.400	Bonos Mexicanos, Series M, 8,500 %, con vencimiento el 18/11/2038	1.983	2,86	
Valores garantizados por hipotecas — 21,15 % (28 de febrero de 2023: 13,31 %)					
MXN	160.700	Bonos Mexicanos, Series M, 7,750 %, con vencimiento el 13/11/2042	8.055	11,63	
MXN	38.800	Bonos Mexicanos, Series M, 8,000 %, con vencimiento el 07/11/2047	1.980	2,86	
		12.018	17,35		
Sudáfrica — 7,57 % (28 de febrero de 2023: 8,58 %)					
ZAR	33.800	Republic of South Africa Government Bond, Serie R214, 6,500 %, con vencimiento el 28/02/2041	1.056	1,52	
ZAR	109.500	Republic of South Africa Government Bond, Serie R214, 8,750 %, con vencimiento el 28/02/2048	4.191	6,05	
		5.247	7,57		
Estados Unidos: 8,61 % (28 de febrero de 2023: 12,74 %)					
	5.960	United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025 *	5.969	8,61	
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 43.849\$)		42.194	60,90		
Organismos de inversión colectiva — 5,46 % (28 de febrero de 2023: 5,60 %)					
	30	Franklin Templeton Global Funds Plc - FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund - LM Class US\$ Accumulating	3.787	5,46	
Total de organismos de inversión colectiva (coste: 3.500\$)		3.787	5,46		
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 68.855\$)					
		67.273	97,09		
Contratos de divisas a plazo: 0,38 % (28 de febrero de 2023: 0,36 %)					
		266	0,38		
Futuros — 0,08 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)					
		55	0,08		
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias					
		67.594	97,55		
Contratos de divisas a plazo — (3,67 %) (28 de febrero de 2023: (5,02 %))					
		(2.543)	(3,67)		
Futuros — (0,19 %) (28 de febrero de 2023: (0,41 %))					
		(130)	(0,19)		
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias					
		(2.673)	(3,86)		
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias					
		64.921	93,69		
Excedente de otros activos respecto a los pasivos					
		4.366	6,31		
Patrimonio		69.287\$	100,00		
<p>Los importes designados como "-" son 0 USD, menos de 1000 USD, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.</p> <p>144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. El 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 1 843 000\$ o el 2,66 % del patrimonio neto.</p> <p>* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.</p>					
ABREVIATURAS:					
BRL	- real brasileño				
COP	- Peso colombiano				
CZK	- Corona checa				
MXN	- peso mexicano				
ZAR	- Rand sudafricano				
Análisis del total de activos					% del total de activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado					87,35
Organismos de inversión colectiva					5,21
Instrumentos financieros derivados					0,44
Otros activos					7,00
Total de activos					100,00

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)	Moneda de venta (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
01 sep. 2023	JP Morgan	Compra	GBP 5.650	USD 7.023	134
11 sep. 2023	Barclays	Compra	USD 18.456	CHF 16.610	(369)
11 sep. 2023	Barclays	Compra	INR 182.000	USD 2.210	(11)
13 sep. 2023	Citi	Compra	KRW 3.060.000	USD 2.359	(45)
14 sep. 2023	HSBC	Compra	THB 80.700	USD 2.338	(30)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD 2.387	AUD 3.702	(13)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD -	GBP -	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD 3	SGD 4	-
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	AUD 109.084	USD 71.318	(598)

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Listado de contratos de divisas a plazo — (continuación)

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)			Moneda de venta (en miles)			Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
		Compra		Venta	Compra		Venta		
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	3	Venta	USD	4	USD	–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	103	Venta	USD	76		–
19 sep. 2023	JP Morgan	Compra	JPY	2.584.000	Venta	USD	18.797		(982)
25 sep. 2023	Barclays	Compra	MYR	7.900	Venta	USD	1.710		(4)
26 sep. 2023	Barclays	Compra	NZD	6.690	Venta	USD	4.148		(158)
29 sep. 2023	Morgan Stanley	Compra	NOK	33.500	Venta	USD	3.205		(52)
23-oct-2023	Citi	Compra	MXN	34.800	Venta	USD	2.038		(17)
25-oct-2023	Citi	Compra	CAD	9.670	Venta	USD	7.357		(195)
30-oct-2023	JP Morgan	Compra	USD	2.148	Venta	COP	8.770.000		41
08-nov.-2023	HSBC	Compra	CLP	5.440.000	Venta	USD	6.402		(65)
15-nov.-2023	HSBC	Compra	USD	538	Venta	ZAR	10.300		(4)
16-nov.-2023	HSBC	Compra	USD	3.389	Venta	CZK	74.900		25
06-dic.-2023	JP Morgan	Compra	AUD	2.460	Venta	USD	1.587		12
08-dic.-2023	JP Morgan	Compra	GBP	5.650	Venta	USD	7.104		54
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 249\$)								USD	266
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(3.482))									(2.543)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(3.233))								USD	(2.277)

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal		Valor teórico (en miles)		Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
Bonos Euro-Buxl a 30 años septiembre de 2023	Morgan Stanley	70	USD	10.156		USD	(130)
Long Gilt diciembre 2023	Morgan Stanley	41		4.964			55
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: USD--)						USD	55
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(283))							(130)
Depreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(283))						USD	(75)

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto
Valores garantizados por hipotecas — 8,32 % (28 de febrero de 2023: 18,58 %)			Petróleo y gas: 7,22 % (28 de febrero de 2023: 8,11 %)		
329 Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	312	2,04	150 Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250 %, con vencimiento el 15/02/2026	151	0,99
235 Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	223	1,46	60 Civitas Resources Inc, 144A, 8,375 %, con vencimiento el 01/07/2028	62	0,40
161 Freddie Mac Pool 'SD8257', 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2052	153	0,99	150 CNX Resources Corp, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 14/03/2027	150	0,98
600 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7, Serie 2021 DNA7, Clase M2, 144A, 7,088 %, con vencimiento el 25/11/2041 *	587	3,83	155 Ecopetrol SA, 4,125 %, con vencimiento el 16/01/2025	151	0,98
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 1 271 USD)	1.275	8,32	120 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 30/03/2026	113	0,74
Bonos y obligaciones corporativos — 46,48 % (28 de febrero de 2023: 59,55 %)			Embalaje y envases: 2,02 % (28 de febrero de 2023: 2,04 %)		
Aerolíneas: 1,56 % (28 de febrero de 2023: 1,76 %)			Tuberías: 1,91 % (28 de febrero de 2023: 1,98 %)		
122 Alaska Airlines 2020-1 Clase A Pass Through Trust, 144A, 4,800 %, con vencimiento el 15/08/2027	118	0,78	55 Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 2,742 %, con vencimiento el 31/12/2039	43	0,28
120 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 20/06/2027	120	0,78	155 New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, vencimiento 30/09/2026	144	0,94
	238	1,56	105 Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 01/06/2028	106	0,69
Fabricantes de automóviles: 3,47 % (28 de febrero de 2023: 4,84 %)			Semiconductores: 1,21 % (28 de febrero de 2023: 1,21 %)		
190 General Motors Co, 5,600 %, con vencimiento el 15/10/2032	183	1,20	235 Micron Technology Inc, 2,703 %, con vencimiento el 15/04/2032	186	1,21
185 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 2,750 %, con vencimiento el 09/03/2028	156	1,02	Transporte: 1,29 % (28 de febrero de 2023: 1,25 %)		
EUR 195 Volvo Car AB, 2,500 %, con vencimiento el 07/10/2027	192	1,25	EUR 220 FedEx Corp, 0,450 %, con vencimiento el 04/05/2029	197	1,29
	531	3,47	Agua: 0,96 % (28 de febrero de 2023: 1,00 %)		
Bancos: 7,45 % (28 de febrero de 2023: 7,54 %)			Soberano: 35,85 % (28 de febrero de 2023: 10,56 %)		
200 Banco do Brasil SA/Cayman, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 18/04/2030	199	1,30	BRL 640 Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2031	123	0,80
EUR 155 Bank of America Corp, 2,456 %, con vencimiento el 22/10/2025 *	149	0,97	BRL 3.370 Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2033	639	4,17
200 BNP Paribas SA, 0,375 %, con vencimiento el 14/10/2027 *	193	1,26	COP 3.623.000 TES colombianos, Serie B, 7,000 %, con vencimiento el 26/03/2031	736	4,80
220 Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, con vencimiento el 12/02/2026 *	204	1,34	200 Export-Import Bank of India, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 18/01/2033	197	1,29
200 JPMorgan Chase & Co, 0,768 %, con vencimiento el 09/08/2025 *	190	1,24	3.790 United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025 *	3.796	24,79
215 UBS AG/Londres, 144A, 0,700 %, con vencimiento el 09/08/2024	205	1,34	Total de bonos y pagarés corporativos (coste 7.101\$)	7.118	46,48
	1.140	7,45	Bonos y obligaciones del Estado — 35,85 % (28 de febrero de 2023: 10,56 %)		
Servicios financieros diversificados: 2,33 % (28 de febrero de 2023: 3,70 %)			Organismos de inversión colectiva — 6,08 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)		
160 Air Lease Corp, 0,800 %, con vencimiento el 18/08/2024	152	0,99	931 Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Clase WA (distribución)	931	6,08
225 XP Inc, 144A, 3,250 %, con vencimiento el 01/07/2026	205	1,34	Total de organismos de inversión colectiva (coste: 931\$)	931	6,08
	357	2,33	Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 14.541\$)		
Eléctric: 1,35 % (28 de febrero de 2023: 1,42 %)			Swaps de incumplimiento de crédito — (0,03 %) (28 febrero de 2023: 0,22 %)		
238 AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, con vencimiento el 31/05/2030	206	1,35	Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		
Electrónica: 2,03 % (28 de febrero de 2023: 2,06 %)			Contratos de divisas a plazo: 0,25 % (28 de febrero de 2023: 0,58 %)		
170 Jabil Inc, 3,600 %, con vencimiento el 15/01/2030	152	0,99	Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		
190 Vontier Corp, 2,400 %, con vencimiento el 01/04/2028	159	1,04	Futuros — 0,43 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)		
	311	2,03	Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		
Energía — Fuentes alternativas: 1,20 % (28 de febrero de 2023: 1,17 %)			Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
EUR 205 Vestas Wind Systems Finance BV, 2,000 %, con vencimiento el 15/06/2034	184	1,20	14.923		
Ingeniería y construcción: 0,75 % (28 de febrero de 2023: 0,75 %)			Swaps de incumplimiento de crédito: (0,27 %) (28 febrero de 2023: 0,00 %)		
120 Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, vencimiento 01/02/2026	115	0,75	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		
Alimentación: 2,09 % (28 de febrero de 2023: 3,42 %)			Contratos de divisas a plazo — (0,49 %) (28 de febrero de 2023: (0,43 %))		
GBP 135 Co-Operative Group Ltd, 5,125 %, con vencimiento el 17/05/2024	169	1,11	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		
155 JBS USA LUX SA/JBS USA Food Co./JBS USA Finance Inc., 5,125 %, con vencimiento el 01/02/2028	151	0,98	Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
	320	2,09	(115)		
Servicios sanitarios: 1,96 % (28 de febrero de 2023: 2,03 %)			Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
160 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 15/03/2026	156	1,02	14.808		
145 HCA Inc, 5,000 %, con vencimiento el 15/03/2024	144	0,94	Excedente de otros activos respecto a los pasivos		
	300	1,96	508		
Empresas de inversión: 1,53 % (28 de febrero de 2023: 2,59 %)			Patrimonio		
135 Ares Capital Corp, 2,150 %, con vencimiento el 15/07/2026	119	0,78	15.316\$		
130 Main Street Capital Corp, 3,000 %, con vencimiento el 14/07/2026	115	0,75	100,00		
	234	1,53			
Minería: 3,41 % (28 de febrero de 2023: 3,46 %)					
220 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/10/2027	214	1,40			
175 FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 01/04/2031	147	0,96			
175 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2026	162	1,05			
	523	3,41			
Multi-National - 2,74 % (28 de febrero de 2023: 3,87 %)					
MXN 4.040 International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, con vencimiento el 22/01/2026	207	1,35			
BRL 1.150 International Bank for Reconstruction & Development, 5,000 %, con vencimiento el 22/01/2026	213	1,39			
	420	2,74			

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

- Los importes designados como “-” son 0 USD, menos de 1.000 USD, menos de 1.000 acciones o menos del 0,01 %.
- 144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. El 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 3 956 000\$ o el 25,84 % del patrimonio neto.
- * Título a interés variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 31 de agosto de 2023.

ABREVIATURAS:

- REMIC – Conducto de inversiones hipotecarias inmobiliarias.
 BRL – eal brasileño
 COP – Peso colombiano
 EUR – euro
 GBP – libra esterlina
 MXN – peso mexicano

Análisis del total de activos		% del total de activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado		89,56
Organismos de inversión colectiva		6,01
Instrumentos financieros derivados		0,70
Otros activos		3,73
Total de activos		100,00

Listado de swaps de incumplimiento de crédito

Contraparte	Entidad de Referencia – Protección Compra/Venta	Fecha de vencimiento	Importe teórico (miles)	Valor (en miles)
Citi	CDX.NA.HY, 5,000 % – Comprar	20 jun. 2028	1.480	USD (41)
Citi	CDX.NA.HY, 5,000 % – Vender	20-dic.-2023	1.350	4
Apreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 febrero de 2023 [miles]: 33\$)				USD 4
Depreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 [miles]: USD-)				(41)
Apreciación neta de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 [miles]: 33\$)				USD (37)

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)		Moneda de venta (en miles)		Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
01 sep. 2023	JP Morgan	Compra	USD 149	Venta	GBP 120	USD (3)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR 98	Venta	USD 108	(1)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP 20	Venta	USD 26	–
19 sep. 2023	Barclays	Compra	JPY 14.000	Venta	USD 98	(2)
19 sep. 2023	Citi	Compra	JPY 53.000	Venta	USD 388	(22)
19 sep. 2023	JP Morgan	Compra	JPY 64.000	Venta	USD 466	(24)
19-oct-2023	HSBC	Compra	USD 1.008	Venta	BRL 4.930	19
19-oct-2023	HSBC	Compra	BRL 1.410	Venta	USD 285	(3)
27-oct-2023	Citi	Compra	USD 211	Venta	MXN 3.600	2
27-oct-2023	HSBC	Compra	USD 344	Venta	MXN 5.900	1
27-oct-2023	HSBC	Compra	USD 290	Venta	MXN 5.100	(6)
27-oct-2023	HSBC	Compra	MXN 6.200	Venta	USD 361	(1)
27-oct-2023	JP Morgan	Compra	MXN 5.300	Venta	USD 308	–
30-oct-2023	JP Morgan	Compra	USD 171	Venta	COP 730.000	(5)
30-oct-2023	JP Morgan	Compra	COP 730.000	Venta	USD 180	(5)
07-nov.-2023	JP Morgan	Compra	USD 940	Venta	EUR 850	16
07-nov.-2023	JP Morgan	Compra	EUR 180	Venta	USD 196	(1)
08-dic.-2023	JP Morgan	Compra	USD 138	Venta	GBP 110	(1)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 86\$)						USD 38
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(64))						(74)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 22\$)						USD (36)

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
U.S. 10 Year Ultra Note diciembre 2023	Citi	29	USD 3.367	USD 34
U.S. 5 Year Note (CBT) diciembre 2023	Citi	18	1.925	14
U.S. Ultra Bond (CBT) diciembre 2023	Citi	11	1.424	18
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: USD-)				USD 66
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(123))				–
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(123))				USD 66

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

FTGF ClearBridge Value Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto
Acciones ordinarias: 93,83 % (28 de febrero de 2023: 99,17 %)			118 Royal Gold Inc		
Aerolíneas: 1,29 % (28 de febrero de 2023: 0,82 %)			13.219 1,38		
248 United Airlines Holdings, Inc.	12.344	1,29	36.976 3,86		
Bancos: 5,21 % (28 de febrero de 2023: 10,33 %)			Fabricación varios: 1,57 % (28 de febrero de 2023: 1,21 %)		
1.210 First Horizon Corp.	15.175	1,58	EUR 100 Siemens AG		
51 Goldman Sachs Group, Inc. (The)	16.768	1,75	15.074 1,57		
437 Wells Fargo & Co.	18.045	1,88	Petróleo y gas: 10,54 % (28 de febrero de 2023: 9,97 %)		
	49.988	5,21	408 APA Corp		
Bebidas: 1,32 % (28 de febrero de 2023: 1,17 %)			487 EQT Corp		
48 Constellation Brands, Inc. 'A'	12.631	1,32	497 Noble Corp Plc		
Biotecnología: 4,38 % (28 de febrero de 2023: 5,57 %)			110 Pioneer Natural Resources Co.		
57 Biogen Inc	15.137	1,58	157 TotalEnergies SE, ADR		
100 BioNTech SE, ADR	12.129	1,26	101.067 10,54		
193 Gilead Sciences Inc	14.770	1,54	Servicios de petróleo y gas: 3,03 % (28 de febrero de 2023: 3,46 %)		
	42.036	4,38	481 Baker Hughes Co 'A'		
Químicos: 2,62 % (28 de febrero de 2023: 2,02 %)			198 Schlumberger NV		
EUR 51 Air Liquide SA	9.266	0,97	29.083 3,03		
186 Eastman Chemical Co.	15.816	1,65	Farmacéuticas: 6,26 % (28 de febrero de 2023: 4,16 %)		
	25.082	2,62	74 AbbVie Inc		
Carbón: 0,66 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			197 AstraZeneca Plc ADR		
152 Teck Resources Ltd	6.298	0,66	221 Johnson & Johnson		
Servicios comerciales: 1,09 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			60.068 6,26		
182 Block Inc	10.490	1,09	Tuberías: 1,88 % (28 de febrero de 2023: 1,90 %)		
Cosmética y cuidado personal: 1,90 % (28 de febrero de 2023: 2,71 %)			515 Enbridge Inc		
868 Coty Inc 'A'	10.046	1,05	18.070 1,88		
GBP 1.992 Haleon Plc	8.158	0,85	Bienes inmuebles: 0,79 % (28 de febrero de 2023: 0,86 %)		
	18.204	1,90	97 Howard Hughes Holdings Inc		
Distribución y venta al por mayor: 1,36 % (28 de febrero de 2023: 1,10 %)			7.596 0,79		
JPY 799 Marubeni Corp	13.023	1,36	Comercio minorista: 1,25 % (28 de febrero de 2023: 0,78 %)		
Servicios financieros diversificados: 3,43 % (28 de febrero de 2023: 2,60 %)			168 Bloomin' Brands Inc		
200 Apollo Global Management, Inc.	17.473	1,82	59 Ross Stores Inc		
151 Capital One Financial Corp.	15.464	1,61	11.947 1,25		
	32.937	3,43	Semiconductores: 3,29 % (28 de febrero de 2023: 2,44 %)		
Eléctric: 6,89 % (28 de febrero de 2023: 6,47 %)			252 Micron Technology Inc		
840 AES Corp. (The)	15.070	1,57	149 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR		
154 American Electric Power Co. Inc.	12.098	1,26	17.640 1,84		
197 Constellation Energy Corp	20.555	2,14	13.957 1,45		
585 Vistra Corp	18.374	1,92	31.597 3,29		
	66.097	6,89	Software: 5,49 % (28 de febrero de 2023: 5,91 %)		
Electrónica: 0,95 % (28 de febrero de 2023: 1,32 %)			147 Fiserv Inc		
242 Sensata Technologies Holding plc	9.110	0,95	34 Microsoft Corp		
Energía – Fuentes alternativas: 1,09 % (28 de febrero de 2023: 1,79 %)			197 Oracle Corp		
399 Fluence Energy Inc	10.502	1,09	52.688 5,49		
Control ambiental: 1,01 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			Transporte: 2,66 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)		
57 Clean Harbors Inc	9.686	1,01	140 Canadian Pacific Kansas City Ltd		
Servicios sanitarios: 2,42 % (28 de febrero de 2023: 2,09 %)			65 Union Pacific Corp		
49 UnitedHealth Group Inc	23.204	2,42	11.100 1,16		
Seguros: 8,14 % (28 de febrero de 2023: 7,60 %)			14.381 1,50		
476 American International Group Inc	27.844	2,90	25.481 2,66		
582 Equitable Holdings Inc	16.751	1,75	Total de acciones ordinarias (coste de 793.686\$)		
47 Everest Group Ltd	16.911	1,76	899.897 93,83		
943 MGIC Investment Corp	16.566	1,73	Fondos de inversión inmobiliaria: 1,48 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)		
	78.072	8,14	Fondos de inversión inmobiliaria (REIT): 1,48 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)		
Internet: 5,79 % (28 de febrero de 2023: 6,89 %)			78 American Tower Corp		
HKD 760 Alibaba Group Holding Ltd	8.828	0,92	14.176 1,48		
103 Expedia Group Inc	11.176	1,16	Total de fondos de inversión inmobiliaria (coste de 14.643 USD)		
47 Meta Platforms, Inc. 'A'	13.970	1,46	14.176 1,48		
456 Uber Technologies Inc	21.540	2,25	Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 808.329\$)		
	55.514	5,79	914.073 95,31		
Alojamiento: 2,01 % (28 de febrero de 2023: 2,97 %)			Contratos de divisas a plazo: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)		
196 Las Vegas Sands Corp	10.737	1,12	Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		
193 MGM Resorts International	8.498	0,89	28 –		
	19.235	2,01	Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
Maquinaria – Diversificadas: 1,65 % (28 de febrero de 2023: 1,57 %)			914.101 95,31		
570 CNH Industrial NV	7.852	0,82	Contratos de divisas a plazo — (0,16 %) (28 de febrero de 2023: (0,10 %))		
201 Flowserve Corp	7.945	0,83	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		
	15.797	1,65	(1.547) (0,16)		
Minería: 3,86 % (28 de febrero de 2023: 5,43 %)			Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
595 Freeport-McMoRan Inc.	23.757	2,48	(1.547) (0,16)		
			Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
			912.554 95,15		
			Excedente de otros activos respecto a los pasivos		
			46.519 4,85		
			Patrimonio		
			959.073\$ 100,00		
– Los importes designados como “-” son 0 USD, menos de 1.000 USD, menos de 1.000 acciones o menos del 0,01 %.					
ABREVIATURAS:					
ADR – recibo de depósito estadounidense					
EUR – euro					
GBP – libra esterlina					
HK – dólar de Hong Kong					
JPY – yen japonés					

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF ClearBridge Value Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Análisis del total de activos	% del total de activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	94,97
Instrumentos financieros derivados	–
Otros activos	5,03
Total de activos	100,00

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)			Moneda de venta (en miles)			Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	81	Venta	EUR	75	USD 1
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	183	Venta	SGD	247	–
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	24	Venta	USD	26	–
06 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	47	Venta	SGD	63	–
06 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	–	Venta	USD	–	–
06 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	–	Venta	USD	–	–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	5.179	Venta	EUR	4.749	25
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	13	Venta	EUR	12	–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	58	Venta	SGD	78	–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	5	Venta	USD	4	–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	1.991	Venta	USD	1.482	(7)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	102.031	Venta	USD	112.257	(1.540)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	528	Venta	USD	571	2
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 10\$)							USD	28
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(976))								(1.547)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(966))							USD	(1.519)

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto
Acciones ordinarias: 98,22 % (28 de febrero de 2023: 93,97 %)		
Bancos: 4,04 % (28 de febrero de 2023: 5,28 %)		
60 Bank of America Corp	1.708	0,86
32 JPMorgan Chase & Co	4.643	2,34
46 US Bancorp	1.667	0,84
	8.018	4,04
Bebidas: 2,67 % (28 de febrero de 2023: 2,85 %)		
39 Coca-Cola Co/The	2.324	1,17
17 PepsiCo Inc	2.982	1,50
	5.306	2,67
Materiales de construcción: 0,95 % (28 de febrero de 2023: 0,85 %)		
9 Vulcan Materials Co	1.880	0,95
Químicos: 4,54 % (28 de febrero de 2023: 4,64 %)		
11 Air Products & Chemicals Inc	3.116	1,57
8 Ecolab Inc	1.520	0,77
19 PPG Industries Inc	2.747	1,38
6 Sherwin-Williams Co/The	1.639	0,82
	9.022	4,54
Servicios comerciales: 2,29 % (28 de febrero de 2023: 2,23 %)		
16 Automatic Data Processing Inc	4.116	2,07
7 PayPal Holdings Inc	436	0,22
	4.552	2,29
Informática: 6,69 % (28 de febrero de 2023: 5,41 %)		
71 Apple Inc	13.285	6,69
Cosmética y cuidado personal: 1,52 % (28 de febrero de 2023: 1,47 %)		
20 Procter & Gamble Co/The	3.019	1,52
Servicios financieros diversificados: 4,83 % (28 de febrero de 2023: 4,58 %)		
9 CME Group Inc	1.851	0,93
15 Intercontinental Exchange Inc	1.809	0,91
24 Visa Inc 'A'	5.940	2,99
	9.600	4,83
Eléctric: 1,18 % (28 de febrero de 2023: 1,27 %)		
16 NextEra Energy Inc	1.101	0,56
18 Sempra	1.233	0,62
	2.334	1,18
Componentes y equipos eléctricos: 1,27 % (28 de febrero de 2023: 0,89 %)		
26 Emerson Electric Co	2.524	1,27
Electrónica: 2,22 % (28 de febrero de 2023: 2,46 %)		
23 Honeywell International Inc	4.411	2,22
Control ambiental: 1,62 % (28 de febrero de 2023: 1,68 %)		
20 Waste Management Inc	3.210	1,62
Alimentación: 1,30 % (28 de febrero de 2023: 1,29 %)		
4 McCormick & Co Inc/MD	355	0,18
31 Mondelez International Inc	2.224	1,12
	2.579	1,30
Productos sanitarios - 2,79 % (28 de febrero de 2023: 3,08 %)		
7 Stryker Corp	1.886	0,95
7 Thermo Fisher Scientific Inc	3.658	1,84
	5.544	2,79
Servicios sanitarios: 2,58 % (28 de febrero de 2023: 3,11 %)		
11 UnitedHealth Group Inc	5.133	2,58
Seguros: 7,64 % (28 de febrero de 2023: 7,66 %)		
- Berkshire Hathaway Inc	7.647	3,85
16 Hartford Financial Services Group Inc/The	1.126	0,56
21 Progressive Corp/The	2.739	1,38
23 Travelers Cos Inc/The	3.669	1,85
	15.181	7,64
Internet: 8,95 % (28 de febrero de 2023: 5,69 %)		
25 Alphabet Inc	3.377	1,70
29 Alphabet Inc 'A'	4.006	2,02
43 Amazon.com Inc	5.943	2,99
8 Meta Platforms, Inc. 'A'	2.267	1,14
5 Netflix Inc	2.179	1,10
	17.772	8,95
Hierro/Acero: 0,71 % (28 de febrero de 2023: 1,09 %)		
53 ArcelorMittal SA	1.415	0,71
Medios: 1,69 % (28 de febrero de 2023: 1,98 %)		
56 Comcast Corp	2.612	1,32
9 Walt Disney Co/The	739	0,37
	3.351	1,69

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto
Fabricación varios: 1,12 % (28 de febrero de 2023: 1,03 %)		
10 Eaton Corp Plc	2.229	1,12
Petróleo y gas: 1,43 % (28 de febrero de 2023: 1,53 %)		
12 Pioneer Natural Resources Co.	2.841	1,43
Embalaje y envases: 0,58 % (28 de febrero de 2023: 0,65 %)		
21 Ball Corp	1.150	0,58
Farmacéuticas: 9,91 % (28 de febrero de 2023: 9,05 %)		
12 AbbVie Inc	1.708	0,86
12 Becton Dickinson & Co	3.260	1,64
7 Eli Lilly & Co	3.664	1,84
26 Johnson & Johnson	4.279	2,16
48 Merck & Co Inc	5.250	2,64
43 Pfizer Inc	1.528	0,77
	19.689	9,91
Tuberías: 0,68 % (28 de febrero de 2023: 0,73 %)		
78 Kinder Morgan Inc.	1.348	0,68
Comercio minorista: 6,03 % (28 de febrero de 2023: 5,87 %)		
2 Costco Wholesale Corp	1.243	0,62
9 Home Depot Inc/The	2.914	1,47
57 TJX Cos Inc/The	5.258	2,65
16 Walmart Inc	2.569	1,29
	11.984	6,03
Semiconductores: 3,60 % (28 de febrero de 2023: 1,79 %)		
3 ASML Holding NV	1.961	0,99
13 Marvell Technology Inc	738	0,37
9 NVIDIA Corp	4.444	2,24
	7.143	3,60
Software: 11,69 % (28 de febrero de 2023: 9,29 %)		
6 Adobe Inc	3.469	1,75
50 Microsoft Corp	16.408	8,26
28 Oracle Corp	3.339	1,68
	23.216	11,69
Telecomunicaciones: 1,20 % (28 de febrero de 2023: 2,55 %)		
7 Arista Networks Inc	1.387	0,70
7 T-Mobile US Inc	992	0,50
	2.379	1,20
Transporte: 2,50 % (28 de febrero de 2023: 2,88 %)		
17 Canadian Pacific Kansas City Ltd	1.362	0,69
4 Union Pacific Corp	915	0,46
16 United Parcel Service Inc 'B'	2.685	1,35
	4.962	2,50
Total de acciones ordinarias (coste de 141.191\$)		
	195.077	98,22
Fondos de inversión inmobiliaria: 1,11 % (28 de febrero de 2023: 1,32 %)		
Fondos de inversión inmobiliaria (REIT): 1,11 % (28 de febrero de 2023: 1,32 %)		
12 American Tower Corp	2.202	1,11
Total de fondos de inversión inmobiliaria (coste de 2.146 USD)		
	2.202	1,11
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 143.337\$)		
	197.279	99,33
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
	197.279	99,33
Contratos de divisas a plazo: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)		
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		
	-	-
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
	-	-
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
	197.279	99,33
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		
	1.325	0,67
Patrimonio		
	198.604\$	100,00
- Los importes designados como "-" son 0 USD, menos de 1.000 USD, menos de 1.000 acciones o menos del 0,01 %.		
Análisis del total de activos		% del total de activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado		99,06
Otros activos		0,94
Total de activos		100,00

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)		Moneda de venta (en miles)		Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)			
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	20	Venta	USD	22	USD	–
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: USD–)								USD	–
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: USD–)								USD	–
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): USD–)								USD	–

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto
Acciones ordinarias: 96,57 % (28 de febrero de 2023: 94,00 %)			Transporte: 2,49 % (28 de febrero de 2023: 2,09 %)		
Vestimenta: 1,50 % (28 de febrero de 2023: 2,34 %)			72 Union Pacific Corp 15.815 1,03		
227 NIKE Inc	23.055	1,50	133 United Parcel Service Inc 'B'	22.554	1,46
Fabricantes de automóviles: 0,82 % (28 de febrero de 2023: 0,78 %)			38.369 2,49		
49 Tesla Inc	12.569	0,82	Total de fondos de inversión inmobiliaria (coste de 1.082.310\$)	1.487.502	96,57
Componentes y equipos de automóvil: 1,16 % (28 de febrero de 2023: 1,59 %)			Fondos de inversión inmobiliaria: 1,59 % (28 de febrero de 2023: 1,68 %)		
176 Aptiv Plc	17.893	1,16	Fondos de inversión inmobiliaria (REIT): 1,59 % (28 de febrero de 2023: 1,68 %)		
Bebidas: 2,19 % (28 de febrero de 2023: 2,54 %)			31 Equinix Inc 24.592 1,59		
586 Monster Beverage Corp	33.651	2,19	Total de fondos de inversión inmobiliaria (coste de 15 492 USD)	24.592	1,59
Químicos: 1,76 % (28 de febrero de 2023: 1,40 %)			Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 1.097.802\$)		
100 Sherwin-Williams Co/The	27.062	1,76	1.512.094 98,16		
Servicios comerciales: 3,49 % (28 de febrero de 2023: 4,38 %)			Contratos de divisas a plazo: 0,02 % (28 de febrero de 2023: 0,02 %)		
307 PayPal Holdings Inc	19.168	1,25	Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo) 280 0,02		
88 S&P Global Inc	34.504	2,24	Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
	53.672	3,49	1.512.374 98,18		
Informática: 4,92 % (28 de febrero de 2023: 4,50 %)			Contratos de divisas a plazo — (0,15 %) (28 de febrero de 2023: (0,12 %))		
403 Apple Inc	75.784	4,92	Depreciación latente de contratos (véase más abajo) (2.302) (0,15)		
Cosmética y cuidado personal: 1,15 % (28 de febrero de 2023: 1,77 %)			Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
110 Estee Lauder Cos., Inc. (The) 'A'	17.692	1,15	(2.302) (0,15)		
Distribución y venta al por mayor: 2,23 % (28 de febrero de 2023: 2,87 %)			Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
48 WW Grainger Inc	34.348	2,23	1.510.072 98,03		
Servicios financieros diversificados: 4,84 % (28 de febrero de 2023: 5,87 %)			Excedente de otros activos respecto a los pasivos		
303 Visa Inc 'A'	74.558	4,84	30.309 1,97		
Eléctric: 1,04 % (28 de febrero de 2023: 0,97 %)			Patrimonio		
241 NextEra Energy Inc	16.075	1,04	1.540.381\$ 100,00		
Electrónica: 1,43 % (28 de febrero de 2023: 2,13 %)			— Los importes designados como "-" son 0 USD, menos de 1.000 USD, menos de 1.000 acciones o menos del 0,01 %.		
117 Honeywell International Inc	21.978	1,43	ABREVIATURAS:		
Productos sanitarios - 7,45 % (28 de febrero de 2023: 8,51 %)			ADR — recibo de depósito estadounidense		
342 Alcon Inc	28.353	1,84	Análisis del total de activos		
102 Intuitive Surgical Inc	31.839	2,07	Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado 97,05		
83 Stryker Corp	23.420	1,52	Instrumentos financieros derivados 0,02		
56 Thermo Fisher Scientific Inc	31.163	2,02	Otros activos 2,93		
	114.775	7,45	Total de activos		
Servicios sanitarios: 3,15 % (28 de febrero de 2023: 3,99 %)			100,00		
102 UnitedHealth Group Inc	48.503	3,15			
Seguros: 1,65 % (28 de febrero de 2023: 1,78 %)					
131 Marsh & McLennan Cos Inc	25.459	1,65			
Internet: 19,28 % (28 de febrero de 2023: 16,25 %)					
822 Amazon.com Inc	113.424	7,36			
217 Meta Platforms, Inc. 'A'	64.159	4,17			
116 Netflix Inc	50.226	3,26			
148 Palo Alto Networks Inc	36.037	2,34			
92 Sea Ltd ADR	3.466	0,22			
629 Uber Technologies Inc	29.720	1,93			
	297.032	19,28			
Fabricación varios: 2,26 % (28 de febrero de 2023: 2,55 %)					
151 Eaton Corp Plc	34.801	2,26			
Farmacéuticas: 4,33 % (28 de febrero de 2023: 4,30 %)					
219 Dexcom Inc	22.114	1,43			
31 Eli Lilly & Co	17.129	1,11			
144 Zoetis Inc	27.510	1,79			
	66.753	4,33			
Comercio minorista: 0,22 % (28 de febrero de 2023: 1,08 %)					
27 Target Corp	3.429	0,22			
Semiconductores: 10,51 % (28 de febrero de 2023: 7,23 %)					
40 ASML Holding NV	26.703	1,73			
354 Intel Corp	12.427	0,81			
249 NVIDIA Corp	122.825	7,97			
	161.955	10,51			
Software: 18,70 % (28 de febrero de 2023: 15,08 %)					
69 Adobe Inc	38.604	2,51			
96 Atlassian Corp	19.645	1,28			
39 Intuit Inc	20.856	1,35			
371 Microsoft Corp	121.584	7,89			
164 Salesforce Inc	36.248	2,35			
179 Splunk Inc	21.704	1,41			
129 Unity Software Inc	4.778	0,31			
101 Workday Inc 'A'	24.670	1,60			
	288.089	18,70			

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)			Moneda de venta (en miles)			Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
		Compra	USD		Venta			
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	1.538	Venta	BRL	7.653	USD (7)
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	20.328	Venta	BRL	99.536	244
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	15	Venta	EUR	14	–
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	211	Venta	GBP	166	1
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	74	Venta	USD	80	–
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	BRL	107.189	Venta	USD	22.596	(968)
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	36	Venta	USD	47	–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	2.981	Venta	EUR	2.716	35
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	45	Venta	EUR	42	–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	71.651	Venta	USD	78.825	(1.074)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	96	Venta	USD	102	–
03-oct-2023	BNY Mellon	Compra	BRL	101.184	Venta	USD	20.578	(253)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 286\$)								USD 280
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(1.551))								(2.302)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(1.265))								USD (2.022)

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto
Acciones ordinarias: 98,84 % (28 de febrero de 2023: 95,22 %)			Contratos de divisas a plazo: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)		
Bebidas: 1,97 % (28 de febrero de 2023: 1,70 %)			Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo) 4 –		
26 Diageo Plc ADR	4.254	1,97	Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias 213.407 98,84		
Biotecnología: 14,62 % (28 de febrero de 2023: 14,46 %)			Contratos de divisas a plazo — (0,04 %) (28 de febrero de 2023: (0,10 %))		
28 Biogen Inc	7.524	3,48	Depreciación latente de contratos (véase más abajo) (86) (0,04)		
103 Ionis Pharmaceuticals Inc	4.136	1,92	Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (86) (0,04)		
56 Ultragenyx Pharmaceutical Inc	2.058	0,95	Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias 213.321 98,80		
51 Vertex Pharmaceuticals Inc	17.851	8,27	Excedente de otros activos respecto a los pasivos 2.595 1,20		
	31.569	14,62	Patrimonio 215.916\$ 100,00		
Materiales de construcción: 3,49 % (28 de febrero de 2023: 3,56 %)			– Los importes designados como “-” son 0 USD, menos de 1.000 USD, menos de 1.000 acciones o menos del 0,01 %.		
128 Johnson Controls International plc	7.533	3,49	∞ El título es valorado de buena fe y a un valor razonable por el Comité de Valoración o según el criterio de este.		
Informática: 7,94 % (28 de febrero de 2023: 6,43 %)			ABREVIATURAS:		
12 Accenture Plc 'A'	3.786	1,75	ADR – recibo de depósito estadounidense		
56 CrowdStrike Holdings Inc	9.107	4,22	Análisis del total de activos		
41 Seagate Technology Holdings Plc	2.891	1,34	Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado 98,17		
30 Western Digital Corp	1.368	0,63	Instrumentos financieros derivados –		
	17.152	7,94	Otros activos 1,83		
Servicios financieros diversificados: 0,63 % (28 de febrero de 2023: 0,67 %)			Total de activos 100,00		
21 Cohen & Steers Inc	1.356	0,63			
Electrónica: 4,94 % (28 de febrero de 2023: 6,57 %)					
81 TE Connectivity Ltd	10.676	4,94			
Entretenimiento: 3,98 % (28 de febrero de 2023: 4,72 %)					
53 Madison Square Garden Entertainment Corp 'A'	1.692	0,78			
39 Madison Square Garden Sports Corp	6.909	3,20			
	8.601	3,98			
Productos sanitarios - 1,52 % (28 de febrero de 2023: 2,10 %)					
17 Insulet Corp	3.274	1,52			
Servicios sanitarios: 9,49 % (28 de febrero de 2023: 9,41 %)					
21 Charles River Laboratories International Inc	4.421	2,05			
34 UnitedHealth Group Inc	16.079	7,44			
	20.500	9,49			
Mobiliario doméstico: 1,56 % (28 de febrero de 2023: 1,46 %)					
40 Dolby Laboratories Inc 'A'	3.372	1,56			
Internet: 6,38 % (28 de febrero de 2023: 5,83 %)					
35 Airbnb Inc	4.568	2,12			
47 Etsy Inc	3.475	1,61			
10 Match Group Inc	472	0,22			
8 Meta Platforms, Inc. 'A'	2.457	1,14			
102 Pinterest Inc	2.796	1,29			
	13.768	6,38			
Medios: 9,71 % (28 de febrero de 2023: 10,44 %)					
260 Comcast Corp	12.176	5,64			
16 Liberty Broadband Corp	1.476	0,68			
74 Liberty Media Corp-Liberty Formula One	5.090	2,36			
18 Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	451	0,21			
134 Warner Bros Discovery Inc	1.767	0,82			
	20.960	9,71			
Minería: 1,97 % (28 de febrero de 2023: 1,49 %)					
106 Freeport-McMoRan Inc.	4.247	1,97			
Farmacéuticas: 2,17 % (28 de febrero de 2023: 2,14 %)					
32 AbbVie Inc	4.689	2,17			
Comercio minorista: 2,32 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)					
17 Starbucks Corp	1.657	0,77			
36 TJX Cos Inc/The	3.346	1,55			
	5.003	2,32			
Semiconductores: 12,02 % (28 de febrero de 2023: 11,40 %)					
23 Broadcom Inc	20.867	9,67			
106 Wolfspeed Inc	5.082	2,35			
	25.949	12,02			
Software: 14,13 % (28 de febrero de 2023: 12,84 %)					
56 Autodesk Inc	12.418	5,75			
40 DocuSign Inc 'A'	2.027	0,94			
57 Doximity Inc	1.355	0,63			
19 HubSpot Inc	10.629	4,92			
26 Snowflake Inc	4.071	1,89			
	30.500	14,13			
Telecomunicaciones: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)					
24 GCI Liberty, Inc. Escrow ∞	–	–			
Total de acciones ordinarias (coste de 152.332\$)					
	213.403	98,84			
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 152.332\$)					
	213.403	98,84			

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)		Moneda de venta (en miles)		Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)			
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	–	Venta	AUD	–	USD	–
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	1	Venta	EUR	1		–
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	–	Venta	GBP	–		–
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	8	Venta	USD	10		–
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	20	Venta	USD	22		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	162	Venta	AUD	253		(1)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	167	Venta	AUD	256		2
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	2	Venta	CHF	2		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	40	Venta	CNH	295		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	39	Venta	EUR	35		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	21	Venta	GBP	16		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	2	Venta	SEK	19		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	21	Venta	SEK	219		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	203	Venta	SGD	273		1
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	186	Venta	SGD	253		(1)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	7.394	Venta	USD	5.502		(27)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	2	Venta	USD	1		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SEK	444	Venta	USD	42		(1)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	GBP	232	Venta	USD	295		(2)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	794	Venta	USD	874		(12)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CNH	5.010	Venta	USD	695		(6)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CHF	49	Venta	USD	56		(1)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	AUD	147	Venta	USD	94		1
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	AUD	6.575	Venta	USD	4.296		(35)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SEK	–	Venta	USD	–		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CNH	155	Venta	USD	21		–
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 4\$)								USD	4
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(229))									(86)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(225))								USD	(82)

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor del patrimonio neto
Acciones ordinarias: 82,82 % (28 de febrero de 2023: 78,26 %)			Capital privado: 3,34 % (28 de febrero de 2023: 1,83 %)		
Industria aeroespacial y defensa: 1,40 % (28 de febrero de 2023: 2,40 %)			11 Blackstone Inc 1.185 3,34		
2 L3Harris Technologies Inc	320	0,90	Semiconductores: 7,71 % (28 de febrero de 2023: 7,20 %)		
2 RTX Corp	178	0,50	– ASML Holding NV 226 0,64		
	498	1,40	2 Broadcom Inc 1.599 4,50		
Bancos: 2,55 % (28 de febrero de 2023: 3,73 %)			1 NXP Semiconductors NV 307 0,86		
1 Goldman Sachs Group, Inc. (The)	177	0,50	5 QUALCOMM Inc 608 1,71		
5 JPMorgan Chase & Co	730	2,05	2.740 7,71		
	907	2,55	Software: 12,20 % (28 de febrero de 2023: 9,72 %)		
Bebidas: 1,98 % (28 de febrero de 2023: 1,83 %)			6 Activision Blizzard Inc 571 1,61		
12 Coca-Cola Co/The	705	1,98	7 Microsoft Corp 2.280 6,42		
Biotecnología: 1,23 % (28 de febrero de 2023: 1,29 %)			10 Oracle Corp 1.199 3,37		
2 Amgen Inc	437	1,23	2 Paychex Inc 284 0,80		
Químicos: 2,43 % (28 de febrero de 2023: 2,33 %)			4.334 12,20		
2 Air Products & Chemicals Inc	457	1,29	Telecomunicaciones: 1,56 % (28 de febrero de 2023: 2,44 %)		
15 Huntsman Corp	406	1,14	10 Cisco Systems Inc 554 1,56		
	863	2,43	Transporte: 2,19 % (28 de febrero de 2023: 1,45 %)		
Informática: 5,99 % (28 de febrero de 2023: 4,70 %)			2 Union Pacific Corp 516 1,45		
11 Apple Inc	2.127	5,99	2 United Parcel Service Inc 'B' 262 0,74		
Cosmética y cuidado personal: 2,43 % (28 de febrero de 2023: 1,56 %)			778 2,19		
– Colgate-Palmolive Co	34	0,10	Total de acciones ordinarias (coste de 20.178\$) 29.425 82,82		
8 Kenvue Inc	175	0,49	Acciones preferentes: 6,54 % (28 de febrero de 2023: 6,35 %)		
4 Procter & Gamble Co/The	653	1,84	Servicios financieros diversificados: 2,21 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)		
	862	2,43	14 Apollo Global Management, Inc. 785 2,21		
Servicios financieros diversificados: 3,69 % (28 de febrero de 2023: 3,69 %)			Electric: 1,39 % (28 de febrero de 2023: 1,34 %)		
45 Blue Owl Capital Inc 'A'	533	1,50	11 NextEra Energy Inc 494 1,39		
1 CME Group Inc	292	0,82	Gas: 0,36 % (28 de febrero de 2023: 0,38 %)		
4 Intercontinental Exchange Inc	487	1,37	3 Spire Inc, Series A 126 0,36		
	1.312	3,69	Medios: 0,51 % (28 de febrero de 2023: 0,69 %)		
Electric: 6,04 % (28 de febrero de 2023: 4,78 %)			8 Paramount Global, Series A 181 0,51		
4 Brookfield Renewable Corp	122	0,34	Capital privado: 2,07 % (28 de febrero de 2023: 2,42 %)		
18 Brookfield Renewable Energy Partners LP/CA, MLP #	469	1,32	10 KKR & Co Inc, Series C 735 2,07		
5 DTE Energy Co	512	1,44	Total de acciones preferentes (coste de 2.630\$) 2.321 6,54		
3 NextEra Energy Inc	173	0,49	Fondos de inversión inmobiliaria: 9,87 % (28 de febrero de 2023: 8,91 %)		
17 PPL Corp	426	1,20	Fondos de inversión inmobiliaria (REIT): 9,87 % (28 de febrero de 2023: 8,91 %)		
6 Sempra	444	1,25	3 Alexandria Real Estate Equities Inc 401 1,13		
	2.146	6,04	5 American Homes 4 Rent 'A' 188 0,53		
Componentes y equipos eléctricos: 1,17 % (28 de febrero de 2023: 0,94 %)			1 American Tower Corp 185 0,52		
4 Emerson Electric Co	414	1,17	6 Apartment Income REIT Corp 202 0,57		
Electrónica: 0,80 % (28 de febrero de 2023: 0,50 %)			4 Digital Realty Trust Inc 501 1,41		
3 Amphenol Corp 'A'	284	0,80	1 Equinix Inc 487 1,37		
Energía – Fuentes alternativas: 1,09 % (28 de febrero de 2023: 0,97 %)			3 Equity LifeStyle Properties Inc 179 0,50		
8 NextEra Energy Partners LP	386	1,09	3 Extra Space Storage Inc 324 0,91		
Seguros: 1,51 % (28 de febrero de 2023: 0,88 %)			9 Gaming and Leisure Properties Inc 410 1,15		
3 Chubb Ltd	537	1,51	9 Global Medical REIT Inc 86 0,24		
Empresas de inversión: 1,55 % (28 de febrero de 2023: 1,97 %)			4 Prologis Inc 545 1,54		
23 Ares Capital Corp	450	1,27	3.508 9,87		
7 Trinity Capital Inc	102	0,28	Total de fondos de inversión inmobiliaria (coste de 3 270 USD) 3.508 9,87		
	552	1,55	Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 26.078\$) 35.254 99,23		
Maquinaria – Diversificadas: 1,52 % (28 de febrero de 2023: 1,89 %)			Contratos de divisas a plazo: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)		
6 Otis Worldwide Corp	540	1,52	Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo) – –		
Petróleo y gas: 2,00 % (28 de febrero de 2023: 0,48 %)			Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias 35.254 99,23		
3 ConocoPhillips	407	1,14	Contratos de divisas a plazo — (0,04 %) (28 de febrero de 2023: (0,14 %))		
1 Pioneer Natural Resources Co.	305	0,86	Depreciación latente de contratos (véase más abajo) (16) (0,04)		
	712	2,00	Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (16) (0,04)		
Farmacéuticas: 6,87 % (28 de febrero de 2023: 6,46 %)			Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias 35.238 99,19		
2 AbbVie Inc	291	0,82	Excedente de otros activos respecto a los pasivos 290 0,81		
3 Johnson & Johnson	409	1,15	Patrimonio 35.528\$ 100,00		
10 Merck & Co Inc	1.072	3,02	– Los importes designados como “-” son 0 USD, menos de 1.000 USD, menos de 1.000 acciones o menos del 0,01 %.		
19 Pfizer Inc	668	1,88	# Master Limited Partnership.		
	2.440	6,87	Análisis del total de activos		
Tuberías: 11,57 % (28 de febrero de 2023: 12,16 %)			Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado 98,96		
6 DT Midstream Inc	331	0,93	Otros activos 1,04		
18 Enbridge Inc	615	1,73	Total de activos 100,00		
36 Kinder Morgan Inc.	618	1,74			
6 ONEOK Inc	362	1,02			
60 Plains GP Holdings LP, MLP 'A' #	968	2,72			
35 Williams Cos Inc/The	1.218	3,43			
	4.112	11,57			

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 — (continuación)

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)			Moneda de venta (en miles)			Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
		Compra		Venta	Compra		Venta		
05 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	–	Venta	USD	–	USD	–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	24	Venta	AUD	38		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	1	Venta	CNH	11		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	24	Venta	EUR	23		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	8	Venta	SGD	10		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	USD	17	Venta	SGD	23		–
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	EUR	504	Venta	USD	553		(8)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	CNH	346	Venta	USD	48		(1)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	AUD	1.115	Venta	USD	729		(6)
15 sep. 2023	BNY Mellon	Compra	SGD	352	Venta	USD	262		(1)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 1\$)								USD	–
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(56))									(16)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(55))								USD	(16)

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias — 94,16 % (28 de febrero de 2023: 96,28%)		
Vestimenta — 1,47% (28 de febrero de 2023: 1,61 %)		
231 Nike Inc	23.432	1,47
Componentes y equipos de automóvil — 0,87%(28 de febrero de 2023: 1,25%)		
138 Aptiv Plc	13.950	0,87
Bancos — 4,58% (28 de febrero de 2023: 6,59%)		
295 JPMorgan Chase & Co.	43.160	2,70
352 Morgan Stanley	29.930	1,88
	73.090	4,58
Bioteología — 3,09% (28 de febrero de 2023: 3,47%)		
249 BioMarin Pharmaceutical Inc	22.755	1,43
346 Gilead Sciences Inc	26.435	1,66
	49.190	3,09
Materiales de construcción — 3,28% (28 de febrero de 2023: 3,27%)		
135 Trane Technologies Plc	27.754	1,74
343 Trex Co Inc	24.485	1,54
	52.239	3,28
Químicos — 1,62% (28 de febrero de 2023: 1,43%)		
141 Ecolab Inc	25.837	1,62
Servicios comerciales — 0,97% (28 de febrero de 2023: 1,20%)		
412 Progyny Inc	15.387	0,97
Informática — 7,88% (28 de febrero de 2023: 6,53%)		
83 Accenture Plc 'A'	26.817	1,68
526 Apple Inc	98.825	6,20
	125.642	7,88
Cosmética y cuidado personal — 3,33% (28 de febrero de 2023: 0,00%)		
353 Colgate-Palmolive Co	25.919	1,63
176 Procter & Gamble Co/The	27.182	1,70
	53.101	3,33
Servicios financieros diversificados — 4,64% (28 de febrero de 2023: 5,42%)		
33 BlackRock Inc	22.760	1,43
316 Charles Schwab Corp/The	18.684	1,17
133 Visa Inc 'A'	32.593	2,04
	74.037	4,64
Elctric — 2,06 % (28 de febrero de 2023: 1,29%)		
658 Brookfield Renewable Corp	18.373	1,15
190 Ormat Technologies Inc	14.460	0,91
	32.833	2,06
Electrónica — 1,44% (28 de febrero de 2023: 3,82%)		
173 Keysight Technologies Inc	23.031	1,44
Energía - Fuentes alternativas — 3,20% (28 de febrero de 2023: 4,53%)		
55 Enphase Energy Inc	6.946	0,43
359 NextEra Energy Partners LP	17.885	1,12
754 Shoals Technologies Group Inc 'A'	14.814	0,93
70 SolarEdge Technologies Inc	11.425	0,72
	51.070	3,20
Alimentación — 1,62% (28 de febrero de 2023: 1,68%)		
316 McCormick & Co Inc/MD	25.900	1,62
Herramientas manuales/mecánicas — 1,92% (28 de febrero de 2023: 2,35%)		
189 Regal Rexnord Corp	30.667	1,92
Productos sanitarios - 5,40% (28 de febrero de 2023: 5,15%)		
70 Cooper Cos Inc/The	25.987	1,63
115 Danaher Corp	30.586	1,92
53 Thermo Fisher Scientific Inc	29.518	1,85
	86.091	5,40
Servicios sanitarios — 2,76% (28 de febrero de 2023: 2,71%)		
92 UnitedHealth Group Inc	44.001	2,76
Seguros — 3,23% (28 de febrero de 2023: 4,57%)		
358 Hartford Financial Services Group Inc/The	25.731	1,61
193 Progressive Corp/The	25.734	1,62
	51.465	3,23
Internet — 5,49% (28 de febrero de 2023: 5,25%)		
343 Alphabet Inc 'A'	46.665	2,93
10 Booking Holdings Inc	31.655	1,99
124 Etsy Inc	9.150	0,57
	87.470	5,49
Maquinaria - Construcción y Minería, 0,58%(28 de febrero de 2023: 0,86%)		
617 Bloom Energy Corp 'A'	9.241	0,58
Maquinaria - Diversificadas: 2,15% (28 de febrero de 2023: 2,19%)		
83 Deere & Co	34.275	2,15
Medios — 1,36% (28 de febrero de 2023: 1,56%)		
260 Walt Disney Co/The	21.722	1,36

Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Fabricación varios — 2,95%(28 de febrero de 2023: 2,29%)		
205 Eaton Corp Plc	47.106	2,95
Embalaje y envases — 1,42% (28 de febrero de 2023: 1,50%)		
416 Ball Corp	22.625	1,42
Farmacéuticas — 5,18% (28 de febrero de 2023: 5,46%)		
391 CVS Health Corp	25.486	1,60
173 Johnson & Johnson	28.040	1,76
156 Novo Nordisk A/S, ADR	29.028	1,82
	82.554	5,18
Comercio minorista — 5,93% (28 de febrero de 2023: 5,83%)		
70 Costco Wholesale Corp	38.446	2,41
110 Home Depot Inc/The	36.431	2,29
139 Williams-Sonoma Inc	19.650	1,23
	94.527	5,93
Semiconductores — 2,68% (28 de febrero de 2023: 3,66%)		
37 ASML Holding NV	24.167	1,52
26 Lam Research Corp	18.543	1,16
	42.710	2,68
Software — 10,91% (28 de febrero de 2023: 8,95%)		
378 Microsoft Corp	123.831	7,77
125 Salesforce Inc	27.633	1,73
49 Synopsys Inc	22.532	1,41
	173.996	10,91
Telecomunicaciones — 2,15% (28 de febrero de 2023: 1,86%)		
598 Cisco Systems Inc	34.310	2,15
Total de acciones ordinarias (coste de 1 473 230 \$)	1.501.499	94,16
Fondos de inversión inmobiliaria — 3,26% (28 de febrero de 2023: 3,05%)		
Fondos de inversión inmobiliaria (REIT) — 3,26% (28 de febrero de 2023: 3,05%)		
31 Equinix Inc	24.134	1,52
224 Prologis Inc	27.788	1,74
	51.922	3,26
Total de fondos de inversión inmobiliaria (coste de 47 489 USD)	51.922	3,26
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 1.520.719\$)	1.553.421	97,42
Contratos de divisas a plazo — 0,00% (28 de febrero de 2023: 0,00%)		
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	31	-
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	1.553.452	97,42
Contratos de divisas a plazo — (0,05 %) (28 de febrero de 2023: 0,05%)		
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(863)	(0,05)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	(863)	(0,05)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	1.552.589	97,37
Excedente de otros activos respecto a los pasivos	41.962	2,63
Patrimonio	1.594.551\$	100,00

- Los importes designados como "-" son 0 USD, menos de 1000 USD, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.

ABREVIATURAS:

ADR - recibo de depósito estadounidense

Análisis del total de activos

	% del total de activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	96,21
Instrumentos financieros derivados	-
Otros activos	3,79
Total de activos	100,00

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 (continuación)

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)			Moneda de venta (en miles)			Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
		Compra	USD		Venta	EUR		USD	
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD	1	Venta	EUR	1	USD	-
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD	-	Venta	EUR	-		-
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD	757	Venta	GBP	595		3
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD	1	Venta	GBP	1		-
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR	34	Venta	USD	37		-
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	GBP	911	Venta	USD	1.159		(7)
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	SEK	88	Venta	USD	8		-
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD	1.094	Venta	EUR	1.005		3
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD	9	Venta	EUR	8		-
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD	3.401	Venta	GBP	2.665		25
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD	37	Venta	GBP	30		-
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	GBP	59.654	Venta	USD	75.972		(395)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR	30.579	Venta	USD	33.642		(461)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	GBP	38	Venta	USD	48		-
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 22\$)								USD	31
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]): \$(840)									(863)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(818))								USD	(832)

FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias — 99,02 % (28 de febrero de 2023: 97,30%)					
Australia — 2,02 % (28 de febrero de 2023: 1,09%)					
AUD	18	Brambles Ltd		170	1,14
AUD	8	Computershare Ltd		130	0,88
				300	2,02
Brasil — 0,35 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
		– MercadoLibre Inc		52	0,35
Canadá — 2,62 % (28 de febrero de 2023: 3,76%)					
CAD		– Constellation Software Inc/Canada		187	1,26
CAD	1	Loblaws Companies Ltd		121	0,81
	1	Shopify Inc 'A'		81	0,55
				389	2,62
China — 3,06 % (28 de febrero de 2023: 3,72%)					
HKD	12	Alibaba Group Holding Ltd		136	0,91
HKD	3	Tencent Holdings Ltd		138	0,93
HKD	61	TravelSky Technology Ltd		109	0,73
	3	Zai Lab Ltd. ADR		73	0,49
				456	3,06
Francia — 2,75 % (28 de febrero de 2023: 3,20%)					
EUR	1	Edenred		35	0,24
EUR		– Kering SA		142	0,95
EUR		– LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE		232	1,56
				409	2,75
Alemania — 4,84 % (28 de febrero de 2023: 4,64%)					
EUR	1	Deutsche Boerse AG		143	0,96
EUR	13	Deutsche Telekom AG		280	1,89
EUR	2	SAP SE		296	1,99
				719	4,84
Hong Kong — 2,59% (28 de febrero de 2023: 2,63%)					
HKD	19	AIA Group Ltd		170	1,14
HKD	6	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.		216	1,45
				386	2,59
India — 1,17 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
	3	HDFC Bank Ltd ADR		174	1,17
Israel — 0,74% (28 de febrero de 2023: 0,93%)					
	1	Nice Ltd ADR		111	0,74
Japón — 6,41 % (28 de febrero de 2023: 5,48%)					
JPY	8	Daiichi Sankyo Co Ltd		242	1,63
JPY		– Keyence Corp		66	0,44
JPY	11	Olympus Corp		153	1,02
JPY		– SMC Corp		77	0,52
JPY	2	Sony Group Corp		185	1,25
JPY	2	Tokyo Electron Ltd		231	1,55
				954	6,41
México — 0,69 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
MXN	21	Grupo Bimbo SAB de CV		102	0,69
Países Bajos — 2,11 % (28 de febrero de 2023: 1,61 %)					
EUR		– Argenx SE ADR		150	1,01
EUR		– ASML Holding NV		163	1,10
				313	2,11
Nueva Zelanda — 0,58% (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
AUD	1	Xero Ltd		86	0,58
Portugal — 0,91% (28 de febrero de 2023: 1,63%)					
EUR	30	EDP – Energias de Portugal SA		136	0,91
Suecia — 0,80 % (28 de febrero de 2023: 1,02%)					
SEK	6	Sandvik AB		119	0,80
Suiza — 1,12 % (28 de febrero de 2023: 1,84%)					
CHF	2	Alcon Inc		167	1,12
Taiwán — 0,92% (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
TWD	8	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd		137	0,92
Reino Unido — 2,54 % (28 de febrero de 2023: 4,29%)					
	1	Diageo Plc ADR		141	0,95
GBP	2	London Stock Exchange Group Plc		237	1,59
				378	2,54
Estados Unidos — 62,80 % (28 de febrero de 2023: 59,75%)					
	1	AbbVie Inc		132	0,89
	1	Accenture Plc 'A'		206	1,38
		– Adobe Inc		241	1,62
	3	Alphabet Inc 'A'		455	3,06
	3	Amazon.com Inc		440	2,96
	1	Amphenol Corp 'A'		117	0,79
	4	Apple Inc		736	4,95
	22	Coty Inc 'A'		250	1,68
		– Deere & Co		189	1,27
				147	0,99
				559	3,76
				210	1,41
				225	1,51
				300	2,02
				159	1,07
				81	0,55
				192	1,29
				109	0,73
				280	1,88
				714	4,80
				96	0,64
				183	1,23
				185	1,24
				282	1,90
				189	1,27
				285	1,92
				246	1,65
				162	1,09
				118	0,79
				271	1,82
				268	1,80
				149	1,00
				112	0,75
				288	1,94
				307	2,07
				122	0,82
				133	0,89
				110	0,74
				94	0,63
				9.342	62,80
Total de acciones ordinarias (coste de 13.451 \$)				14.730	99,02
Derechos — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
Canadá — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
CAD		– Constellation Software Inc/Canada		–	–
Derechos totales (Coste \$-)				–	–
Garantía — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
Canadá — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
CAD		– Constellation Software Inc/Canada		–	–
Derechos totales (Coste \$-)				–	–
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias				14.730	99,02
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias				14.730	99,02
Excedente de otros activos respecto a los pasivos				147	0,98
Patrimonio				14.877\$	100,00
– Los importes designados como "-" son 0 USD, menos de 1000 USD, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.					
ABREVIATURAS:					
ADR	– recibo de depósito estadounidense				
AUD	– dólar australiano				
CAD	– dólar canadiense				
CHF	– franco suizo				
EUR	– euro				
GBP	– libra esterlina				
HKD	– dólar de Hong Kong				
JPY	– yen japonés				
MXN	– peso mexicano				
SEK	– corona sueca				
TWD	– dólar taiwanés				
Análisis del total de activos					% del total de activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado					98,72
Otros activos					1,28
Total de activos					100,00

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Acciones (en miles)	Valor (en miles) EUR	% del valor neto de los activos	Acciones (en miles)	Valor (en miles) EUR	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias — 93,06 % (28 de febrero de 2023: 93,42%)					
Australia — 4,46 % (28 de febrero de 2023: 5,07%)					
AUD	3.386	Atlas Arteria Ltd	12.317	1,41	
AUD	3.379	Transurban Group	26.692	3,05	
			39.009	4,46	
Brasil — 2,96 % (28 de febrero de 2023: 1,70%)					
BRL	2.031	Centrais Elétricas Brasileiras SA	13.339	1,53	
BRL	3.012	Rumo SA	12.527	1,43	
			25.866	2,96	
Canadá — 5,00 % (28 de febrero de 2023: 8,77%)					
CAD	1.561	Gibson Energy Inc	21.623	2,47	
CAD	771	Pembina Pipeline Corp	22.116	2,53	
			43.739	5,00	
Francia — 6,24 % (28 de febrero de 2023: 6,89%)					
	133	Aéroports de Paris	16.160	1,85	
	2.491	Getlink SE	38.409	4,39	
			54.569	6,24	
Alemania — 2,09 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
	365	Fraport AG Frankfurt Airport Servicios en todo el mundo	18.250	2,09	
Italia — 7,82 % (28 de febrero de 2023: 3,23%)					
	5.868	Enel SpA	36.320	4,16	
	4.208	Terna – Rete Elettrica Nazionale	31.995	3,66	
			68.315	7,82	
Japón — 5,64 % (28 de febrero de 2023: 6,02%)					
JPY	200	East Japan Railway Co	23.642	2,71	
JPY	492	East Japan Railway Co	25.622	2,93	
			49.264	5,64	
Portugal — 3,00% (28 de febrero de 2023: 3,39%)					
	6.238	EDP – Energias de Portugal SA	26.207	3,00	
España — 3,18 % (28 de febrero de 2023: 11,53%)					
	790	Cellnex Telecom SA, 144A	27.839	3,18	
Reino Unido — 7,36 % (28 de febrero de 2023: 10,87%)					
GBP	946	Severn Trent Plc	26.480	3,03	
GBP	950	SSE Plc	18.003	2,06	
GBP	1.800	United Utilities Group Plc	19.878	2,27	
			64.361	7,36	
Estados Unidos — 45,31 % (28 de febrero de 2023: 35,95%)					
USD	130	American Water Works Co Inc	16.573	1,90	
USD	1.301	CenterPoint Energy Inc	33.459	3,83	
USD	146	Cheniere Energy Inc	21.953	2,51	
USD	281	Constellation Energy Corp	27.030	3,09	
USD	1.235	CSX Corp	34.380	3,93	
USD	276	Entergy Corp	24.225	2,77	
USD	1.277	Ferrowial SE	37.349	4,27	
USD	654	NextEra Energy Inc	40.254	4,61	
USD	64	Norfolk Southern Corp	12.026	1,38	
USD	613	OGE Energy Corp	19.242	2,20	
USD	3.170	PG&E Corp	47.632	5,45	
USD	1.476	PPL Corp	33.925	3,88	
Acciones (en miles)					
USD	472	Public Service Enterprise Group Inc	26.610	3,04	
USD	105	Union Pacific Corp	21.446	2,45	
			396.104	45,31	
Total de acciones ordinarias (coste de 849.269 €)					
Fondos de inversión inmobiliaria — 3,90% (28 de febrero de 2023: 3,73%)					
Estados Unidos — 3,90 % (28 de febrero de 2023: 3,73%)					
USD	204	American Tower Corp	34.117	3,90	
Total de fondos de inversión inmobiliaria (coste de 47 412USD)					
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 896.681€)					
Contratos de divisas a plazo — 0,20% (28 de febrero de 2023: 0,18%)					
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)					
1.728					
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias					
849.368					
Contratos de divisas a plazo — 0,03 % (28 de febrero de 2023: 0,10%)					
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)					
(210)					
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias					
(210)					
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias					
849.158					
Excedente de otros activos respecto a los pasivos					
25.052					
Patrimonio					
874.210€					
100,00					
– Los importes designados como “-” son 0 EUR, menos de 1000 EUR, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.					
144A	Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. El 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 27 839 000 \$ o el 3,18 % del patrimonio neto.				
ABREVIATURAS:					
AUD	– dólar australiano				
BRL	– real brasileño				
CAD	– dólar canadiense				
GBP	– libra esterlina				
JPY	– yen japonés				
USD	– Dólar estadounidense				
Análisis del total de activos					
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado					
96,24					
Instrumentos financieros derivados					
0,20					
Otros activos					
3,56					
Total de activos					
100,00					

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Divisa de compra (en miles)	Divisa de venta (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR 1	Venta AUD 1	€ –
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR 1.949	Venta BRL 10.312	31
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR 189	Venta BRL 1.031	(1)
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	GBP 133	Venta EUR 155	–
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	BRL 11.343	Venta EUR 2.161	(51)
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD 30	Venta EUR 28	–
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD 88	Venta EUR 81	1
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR 32	Venta GBP 28	–
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR –	Venta SGD –	–
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR 18	Venta USD 20	–
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR 125	Venta USD 135	–
06-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR 1	Venta SGD 1	–
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR 79	Venta AUD 133	(1)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR 40	Venta CNH 313	–
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR 1.235	Venta CNH 9.801	(8)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	SGD 7	Venta EUR 5	–
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	SGD 6.963	Venta EUR 4.710	41
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	AUD 4.362	Venta EUR 2.591	14
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	CNH 245.347	Venta EUR 30.937	156
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD 450	Venta EUR 416	€ –

^ No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 (continuación)

Listado de contratos de divisas a plazo (continuación)

Fecha de vencimiento	Contraparte	Divisa de compra (en miles)			Divisa de venta (en miles)			Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD	101.952	Venta	EUR	92.682	1.269	
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	CNH	243	Venta	EUR	30	-	
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR	451	Venta	SGD	666	(4)	
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR	4.903	Venta	USD	5.351	(28)	
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR	156	Venta	USD	169	-	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	GBP	185	Venta	AUD	365	(3)	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	CAD	2.968	Venta	AUD	3.410	(13)	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR	982	Venta	AUD	1.666	(14)	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	CAD	96	Venta	AUD	110	-	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	CAD	1.965	Venta	BRL	7.235	(1)	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	CAD	153	Venta	BRL	555	2	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	GBP	118	Venta	BRL	752	(1)	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	GBP	9	Venta	BRL	57	-	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR	50	Venta	BRL	264	1	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR	639	Venta	BRL	3.477	(5)	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	GBP	200	Venta	CAD	345	(2)	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR	1.079	Venta	CAD	1.594	(8)	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	BRL	37	Venta	EUR	7	-	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	GBP	1.182	Venta	EUR	1.382	(3)	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	CAD	19.624	Venta	EUR	13.296	86	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR	74	Venta	GBP	64	-	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	CAD	4.897	Venta	GBP	2.838	28	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR	1.517	Venta	GBP	1.298	4	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	GBP	223	Venta	JPY	41.076	-	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR	1.206	Venta	JPY	189.878	-	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	CAD	3.709	Venta	JPY	395.164	18	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	GBP	1.842	Venta	USD	2.345	(10)	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR	9.953	Venta	USD	10.840	(31)	
26-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	CAD	30.583	Venta	USD	22.559	77	
03-Oct-2023	BNY Mellon	Compra	BRL	8.852	Venta	EUR	1.663	(26)	
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 1.921€)								€	1.728
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: (1058)) €									(210)
Apreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [en miles]: 863€)								€	1.518

^ No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias — 90,11 % (28 de febrero de 2023: 90,92%)					
Australia — 8,73 % (28 de febrero de 2023: 9,91%)					
AUD	2.358	3,75			
AUD	2.455	2,65			
AUD	992	2,33			
	31.874	8,73			
Brasil — 3,25 % (28 de febrero de 2023: 3,91%)					
BRL	2.075	1,43			
BRL	966	1,82			
	11.883	3,25			
Canadá — 8,05 % (28 de febrero de 2023: 10,67%)					
CAD	103	0,99			
CAD	495	2,04			
CAD	350	2,98			
CAD	207	2,04			
	29.416	8,05			
China — 1,66 % (28 de febrero de 2023: 1,17%)					
HKD	2,163	1,66			
Italia — 9,48 % (28 de febrero de 2023: 4,87%)					
EUR	2,419	4,45			
EUR	765	1,19			
EUR	2,720	3,84			
	34.632	9,48			
Japón — 3,70 % (28 de febrero de 2023: 3,51%)					
JPY	312	3,70			
Portugal — 4,77 % (28 de febrero de 2023: 5,27%)					
EUR	3,820	4,77			
España — 5,94 % (28 de febrero de 2023: 11,64%)					
EUR	401	1,88			
EUR	636	2,06			
EUR	450	2,00			
	21.690	5,94			
Reino Unido — 10,52 % (28 de febrero de 2023: 14,11%)					
GBP	1,267	4,33			
GBP	838	1,87			
GBP	83	0,69			
GBP	461	2,60			
GBP	315	1,03			
	38.412	10,52			
Estados Unidos — 34,01 % (28 de febrero de 2023: 25,86%)					
	254	1,94			
	59	1,67			
	222	4,19			
	129	3,37			
EUR	304	2,64			
	186	3,41			
	163	2,22			
	386	3,60			
	248	4,16			
	223	4,14			
	42	2,56			
	12	0,11			
			Acciones preferentes — 1,56% (28 de febrero de 2023: 1,42%)		
			Brasil — 1,56% (28 de febrero de 2023: 1,42%)		
			BRL	724	1,56
			Total de acciones preferentes (coste de 6,1835)		
			5,684 1,56		
			Fondos de inversión inmobiliaria — 5,61% (28 de febrero de 2023: 6,00%)		
			Estados Unidos — 5,61% (28 de febrero de 2023: 6,00%)		
			63	11.442	3,13
			90	9.046	2,48
			20.488 5,61		
			Total de fondos de inversión inmobiliaria (coste de 27 361 USD)		
			20.488 5,61		
			Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste — 392.3285)		
			355.274 97,28		
			Contratos de divisas a plazo — 0,00% (28 de febrero de 2023: 0,01%)		
			Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo) 6 —		
			Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
			355.280 97,28		
			Contratos de divisas a plazo — (0,28 %) (28 de febrero de 2023: 0,55%)		
			Depreciación latente de contratos (véase más abajo) (1.018) (0,28)		
			Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
			(1.018) (0,28)		
			Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
			354.262 97,00		
			Excedente de otros activos respecto a los pasivos		
			10.963 3,00		
			Patrimonio		
			365.225 100,00		
			— Los importes designados como "-" son 0 USD, menos de 1000 USD, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.		
			ABREVIATURAS:		
			AUD	— dólar australiano	
			BRL	— real brasileño	
			CAD	— dólar canadiense	
			EUR	— euro	
			GBP	— libra esterlina	
			HKD	— dólar de Hong Kong	
			JPY	— yen japonés	
			Análisis del total de activos		
			Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado 96,10		
			Instrumentos financieros derivados —		
			Otros activos 3,90		
			Total de activos		
			100,00		

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Divisa de compra (en miles)	Divisa de venta (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)		
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD 6	Venta	SGD 8	USD —
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	SGD 16	Venta	USD 12	—
06-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	SGD 126	Venta	USD 93	—
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD 210	Venta	AUD 325	(1)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD 1	Venta	AUD 1	—
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD 50	Venta	CNH 364	—
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD 218	Venta	EUR 202	(1)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD 1.372	Venta	EUR 1.260	5
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD 218	Venta	GBP 172	(1)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD 243	Venta	GBP 192	—
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD 108	Venta	SGD 145	—
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD 2.864	Venta	SGD 3.885	(13)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	AUD 10.890	Venta	USD 7.120	(60)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR 40.097	Venta	USD 44.116	(604)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	GBP 4.437	Venta	USD 5.651	(29)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR 54	Venta	USD 58	—
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	GBP 175	Venta	USD 222	USD 1

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 (continuación)

Listado de contratos de divisas a plazo (continuación)

Fecha de vencimiento	Contraparte	Divisa de compra (en miles)			Divisa de venta (en miles)			Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	SGD	579	Venta	USD	428	-
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	SGD	79.778	Venta	USD	59.365	(295)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	CNH	11.685	Venta	USD	1.621	(14)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	AUD	2	Venta	USD	2	-
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 24\$)							USD	6
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(2.229))								(1.018)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(2.205))							USD	(1.012)

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Organismos de inversión colectiva — 5,82 % (28 de febrero de 2023: 4,39%)					
39.321 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	39.321	5,82	225 Udemey Inc	2.333	0,35
			58 V2X Inc	2.932	0,43
Total de organismos de inversión colectiva (coste: 39.321\$)	39.321	5,82		34.664	5,13
Acciones ordinarias — 94,79 % (28 de febrero de 2023: 95,04%)			Informática — 1,97% (28 de febrero de 2023: 1,39%)		
Publicidad — 0,02% (28 de febrero de 2023: 0,59%)					
322 Marin Software Inc	148	0,02	616 Conduent Inc	1.926	0,28
Industria aeroespacial y defensa — 4,07% (28 de febrero de 2023: 5,27%)			247 Kyndryl Holdings Inc	4.174	0,62
75 AAR Corp	4.645	0,69	332 SecureWorks Corp	2.282	0,34
248 Astronics Corp	4.348	0,64	118 TTEC Holdings Inc	3.518	0,52
88 Ducommun Inc	4.004	0,59	22 WNS Holdings Ltd ADR	1.422	0,21
73 Kaman Corp	1.632	0,24		13.322	1,97
178 Kratos Defense & Security Solutions Inc	2.864	0,42	Cosmética y cuidado personal — 0,34% (28 de febrero de 2023: 0,30%)		
205 Leonardo DRS Inc	3.516	0,52	16 Inter Parfums Inc	2.279	0,34
65 Mercury Systems Inc	2.571	0,38	Distribución y venta al por mayor — 2,93% (28 de febrero de 2023: 3,30%)		
44 Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	940	0,14	376 Hudson Technologies Inc	4.535	0,67
319 Triumph Group Inc	3.007	0,45	488 Manitex International Inc	2.276	0,34
	27.527	4,07	303 MRC Global Inc	2.824	0,42
Aerolíneas — 0,50% (28 de febrero de 2023: 0,67%)			133 Resideo Technologies Inc	2.245	0,33
52 Alaska Air Group Inc	2.165	0,32	83 VSE Corp	4.691	0,69
14 Allegiant Travel Co	1.226	0,18	20 WESCO International Inc	3.226	0,48
	3.391	0,50		19.797	2,93
Vestimenta — 0,80% (28 de febrero de 2023: 1,12%)			Servicios financieros diversificados — 3,07% (28 de febrero de 2023: 2,13%)		
398 Fossil Group Inc	847	0,12	105 Air Lease Corp 'A'	4.282	0,63
203 Lakeland Industries Inc	2.879	0,43	60 Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	2.315	0,34
95 Rocky Brands Inc	1.690	0,25	100 B Riley Financial Inc	5.125	0,76
	5.416	0,80	CAD 359 Canaccord Genuity Group Inc	2.273	0,34
Fabricantes de automóviles — 0,68% (28 de febrero de 2023: 0,76%)			239 GCM Grosvenor Inc	1.821	0,27
202 Wabash National Corp	4.566	0,68	57 Moelis & Co 'A'	2.716	0,40
Componentes y equipos de automóvil — 2,63% (28 de febrero de 2023: 2,78%)			210 Perella Weinberg Partners 'A'	2.211	0,33
78 Adient Plc	3.046	0,45		20.743	3,07
438 Commercial Vehicle Group Inc	4.033	0,60	Componentes y equipos eléctricos — 1,30% (28 de febrero de 2023: 1,16%)		
153 Dana Inc	2.468	0,37	222 American Superconductor Corp	2.060	0,31
474 Garrett Motion Inc	3.671	0,54	99 Insteel Industries Inc	3.458	0,51
169 Goodyear Tire & Rubber Co/The	2.183	0,32	285 nLight Inc	3.252	0,48
152 Shyft Group Inc/The	2.392	0,35		8.770	1,30
	17.793	2,63	Electrónica — 4,85% (28 de febrero de 2023: 5,34%)		
Bancos — 2,40% (28 de febrero de 2023: 1,67%)			38 Advanced Energy Industries Inc	4.541	0,67
55 BankUnited Inc	1.446	0,21	121 Applied Optoelectronics Inc	1.661	0,25
113 BayCom Corp	2.181	0,32	25 Avnet Inc	1.269	0,19
79 Business First Bancshares Inc	1.608	0,24	157 Benchmark Electronics Inc	4.035	0,60
87 Capstar Financial Holdings Inc	1.141	0,17	51 Coherent Corp	1.926	0,28
50 First Bancshares Inc/The	1.433	0,21	306 Comtech Telecommunications Corp	3.075	0,45
84 Hanmi Financial Corp	1.453	0,21	98 CTS Corp	4.375	0,65
97 Hilltop Holdings Inc	2.941	0,44	315 Identiv Inc	2.605	0,39
89 Seacoast Banking Corp of Florida	2.095	0,31	191 Knowles Corp	3.061	0,45
39 Western Alliance Bancorp	1.930	0,29	230 Stoneridge Inc	4.719	0,70
	16.228	2,40	55 Vishay Intertechnology Inc	1.500	0,22
Biotecnología — 0,38% (28 de febrero de 2023: 0,31%)				32.767	4,85
172 NeoGenomics Inc	2.585	0,38	Energía – Fuentes alternativas — 0,00% (28 de febrero de 2023: 0,34%)		
Materiales de construcción — 2,89% (28 de febrero de 2023: 2,89%)			- TPI Composites Inc	2	-
211 Aspen Aerogels Inc	1.285	0,19	Ingeniería y construcción — 4,12% (28 de febrero de 2023: 3,93%)		
55 Gibraltar Industries Inc	4.088	0,61	22 Arcosa Inc	1.701	0,25
67 Griffon Corp	2.803	0,41	8 Comfort Systems USA Inc	1.532	0,23
122 Modine Manufacturing Co	5.785	0,86	488 Concrete Pumping Holdings Inc	3.728	0,55
336 SmartRent Inc	1.144	0,17	127 Construction Partners Inc 'A'	4.423	0,66
118 Summit Materials Inc 'A'	4.401	0,65	118 Limbach Holdings Inc	4.271	0,63
	19.506	2,89	435 Mistras Group Inc	2.317	0,34
Químicos — 1,61% (28 de febrero de 2023: 1,84%)			635 Orion Group Holdings Inc	3.040	0,45
108 Huntsman Corp	3.018	0,45	138 Primoris Services Corp	4.881	0,72
140 Livent Corp	3.003	0,44	24 Sterling Infrastructure Inc	1.972	0,29
191 Mativ Holdings Inc	3.135	0,46		27.865	4,12
128 Tronox Holdings Plc	1.745	0,26	Entretimiento — 0,32% (28 de febrero de 2023: 0,32%)		
	10.901	1,61	114 IMAX Corp	2.178	0,32
Servicios comerciales — 5,13% (28 de febrero de 2023: 3,90%)			Control ambiental — 0,52% (28 de febrero de 2023: 0,55%)		
218 Acacia Research Corp	834	0,12	253 CECO Environmental Corp	3.482	0,52
47 Adtalem Global Education Inc	2.056	0,30	Alimentación — 0,45% (28 de febrero de 2023: 0,51%)		
366 Arlo Technologies Inc	3.564	0,53	96 Krispy Kreme Inc	1.283	0,19
116 Cross Country Healthcare Inc	2.986	0,44	392 SunOpta Inc	1.725	0,26
97 Evercel Inc	82	0,01		3.008	0,45
346 Healthcare Services Group Inc	3.994	0,59	Acciones ordinarias (continuación)		
22 Herc Holdings Inc	2.875	0,43	Herramientas manuales/mecánicas — 0,53% (28 de febrero de 2023: 0,80%)		
57 Korn Ferry	2.902	0,43	36 Hurco Cos Inc	779	0,11
68 LiveRamp Holdings Inc	2.194	0,33	234 Luxfer Holdings Plc	2.808	0,42
233 Resources Connection Inc	3.606	0,53		3.587	0,53
130 Sterling Check Corp	1.816	0,27	Productos sanitarios - 2,99% (28 de febrero de 2023: 2,02%)		
165 TrueBlue Inc	2.490	0,37	1.004 Accuray Inc	2.868	0,43
			413 Apyx Medical Corp	1.933	0,29
			209 Artivion Inc	3.540	0,52

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 (continuación)

Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
39 Azena Inc	2.207	0,33	Minería — 1,31% (28 de febrero de 2023: 1,17%)		
148 CareDx Inc	1.380	0,20	CAD 424 Capstone Copper Corp	1.972	0,29
286 MiMedx Group Inc	2.119	0,31	34 Century Aluminum Co	254	0,04
125 Tactile Systems Technology Inc	2.374	0,35	690 Ferroglobe Plc	3.683	0,55
194 Varex Imaging Corp	3.809	0,56	CAD 457 Major Drilling Group International Inc	2.932	0,43
	20.230	2,99		8.841	1,31
Servicios sanitarios — 1,34% (28 de febrero de 2023: 1,33%)			Fabricación varios — 1,26% (28 de febrero de 2023: 1,63%)		
376 Community Health Systems Inc	1.270	0,19	17 EnPro Industries Inc	2.369	0,35
304 Qipit Home Medical Corp	1.797	0,27	17 Fabrinet	2.749	0,41
111 RadNet Inc	3.717	0,55	136 Trinity Industries Inc	3.398	0,50
77 Select Medical Holdings Corp	2.249	0,33		8.516	1,26
	9.033	1,34	Equipos de oficina y comerciales — 0,36% (28 de febrero de 2023: 0,00%)		
Constructores de viviendas — 2,75% (28 de febrero de 2023: 2,86%)			152 Xerox Holdings Corp	2.409	0,36
62 Beazer Homes USA Inc	1.813	0,27	Petróleo y gas — 2,74% (28 de febrero de 2023: 2,57%)		
11 Cavco Industries Inc	2.954	0,44	630 Baytex Energy Corp	2.566	0,38
23 Century Communities Inc	1.694	0,25	28 Chesapeake Energy Corp	2.451	0,36
15 MII Homes Inc	1.458	0,21	78 Matador Resources Co	4.950	0,73
59 Skyline Champion Corp	4.233	0,63	100 Northern Oil and Gas Inc	4.195	0,62
60 Taylor Morrison Home Corp 'A'	2.839	0,42	145 Patterson-UTI Energy Inc	2.054	0,31
21 Toll Brothers Inc	1.691	0,25	338 Southwestern Energy Co	2.289	0,34
60 Tri Pointe Homes Inc	1.878	0,28		18.505	2,74
	18.560	2,75	Servicios de petróleo y gas — 3,65% (28 de febrero de 2023: 2,41%)		
Mobiliario doméstico — 0,26% (28 de febrero de 2023: 0,18%)			301 Archrock Inc	3.852	0,57
406 VIA Optronics AG ADR	512	0,08	110 DMC Global Inc	2.640	0,39
215 Vizio Holding Corp	1.235	0,18	427 Mammoth Energy Services Inc	1.980	0,29
	1.747	0,26	420 Matrix Service Co	3.476	0,52
Productos/utensilios del hogar — 0,46% (28 de febrero de 2023: 0,40%)			294 Newport Resources Inc	1.758	0,26
37 Spectrum Brands Holdings Inc	3.085	0,46	210 NOW Inc	2.342	0,35
Seguros — 0,68% (28 de febrero de 2023: 0,33%)			137 ProPetro Holding Corp	1.321	0,20
92 Brighthouse Financial Inc	4.593	0,68	178 Ranger Energy Services Inc	2.120	0,31
Internet — 4,17% (28 de febrero de 2023: 3,78%)			254 Select Water Solutions Inc	2.042	0,30
150 Cars.com Inc	2.809	0,42	298 Solaris Oilfield Infrastructure Inc 'A'	3.132	0,46
661 comScore Inc	463	0,07		24.663	3,65
89 Criteo SA ADR	2.616	0,39	Embalaje y envases — 0,39% (28 de febrero de 2023: 0,47%)		
672 DHI Group Inc	2.525	0,37	100 TriMas Corp	2.632	0,39
585 Entravision Communications Corp	2.236	0,33	Farmacéuticas — 0,61% (28 de febrero de 2023: 0,93%)		
282 EverQuote Inc	1.744	0,26	160 Organon & Co	3.522	0,52
71 IAC Inc	3.911	0,58	999 Societal CDMO Inc	588	0,09
703 Innovid Corp	819	0,12		4.110	0,61
361 LifeMD Inc	1.391	0,21	Capital privado — 0,37% (28 de febrero de 2023: 0,17%)		
355 Magnite Inc	2.929	0,43	211 P10 Inc	2.534	0,37
119 Overstock.com Inc	3.093	0,46	Bienes inmuebles — 0,15% (28 de febrero de 2023: 0,17%)		
365 QuinStreet Inc	3.617	0,53	157 Fathom Holdings Inc	985	0,15
	28.153	4,17	Comercio minorista — 6,19% (28 de febrero de 2023: 7,40%)		
Hierro/Acero — 2,63% (28 de febrero de 2023: 3,20%)			17 Asbury Automotive Group Inc	3.904	0,58
101 ATI Inc	4.557	0,68	586 Barnes & Noble Education Inc	758	0,11
86 Carpenter Technology Corp	5.366	0,80	20 BlueLink Holdings Inc	1.764	0,26
63 Commercial Metals Co	3.540	0,52	178 Caleres Inc	5.093	0,75
88 Haynes International Inc	4.272	0,63	344 Carrols Restaurant Group Inc	2.400	0,36
	17.735	2,63	404 Chico's FAS Inc	2.072	0,31
Alojamiento — 0,58% (28 de febrero de 2023: 0,61%)			327 Designer Brands Inc	3.436	0,51
136 Century Casinos Inc	885	0,13	12 Dillard's Inc	4.242	0,63
200 Marcus Corp/The	3.035	0,45	31 Express Inc	316	0,05
	3.920	0,58	144 J Jill Inc	3.627	0,54
Maquinaria - Construcción y Minería — 1,86% (28 de febrero de 2023: 1,43%)			46 MarineMax Inc	1.520	0,22
65 Argan Inc	2.741	0,40	677 Noodles & Co 'A'	1.878	0,28
691 Babcock & Wilcox Enterprises Inc	3.623	0,54	164 Nordstrom Inc	2.656	0,39
58 BWX Technologies Inc	4.303	0,64	60 OneWater Marine Inc 'A'	1.559	0,23
31 Terex Corp	1.897	0,28	34 Patrick Industries Inc	2.838	0,42
	12.564	1,86	238 Sportsman's Warehouse Holdings Inc	1.145	0,17
Maquinaria - Diversificadas — 1,40% (28 de febrero de 2023: 2,02%)			Acciones ordinarias (continuación)		
130 Ichor Holdings Ltd	4.762	0,71	Minorista — (continuación)		
669 Intevac Inc	2.324	0,34	164 Vera Bradley Inc	1.174	0,17
118 Power Solutions International Inc	361	0,05	76 Victoria's Secret & Co	1.451	0,21
142 Twin Disc Inc	2.046	0,30		41.833	6,19
	9.493	1,40	Ahorro y préstamos — 0,49% (28 de febrero de 2023: 0,52%)		
Medios — 0,42% (28 de febrero de 2023: 0,48%)			48 Axos Financial Inc	2.085	0,31
138 Thryv Holdings Inc	2.807	0,42	102 New York Community Bancorp Inc	1.257	0,18
				3.342	0,49
Fabricación de metal y ferretería — 2,15% (28 de febrero de 2023: 2,27%)			Semiconductores — 5,87% (28 de febrero de 2023: 5,09%)		
47 Helios Technologies Inc	2.720	0,41	125 Alpha & Omega Semiconductor Ltd	3.926	0,58
151 Mayville Engineering Co Inc	1.768	0,26	109 Amkor Technology Inc	3.048	0,45
106 Northwest Pipe Co	3.515	0,52	359 Amtech Systems Inc	3.091	0,46
32 Olympic Steel Inc	1.699	0,25	114 CoHu Inc	4.279	0,63
219 TimkenSteel Corp	4.802	0,71	114 FormFactor Inc	4.040	0,60
	14.504	2,15	107 inTEST Corp	1.869	0,28

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 (continuación)

Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
67 Kulicke & Soffa Industries Inc	3.488	0,52			
30 Onto Innovation Inc	4.237	0,63			
126 Ultra Clean Holdings Inc	4.426	0,65			
182 Veeco Instruments Inc	5.305	0,78			
54 Vishay Precision Group Inc	1.953	0,29			
	39.662	5,87			
Software — 1,87% (28 de febrero de 2023: 1,81%)					
148 ACV Auctions Inc	2.482	0,37			
108 Digi International Inc	3.594	0,53			
13 Everbridge Inc	332	0,05			
151 HireRight Holdings Corp	1.578	0,23			
366 Immersion Corp	2.571	0,38			
332 Viant Technology Inc	2.081	0,31			
	12.638	1,87			
Telecomunicaciones — 3,52% (28 de febrero de 2023: 4,15%)					
179 A10 Networks Inc	2.662	0,39			
272 ADTRAN Holdings Inc	2.325	0,34			
117 Aviat Networks Inc	4.115	0,61			
110 Cambium Networks Corp	1.010	0,15			
67 Clearfield Inc	2.350	0,35			
461 DZS Inc	1.069	0,16			
131 Frequency Electronics Inc	870	0,13			
305 Infinera Corp	1.425	0,21			
269 Ooma Inc	3.786	0,56			
534 PCTEL Inc	2.214	0,33			
513 Ribbon Communications Inc	1.522	0,22			
372 Terran Orbital Corp	452	0,07			
	23.800	3,52			
Transporte — 2,81% (28 de febrero de 2023: 3,64%)					
247 Ardmore Shipping Corp	3.068	0,45			
442 Daseke Inc	2.346	0,35			
60 Hub Group Inc 'A'	4.669	0,69			
241 Navigator Holdings Ltd	3.322	0,49			
357 Radiant Logistics Inc	2.406	0,36			
62 Scorpio Tankers Inc	3.142	0,47			
	18.953	2,81			
Total de acciones ordinarias (coste de 623.415 \$)	640.372	94,79			
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 662.7365)	679.693	100,61			
Contratos de divisas a plazo — 0,01% (28 de febrero de 2023: 0,02%)					
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	94	0,01			
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	679.787	100,62			
Contratos de divisas a plazo — (0,14 %) (28 de febrero de 2023: 0,22%)					

Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(945)	(0,14)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	(945)	(0,14)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	678.842	100,48
Excedente de pasivos respecto a otros activos	(3.303)	(0,48)
Patrimonio	675.539\$	100,00

Los importes designados como "-" son 0 USD, menos de 1000 USD, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.

ABREVIATURAS:

ADR	–	recibo de depósito estadounidense
CAD	–	dólar canadiense

Análisis del total de activos

	% del total de activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	93,96
Organismos de inversión colectiva	5,77
Instrumentos financieros derivados	0,01
Otros activos	0,26
Total de activos	100,00

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Divisa de compra (en miles)	Divisa de venta (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	– Venta AUD	– USD
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	249 Venta BRL	1.243 (2)
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	5.631 Venta BRL	27.558 71
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	18 Venta EUR	16 –
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	7 Venta GBP	5 –
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	145 Venta SGD	196 –
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra EUR	16 Venta USD	19 –
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra EUR	– Venta USD	– –
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra GBP	65 Venta USD	82 –
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra GBP	– Venta USD	– –
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra SGD	7 Venta USD	6 –
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra BRL	28.801 Venta USD	6.071 (260)
06-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	4 Venta SGD	5 –
06-sep.-2023	BNY Mellon	Compra SGD	3 Venta USD	2 –
06-sep.-2023	BNY Mellon	Compra CNH	138 Venta USD	19 –
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	242 Venta AUD	370 2
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	279 Venta AUD	436 (3)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	13 Venta CNH	96 –
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	194 Venta CNH	1.416 (1)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	21 Venta EUR	19 –
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	1.218 Venta EUR	1.113 11
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	8 Venta GBP	6 –
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	376 Venta PLN	1.541 3
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	– Venta SEK	1 –
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	9 Venta SEK	96 –
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	966 Venta SGD	1.300 4
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	1.218 Venta SGD	1.649 USD (3)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra SGD	38.953 Venta USD	28.986 (144)

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 (continuación)

Listado de contratos de divisas a plazo (continuación)

Fecha de vencimiento	Contraparte	Divisa de compra (en miles)			Divisa de venta (en miles)			Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	PLN	23.852	Venta	USD	5.851	(75)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	SEK	855	Venta	USD	80	(2)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	AUD	8.268	Venta	USD	5.405	(45)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	AUD	99	Venta	USD	65	-
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	CNH	388	Venta	USD	53	-
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR	64	Venta	USD	69	-
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	CNH	22.169	Venta	USD	3.075	(27)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR	20.821	Venta	USD	22.907	(313)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	SGD	1.134	Venta	USD	836	3
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	GBP	93	Venta	USD	119	(1)
03-oct.-2023	BNY Mellon	Compra	BRL	27.569	Venta	USD	5.607	(69)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 150\$)							USD	94
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(1.623))								(945)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(1.473))							USD	(851)

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Organismos de inversión colectiva — 2,91 % (28 de febrero de 2023: 3,48%)					
11 ETF iShares Russell 2000 Value – ETF	1.641	1,78	22 Esab Corp	1.622	1,75
1.044 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	1.044	1,13	9 Kadant Inc	1.895	2,05
Total de organismos de inversión colectiva (coste: 2.692\$)	2.685	2,91		3.517	3,80
Acciones ordinarias — 97,35 % (28 de febrero de 2023: 97,23%)			Fabricación de metal y ferretería — 1,49% (28 de febrero de 2023: 0,65%)		
Industria aeroespacial y defensa — 1,68%(28 de febrero de 2023: 1,09%)					
91 Leonardo DRS Inc	1.550	1,68	20 Northwest Pipe Co	677	0,73
Vestimenta — 2,92% (28 de febrero de 2023: 2,41%)			23 Ryerson Holding Corp	702	0,76
13 Carter's Inc	927	1,00		1.379	1,49
38 Steven Madden Ltd	1.318	1,43	Fabricación varios — 5,41%(28 de febrero de 2023: 5,33%)		
57 Wolverine World Wide Inc	458	0,49	11 EnPro Industries Inc	1.465	1,58
	2.703	2,92	5 Fabrinet	855	0,93
Componentes y equipos de automóvil — 3,94%(28 de febrero de 2023: 3,47%)			24 John Bean Technologies Corp	2.680	2,90
62 Gentex Corp	2.020	2,18		5.000	5,41
41 Miller Industries Inc/TN	1.626	1,76	Servicios de petróleo y gas — 1,74% (28 de febrero de 2023: 1,54%)		
	3.646	3,94	CAD 156 Pason Systems Inc	1.612	1,74
Materiales de construcción — 1,86% (28 de febrero de 2023: 2,02%)			Farmacéuticas — 2,23% (28 de febrero de 2023: 3,27%)		
28 Louisiana-Pacific Corp	1.719	1,86	96 Catalyst Pharmaceuticals Inc	1.345	1,46
Químicos — 3,31% (28 de febrero de 2023: 3,48%)			20 Harmony Biosciences Holdings Inc	715	0,77
21 Innospec Inc	2.296	2,49		2.060	2,23
4 Quaker Chemical Corp	760	0,82	Bienes inmuebles — 4,39% (28 de febrero de 2023: 3,88%)		
	3.056	3,31	168 Kennedy-Wilson Holdings Inc	2.680	2,90
Servicios comerciales — 8,63% (28 de febrero de 2023: 7,42%)			41 Marcus & Millichap Inc	1.378	1,49
12 AMN Healthcare Services Inc	1.029	1,11		4.058	4,39
14 Cass Information Systems Inc	546	0,59	Comercio minorista — 1,35% (28 de febrero de 2023: 1,49%)		
22 Computer Task Group Inc	227	0,25	46 Movado Group Inc	1.247	1,35
139 Dun & Bradstreet Holdings Inc	1.510	1,63	Semiconductores — 10,25% (28 de febrero de 2023: 9,18%)		
58 Forrester Research Inc	1.760	1,90	8 Cirrus Logic Inc	668	0,72
47 Korn Ferry	2.411	2,61	16 Cohu Inc	583	0,63
8 RB Global Inc	495	0,54	70 FormFactor Inc	2.460	2,66
	7.978	8,63	26 MKS Instruments Inc	2.556	2,77
Informática — 0,52% (28 de febrero de 2023: 0,00%)			13 Onto Innovation Inc	1.750	1,89
8 Crane NXT Co	484	0,52	41 Vishay Precision Group Inc	1.461	1,58
Cosmética y cuidado personal — 2,26% (28 de febrero de 2023: 2,16%)				9.478	10,25
15 Inter Parfums Inc	2.087	2,26	Software — 0,91% (28 de febrero de 2023: 2,94%)		
Distribución y venta al por mayor — 0,88% (28 de febrero de 2023: 2,20%)			8 Avid Technology Inc	225	0,24
67 Hudson Technologies Inc	811	0,88	14 Simulations Plus Inc	620	0,67
Servicios financieros diversificados — 8,63% (28 de febrero de 2023: 7,55%)				845	0,91
54 Air Lease Corp 'A'	2.213	2,39	Transporte — 1,93% (28 de febrero de 2023: 3,63%)		
52 Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	2.010	2,18	9 Landstar System Inc	1.782	1,93
25 Houlihan Lokey Inc 'A'	2.606	2,82	Total de acciones ordinarias (coste de 83.219 \$)		
33 Lazard Ltd 'A'	1.148	1,24		89.990	97,35
	7.977	8,63	Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 85.911\$)		
Electrónica — 6,79% (28 de febrero de 2023: 5,96%)			Contratos de divisas a plazo — 0,00% (28 de febrero de 2023: 0,00%)		
33 Brady Corp 'A'	1.662	1,80	Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		
26 ESCO Technologies Inc	2.748	2,97		92.675	100,26
62 Kimball Electronics Inc	1.864	2,02	Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
	6.274	6,79		92.675	100,26
Ingeniería y construcción — 2,25% (28 de febrero de 2023: 2,22%)			Contratos de divisas a plazo — 0,00% (28 de febrero de 2023: 0,00%)		
27 Arcosa Inc	2.083	2,25	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		
Control ambiental — 0,39% (28 de febrero de 2023: 0,88%)				(2)	–
8 Heritage-Crystal Clean Inc	358	0,39	Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
Productos sanitarios — 5,25% (28 de febrero de 2023: 5,87%)				(2)	–
31 Bio-Techne Corp	2.424	2,62	Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
31 Enovis Corp	1.756	1,90		92.673	100,26
4 UFP Technologies Inc	669	0,73	Excedente de pasivos respecto a otros activos		
	4.849	5,25		(238)	(0,26)
Constructores de viviendas — 4,13% (28 de febrero de 2023: 3,71%)			Patrimonio		
13 LCI Industries	1.598	1,73		92.435\$	100,00
31 Skyline Champion Corp	2.221	2,40	– Los importes designados como “-” son 0 USD, menos de 1000 USD, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.		
	3.819	4,13	ABREVIATURAS:		
Seguros — 4,64% (28 de febrero de 2023: 4,88%)			ETF – Fondo cotizado		
12 RLI Corp	1.574	1,71	CAD – dólar canadiense		
2 White Mountains Insurance Group Ltd	2.711	2,93	Análisis del total de activos		
	4.285	4,64	Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado		
Internet — 2,93% (28 de febrero de 2023: 2,92%)			Organismos de inversión colectiva		
41 Ziff Davis Inc	2.705	2,93	Otros activos		
Ocio — 1,67% (28 de febrero de 2023: 1,59%)			Total de activos		
20 Brunswick Corp/DE	1.544	1,67		100,00	
Alojamiento — 1,17% (28 de febrero de 2023: 1,99%)					
166 Century Casinos Inc	1.084	1,17			
Maquinaria – Diversificadas — 3,80% (28 de febrero de 2023: 3,50%)					

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023 (continuación)

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Divisa de compra (en miles)			Divisa de venta (en miles)			Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
		Compra	EUR	20	Venta	USD	22	USD	-
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR	20	Venta	USD	22	USD	-
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD	6	Venta	EUR	6		-
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD	12	Venta	SEK	129		-
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD	1	Venta	SEK	14		-
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	SEK	161	Venta	USD	15		(1)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR	92	Venta	USD	101		(1)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	SEK	1	Venta	USD	-		-
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: USD-)									-
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(2))									(2)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(2))									USD (2)

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Organismos de inversión colectiva — 4,05 % (28 de febrero de 2023: 4,24%)					
171 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	171	4,05			
Total de organismos de inversión colectiva (coste: 171\$)	171	4,05			
Acciones ordinarias — 95,97 % (28 de febrero de 2023: 96,21%)					
Australia — 3,88 % (28 de febrero de 2023: 3,53%)					
AUD 25 Hansen Technologies Ltd	89	2,12			
AUD 15 IPH Ltd	75	1,76			
	164	3,88			
Bélgica — 1,01% (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
EUR 2 Azelis Group NV	43	1,01			
Brasil — 1,49 % (28 de febrero de 2023: 1,03%)					
BRL 16 Odontoprev SA	33	0,79			
BRL 5 TOTVS SA	30	0,70			
	63	1,49			
Canadá — 6,11 % (28 de febrero de 2023: 1,16%)					
1 Colliers International Group Inc	91	2,15			
1 FirstService Corp	102	2,42			
1 RB Global Inc	65	1,54			
	258	6,11			
Francia — 0,80 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
EUR 1 Lectra	34	0,80			
Alemania — 1,24 % (28 de febrero de 2023: 1,79%)					
EUR – New Work SE	53	1,24			
Italia — 2,97 % (28 de febrero de 2023: 3,01%)					
EUR 1 Carel Industries SpA, 144A	31	0,74			
EUR – DiaSorin SpA	36	0,85			
EUR 9 GVS SpA, 144A	58	1,38			
	125	2,97			
Japón — 10,30 % (28 de febrero de 2023: 11,67%)					
JPY 1 As One Corp	39	0,93			
JPY 4 BML Inc	82	1,93			
JPY 3 JCU Corp	65	1,53			
JPY 2 Miura Co Ltd	39	0,93			
JPY 1 OBIC Business Consultants Co Ltd	47	1,12			
JPY 3 TKC Corp	81	1,91			
JPY 2 USS Co Ltd	33	0,78			
JPY 2 Zuken Inc	50	1,17			
	436	10,30			
Países Bajos — 2,19 % (28 de febrero de 2023: 2,14%)					
EUR – IMCD NV	43	1,01			
EUR 14 Marel hf, 144A	50	1,18			
	93	2,19			
Polonia — 1,14 % (28 de febrero de 2023: 1,33%)					
PLN 3 Asseco Poland SA	48	1,14			
Corea del Sur — 1,46 % (28 de febrero de 2023: 1,99%)					
KRW 8 NICE Information Service Co Ltd	62	1,46			
Suecia — 1,09 % (28 de febrero de 2023: 1,07%)					
SEK 11 Karnov Group AB	46	1,09			
Suiza — 1,83 % (28 de febrero de 2023: 1,79%)					
CHF – Kardex Holding AG	32	0,76			
CHF – VZ Holding AG	45	1,07			
	77	1,83			
Reino Unido — 13,21 % (28 de febrero de 2023: 12,45%)					
GBP 7 Auction Technology Group Plc	63	1,49			
GBP 1 Croda International Plc	41	0,96			
GBP 1 Diploma Plc	57	1,34			
GBP 6 DiscoverIE Group Plc	60	1,42			
GBP 1 Intertek Group Plc	43	1,01			
GBP 71 Learning Technologies Group Plc	69	1,62			
GBP 10 Marlowe Plc	78	1,85			
GBP 26 Restore Plc	58	1,38			
GBP – Spirax-Sarco Engineering Plc	49	1,17			
GBP 2 Victrex Plc	41	0,97			
	559	13,21			
Estados Unidos — 46,24 % (28 de febrero de 2023: 52,24%)					
1 Arcosa Inc	75	1,78			
1 Avid Technology Inc	17	0,40			
1 Brunswick Corp/DE	69	1,64			
1 Cognex Corp	39	0,92			
1 Dorman Products Inc	70	1,66			
1 Enovis Corp	46	1,09			
– EnPro Industries Inc	22	0,52			
1 Esab Corp	43	1,02			
1 ESCO Technologies Inc	62	1,48			
			2 FormFactor Inc	75	1,79
			2 Forrester Research Inc	53	1,24
			– Fox Factory Holding Corp	34	0,80
			1 Gentex Corp	49	1,15
			1 Haemonetics Corp	77	1,83
			– Houlihan Lokey Inc 'A'	39	0,92
			1 Innospec Inc	72	1,70
			– Inter Parfums Inc	63	1,49
			1 John Bean Technologies Corp	65	1,53
			– Kadant Inc	76	1,79
			5 Kennedy-Wilson Holdings Inc	79	1,86
			– Landstar System Inc	56	1,31
			– LCI Industries	62	1,47
			– Lincoln Electric Holdings Inc	70	1,65
			– Littelfuse Inc	42	0,98
			1 LKQ Corp	28	0,67
			1 Marcus & Millichap Inc	23	0,54
			1 MKS Instruments Inc	90	2,14
			– Quaker Chemical Corp	77	1,83
			– Ralph Lauren Corp 'A'	54	1,27
			– Rogers Corp	43	1,03
			1 SEI Investments Co	72	1,70
			1 UFP Industries Inc	86	2,03
			– Valmont Industries Inc	55	1,31
			1 Ziff Davis Inc	72	1,70
				1.955	46,24
			Vietnam — 1,01 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)		
			GBP 2 XP Power Ltd	43	1,01
			Total de acciones ordinarias (coste de 4.450 \$)	4.059	95,97
			Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	4.230	100,02
			Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	4.230	100,02
			Excedente de pasivos respecto a otros activos	(1)	(0,02)
			Patrimonio	4.229\$	100,00
			– Los importes designados como “-” son 0 USD, menos de 1000 USD, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.		
			144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. El 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 139 000 \$ o el 3,30 % del patrimonio neto.		
			ABREVIATURAS:		
			AUD	– dólar australiano	
			BRL	– real brasileño	
			CHF	– franco suizo	
			EUR	– euro	
			GBP	– libra esterlina	
			JPY	– yen japonés	
			KRW	– won surcoreano	
			PLN	– esloti polaco	
			SEK	– corona sueca	
			Análisis del total de activos		
			Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado		
					95,46
			Organismos de inversión colectiva		
					4,02
			Otros activos		
					0,52
			Total de activos		
					100,00

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^]_μ

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Acciones (en miles)	Valor (en miles) EUR
Acciones ordinarias — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)	
Rusia — 0,00% (28 de febrero de 2023: 0,00%)	
54 GBP Evraz Plc †	-
Total de acciones ordinarias (coste 313 EUR)	-
Excedente de pasivos respecto a otros activos	-
Patrimonio	€-

- Los importes designados como "-" son 0 EUR, menos de 1000 EUR, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.

† Poca liquidez.

μ El 11 de julio de 2022, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] dejó de cotizar en bolsa.

ABREVIATURAS:

GBP - libra esterlina

Análisis del total de activos	% del total de activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	-
Otros activos	100,00
Total de activos	100,00

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund[^]F

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD
Acciones ordinarias — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)	
Grecia — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)	
1 EUR FF Group †	—
Hong Kong — 0,00% (28 de febrero de 2023: 0,00%)	
38 HKD Hanergy Mobile Energy Holding Group Co Ltd †	—
Total de acciones ordinarias (coste 44 USD)	—
Excedente de pasivos respecto a otros activos	—
Patrimonio	— USD

— Los importes designados como "—" son 0 USD, menos de 1000 USD, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.

† Poca liquidez.

F El 14 de abril de 2021, Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund dejó de cotizar en bolsa.

ABREVIATURAS:

EUR — euro

HKD — dólar de Hong Kong

Análisis del total de activos	% del total de activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	—
Otros activos	100,00
Total de activos	100,00

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^Ω

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD
Acciones ordinarias — 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)	
Rusia — 0,00% (28 de febrero de 2023: 0,00%)	
8 Gazprom PJSC ADR †	-
Total de acciones ordinarias (coste 54 USD)	-
Excedente de pasivos respecto a otros activos	-
Patrimonio	- USD

- Los importes designados como "-" son 0 USD, menos de 1000 USD, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.

† Poca liquidez.

Ω A fecha efectiva del 27 de abril de 2022, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^Ω dejó de cotizar en bolsa.

ABREVIATURAS:

ADR - recibo de depósito estadounidense

Análisis del total de activos	% del total de activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	-
Otros activos	100,00
Total de activos	100,00

^Ω No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

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

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Organismos de inversión colectiva — 0,38 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
573 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	573	0,38	25 ResMed Inc	4.023	2,67
			19 Veeva Systems Inc 'A'	3.986	2,65
			24 Zoetis Inc	4.494	2,98
Total de organismos de inversión colectiva (coste: 573\$)	573	0,38		83.517	55,47
Acciones ordinarias — 100,75 % (28 de febrero de 2023: 101,05%)			Total de acciones ordinarias (coste de 155.254 \$)		
China — 2,11% (28 de febrero de 2023: 3,03%)			Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 155.827\$)		
HKD 564 Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	3.181	2,11		152.269	101,13
Dinamarca — 2,98 % (28 de febrero de 2023: 3,50%)			Contratos de divisas a plazo — 0,02% (28 de febrero de 2023: 0,03%)		
DKK 39 Coloplast A/S	4.489	2,98	Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		
Francia — 8,82 % (28 de febrero de 2023: 10,14%)					
EUR 6 Kering SA	3.264	2,17	Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
EUR 14 L'Oreal SA	6.236	4,14	152.302 101,15		
EUR 19 Pernod Ricard SA	3.778	2,51	Contratos de divisas a plazo — 0,98 % (28 de febrero de 2023: 1,01%)		
	13.278	8,82	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		
Irlanda — 4,16 % (28 de febrero de 2023: 5,88%)					
EUR 74 Kingspan Group Plc	6.271	4,16	Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
Italia — 8,95 % (28 de febrero de 2023: 8,65%)					
EUR 21 Ferrari NV	6.669	4,43	150.823 100,17		
EUR 100 Moncler SpA	6.803	4,52	Excedente de pasivos respecto a otros activos		
	13.472	8,95	(250) (0,17)		
Países Bajos — 6,99 % (28 de febrero de 2023: 5,90%)			Patrimonio		
EUR 3 Adyen NV, 144A	2.322	1,54	150.573\$ 100,00		
EUR 12 ASML Holding NV	8.205	5,45			
	10.527	6,99			
Suecia — 8,27 % (28 de febrero de 2023: 9,97%)					
SEK 159 Assa Abloy AB	3.583	2,38			
SEK 421 Atlas Copco AB	5.567	3,70			
SEK 369 Hexagon AB	3.296	2,19			
	12.446	8,27			
Reino Unido — 3,00 % (28 de febrero de 2023: 7,55%)					
GBP 65 Croda International Plc	4.515	3,00			
Estados Unidos — 55,47 % (28 de febrero de 2023: 43,39%)					
AUD 9 Adobe Inc	5.126	3,40			
13 ANSYS Inc	4.282	2,84			
16 Autodesk Inc	3.577	2,38			
27 CSL Ltd	4.845	3,22			
24 Estee Lauder Cos., Inc. (The) 'A'	3.780	2,51			
13 Illumina Inc	2.107	1,40			
20 Linde Plc	7.553	5,02			
24 Masimo Corp	2.736	1,82			
14 Mastercard Inc	5.917	3,93			
4 Mettler-Toledo International Inc	4.449	2,96			
26 Microsoft Corp	8.379	5,56			
35 NIKE Inc	3.517	2,34			
30 NVIDIA Corp	14.746	9,79			

Los importes designados como "-" son 0 USD, menos de 1000 USD, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.					
144A	Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. El 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 5 503 000 \$ o el 3,65 % del patrimonio neto.				

ABREVIATURAS:

AUD	– dólar australiano
DKK	– corona danesa
EUR	– euro
GBP	– libra esterlina
HKD	– dólar de Hong Kong
SEK	– corona sueca

Análisis del total de activos

	% del total de activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	99,44
Organismos de inversión colectiva	0,38
Instrumentos financieros derivados	0,02
Otros activos	0,16
Total de activos	100,00

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)	Moneda de venta (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	Venta EUR 27	USD –
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra EUR	Venta USD 27	USD –
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	Venta EUR 1.227	EUR (6)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	Venta EUR 5.576	EUR 30
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	Venta GBP 238	GBP 2
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra USD	Venta GBP 25	GBP –
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra EUR	Venta USD 99.726	USD (1.461)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra EUR	Venta USD 1.706	USD 1
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra GBP	Venta USD 1.892	USD (12)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra GBP	Venta USD 63	USD –
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 41\$)				USD 33
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(1.422))				(1.479)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(1.381))				USD (1.446)

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias — 57,23 % (28 de febrero de 2023: 56,65%)			Total de fondos de inversión inmobiliaria (coste de 10 338 USD)		
Australia — 14,62 % (28 de febrero de 2023: 13,13%)			Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 23.141\$)		
AUD	107	3,73	20.210 98,60		
AUD	73	2,07	Contratos de divisas a plazo — 0,00% (28 de febrero de 2023: 0,00%)		
AUD	583	6,69	Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		
AUD	51	2,13	Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
	2.996	14,62	20.210 98,60		
China — 12,04 % (28 de febrero de 2023: 13,32%)			Contratos de divisas a plazo — (0,01 %) (28 de febrero de 2023: 0,07%)		
HKD	386	2,26	Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		
HKD	1,996	0,95	Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
HKD	1,588	6,04	(1) (0,01)		
HKD	1,106	2,79	Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
	2.467	12,04	20.209 98,59		
Hong Kong — 4,28% (28 de febrero de 2023: 5,49%)			Excedente de otros activos respecto a los pasivos		
HKD	90	3,42	288 1,41		
HKD	42	0,86	Patrimonio		
	876	4,28	20.497\$ 100,00		
India — 7,89 % (28 de febrero de 2023: 7,70%)			— Los importes designados como "-" son 0 USD, menos de 1000 USD, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.		
INR	242	2,49	144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. El 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 194 000 \$ o el 0,95 % del patrimonio neto.		
INR	242	0,72	ABREVIATURAS:		
INR	324	4,68	AUD — dólar australiano		
	1.618	7,89	HKD — dólar de Hong Kong		
Malasia — 2,52% (28 de febrero de 2023: 2,57%)			INR — rupia india		
MYR	50	0,89	MYR — ringgit malasio		
MYR	442	1,63	NZD — dólar neozelandés		
	517	2,52	PHP — peso filipino		
Nueva Zelanda — 5,32% (28 de febrero de 2023: 5,98%)			SGD — dólar de Singapur		
NZD	186	4,37	THB — baht tailandés		
NZD	39	0,95			
	1.091	5,32			
Filipinas — 1,84% (28 de febrero de 2023: 1,10%)			Análisis del total de activos		
PHP	62	1,84	Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado		
Singapur — 5,51 % (28 de febrero de 2023: 4,14%)			Otros activos		
SGD	772	3,22	Total de activos		
SGD	736	2,29	100,00		
	1.129	5,51			
Tailandia — 3,21% (28 de febrero de 2023: 3,22%)					
THB	2,427	3,21			
Total de acciones ordinarias (coste de 12.803 \$)					
	11.730	57,23			
Fondos de inversión inmobiliaria — 41,37% (28 de febrero de 2023: 42,58%)					
Australia — 19,28 % (28 de febrero de 2023: 20,53%)					
AUD	63	0,70			
AUD	420	4,60			
AUD	138	1,82			
AUD	97	0,66			
AUD	680	5,87			
AUD	155	2,08			
AUD	604	3,55			
	3.951	19,28			
Hong Kong — 9,87% (28 de febrero de 2023: 8,91%)					
HKD	1,097	3,32			
HKD	271	6,55			
	2.023	9,87			
India — 5,23 % (28 de febrero de 2023: 4,22%)					
INR	292	5,23			
Nueva Zelanda — 1,94% (28 de febrero de 2023: 2,04%)					
NZD	750	1,94			
Singapur — 5,05 % (28 de febrero de 2023: 6,88%)					
SGD	249	1,71			
SGD	106	0,86			
SGD	298	2,48			
	1.035	5,05			

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Moneda de compra (en miles)	Moneda de venta (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles) (en miles)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD	1
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD	2
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	CNH	—
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD	—
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD	10
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD	3
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	SGD	8
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	SGD	312
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	CNH	—
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	CNH	7
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	AUD	1
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	AUD	34
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 1 USD)				USD
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: \$(19))				(1)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): \$(18))				(1)

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Organismos de inversión colectiva — 0,73 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)			Excedente de pasivos respecto a otros activos		
241 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	241	0,73	Patrimonio		
Total de organismos de inversión colectiva (coste: 2415)			32.965\$ 100,00		
Acciones ordinarias — 99,62 % (28 de febrero de 2023: 99,55%)			– Los importes designados como “-” son 0 USD, menos de 1000 USD, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.		
Brasil — 6,45 % (28 de febrero de 2023: 6,02%)			144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. El 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 1 200 000 \$ o el 3,64 % del patrimonio neto.		
BRL 206 B3 SA – Brasil Bolsa Balcao	539	1,63	ABREVIATURAS:		
BRL 176 Cosan SA	624	1,89	ADR	– recibo de depósito estadounidense	
BRL 124 Odontoprev SA	258	0,78	BRL	– real brasileño	
BRL 98 WEG SA	707	2,15	CNH	– renminbi chino	
	2.128	6,45	GBP	– libra esterlina	
Chile — 2,05 % (28 de febrero de 2023: 2,16%)			HKD	– dólar de Hong Kong	
GBP 37 Antofagasta Plc	674	2,05	IDR	– rupia indonesia	
China — 25,56 % (28 de febrero de 2023: 28,67%)			INR	– rupia india	
HKD 55 Alibaba Group Holding Ltd	644	1,95	KRW	– won surcoreano	
HKD 7 Alibaba Group Holding Ltd ADR	609	1,85	MXN	– peso mexicano	
HKD 123 China Merchants Bank Co Ltd	487	1,48	PHP	– peso filipino	
CNH 18 Contemporary Amperex Technology Co Ltd	575	1,74	SAR	– riyal saudí	
HKD 28 ENN Energy Holdings Ltd	221	0,67	TWD	– dólar taiwanés	
HKD 4 JD.com Inc	61	0,19	ZAR	– Rand sudafricano	
HKD 11 JD.com Inc ADR	356	1,08			
HKD 44 Meituan ‘B’, 144A	735	2,23	Análisis del total de activos		
HKD 112 Minth Group Ltd	332	1,01	Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado		
CNH 189 Ping An Bank Co Ltd	289	0,88	Organismos de inversión colectiva		
HKD 115 Ping An Insurance Group Co of China Ltd	688	2,09	Otros activos		
HKD 116 Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	273	0,83	Total de activos		
CNH 34 Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	319	0,97	99,06		
HKD 50 Tencent Holdings Ltd	2.055	6,23	0,73		
HKD 83 Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	465	1,41	0,21		
CNH 26 Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	106	0,32	100,00		
HKD 250 Xinyi Solar Holdings Ltd	209	0,63			
	8.424	25,56			
Hong Kong — 2,44 % (28 de febrero de 2023: 2,94%)					
HKD 89 AIA Group Ltd	805	2,44			
India — 18,75 % (28 de febrero de 2023: 17,02%)					
INR 12 Asian Paints Ltd	457	1,38			
INR 69 HDFC Bank Ltd	1.319	4,00			
INR 86 ICICI Bank Ltd	997	3,02			
INR 25 Kotak Mahindra Bank Ltd	539	1,64			
INR 4 Maruti Suzuki India Ltd	534	1,62			
INR 32 Reliance Industries Ltd	928	2,82			
INR 26 Titan Co Ltd	995	3,02			
INR 4 UltraTech Cement Ltd	412	1,25			
	6.181	18,75			
Indonesia — 4,18 % (28 de febrero de 2023: 3,54%)					
IDR 476 Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	287	0,87			
IDR 2,039 Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	741	2,25			
IDR 1,436 Telkom Indonesia Persero Tbk PT	350	1,06			
	1.378	4,18			
México — 4,55 % (28 de febrero de 2023: 4,57%)					
MXN 75 Grupo Financiero Banorte SAB de CV	637	1,93			
MXN 122 Orbia Advance Corp SAB de CV	272	0,83			
MXN 150 Wal-Mart de México SAB de CV	590	1,79			
	1.499	4,55			
Perú — 1,24 % (28 de febrero de 2023: 1,15%)					
3 Credicorp Ltd	408	1,24			
Filipinas — 0,39 % (28 de febrero de 2023: 0,43%)					
PHP 148 Robinsons Retail Holdings Inc	129	0,39			
Arabia Saudita — 2,32 % (28 de febrero de 2023: 1,78%)					
SAR 31 Al Rajhi Bank	589	1,79			
SAR 3 Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co	175	0,53			
	764	2,32			
Singapur — 0,29 % (28 de febrero de 2023: 0,47%)					
3 Sea Ltd ADR	97	0,29			
Sudáfrica — 0,70 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
ZAR 3 Capitec Bank Holdings Ltd	232	0,70			
Corea del Sur — 16,30 % (28 de febrero de 2023: 15,91%)					
KRW 1 LG Chem Ltd	586	1,78			
KRW – LG Energy Solution Ltd	116	0,35			
KRW – LG H&H Co Ltd	100	0,30			
KRW 2 NAVER Corp	303	0,92			
KRW 53 Samsung Electronics Co Ltd	2.690	8,16			
KRW 1 Samsung SDI Co Ltd	424	1,29			
KRW 13 SK Hynix Inc	1.154	3,50			
	5.373	16,30			
Taiwán — 12,54 % (28 de febrero de 2023: 12,47%)					
TWD 54 Delta Electronics Inc	584	1,77			
TWD 34 Globalwafers Co Ltd	489	1,48			
TWD 178 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	3.062	9,29			
	4.135	12,54			
Estados Unidos — 1,86 % (28 de febrero de 2023: 2,42%)					
1 EPAM Systems Inc	243	0,73			
2 Globant SA	371	1,13			
	614	1,86			
Total de acciones ordinarias (coste de 40.294 \$)			32.841 99,62		
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias			33.082 100,35		
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias			33.082 100,35		

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Acciones (en miles)	Valor (en miles) EUR	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias — 99,55 % (28 de febrero de 2023: 99,83%)		
Dinamarca — 3,65 % (28 de febrero de 2023: 3,76%)		
DKK 66 Coloplast A/S	6.870	3,65
Francia — 21,32 % (28 de febrero de 2023: 21,05%)		
211 Dassault Systemes SE	7.728	4,10
16 Kering SA	7.822	4,15
25 L'Oreal SA	10.129	5,38
30 Pernod Ricard SA	5.434	2,89
35 Sartorius Stedim Biotech	9.035	4,80
	40.148	21,32
Alemania — 6,10 % (28 de febrero de 2023: 7,65%)		
138 Infineon Technologies AG	4.566	2,42
109 Nemetschek SE	6.920	3,68
	11.486	6,10
Irlanda — 5,05 % (28 de febrero de 2023: 6,83%)		
122 Kingspan Group Plc	9.514	5,05
Italia — 17,15 % (28 de febrero de 2023: 15,71%)		
64 Ferrari NV	18.807	9,99
216 Moncler SpA	13.494	7,16
	32.301	17,15
Países Bajos — 13,76 % (28 de febrero de 2023: 8,94%)		
4 Adyen NV, 144A	3.197	1,70
29 ASML Holding NV	17.719	9,41
47 BE Semiconductor Industries NV	5.001	2,65
	25.917	13,76
Suecia — 12,57 % (28 de febrero de 2023: 13,48%)		
SEK 397 Assa Abloy AB	8.243	4,38
SEK 733 Atlas Copco AB	8.930	4,74
SEK 789 Hexagon AB	6.499	3,45
	23.672	12,57
Suiza — 3,77 % (28 de febrero de 2023: 3,36%)		
CHF 7 Partners Group Holding AG	7.101	3,77
Reino Unido — 6,28 % (28 de febrero de 2023: 12,44%)		
GBP 111 Croda International Plc	7.132	3,79
GBP 1,684 Oxford Nanopore Technologies Plc	4.680	2,49
	11.812	6,28
Estados Unidos — 9,90 % (28 de febrero de 2023: 6,61%)		
USD 28 Linde Plc	9.938	5,28
USD 8 Mettler-Toledo International Inc	8.705	4,62
	18.643	9,90
Total de acciones ordinarias (coste de 207.873 €)	187.464	99,55
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 207.873€)	187.464	99,55
Contratos de divisas a plazo — 0,01% (28 de febrero de 2023: 0,01%)		
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	11	0,01
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	187.475	99,56
Contratos de divisas a plazo — (0,02 %) (28 de febrero de 2023: 0,01%)		
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(28)	(0,02)

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Divisa de compra (en miles)	Divisa de venta (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR 682	Venta BRL 3.612	€ 10
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR 77	Venta BRL 414	–
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	BRL 3.903	Venta EUR 744	(18)
05-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	BRL 122	Venta EUR 23	–
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD 59	Venta EUR 52	1
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD –	Venta EUR –	–
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR 3	Venta USD 3	–
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR –	Venta USD 1	–
03-oct.-2023	BNY Mellon	Compra	BRL 3.615	Venta EUR 679	(10)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: 22€)				€	11
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 [miles]: (20)) €				€	(28)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 2€)				€	(17)

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Acciones (en miles)	Valor (en miles) EUR	% del valor neto de los activos
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	(28)	(0,02)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	187.447	99,54
Excedente de otros activos respecto a los pasivos	872	0,46
Patrimonio	188.319€	100,00

– Los importes designados como “-” son 0 EUR, menos de 1000 EUR, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.

144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. El 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 3 197 000 \$ o el 1,70 % del patrimonio neto.

ABREVIATURAS:

CHF	– franco suizo
DKK	– corona danesa
GBP	– libra esterlina
SEK	– corona sueca
USD	– Dólar estadounidense

Análisis del total de activos

	% del total de activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	99,47
Instrumentos financieros derivados	0,01
Otros activos	0,52
Total de activos	100,00

FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^]

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos	Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias — 94,92%			Contratos de divisas a plazo — (0,04%)		
Brasil — 4,84 %			Depreciación latente de contratos (véase más abajo) (2) (0,04)		
— MercadoLibre Inc	231	4,84	Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (2) (0,04)		
Dinamarca — 4,60 %			Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias 4.522 94,88		
DKK 5 Novozymes A/S	219	4,60	Excedente de otros activos respecto a los pasivos 244 5,12		
Francia — 4,92%			Patrimonio 4.766\$ 100,00		
EUR 8 Veolia Environnement SA	234	4,92	— Los importes designados como "-" son 0 USD, menos de 1000 USD, menos de 1000 acciones o menos del 0,01 %.		
India — 5,80 %			144A Valores exentos de registro bajo la Norma 144A de la Ley de Valores (Securities Act) de 1933, según modificaciones. Estos valores solo podrán revenderse, en operaciones exentas de registro, a compradores institucionales cualificados. El 31 de agosto de 2023, estos títulos sumaban 206.000 \$ o el 4,31 % del patrimonio neto.		
4 HDFC Bank Ltd ADR	276	5,80	ABREVIATURAS:		
Indonesia — 3,05 %			ADR — recibo de depósito estadounidense		
IDR 400 Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	145	3,05	DKK — corona danesa		
Italia — 4,28%			EUR — euro		
EUR 6 Amplifon SpA	204	4,28	GBP — libra esterlina		
Nigeria — 4,31 %			IDR — rupia indonesia		
GBP 142 Airtel Africa Plc, 144A	206	4,31	SEK — corona sueca		
Suecia — 1,20%					
SEK 2 MIPS AB	57	1,20			
Reino Unido — 9,60%					
GBP 4 Croda International Plc	249	5,22			
GBP 6 FDM Group Holdings Plc	41	0,87			
GBP 13 Mears Group Plc	47	0,97			
GBP 12 Vistry Group Plc	121	2,54			
	458	9,60			
Estados Unidos — 52,32%					
5 Coursera Inc	84	1,75			
1 Deere & Co	215	4,51			
1 Ecolab Inc	236	4,95			
3 Energy Recovery Inc	88	1,84			
2 Everbridge Inc	54	1,13			
1 Illumina Inc	201	4,22			
1 Intuitive Surgical Inc	300	6,29			
1 Masimo Corp	152	3,20			
1 Planet Fitness Inc 'A'	74	1,55			
2 Revvity Inc	246	5,17			
1 Stride Inc	56	1,17			
1 Valmont Industries Inc	237	4,97			
1 Veeva Systems Inc 'A'	209	4,38			
4 Verra Mobility Corp 'A'	64	1,35			
3 Xylem Inc/NY	278	5,84			
	2.494	52,32			
Total de acciones ordinarias (coste de 4.765 \$) 4.524 94,92					
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste: 4.765\$) 4.524 94,92					
Contratos de divisas a plazo — 0,00%					
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo) — —					
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias 4.524 94,92					

Calendario de contratos de divisas a plazo

Fecha de vencimiento	Contraparte	Divisa de compra (en miles)			Divisa de venta (en miles)			Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)	
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD	5	Venta	EUR	4	USD	—
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	USD	4	Venta	GBP	4	—	—
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	GBP	76	Venta	USD	97	(1)	(1)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	EUR	91	Venta	USD	100	(1)	(1)
15-sep.-2023	BNY Mellon	Compra	GBP	2	Venta	USD	2	—	—
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo								USD	—
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo								—	(2)
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo								USD	(2)

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Franklin Responsible Income 2028 Fund

Cartera de inversiones al 31 de agosto de 2023

Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) EUR	% del valor neto de los activos	Valor nominal (en miles)	Valor (en miles) EUR	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos — 96,47% (28 de febrero de 2023: 92,33%)					
Australia — 1,44 % (28 de febrero de 2023: 1,34%)					
1.500 Macquarie Group Ltd, 0,350%, due 03/03/2028	1.264	1,44	1.400 Tele2 AB, 2,125%, con vencimiento el 15/05/2028	1.298	1,48
Bélgica — 2,43% (28 de febrero de 2023: 2,19%)					
900 Azelis Finance NV, 5,750 %, con vencimiento el 15/03/2028	919	1,04	500 Verisure Holding AB, 9,250 %, con vencimiento el 15/10/2027	534	0,61
1.200 Crelan SA, 5,750 %, con vencimiento el 26/01/2028	1.218	1,39	900 Volvo Car AB, 4,250%, con vencimiento el 31/05/2028	863	0,98
	2.137	2,43		5.242	5,97
China — 1,31 % (28 de febrero de 2023: 1,32%)					
1.400 —BRF NV, 1,539%, con vencimiento 03/08/2028	1.152	1,31	Suiza — 2,93 % (28 de febrero de 2023: 2,49%)		
República Checa — 1,41 % (28 de febrero de 2023: 1,77%)					
1.300 CEZ AS, 3,000 %, con vencimiento al 05/06/2028	1.234	1,41	1.400 Cloverie Plc para Zurich Insurance Co Ltd, 1,500%, con vencimiento el 15/12/2028	1.269	1,45
Dinamarca — 2,65 % (28 de febrero de 2023: 1,57%)					
1.400 H Lundbeck A/S, 0,875%, con vencimiento el 14/10/2027	1.227	1,40	1.300 UBS Group AG, 4,625%, con vencimiento el 17/03/2028 *	1.303	1,48
1.300 Nykredit Realkredit AS, 0,375 %, con vencimiento el 17/01/2028	1.100	1,25		2.572	2,93
	2.327	2,65	Reino Unido — 12,62 % (28 de febrero de 2023: 14,60%)		
Finlandia — 1,44% (28 de febrero de 2023: 1,55%)					
1.500 OP Corporate Bank plc, 0,375 %, con vencimiento al 16/06/2028	1.268	1,44	1.500 Barclays Plc, 0,877 %, con vencimiento al 28/01/2028 *	1.331	1,52
Francia — 18,61 % (28 de febrero de 2023: 16,09%)					
600 Adevinta ASA, 3,000%, con vencimiento el 15/11/2027	565	0,64	1.300 easyJet FinCo BV, 1,875 %, con vencimiento al 03/03/2028	1.155	1,32
500 Altice France SA/France, 3,375 %, con vencimiento 15/01/2028	354	0,40	1.200 HSBC Holdings Plc, 4,752%, con vencimiento el 10/03/2028 *	1.210	1,38
1.500 BNP Paribas SA, 0,500%, con vencimiento el 19/02/2028 *	1.317	1,50	1.500 Motability Operations Group Plc, 0,125%, con vencimiento el 20/07/2028	1.263	1,44
1.200 BPCE SA, 4,375 %, con vencimiento al 13/07/2028	1.202	1,37	1.500 National Grid Plc, 0,163 %, con vencimiento al 20/01/2028	1.276	1,45
600 CAB SELAS, 3,375%, con vencimiento el 01/02/2028	512	0,58	1.500 Nationwide Building Society, 0,250 %, con vencimiento al 14/09/2028	1.251	1,42
1.400 Credit Agricole SA, 0,375 %, con vencimiento el 20/04/2028	1.190	1,36	1.200 NatWest Markets Plc, 4,250 %, con vencimiento al 13/01/2028	1.202	1,37
1.200 Engie SA, 1,750 %, con vencimiento al 27/03/2028	1.108	1,26	1.300 Sage Group Plc/The, 3,820 %, con vencimiento 15/02/2028	1.301	1,48
1.400 Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1,625%, con vencimiento el 27/11/2027	1.267	1,44	800 Santander UK Group Holdings Plc, 3,530 %, con vencimiento al 25/08/2028 *	767	0,87
320 KOC Holding SASU, 5,625 %, con vencimiento al 15/10/2028	303	0,35	400 Victoria Plc, 3,625 %, con vencimiento 24/08/2026	325	0,37
300 Iliad SA, 1,875 %, con vencimiento al 11/02/2028	258	0,30		11.081	12,62
1.300 La Banque Postale SA, 1,000 %, con vencimiento al 09/02/2028 *	1.155	1,32	Estados Unidos — 15,49 % (28 de febrero de 2023: 14,75%)		
1.300 Orano SA, 2,750 %, con vencimiento al 08/03/2028	1.197	1,37	600 Avantor Funding Inc, 3,875 %, con vencimiento al 15/07/2028	554	0,63
1.200 RCI Banque SA, 4,875 %, con vencimiento al 21/09/2028	1.214	1,38	640 S&P Global Inc, 1,500 %, con vencimiento al 15/01/2027	582	0,66
900 Rexel SA, 2,125 %, con vencimiento al 15/12/2028	800	0,91	1.000 Crown European Holdings SA, 5,000%, con vencimiento el 15/05/2028	1.007	1,15
400 EIFFAGE SA, 0,950 %, con vencimiento al 19/10/2028	344	0,39	1.400 DXC Capital Funding DAC, 0,450 %, con vencimiento al 15/09/2027	1.172	1,33
1.300 Société Générale SA, 0,125 %, con vencimiento al 18/02/2028	1.100	1,25	1.300 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000 %, con vencimiento al 22/03/2028	1.196	1,36
1.200 TDF Infrastructure SASU, 5,625%, con vencimiento el 21/07/2028	1.202	1,37	800 IQVIA Inc, 2,250%, con vencimiento 15/01/2028	714	0,81
1.500 Teleperformance SE, 0,250%, con vencimiento el 26/11/2027	1.246	1,42	1.400 JPMorgan Chase & Co, 1,638 %, con vencimiento al 18/05/2028 *	1.286	1,46
	16.334	18,61	1.200 LKQ European Holdings BV, 4,125%, con vencimiento el 01/04/2028	1.174	1,34
Alemania — 2,42 % (28 de febrero de 2023: 3,54%)					
1.200 Commerzbank AG, 4,625 %, con vencimiento al 21/03/2028 *	1.190	1,35	1.000 Morgan Stanley, 4,813 %, con vencimiento al 25/10/2028 *	1.024	1,17
1.000 Deutsche Lufthansa AG, 3,750%, con vencimiento el 11/02/2028	938	1,07	1.300 PVH Corp, 3,125 %, con vencimiento al 15/12/2027	1.225	1,40
	2.128	2,42	1.400 Schneider Electric SE, 1,500%, con vencimiento el 15/01/2028	1.296	1,48
Irlanda — 2,98 % (28 de febrero de 2023: 3,05%)					
1.400 AIB Group Plc, 2,250 %, con vencimiento al 04/04/2028 *	1.292	1,47	1.500 Thermo Fisher Scientific Inc, 0,500%, con vencimiento el 01/03/2028	1.309	1,49
1.300 Bank of Ireland Group Plc, 4,875 %, con vencimiento al 16/07/2028 *	1.321	1,51	1.200 Verizon Communications Inc, 1,375%, con vencimiento el 02/11/2028	1.064	1,21
	2.613	2,98		13.603	15,49
Italia — 5,42 % (28 de febrero de 2023: 7,49%)					
900 Autostrade per l'Italia SpA, 1,625 %, con vencimiento al 25/01/2028	798	0,91	Total de bonos y pagarés corporativos (coste 84.963€)		
600 Autostrade per l'Italia SpA, Reg. S, 2,000 %, con vencimiento al 04/12/2028	528	0,60	Bonos y obligaciones del Estado — 2,00% (28 de febrero de 2023: 2,07%)		
350 IMA Industria Macchine Automatiche SpA, 3,750%, con vencimiento 15/01/2028	315	0,36	Paraguay — 2,00% (28 de febrero de 2023: 2,07%)		
1.500 Intesa Sanpaolo SpA, 1,750 %, con vencimiento al 20/03/2028	1.361	1,55	2.000 Romanian Government International Bond, 2,125 %, con vencimiento al 07/03/2028	1.761	2,00
400 Italmatch Chemicals SpA, 10,000 %, con vencimiento al 06/02/2028	395	0,45		1.761	2,00
1.000 Mundys SpA, 1,875%, con vencimiento el 12/02/2028	864	0,98	Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 1.748€)		
500 TeamSystem SpA, 7,413%, con vencimiento el 15/02/2028 *	497	0,57	Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
	4.758	5,42	86.453 98,47		
Japón — 1,45 % (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
1.500 NTT Finance Corp, 0,399%, con vencimiento el 13/12/2028	1.275	1,45	Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		
Luxemburgo — 2,02% (28 de febrero de 2023: 3,14%)					
1.000 Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,000 %, con vencimiento al 04/05/2028	786	0,89	86.453 98,47		
500 Kleopatra Finco Sarl, 4,250%, con vencimiento 01/03/2026	419	0,48	Excedente de otros activos respecto a los pasivos		
600 Cellnex Telecom SA, 4,000 %, con vencimiento al 15/11/2027	567	0,65	1.339 1,53		
	1.772	2,02	Patrimonio		
Países Bajos — 5,82 % (28 de febrero de 2023: 2,14%)					
1.300 ABN AMRO Bank NV, 4,000%, con vencimiento al 16/01/2028	1.285	1,46	87.792€ 100,00		
1.200 Cooperatieve Rabobank UA, 4,625%, con vencimiento el 27/01/2028 *	1.217	1,39			
1.300 ING Groep NV, 4,875%, con vencimiento el 14/11/2027 *	1.322	1,51			
1.400 TenneT Holding BV, 1,375%, con vencimiento el 05/06/2028	1.283	1,46			
	5.107	5,82			
Noruega — 1,48% (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
1.500 Telenor ASA, 0,250%, con vencimiento el 14/02/2028	1.296	1,48			
Portugal — 1,31% (28 de febrero de 2023: 2,24%)					
1.100 Caixa Geral de Depositos SA, 5,750 %, con vencimiento al 31/10/2028 *	1.152	1,31			
Paraguay — 0,59% (28 de febrero de 2023: 0,00%)					
600 United Group BV, 4,625%, con vencimiento el 15/08/2028	516	0,59			
España — 6,68 % (28 de febrero de 2023: 9,71%)					
1.300 Abertis Infraestructuras SA, 4,125%, con vencimiento el 31/01/2028	1.296	1,48			
400 Arena Luxembourg Finance Sarl, 1,875 %, con vencimiento al 01/02/2028	335	0,38			
1.000 Banco de Sabadell SA, 5,250 %, con vencimiento al 07/02/2029 *	994	1,13			
1.400 CaixaBank SA, 0,750 %, con vencimiento al 26/05/2028 *	1.220	1,39			
700 Unicaja Banco SA, 7,250 %, con vencimiento al 15/11/2027 *	720	0,82			
1.300 Werfen SA/Spain, 4,625%, con vencimiento el 06/06/2028	1.296	1,48			
	5.861	6,68			
Suecia — 5,97 % (28 de febrero de 2023: 2,67%)					
1.600 Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,375%, con vencimiento el 21/06/2028	1.347	1,53			
1.200 Svenska Handelsbanken AB, 3,750 %, con vencimiento al 01/11/2027	1.200	1,37			

^ No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

[Esta página se ha dejado intencionadamente en blanco]

Resumen de la situación financiera

	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	
	A 31 de agosto de 2023	A 28 de febrero de 2023	A 31 de agosto de 2023	A 28 de febrero de 2023	A 31 de agosto de 2023	A 28 de febrero de 2023	A 31 de agosto de 2023	A 28 de febrero de 2023
(en miles)								
ACTIVO CIRCULANTE:								
Liquidez y equivalentes de liquidez (Nota 7)	USD 1	USD 1	USD -	USD -	USD 7.482	USD 34.310	€ 1.873	€ 4.251
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 7)	-	-	2.257	2.060	4.123	7.065	1.863	2.191
Activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias:								
Inversiones	950.341	844.196	226.747	140.166	1.007.553	1.183.129	86.466	125.838
Inversiones pignoradas	-	-	-	-	235	-	-	-
Opciones	-	-	327	64	2.256	556	-	4
Contratos de permuta financiera	-	-	1.321	2.534	9.469	8.276	22	-
Opciones sobre swaps (swaptions)	-	-	-	-	-	-	-	-
Apreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	-	-	-	-	567	540	4	72
Plusvalía latente en contratos de futuros	-	-	310	303	2.534	2.474	322	476
Cuentas por cobrar por inversiones vendidas	-	-	4.584	1.429	12.429	17.093	-	-
Cuentas por cobrar por acciones participativas rescatables vendidas	-	-	275	53	395	429	-	-
Intereses y otros ingresos a cobrar	2.142	2.036	1.538	1.107	8.528	8.995	742	1.280
Dividendos a cobrar	-	-	69	8	10	10	9	31
Comisiones de gestión por cobrar	-	-	-	-	-	-	-	-
Otros activos	1	-	-	-	8	-	2	-
Total activo circulante	952.485	846.233	237.428	147.724	1.055.589	1.262.877	91.303	134.143
PASIVO CIRCULANTE:								
Descubierto de efectivo (Nota 7)	-	-	5.862	620	6.816	849	-	-
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 7)	-	-	1.337	2.826	1.189	445	8	9
Pasivo financiero a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias:								
Opciones	-	-	195	70	1.588	615	-	4
Contratos de permuta financiera	-	-	20	46	1.749	1.867	-	-
Opciones sobre swaps (swaptions)	-	-	-	-	-	-	-	-
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	-	-	-	-	2.005	2.578	179	338
Depreciación no realizada de contratos de futuros	-	-	152	180	1.496	3.625	91	1.065
Pagadero por inversiones adquiridas	19.824	9.879	25.760	11.726	37.494	101.191	647	187
Distribuciones a los tenedores de participaciones reembolsables	3.017	2.054	177	132	175	148	1	1
Comisión de gestión por pagar (Nota 3)	456	363	111	71	465	487	3	3
Comisiones pagaderas (Nota 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Comisiones de Administrador y Depositario por pagar (Nota 3)	30	24	23	16	73	73	13	14
Comisiones de servicios a los accionistas por pagar (Nota 3)	-	-	10	1	23	20	-	-
Cuentas por pagar por la readquisición de participaciones reembolsables	-	-	217	1	2.052	1.904	-	-
Gastos acumulados y otros pasivos	239	298	88	116	435	375	38	55
Pasivos (excluye los activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables)	23.566	12.618	33.952	15.805	55.560	114.177	980	1.676
Total de activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables	USD 928.919	USD 833.615	USD 203.476	USD 131.919	USD 1.000.029	USD 1.148.700	€ 90.323	€ 132.467

	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	
	A 31 de agosto de 2023	A 28 de febrero de 2023	A 31 de agosto de 2023	A 28 de febrero de 2023	A 31 de agosto de 2023	A 28 de febrero de 2023	A 31 de agosto de 2023	A 28 de febrero de 2023
(en miles)								
ACTIVO CIRCULANTE:								
Liquidez y equivalentes de liquidez (Nota 7)	USD 1.001	USD 3.850	USD 14	USD 14	USD 17	USD 17	USD 15	USD 45
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 7)	124	162	-	-	-	-	-	-
Activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias:								
Inversiones	50.686	52.716	-	-	-	-	-	-
Inversiones pignoradas	-	-	-	-	-	-	-	-
Opciones	-	-	-	-	-	-	-	-
Contratos de permuta financiera	-	-	-	-	-	-	-	-
Opciones sobre swaps (swaptions)	-	-	-	-	-	-	-	-
Apreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	32	60	-	-	-	-	-	-
Plusvalía latente en contratos de futuros	-	38	-	-	-	-	-	-
Cuentas por cobrar por inversiones vendidas	355	554	-	-	-	-	-	-
Cuentas por cobrar por acciones participativas rescatables vendidas	8	4	-	-	-	-	-	-
Intereses y otros ingresos a cobrar	703	739	-	-	-	-	-	-
Dividendos a cobrar	1	-	-	-	-	-	-	-
Comisiones de gestión por cobrar	-	-	-	-	-	-	-	-
Otros activos	9	-	-	-	-	-	-	-
Total activo circulante	52.919	58.123	14	14	17	17	15	45
PASIVO CIRCULANTE:								
Descubierto de efectivo (Nota 7)	-	140	-	-	-	-	-	-
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 7)	-	38	-	-	-	-	-	-
Pasivo financiero a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias:								
Opciones	-	-	-	-	-	-	-	-
Contratos de permuta financiera	-	-	-	-	-	-	-	-
Opciones sobre swaps (swaptions)	-	-	-	-	-	-	-	-
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	105	271	-	-	-	-	-	-
Depreciación no realizada de contratos de futuros	10	-	-	-	-	-	-	-
Pagadero por inversiones adquiridas	851	4	-	-	-	-	-	-
Distribuciones a los tenedores de participaciones reembolsables	100	89	-	-	-	-	-	-
Comisión de gestión por pagar (Nota 3)	40	41	-	-	-	-	-	-
Comisiones pagaderas (Nota 3)	-	-	-	-	-	-	-	-
Comisiones de Administrador y Depositario por pagar (Nota 3)	12	11	-	-	-	-	-	3
Comisiones de servicios a los accionistas por pagar (Nota 3)	3	4	-	-	-	-	-	-
Cuentas por pagar por la readquisición de participaciones reembolsables	51	-	-	-	-	-	-	-
Gastos acumulados y otros pasivos	64	94	14	14	17	17	15	42
Pasivos (excluye los activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables)	1.236	692	14	14	17	17	15	45
Total de activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables	USD 51.683	USD 57.431	USD -	USD -	USD -	USD -	USD -	USD -

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 [^]			
A 31 de agosto de 2023		A 28 de febrero de 2023		A 31 de agosto de 2023		A 28 de febrero de 2023		A 31 de agosto de 2023		A 28 de febrero de 2023		A 31 de agosto de 2023		A 28 de febrero de 2023		A 31 de agosto de 2023		A 28 de febrero de 2023	
USD	681	USD	1.425	USD	8.313	USD	20.391	USD	631	USD	63	USD	29	USD	60	USD	22	USD	35
	-		-		1.907		882		1.060		1.126		-		-		-		-
	-		-		210.547		202.891		101.700		123.407		-		-		-		-
	-		-		-		-		-		-		-		-		-		-
	-		-		-		-		101		102		-		-		-		-
	-		-		-		-		-		-		-		-		-		-
	-		-		535		775		-		1		-		-		-		-
	-		-		221		74		50		-		-		-		-		-
	-		-		176		4.780		1.449		608		-		-		-		-
	-		-		58		28		17		8		-		-		-		-
	-		-		2.588		2.851		1.597		1.920		-		-		-		-
	-		-		6		15		2		5		-		-		-		-
	-		-		-		-		-		-		-		-		-		-
	-		-		5		-		-		-		-		-		-		-
	681		1.426		224.356		232.687		106.607		127.240		29		62		22		35
	-		-		37		559		-		155		-		-		-		-
	-		-		84		27		96		-		-		-		-		-
	-		-		-		-		-		-		-		-		-		-
	-		-		-		-		58		116		-		-		-		-
	-		-		-		-		-		-		-		-		-		-
	-		-		1.411		4.011		30		35		-		-		-		-
	-		-		166		29		-		31		-		-		-		-
	-		-		136		266		197		1.250		-		-		-		-
	-		12		100		94		177		172		-		-		-		-
	-		14		96		91		63		67		-		-		-		-
	-		-		-		-		-		-		-		-		-		-
	-		9		23		20		16		14		-		3		-		3
	-		2		6		6		7		7		-		-		-		-
	662		1.366		11		45		52		74		11		11		-		-
	19		23		123		184		52		79		18		48		22		32
	681		1.426		2.193		5.332		748		2.000		29		62		22		35
USD	-	USD	-	USD	222.163	USD	227.355	USD	105.859	USD	125.240	USD	-	USD	-	USD	-	USD	-

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 [^]			
A 31 de agosto de 2023		A 28 de febrero de 2023		A 31 de agosto de 2023		A 28 de febrero de 2023		A 31 de agosto de 2023		A 28 de febrero de 2023		A 31 de agosto de 2023		A 28 de febrero de 2023		A 31 de agosto de 2023		A 28 de febrero de 2023	
USD	239	USD	998	USD	3.854	USD	3.559	USD	4.628	USD	4.735	USD	698	USD	743	€	15	€	31
	1.156		1.540		3.563		2.733		1.954		1.544		967		1.074		-		-
	391.029		433.473		464.179		532.162		163.564		146.874		29.460		43.765		-		-
	-		-		-		-		-		152		-		-		-		-
	-		-		-		-		-		19		-		-		-		-
	-		-		-		213		61		-		-		-		-		-
	6		162		2.481		3.707		937		1.011		216		343		-		-
	-		-		718		4.839		404		338		110		202		-		-
	-		771		1.119		2.646		1.550		3.576		-		1		-		-
	41		41		1.157		2.043		17		1		2		1		-		-
	4.203		4.375		4.353		2.855		1.120		1.086		343		491		-		-
	24		20		20		127		5		15		2		6		-		-
	-		-		-		-		-		-		-		-		-		-
	2		-		9		1		2		-		9		-		-		-
	396.700		441.380		481.453		554.885		174.242		159.351		31.807		46.626		15		31
	1.759		522		620		484		-		-		-		-		-		-
	1		6		406		1		139		17		74		3		-		-
	-		-		-		-		-		4		-		-		-		-
	-		-		326		-		-		-		92		76		-		-
	-		-		-		-		-		-		-		-		-		-
	618		1.130		3.247		3.219		1.300		2.097		79		90		-		-
	269		373		705		61		245		1.043		41		34		-		-
	-		770		1.119		25.758		17.834		9.282		109		306		-		-
	2		15		7		2		-		-		-		-		-		-
	233		200		164		153		19		17		2		2		-		-
	-		-		-		-		-		-		-		-		-		-
	38		32		40		36		19		15		11		9		-		3
	15		13		15		11		-		-		-		-		-		-
	13		299		541		1.106		-		72		-		-		-		-
	287		313		55		84		222		101		40		56		15		28
	3.235		3.673		7.245		30.915		19.778		12.648		448		576		15		31
USD	393.465	USD	437.707	USD	474.208	USD	523.970	USD	154.464	USD	146.703	USD	31.359	USD	46.050	€	-	€	-

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de situación financiera — (continuación)

(en miles)	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 [^]	
	A 31 de agosto de 2023	A 28 de febrero de 2023	A 31 de agosto de 2023	A 28 de febrero de 2023	A 31 de agosto de 2023	A 28 de febrero de 2023	A 31 de agosto de 2023	A 28 de febrero de 2023
	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
ACTIVO CIRCULANTE:								
Liquidez y equivalentes de liquidez (Nota 7)	26.891	63.691	30	30	3.764	3.203	–	–
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 7)	143.867	250.586	–	–	3.779	3.915	–	–
Activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias:								
Inversiones	1.432.224	1.913.653	–	–	275.837	267.865	–	–
Inversiones pignoradas	57.208	1.590	–	–	–	–	–	–
Opciones	21.526	6.090	–	–	280	566	–	–
Contratos de permuta financiera	113.490	155.867	–	–	725	1.033	–	–
Opciones sobre swaps (swaptions)	–	–	–	–	47	–	–	–
Apreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	13.409	21.504	–	–	536	536	–	–
Plusvalía latente en contratos de futuros	54.997	20.467	–	–	1.448	53	–	–
Cuentas por cobrar por inversiones vendidas	384	13.260	–	–	3.571	5.180	–	–
Cuentas por cobrar por acciones participativas rescatables vendidas	899	1.024	–	–	8	2.133	–	–
Intereses y otros ingresos a cobrar	29.668	36.399	–	–	3.869	3.427	–	–
Dividendos a cobrar	164	487	–	–	8	8	–	–
Comisiones de gestión por cobrar	–	–	–	–	–	–	–	–
Otros activos	7	–	–	–	9	1	–	–
Total activo circulante	1.894.734	2.484.618	30	30	293.881	287.920	–	–
PASIVO CIRCULANTE:								
Descubierto de efectivo (Nota 7)	76.873	83.849	–	–	189	2	–	–
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 7)	19.369	76.579	–	–	249	119	–	–
Pasivo financiero a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias:								
Opciones	45.858	46.352	–	–	56	36	–	–
Contratos de permuta financiera	53.289	43.002	–	–	353	761	–	–
Opciones sobre swaps (swaptions)	–	–	–	–	73	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	14.349	43.616	–	–	2.359	2.965	–	–
Depreciación no realizada de contratos de futuros	54.049	47.194	–	–	504	890	–	–
Pagadero por inversiones adquiridas	114.479	4.384	–	–	1.181	7.800	–	–
Distribuciones a los tenedores de participaciones reembolsables	–	–	–	–	–	–	–	–
Comisión de gestión por pagar (Nota 3)	1.627	2.062	–	–	27	24	–	–
Comisiones pagaderas (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Comisiones de Administrador y Depositario por pagar (Nota 3)	102	151	–	–	26	22	–	–
Comisiones de servicios a los accionistas por pagar (Nota 3)	122	136	–	–	–	–	–	–
Cuentas por pagar por la readquisición de participaciones reembolsables	1.042	3.140	–	–	1.890	82	–	–
Gastos acumulados y otros pasivos	1.415	1.652	30	30	165	207	–	–
Pasivos (excluye los activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables)	382.574	352.117	30	30	7.072	12.908	–	–
Total de activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables	USD 1.512.160	USD 2.132.501	USD –	USD –	USD 286.809	USD 275.012	USD –	USD –
(en miles)	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 [^]	
	A 31 de agosto de 2023	A 28 de febrero de 2023	A 31 de agosto de 2023	A 28 de febrero de 2023	A 31 de agosto de 2023	A 28 de febrero de 2023	A 31 de agosto de 2023	A 28 de febrero de 2023
	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
ACTIVO CIRCULANTE:								
Liquidez y equivalentes de liquidez (Nota 7)	67	136	3.196	223	1.920	1.762	35	5
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 7)	275	194	–	–	1.118	2.709	99	8
Activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias:								
Inversiones	8.902	8.571	151.997	164.330	260.160	538.707	23.928	10.360
Inversiones pignoradas	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratos de permuta financiera	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones sobre swaps (swaptions)	–	–	–	–	–	–	–	–
Apreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	77	92	1.454	3.132	7.522	13.024	12	10
Plusvalía latente en contratos de futuros	26	59	–	–	512	2.190	42	2
Cuentas por cobrar por inversiones vendidas	–	155	106	490	–	1.798	567	248
Cuentas por cobrar por acciones participativas rescatables vendidas	–	–	157	117	2	1.797	–	1
Intereses y otros ingresos a cobrar	95	104	1.883	1.781	2.667	5.523	386	175
Dividendos a cobrar	3	1	340	345	156	233	4	2
Comisiones de gestión por cobrar	2	2	–	–	–	–	–	–
Otros activos	8	8	–	–	–	–	16	–
Total activo circulante	9.455	9.322	159.133	170.418	274.057	567.743	25.089	10.811
PASIVO CIRCULANTE:								
Descubierto de efectivo (Nota 7)	32	–	–	4	–	7	123	–
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 7)	–	26	–	850	992	2.495	–	–
Pasivo financiero a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias:								
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratos de permuta financiera	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones sobre swaps (swaptions)	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	161	107	3.353	3.966	16.536	23.627	245	202
Depreciación no realizada de contratos de futuros	13	5	–	–	–	–	–	–
Pagadero por inversiones adquiridas	–	145	106	490	–	1.798	350	163
Distribuciones a los tenedores de participaciones reembolsables	–	–	–	–	–	–	1	1
Comisión de gestión por pagar (Nota 3)	–	–	85	83	208	260	6	–
Comisiones pagaderas (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Comisiones de Administrador y Depositario por pagar (Nota 3)	14	13	24	24	27	38	10	7
Comisiones de servicios a los accionistas por pagar (Nota 3)	–	–	11	11	–	–	–	–
Cuentas por pagar por la readquisición de participaciones reembolsables	–	–	1.074	2.595	55	–	3	–
Gastos acumulados y otros pasivos	24	31	354	386	229	247	29	44
Pasivos (excluye los activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables)	244	327	5.007	8.409	18.047	28.472	767	417
Total de activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables	USD 9.211	USD 8.995	USD 154.126	USD 162.009	USD 256.010	USD 539.271	USD 24.322	USD 10.394

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

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

Estado de situación financiera — (continuación)

(en miles)	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 ^{^α}			
	A 31 de agosto de 2023		A 28 de febrero de 2023		A 31 de agosto de 2023		A 28 de febrero de 2023		A 31 de agosto de 2023		A 28 de febrero de 2023		A 31 de agosto de 2023		A 28 de febrero de 2023	
	USD		USD		USD		USD		USD		USD		USD		USD	
ACTIVO CIRCULANTE:																
Liquidez y equivalentes de liquidez (Nota 7)	USD	15	USD	–	USD	2.369	USD	1.879	USD	2	USD	1.147	USD	26	USD	–
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 7)		–		–		1.715		664		418		431		–		–
Activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias:																
Inversiones		–		–		67.273		69.694		14.815		13.130		–		2.583
Inversiones pignoradas		–		–		–		–		–		–		–		–
Opciones		–		–		–		–		–		–		–		–
Contratos de permuta financiera		–		–		–		–		4		33		–		–
Opciones sobre swaps (swaptions)		–		–		–		–		–		–		–		–
Apreciación latente sobre contratos de divisas a plazo		–		–		266		249		38		86		–		–
Plusvalía latente en contratos de futuros		–		–		55		–		66		–		–		–
Cuentas por cobrar por inversiones vendidas		–		–		312		327		–		–		–		–
Cuentas por cobrar por acciones participativas rescatables vendidas		–		–		–		–		–		–		–		–
Intereses y otros ingresos a cobrar		–		–		690		948		155		186		–		–
Dividendos a cobrar		–		–		3		9		3		–		–		5
Comisiones de gestión por cobrar		–		–		1		–		1		5		–		23
Otros activos		–		–		–		–		–		4		–		–
Total activo circulante		15		–		72.684		73.770		15.502		15.022		26		2.611
PASIVO CIRCULANTE:																
Descubierto de efectivo (Nota 7)		–		–		188		1		–		–		–		–
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 7)		–		–		66		122		–		–		–		–
Pasivo financiero a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias:																
Opciones		–		–		–		–		41		–		–		–
Contratos de permuta financiera		–		–		–		–		–		–		–		–
Opciones sobre swaps (swaptions)		–		–		–		–		–		–		–		–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo		–		–		2.543		3.482		74		64		–		20
Depreciación no realizada de contratos de futuros		–		–		130		283		–		123		–		–
Pagadero por inversiones adquiridas		–		–		312		327		–		–		–		–
Distribuciones a los tenedores de participaciones reembolsables		–		–		–		–		–		–		–		–
Comisión de gestión por pagar (Nota 3)		–		–		–		–		–		–		–		–
Comisiones pagaderas (Nota 3)		–		–		–		–		–		–		–		–
Comisiones de Administrador y Depositario por pagar (Nota 3)		–		–		13		13		11		4		6		7
Comisiones de servicios a los accionistas por pagar (Nota 3)		–		–		–		–		–		–		–		–
Cuentas por pagar por la readquisición de participaciones reembolsables		15		–		–		–		–		–		–		–
Gastos acumulados y otros pasivos		–		–		145		132		60		27		20		50
Pasivos (excluye los activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables)		15		–		3.397		4.360		186		218		26		77
Total de activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables	USD	–	USD	–	USD	69.287	USD	69.410	USD	15.316	USD	14.804	USD	–	USD	2.534

(en miles)	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund				FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund				FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund				FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]			
	A 31 de agosto de 2023		A 28 de febrero de 2023		A 31 de agosto de 2023		A 28 de febrero de 2023		A 31 de agosto de 2023		A 28 de febrero de 2023		A 31 de agosto de 2023		A 28 de febrero de 2023	
	USD		USD		USD		USD		USD		USD		USD		USD	
ACTIVO CIRCULANTE:																
Liquidez y equivalentes de liquidez (Nota 7)	USD	3.747	USD	11.596	USD	301	USD	2.053	USD	27.439	USD	11.074	USD	164	USD	385
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 7)		–		–		–		–		–		–		–		–
Activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias:																
Inversiones		213.403		214.039		35.254		36.590		1.553.421		1.629.033		14.730		12.823
Inversiones pignoradas		–		–		–		–		–		–		–		–
Opciones		–		–		–		–		–		–		–		–
Contratos de permuta financiera		–		–		–		–		–		–		–		–
Opciones sobre swaps (swaptions)		–		–		–		–		–		–		–		–
Apreciación latente sobre contratos de divisas a plazo		4		4		–		1		31		22		–		–
Plusvalía latente en contratos de futuros		–		–		–		–		–		–		–		–
Cuentas por cobrar por inversiones vendidas		92		179		–		–		14.782		3.682		–		–
Cuentas por cobrar por acciones participativas rescatables vendidas		21		5		–		–		17.776		29.209		–		–
Intereses y otros ingresos a cobrar		6		14		–		7		10		20		1		–
Dividendos a cobrar		97		42		60		72		1.208		740		21		13
Comisiones de gestión por cobrar		–		–		–		–		–		–		–		–
Otros activos		2		–		8		–		8		4		5		–
Total activo circulante		217.372		225.879		35.623		38.723		1.614.675		1.673.784		14.921		13.221
PASIVO CIRCULANTE:																
Descubierto de efectivo (Nota 7)		622		–		–		–		58		7		6		–
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 7)		–		–		–		–		–		–		–		–
Pasivo financiero a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias:																
Opciones		–		–		–		–		–		–		–		–
Contratos de permuta financiera		–		–		–		–		–		–		–		–
Opciones sobre swaps (swaptions)		–		–		–		–		–		–		–		–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo		86		229		16		56		863		840		–		–
Depreciación no realizada de contratos de futuros		–		–		–		–		–		–		–		–
Pagadero por inversiones adquiridas		92		179		–		–		14.782		3.682		–		–
Distribuciones a los tenedores de participaciones reembolsables		–		–		–		–		–		–		–		–
Comisión de gestión por pagar (Nota 3)		207		200		32		33		720		704		6		6
Comisiones pagaderas (Nota 3)		–		–		–		–		–		–		–		–
Comisiones de Administrador y Depositario por pagar (Nota 3)		42		43		12		11		110		130		10		9
Comisiones de servicios a los accionistas por pagar (Nota 3)		37		35		4		4		164		170		–		–
Cuentas por pagar por la readquisición de participaciones reembolsables		193		176		1		44		3.332		28.161		–		–
Gastos acumulados y otros pasivos		177		224		30		47		95		111		22		27
Pasivos (excluye los activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables)		1.456		1.086		95		195		20.124		33.805		44		42
Total de activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables	USD	215.916	USD	224.793	USD	35.528	USD	38.528	USD	1.594.551	USD	1.639.979	USD	14.877	USD	13.179

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

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

Estado de situación financiera — (continuación)

	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 [^] ₆									
	A 31 de agosto de 2023	A 28 de febrero de 2023	A 31 de agosto de 2023	A 28 de febrero de 2023	A 31 de agosto de 2023	A 28 de febrero de 2023	A 31 de agosto de 2023	A 28 de febrero de 2023								
(en miles)																
ACTIVO CIRCULANTE:																
Liquidez y equivalentes de liquidez (Nota 7)	USD	–	USD	–	USD	23	USD	23	€	1.351	€	1.256	USD	2.310	USD	402
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 7)		–		–		–		–		–				–		–
Activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias:																
Inversiones		4.230		4.273		–		–		–		–		–		20.883
Inversiones pignoradas		–		–		–		–		–		–		–		–
Opciones		–		–		–		–		–		–		–		–
Contratos de permuta financiera		–		–		–		–		–		–		–		–
Opciones sobre swaps (swaptions)		–		–		–		–		–		–		–		–
Apreciación latente sobre contratos de divisas a plazo		–		–		–		–		–		–		–		–
Plusvalía latente en contratos de futuros		–		–		–		–		–		–		–		–
Cuentas por cobrar por inversiones vendidas		–		–		–		–		–		–		–		–
Cuentas por cobrar por acciones participativas rescatables vendidas		–		–		–		–		–		–		–		3
Intereses y otros ingresos a cobrar		–		–		–		–		–		–		–		1
Dividendos a cobrar		5		8		–		–		11		3		–		62
Comisiones de gestión por cobrar		1		–		–		–		–		–		–		–
Otros activos		16		–		–		–		–		–		3		–
Total activo circulante		4.252		4.281		23		23		1.362		1.259		2.313		21.351
PASIVO CIRCULANTE:																
Descubierto de efectivo (Nota 7)		2		–		–		–		–		–		–		–
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 7)		–		–		–		–		–		–		–		–
Pasivo financiero a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias:																
Opciones		–		–		–		–		–		–		–		–
Contratos de permuta financiera		–		–		–		–		–		–		–		–
Opciones sobre swaps (swaptions)		–		–		–		–		–		–		–		–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo		–		–		–		–		–		–		–		90
Depreciación no realizada de contratos de futuros		–		–		–		–		–		–		–		–
Pagadero por inversiones adquiridas		–		–		–		–		–		–		–		–
Distribuciones a los tenedores de participaciones reembolsables		–		–		–		–		–		–		–		–
Comisión de gestión por pagar (Nota 3)		–		1		–		–		–		–		–		25
Comisiones pagaderas (Nota 3)		–		–		–		–		–		–		–		–
Comisiones de Administrador y Depositario por pagar (Nota 3)		8		7		–		–		–		3		8		11
Comisiones de servicios a los accionistas por pagar (Nota 3)		–		–		–		–		–		–		–		2
Cuentas por pagar por la readquisición de participaciones reembolsables		–		–		–		–		1.175		1.185		2.247		–
Gastos acumulados y otros pasivos		13		19		23		23		187		71		58		133
Pasivos (excluye los activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables)		23		27		23		23		1.362		1.259		2.313		261
Total de activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables	USD	4.229	USD	4.254	USD	–	USD	–	€	–	€	–	USD	–	USD	21.090
(en miles)																
ACTIVO CIRCULANTE:																
Liquidez y equivalentes de liquidez (Nota 7)	USD	28	USD	28	€	82	€	65	USD	51	USD	51	USD	61	USD	61
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 7)		–		–		–		–		–		–		–		–
Activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias:																
Inversiones		–		–		–		–		–		–		–		–
Inversiones pignoradas		–		–		–		–		–		–		–		–
Opciones		–		–		–		–		–		–		–		–
Contratos de permuta financiera		–		–		–		–		–		–		–		–
Opciones sobre swaps (swaptions)		–		–		–		–		–		–		–		–
Apreciación latente sobre contratos de divisas a plazo		–		–		–		–		–		–		–		–
Plusvalía latente en contratos de futuros		–		–		–		–		–		–		–		–
Cuentas por cobrar por inversiones vendidas		–		–		–		–		–		–		–		–
Cuentas por cobrar por acciones participativas rescatables vendidas		–		–		–		–		–		–		–		–
Intereses y otros ingresos a cobrar		–		–		–		–		–		–		–		–
Dividendos a cobrar		–		–		–		–		–		–		–		–
Comisiones de gestión por cobrar		–		–		–		–		–		–		–		–
Otros activos		–		–		–		–		–		–		–		–
Total activo circulante		28		28		82		65		51		51		61		61
PASIVO CIRCULANTE:																
Descubierto de efectivo (Nota 7)		–		–		–		–		–		–		–		–
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 7)		–		–		–		–		–		–		–		–
Pasivo financiero a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias:																
Opciones		–		–		–		–		–		–		–		–
Contratos de permuta financiera		–		–		–		–		–		–		–		–
Opciones sobre swaps (swaptions)		–		–		–		–		–		–		–		–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo		–		–		–		–		–		–		–		–
Depreciación no realizada de contratos de futuros		–		–		–		–		–		–		–		–
Pagadero por inversiones adquiridas		–		–		–		–		–		–		–		–
Distribuciones a los tenedores de participaciones reembolsables		–		–		–		–		–		–		–		–
Comisión de gestión por pagar (Nota 3)		–		–		–		–		–		–		–		–
Comisiones pagaderas (Nota 3)		–		–		3		–		–		–		–		–
Comisiones de Administrador y Depositario por pagar (Nota 3)		–		–		–		–		–		–		–		–
Comisiones de servicios a los accionistas por pagar (Nota 3)		–		–		–		–		–		–		–		–
Cuentas por pagar por la readquisición de participaciones reembolsables		–		–		–		–		51		51		38		38
Gastos acumulados y otros pasivos		28		28		79		65		–		–		23		23
Pasivos (excluye los activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables)		28		28		82		65		51		51		61		61
Total de activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables	USD	–	USD	–	€	–	€	–	USD	–	USD	–	USD	–	USD	–

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de situación financiera — (continuación)

	Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]		Franklin Templeton Global Funds Plc	
	A 31 de agosto de 2023	28 de febrero de 2023	A 31 de agosto de 2023	28 de febrero de 2023
(en miles)				
ACTIVO CIRCULANTE:				
Liquidez y equivalentes de liquidez (Nota 7)	€ 222	€ 1.848	USD 235.072	USD 331.948
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 7)	–	–	203.275	312.657
Activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias:				
Inversiones	86.453	34.759	16.096.309	17.052.700
Inversiones pignoradas	–	–	57.443	1.742
Opciones	–	–	24.476	7.318
Contratos de permuta financiera	–	–	125.776	170.266
Opciones sobre swaps (swaptions)	–	–	47	–
Apreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	35.171	53.350
Plusvalía latente en contratos de futuros	–	–	69.493	32.496
Cuentas por cobrar por inversiones vendidas	156	–	218.032	135.703
Cuentas por cobrar por acciones participativas rescatables vendidas	–	689	35.638	48.971
Intereses y otros ingresos a cobrar	1.020	344	91.408	103.724
Dividendos a cobrar	40	11	11.968	10.290
Comisiones de gestión por cobrar	–	9	17	64
Otros activos	3	2	269	59
Total activo circulante	87.894	37.662	17.204.394	18.261.288
PASIVO CIRCULANTE:				
Descubierta de efectivo (Nota 7)	–	–	105.849	91.015
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 7)	–	–	25.997	84.123
Pasivo financiero a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias:				
Opciones	–	–	47.795	47.119
Contratos de permuta financiera	–	–	65.757	46.859
Opciones sobre swaps (swaptions)	–	–	73	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	74.855	121.367
Depreciación no realizada de contratos de futuros	–	–	58.809	59.938
Pagadero por inversiones adquiridas	–	815	391.788	301.633
Distribuciones a los tenedores de participaciones reembolsables	–	–	4.030	2.826
Comisión de gestión por pagar (Nota 3)	35	–	9.556	9.548
Comisiones pagaderas (Nota 3)	–	–	3	–
Comisiones de Administrador y Depositario por pagar (Nota 3)	8	2	1.618	1.695
Comisiones de servicios a los accionistas por pagar (Nota 3)	–	–	1.027	1.005
Cuentas por pagar por la readquisición de participaciones reembolsables	23	–	67.302	54.803
Gastos acumulados y otros pasivos	36	22	11.358	11.327
Pasivos (excluye los activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables)	102	839	865.817	833.258
Total de activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables	€ 87.792	€ 36.823	USD 16.338.577	USD 17.428.030

Las cantidades designadas como “–” son o bien 0\$/€0/¥0/£0 o bien inferiores a 1000 \$ / 1000 € / 1000 ¥ / 1000 £.

Las cifras en euros de 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[^] y Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] se han convertido a dólares estadounidenses en la cifra total de Franklin Templeton Global Funds Plc a 31 de agosto de 2023 utilizando el tipo de cambio de cierre USD/EUR de 0,9222 (28 de febrero de 2023: 0,9454).

Las cifras en yenes del Legg Mason Japan Equity Fund[^] se han convertido a dólares estadounidenses en la cifra total de Franklin Templeton Global Funds Plc a 31 de agosto de 2023 utilizando el tipo de cambio de cierre USD/JPY de 145,4950 (28 de febrero de 2023: 136,1550).

Las cifras en libras esterlinas del FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] se han convertido en dólares estadounidenses en la cifra total de Franklin Templeton Global Funds Plc a 31 de agosto de 2023 utilizando el tipo de cambio de cierre USD/GBP de 0,7894 (28 de febrero de 2023: 0,8314).

α A partir de la fecha efectiva de 24 de marzo de 2023, FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] y FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^] dejaron de cotizar.

β A partir de la fecha efectiva de 20 de abril de 2023, el FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] dejó de cotizar.

γ A partir de la fecha efectiva de 20 de junio de 2023, se lanza el FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^].

δ A partir de la fecha efectiva de 17 de julio de 2023, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] dejó de cotizar en bolsa.

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Estado de situación financiera — (continuación)

	31 de agosto de 2023			28 de febrero de 2023			28 de febrero de 2022		
	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor li- quidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor li- quidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor li- quidativo/ Acción:
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund									
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	USD 4.333	53	81,66	USD 5.748	66	87,21	USD 6.166	63	98,23
Clase A AUD de Distribución (M) Plus	437	7	94,50	454	7	97,11	487	7	101,33
Clase A Euro de Distribución (M) Plus (e)	440	5	83,21	457	5	91,10	490	5	96,80
Clase A SGD de Distribución (M) Plus	46	77	0,81	45	70	0,86	54	75	0,98
Clase D AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	21	–	89,92	375	6	96,94	684	8	111,38
Clase A CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1	–	91,17	1	–	98,76	1	–	113,18
Clase D HKD de Distribución (M) Plus	1	–	96,23	1	–	102,55	1	–	114,51
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	224	325	0,93	307	414	1,00	1.016	1.221	1,13
Clase D USD de Distribución (M) Plus	124	1	95,04	1.014	10	101,21	856	8	113,52
Clase D USD de Capitalización	4.114	37	111,15	5.511	48	115,20	5.888	48	123,07
Clase X AUD de Capitalización	223	3	128,91	5.312	4	128,43	350	4	126,73
Clase X USD de Capitalización	5.584	46	122,13	5.801	46	126,36	6.077	45	134,52
Clase S GBP de Capitalización	472	3	134,87	487	3	146,47	515	3	138,89
Clase S GBP de Distribución (M) Plus (e)	472	4	95,12	487	4	106,24	515	4	105,80
Clase LM AUD de Capitalización	4.005	47	131,93	4.121	47	130,72	4.834	52	127,51
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]									
Clase A USD de Capitalización	USD 4.122	46	89,90	USD 4.789	54	88,85	USD 7.343	68	108,56
Clase E USD de Capitalización	354	4	99,62	352	4	98,83	402	3	121,66
Clase F USD de Capitalización	13.817	121	114,23	14.837	132	112,56	11.843	87	136,70
Clase X USD de Capitalización	2	–	97,86	2	–	96,38	656	6	116,89
Clase Premier USD de Capitalización	3.587	36	99,88	3.812	39	98,17	6.709	57	118,63
Clase S USD de Capitalización	325	3	121,52	347	3	119,33	2.252	16	143,91
Clase S Euro de Capitalización	10.758	94	105,07	10.563	94	105,77	18.633	138	120,24
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]									
Clase A USD de Capitalización (Cubierta)	€ 26	–	81,44	€ 26	–	80,63	€ 39	1	86,53
Clase A EUR de Capitalización	1.691	12	136,34	1.770	13	136,40	7.094	47	151,56
Clase E USD de Capitalización (Cubierta)	26	–	80,30	26	–	79,81	38	1	86,29
Clase X EUR de Capitalización	454	3	141,33	528	4	140,86	1.877	12	155,36
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)	667	35	101,85	1.342	76	97,67	3.184	191	96,48
Clase Premier EUR de Capitalización	838	6	143,73	850	6	143,00	26.577	169	157,16
Clase S USD de Capitalización	1	–	111,92	1	–	108,31	–	–	–
Clase S Euro de Capitalización	75.665	600	126,01	76.234	609	125,11	145.601	1.063	136,96
Clase S GBP de Capitalización	108.951	1.265	73,70	108.320	1.267	75,17	119.180	1.273	78,23
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^{^y}									
Clase A USD de Capitalización	USD 94	1	95,03	USD –	–	–	USD –	–	–
Clase X GBP de Capitalización (Cubierta)	1	–	96,65	–	–	–	–	–	–
Clase S USD de Capitalización	4.483	47	95,38	–	–	–	–	–	–
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	94	1	94,96	–	–	–	–	–	–
Clase S GBP de Capitalización (Cubierta)	94	1	95,25	–	–	–	–	–	–
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]									
Clase A EUR de Capitalización	€ 11.160	111	100,09	€ 98	1	98,13	€ –	–	–
Clase A EUR de Distribución (A)	44.624	446	100,15	5.022	51	98,18	–	–	–
Clase A EUR de Distribución (A) Plus	–	–	–	98	1	98,13	–	–	–
Clase D Euro de Capitalización	1.330	13	99,76	98	1	98,08	–	–	–
Clase D Euro de Distribución (A)	203	2	99,76	98	1	98,08	–	–	–
Clase K Euro de Capitalización	€ –	–	–	€ 98	1	98,11	€ –	–	–
Clase K Euro de Distribución (A)	–	–	–	98	1	98,11	–	–	–
Clase X EUR de Capitalización	474	5	100,31	9.474	97	98,17	–	–	–
Clase X Euro de Distribución (A)	30.001	299	100,39	21.739	221	98,22	–	–	–

Estado de situación financiera — (continuación)

Los importes que se indican con “-” equivalen a cero USD/EUR/GBP o son inferiores a 1000 USD/EUR/GBP.

La información sobre el valor liquidativo por acción representa las participaciones reembolsables denominadas en la respectiva moneda de cada clase de acciones correspondiente.

α A partir del 24 de marzo de 2023, FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^α y FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^α dejaron de cotizar.

β A partir de la fecha efectiva de 20 de abril de 2023, el FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^α dejó de cotizar.

γ A partir de la fecha efectiva de 20 de junio de 2023, se lanza el FTGF Martin Currie Improving Society Fund^α.

δ A partir del 17 de julio de 2023, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^α dejó de cotizar en bolsa.

α No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Estado del resultado 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	
	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022
(en miles)								
INGRESOS POR INVERSIONES:								
Ingresos brutos por dividendos e intereses de bonos	USD 23.172	USD 4.265	USD 3.280	USD 3.207	USD 25.271	USD 24.148	€ 1.391	€ 1.063
Interés	–	–	–	–	26	–	9	–
Compensación	–	–	–	–	(17)	2	–	–
Otros ingresos	–	–	–	–	–	–	–	–
Ganancia neta/(pérdida) sobre activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados:								
Ganancia neta realizada/(pérdida) sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	–	–	(963)	(14.071)	(40.143)	(80.758)	(7.880)	(1.805)
Ganancia neta no realizada/(pérdida) sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	–	–	(579)	(10.394)	31.447	(100.138)	9.820	(15.176)
Inversión total ingreso/(pérdida)	23.172	4.265	1.738	(21.258)	16.584	(156.746)	3.340	(15.918)
GASTOS:								
Comisiones de gestión (Nota 3)	2.612	2.535	535	725	2.985	3.948	18	16
Comisiones de rentabilidad (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Comisiones de Administrador y Depositario (Nota 3)	119	115	62	74	411	504	47	52
Comisiones de servicios a los accionistas (Nota 3)	–	–	58	90	140	169	1	1
Honorarios judiciales	15	–	2	3	15	16	1	1
Comisiones de auditoría	10	9	20	19	20	19	12	12
Gastos de impresión	2	33	–	9	–	49	2	5
Gastos de dividendos	–	–	–	–	–	–	–	–
Gastos por intereses	–	–	–	–	25	10	–	6
Honorarios de los Consejeros (Nota 3)	5	3	1	1	6	5	1	–
Ajuste de gastos acumulados y otros pasivos	–	–	–	–	–	–	–	–
Otros gastos	58	37	27	40	134	173	18	16
Total de gastos	2.821	2.732	705	961	3.736	4.893	100	109
Exenciones de gastos y reembolsos/deducciones (Nota 3)	–	(645)	(8)	(2)	(3)	–	–	–
Gastos netos totales	2.821	2.087	697	959	3.733	4.893	100	109
Ganancia neta/(pérdida) antes de costes financieros	20.351	2.178	1.041	(22.217)	12.851	(161.639)	3.240	(16.027)
COSTES FINANCIEROS:								
Distribuciones a los tenedores de acciones participativas rescatables (Nota 4)	(16.470)	(1.825)	(937)	(993)	(1.502)	(1.354)	(8)	(3)
Ganancia/(pérdida) del ejercicio financiero	3.881	353	104	(23.210)	11.349	(162.993)	3.232	(16.030)
Retenciones/(impuestos) sobre dividendos y otros impuestos	–	–	(4)	2	(92)	(106)	3	1
Aumento neto/(Disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	USD 3.881	USD 353	USD 100	USD (23.208)	USD 11.257	USD (163.099)	€ 3.235	€ (16.029)
(en miles)								
INGRESOS POR INVERSIONES:								
Ingresos brutos por dividendos e intereses de bonos	USD 2.026	USD 2.104	USD –	USD –	USD –	USD –	USD –	USD 1.650
Interés	1	–	–	–	–	–	–	–
Compensación	(7)	(1)	–	–	–	–	–	–
Otros ingresos	–	–	–	–	–	–	–	–
Ganancia neta/(pérdida) sobre activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados:								
Ganancia neta realizada/(pérdida) sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	(4.456)	(2.124)	–	–	–	–	–	(2.945)
Ganancia neta no realizada/(pérdida) sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	3.286	(8.536)	–	–	–	–	–	(1.696)
Inversión total ingreso/(pérdida)	850	(8.557)	–	–	–	–	–	(2.991)
GASTOS:								
Comisiones de gestión (Nota 3)	245	339	–	–	–	–	–	56
Comisiones de rentabilidad (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Comisiones de Administrador y Depositario (Nota 3)	23	27	–	–	–	–	–	17
Comisiones de servicios a los accionistas (Nota 3)	34	44	–	–	–	–	–	7
Honorarios judiciales	1	1	–	–	–	–	–	1
Comisiones de auditoría	13	13	–	–	–	–	–	14
Gastos de impresión	1	4	–	–	–	–	–	2
Gastos de dividendos	–	–	–	–	–	–	–	–
Gastos por intereses	–	1	–	–	–	–	–	–
Honorarios de los Consejeros (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ajuste de gastos acumulados y otros pasivos	–	–	–	–	–	–	–	–
Otros gastos	20	16	–	–	–	–	–	15
Total de gastos	337	445	–	–	–	–	–	112
Exenciones de gastos y reembolsos/deducciones (Nota 3)	(13)	(6)	–	–	–	–	–	(13)
Gastos netos totales	324	439	–	–	–	–	–	99
Ganancia neta/(pérdida) antes de costes financieros	526	(8.996)	–	–	–	–	–	(3.090)
COSTES FINANCIEROS:								
Distribuciones a los tenedores de acciones participativas rescatables (Nota 4)	(1,317)	(1.145)	–	–	–	–	–	(153)
Ganancia/(pérdida) del ejercicio financiero	(791)	(10.141)	–	–	–	–	–	(3.243)
Retenciones/(impuestos) sobre dividendos y otros impuestos	11	(31)	–	–	–	–	–	1
Aumento neto/(Disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	USD (780)	USD (10.172)	USD –	USD –	USD –	USD –	USD –	USD (3.242)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

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 [^]	
para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022
USD 18	USD 1.263	USD 6.617	USD 6.438	USD 4.660	USD 7.237	USD -	USD 935	USD -	USD 357
-	-	5	-	-	-	-	-	-	-
-	-	3	2	(1)	-	-	1	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	(1.074)	(10.176)	(4.430)	(6.518)	(10.347)	-	(1.747)	-	(5.080)
-	(3.503)	9.141	(34.486)	5.514	(19.738)	-	(1.113)	-	2.932
18	(3.314)	5.590	(32.476)	3.655	(22.848)	-	(1.924)	-	(1.791)
-	243	576	634	400	604	-	103	-	2
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	19	87	95	46	78	-	17	-	7
-	27	38	42	44	55	-	7	-	-
-	1	3	4	2	3	-	-	-	-
-	13	20	19	13	13	-	12	-	10
-	2	-	12	-	8	-	3	-	1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	2	1	1	-	-	-	-
-	-	1	1	1	1	-	-	-	-
18	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	14	28	59	23	36	-	26	-	10
18	319	753	868	530	799	-	168	-	30
-	(15)	-	-	(2)	-	-	(14)	-	(16)
18	304	753	868	528	799	-	154	-	14
-	(3.618)	4.837	(33.344)	3.127	(23.647)	-	(2.078)	-	(1.805)
-	(273)	(2.487)	(2.456)	(2.048)	(1.739)	-	(581)	-	(319)
-	(3.891)	2.350	(35.800)	1.079	(25.386)	-	(2.659)	-	(2.124)
-	(1)	(83)	(114)	11	(72)	-	(9)	-	10
USD -	USD (3.892)	USD 2.267	USD (35.914)	USD 1.090	USD (25.458)	USD -	USD (2.668)	USD -	USD (2.114)
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 [^]	
para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022
USD 9.496	USD 9.357	USD 7.014	USD 2.505	USD 2.861	USD 2.133	USD 754	USD 1.056	€ -	€ 404
1	2	11	-	3	-	1	-	-	-
(13)	-	(23)	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(7.794)	(6.813)	(1.114)	(9.961)	(4.499)	(4.143)	(4.558)	2.884	-	(3.793)
4.120	(44.878)	20.608	(51.207)	5.637	(19.964)	3.897	(11.850)	-	992
5.810	(42.332)	26.496	(58.663)	4.002	(21.974)	94	(7.910)	-	(2.397)
1.542	1.632	1.009	752	122	125	11	13	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
168	164	196	135	62	60	18	27	-	8
87	104	82	53	1	2	2	2	-	-
6	6	7	5	2	2	1	1	-	-
20	19	13	13	13	13	13	13	-	12
-	17	8	16	3	8	1	3	-	2
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1	-	4	5	1	1	-	1	-	14
2	2	3	1	1	1	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
54	75	50	49	32	36	11	13	-	3
1.880	2.019	1.372	1.029	237	248	57	73	-	39
-	-	-	-	-	-	-	-	-	(11)
1.880	2.019	1.372	1.029	237	248	57	73	-	28
3.930	(44.351)	25.124	(59.692)	3.765	(22.222)	37	(7.983)	-	(2.425)
(4.472)	(4.320)	(4.504)	(1.426)	-	-	-	-	-	(1)
(542)	(48.671)	20.620	(61.118)	3.765	(22.222)	37	(7.983)	-	(2.426)
(241)	(295)	14	-	(30)	(46)	-	(5)	-	-
USD (783)	USD (48.966)	USD 20.634	USD (61.118)	USD 3.735	USD (22.268)	USD 37	USD (7.988)	€ -	€ (2.426)

Estado del resultado global – (continuación)

	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 [^]	
	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022
(en miles)								
INGRESOS POR INVERSIONES:								
Ingresos brutos por dividendos e intereses de bonos	USD 55.517	USD 58.441	USD –	USD –	USD 11.110	USD 8.907	USD –	USD –
Interés	30	98	–	–	3	–	–	–
Compensación	(481)	(327)	–	–	(1)	–	–	–
Otros ingresos	–	–	–	–	–	–	–	–
Ganancia neta/(pérdida) sobre activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados:								
Ganancia neta realizada/(pérdida) sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	(19.221)	(477.283)	–	–	(1.601)	(46.892)	–	–
Ganancia neta no realizada/(pérdida) sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	70.165	(48.388)	–	–	7.693	(24.721)	–	–
Inversión total ingreso/(pérdida)	106.010	(467.459)	–	–	17.204	(62.706)	–	–
GASTOS:								
Comisiones de gestión (Nota 3)	10.631	17.305	–	–	158	161	–	–
Comisiones de rentabilidad (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Comisiones de Administrador y Depositario (Nota 3)	644	993	–	–	109	113	–	–
Comisiones de servicios a los accionistas (Nota 3)	767	1.201	–	–	–	–	–	–
Honorarios judiciales	14	62	–	–	3	10	–	–
Comisiones de auditoría	20	19	–	–	13	13	–	–
Gastos de impresión	–	143	–	–	7	27	–	–
Gastos de dividendos	–	–	–	–	–	–	–	–
Gastos por intereses	17	89	–	–	–	3	–	–
Honorarios de los Consejeros (Nota 3)	11	14	–	–	1	1	–	–
Ajuste de gastos acumulados y otros pasivos	–	–	–	–	–	–	–	–
Otros gastos	12	493	–	–	28	63	–	–
Total de gastos	12.116	20.319	–	–	319	391	–	–
Exenciones de gastos y reembolsos/deducciones (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Gastos netos totales	12.116	20.319	–	–	319	391	–	–
Ganancia neta/(pérdida) antes de costes financieros	93.894	(487.778)	–	–	16.885	(63.097)	–	–
COSTES FINANCIEROS:								
Distribuciones a los tenedores de acciones participativas rescatables (Nota 4)	(11.992)	(9.115)	–	–	(1.340)	(299)	–	–
Ganancia/(pérdida) del ejercicio financiero	81.902	(496.893)	–	–	15.545	(63.396)	–	–
Retenciones/(impuestos) sobre dividendos y otros impuestos	(2.088)	(4.053)	–	–	(38)	(83)	–	–
Aumento neto/(Disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	USD 79.814	USD (500.946)	USD –	USD –	USD 15.507	USD (63.479)	USD –	USD –
(en miles)								
INGRESOS POR INVERSIONES:								
Ingresos brutos por dividendos e intereses de bonos	USD 140	USD 118	USD 4.922	USD 3.864	USD 15.092	USD 10.072	USD 932	USD 356
Interés	–	–	1	–	–	2	–	–
Compensación	–	–	(12)	(21)	(12)	–	–	–
Otros ingresos	–	–	–	–	–	–	–	–
Ganancia neta/(pérdida) sobre activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados:								
Ganancia neta realizada/(pérdida) sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	(298)	524	(14.204)	(17.945)	(15.960)	(64.076)	265	(1.289)
Ganancia neta no realizada/(pérdida) sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	445	(1.495)	12.052	(16.282)	14.594	(20.744)	110	(284)
Inversión total ingreso/(pérdida)	287	(853)	2.759	(30.383)	13.714	(74.746)	1.307	(1.217)
GASTOS:								
Comisiones de gestión (Nota 3)	14	14	530	689	1.472	904	40	26
Comisiones de rentabilidad (Nota 3)	–	–	–	–	–	–	–	–
Comisiones de Administrador y Depositario (Nota 3)	10	10	66	72	177	226	11	7
Comisiones de servicios a los accionistas (Nota 3)	–	–	70	101	4	4	–	–
Honorarios judiciales	5	–	2	2	6	7	–	–
Comisiones de auditoría	9	9	20	19	13	13	13	13
Gastos de impresión	–	–	–	1	–	24	–	1
Gastos de dividendos	–	–	–	–	–	–	–	–
Gastos por intereses	–	–	1	2	1	21	1	–
Honorarios de los Consejeros (Nota 3)	–	–	1	–	3	2	–	–
Ajuste de gastos acumulados y otros pasivos	–	–	–	–	–	–	–	–
Otros gastos	12	9	28	21	44	82	7	7
Total de gastos	50	42	718	907	1.720	1.283	72	54
Exenciones de gastos y reembolsos/deducciones (Nota 3)	(29)	(21)	–	–	–	–	(15)	(20)
Gastos netos totales	21	21	718	907	1.720	1.283	57	34
Ganancia neta/(pérdida) antes de costes financieros	266	(874)	2.041	(31.290)	11.994	(76.029)	1.250	(1.251)
COSTES FINANCIEROS:								
Distribuciones a los tenedores de acciones participativas rescatables (Nota 4)	–	–	(925)	(349)	(1.217)	(668)	(4)	(3)
Ganancia/(pérdida) del ejercicio financiero	266	(874)	1.116	(31.639)	10.777	(76.697)	1.246	(1.254)
Retenciones/(impuestos) sobre dividendos y otros impuestos	–	(1)	5	(88)	125	(469)	–	(2)
Aumento neto/(Disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	USD 266	USD (875)	USD 1.121	USD (31.727)	USD 10.902	USD (77.166)	USD 1.246	USD (1.256)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

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

Estado del resultado global – (continuación)

	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 ^{^u}									
	para el período de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el período de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el período de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el período de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el período de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el período de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el período de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el período de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022								
(en miles)																
INGRESOS POR INVERSIONES:																
Ingresos brutos por dividendos e intereses de bonos	USD	–	USD	–	USD	2.580	USD	2.250	USD	539	USD	–	USD	7	USD	23
Interés		–		–		–		–		–		–		–		–
Compensación		–		–		–		–		–		–		–		–
Otros ingresos		–		–		–		–		–		–		–		–
Ganancia neta/(pérdida) sobre activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados:																
Ganancia neta realizada/(pérdida) sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación		–		–		(8.838)		(13.714)		(390)		–		(109)		(66)
Ganancia neta no realizada/(pérdida) sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación		–		–		6.230		(4.266)		404		–		(63)		(298)
Inversión total ingreso/(pérdida)		–		–		(28)		(15.730)		553		–		(165)		(341)
GASTOS:																
Comisiones de gestión (Nota 3)		–		–		1		1		27		–		1		5
Comisiones de rentabilidad (Nota 3)		–		–		–		–		–		–		–		–
Comisiones de Administrador y Depositario (Nota 3)		–		–		30		32		9		–		–		4
Comisiones de servicios a los accionistas (Nota 3)		–		–		–		–		–		–		–		–
Honorarios judiciales		–		–		1		2		–		–		–		–
Comisiones de auditoría		–		–		13		13		10		–		–		13
Gastos de impresión		–		–		2		6		1		–		–		–
Gastos de dividendos		–		–		–		–		–		–		–		–
Gastos por intereses		–		–		–		–		–		–		–		–
Honorarios de los Consejeros (Nota 3)		–		–		–		–		–		–		–		–
Ajuste de gastos acumulados y otros pasivos		–		–		–		–		–		–		–		–
Otros gastos		–		–		13		28		22		–		–		5
Total de gastos		–		–		60		82		69		–		1		27
Exenciones de gastos y reembolsos/deducciones (Nota 3)		–		–		(6)		(17)		(34)		–		–		(20)
Gastos netos totales		–		–		54		65		35		–		1		7
Ganancia neta/(pérdida) antes de costes financieros		–		–		(82)		(15.795)		518		–		(166)		(348)
COSTES FINANCIEROS:																
Distribuciones a los tenedores de acciones participativas rescatables (Nota 4)		–		–		–		–		(7)		–		–		–
Ganancia/(pérdida) del ejercicio financiero		–		–		(82)		(15.795)		511		–		(166)		(348)
Retenciones/(impuestos) sobre dividendos y otros impuestos		–		–		(41)		(79)		(7)		–		(2)		(6)
Aumento neto/(Disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	USD	–	USD	–	USD	(123)	USD	(15.874)	USD	504	USD	–	USD	(168)	USD	(354)

	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund		FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]									
	para el período de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el período de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el período de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el período de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el período de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el período de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el período de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el período de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022								
(en miles)																
INGRESOS POR INVERSIONES:																
Ingresos brutos por dividendos e intereses de bonos	USD	1.191	USD	2.171	USD	637	USD	853	USD	12.276	USD	9.634	USD	123	USD	123
Interés		–		–		–		–		–		–		–		–
Compensación		(5)		–		(1)		–		–		–		–		–
Otros ingresos		–		–		–		–		–		–		–		–
Ganancia neta/(pérdida) sobre activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados:																
Ganancia neta realizada/(pérdida) sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación		1.512		11.278		1.252		392		(8.928)		(14.603)		292		148
Ganancia neta no realizada/(pérdida) sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación		16.274		(85.884)		899		(4.703)		83.654		(164.705)		1.098		(1.866)
Inversión total ingreso/(pérdida)		18.972		(72.435)		2.787		(3.458)		87.002		(169.674)		1.513		(1.595)
GASTOS:																
Comisiones de gestión (Nota 3)		1.239		2.192		210		239		4.402		4.017		49		46
Comisiones de rentabilidad (Nota 3)		–		–		–		–		–		–		–		–
Comisiones de Administrador y Depositario (Nota 3)		91		165		18		18		620		526		8		8
Comisiones de servicios a los accionistas (Nota 3)		221		276		33		38		1.076		744		2		1
Honorarios judiciales		2		6		1		1		23		15		–		–
Comisiones de auditoría		20		20		13		13		15		11		7		6
Gastos de impresión		6		–		1		2		29		43		–		–
Gastos de dividendos		–		–		–		–		–		–		–		–
Gastos por intereses		–		–		–		–		27		9		–		–
Honorarios de los Consejeros (Nota 3)		1		2		–		–		9		6		–		–
Ajuste de gastos acumulados y otros pasivos		–		–		–		–		–		–		–		–
Otros gastos		31		36		17		16		189		122		10		9
Total de gastos		1.611		2.697		293		327		6.390		5.493		76		70
Exenciones de gastos y reembolsos/deducciones (Nota 3)		–		–		(22)		(18)		(46)		(45)		(15)		(13)
Gastos netos totales		1.611		2.697		271		309		6.344		5.448		61		57
Ganancia neta/(pérdida) antes de costes financieros		17.361		(75.132)		2.516		(3.767)		80.658		(175.122)		1.452		(1.652)
COSTES FINANCIEROS:																
Distribuciones a los tenedores de acciones participativas rescatables (Nota 4)		(57)		–		(80)		(117)		(100)		(58)		–		–
Ganancia/(pérdida) del ejercicio financiero		17.304		(75.132)		2.436		(3.884)		80.558		(175.180)		1.452		(1.652)
Retenciones/(impuestos) sobre dividendos y otros impuestos		(232)		(422)		(113)		(175)		(3.082)		(2.586)		(16)		(17)
Aumento neto/(Disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	USD	17.072	USD	(75.554)	USD	2.323	USD	(4.059)	USD	77.476	USD	(177.766)	USD	1.436	USD	(1.669)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

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

Estado del resultado global – (continuación)

	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund ^A				Legg Mason US Equity Fund ^A				Franklin MV European Equity Growth and Income Fund ^A				FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund ^{A,§}				
	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022		
(en miles)																	
INGRESOS POR INVERSIONES:																	
Ingresos brutos por dividendos e intereses de bonos	USD	44	USD	40	USD	–	USD	–	€	–	€	793	USD	749	USD	987	
Interés		–		–		–		–		–		–		–		–	
Compensación		–		–		–		–		–		–		–		–	
Otros ingresos		–		–		–		–		135		–		–		–	
Ganancia neta/(pérdida) sobre activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados:																	
Ganancia neta realizada/(pérdida) sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación		(113)		(131)		–		–		–		(706)		(2.379)		(507)	
Ganancia neta no realizada/(pérdida) sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación		78		(434)		–		–		–		(522)		2.918		(3.080)	
Inversión total ingreso/(pérdida)		9		(525)		–		–		135		(435)		1.288		(2.600)	
GASTOS:																	
Comisiones de gestión (Nota 3)		16		16		–		–		–		125		115		172	
Comisiones de rentabilidad (Nota 3)		–		–		–		–		–		–		–		–	
Comisiones de Administrador y Depositario (Nota 3)		4		4		–		–		–		8		6		11	
Comisiones de servicios a los accionistas (Nota 3)		–		–		–		–		–		12		17		27	
Honorarios judiciales		–		–		–		–		–		–		–		–	
Comisiones de auditoría		6		5		–		–		–		12		10		9	
Gastos de impresión		–		–		–		–		–		–		–		2	
Gastos de dividendos		–		–		–		–		–		–		–		–	
Gastos por intereses		–		–		–		–		–		2		–		–	
Honorarios de los Consejeros (Nota 3)		–		–		–		–		–		–		–		–	
Ajuste de gastos acumulados y otros pasivos		–		–		–		–		135		–		–		–	
Otros gastos		11		8		–		–		–		1		34		15	
Total de gastos		37		33		–		–		135		160		182		236	
Exenciones de gastos y reembolsos/deducciones (Nota 3)		(18)		(14)		–		–		–		(9)		(41)		(14)	
Gastos netos totales		19		19		–		–		135		151		141		222	
Ganancia neta/(pérdida) antes de costes financieros		(10)		(544)		–		–		–		(586)		1.147		(2.822)	
COSTES FINANCIEROS:																	
Distribuciones a los tenedores de acciones participativas rescatables (Nota 4)		–		–		–		–		–		(119)		(324)		(325)	
Ganancia/(pérdida) del ejercicio financiero		(10)		(544)		–		–		–		(705)		823		(3.147)	
Retenciones/(impuestos) sobre dividendos y otros impuestos		(7)		(7)		–		–		–		(226)		(11)		(100)	
Aumento neto/(Disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	USD	(17)	USD	(551)	USD	–	USD	–	€	–	€	(931)	USD	812	USD	(3.247)	

	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund ^A		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund ^A		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund ^A		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund ^A	
	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	
(en miles)								
INGRESOS POR INVERSIONES:								
Ingresos brutos por dividendos e intereses de bonos	USD	–	USD	–	€	–	€	–
Interés		–		–		–		–
Compensación		–		–		–		–
Otros ingresos		–		–		22		–
Ganancia neta/(pérdida) sobre activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados:								
Ganancia neta realizada/(pérdida) sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación		–		–		–		–
Ganancia neta no realizada/(pérdida) sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación		–		–		–		–
Inversión total ingreso/(pérdida)		–		–		22		–
GASTOS:								
Comisiones de gestión (Nota 3)		–		–		–		–
Comisiones de rentabilidad (Nota 3)		–		–		–		–
Comisiones de Administrador y Depositario (Nota 3)		–		–		–		–
Comisiones de servicios a los accionistas (Nota 3)		–		–		–		–
Honorarios judiciales		–		–		–		–
Comisiones de auditoría		–		–		–		–
Gastos de impresión		–		–		–		–
Gastos de dividendos		–		–		–		–
Gastos por intereses		–		–		–		–
Honorarios de los Consejeros (Nota 3)		–		–		–		–
Ajuste de gastos acumulados y otros pasivos		–		–		22		–
Otros gastos		–		–		–		–
Total de gastos		–		–		22		–
Exenciones de gastos y reembolsos/deducciones (Nota 3)		–		–		–		–
Gastos netos totales		–		–		22		–
Ganancia neta/(pérdida) antes de costes financieros		–		–		–		–
COSTES FINANCIEROS:								
Distribuciones a los tenedores de acciones participativas rescatables (Nota 4)		–		–		–		–
Ganancia/(pérdida) del ejercicio financiero		–		–		–		–
Retenciones/(impuestos) sobre dividendos y otros impuestos		–		–		–		–
Aumento neto/(Disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	USD	–	USD	–	€	–	€	–

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 ^{^j}												
para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022											
USD	-	USD	-	USD	-	USD	95	¥	-	¥	-	USD	4	USD	246					
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	9	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	-	1.634	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	-	(1.498)	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	9	231	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	-	24	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	-	2	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	-	2	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	-	13	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	9	-	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	-	19	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	9	60	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	-	(33)	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	9	27	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	-	204	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	-	(12)	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	-	192	-	-	-	-	-	-	-	-					
-	-	-	-	-	-	-	(26)	-	-	-	-	-	-	-	-					
USD	-	USD	-	USD	-	USD	166	¥	-	¥	-	USD	127	USD	(2.008)					
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 [^]		FTGF Martin Currie Improving Society Fund ^{^y}												
para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022											
USD	1.009	USD	956	USD	740	USD	804	USD	501	USD	537	€	1729	€	2.341	USD	12	USD	-	
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
(608)	(10.689)	(568)	(22)	(139)	(2.068)	(7.937)	(8.920)	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
13.455	(35.809)	(709)	(2.095)	468	(6.298)	8.269	(32.918)	(243)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
13.856	(45.542)	(539)	(1.313)	830	(7.829)	2.065	(39.497)	(230)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
517	545	107	125	182	201	357	507	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
63	57	12	12	17	18	80	100	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
58	59	33	38	9	10	4	10	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
2	2	-	-	-	1	3	3	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
10	10	10	10	6	6	10	7	3	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
2	5	-	1	1	2	3	8	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
1	-	-	-	-	-	1	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
23	21	16	16	20	23	6	25	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
676	699	178	202	235	261	464	668	21	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
-	-	(21)	(19)	(18)	(19)	-	(7)	(19)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
676	699	157	183	217	242	464	661	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
13.180	(46.241)	(696)	(1.496)	613	(8.071)	1.601	(40.158)	(232)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
-	-	(230)	(230)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
13.180	(46.241)	(926)	(1.726)	613	(8.071)	1.601	(40.158)	(232)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
(63)	(61)	(48)	(64)	(52)	(52)	(133)	(217)	(1)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
USD	13.117	USD	(46.302)	USD	(974)	USD	(1.790)	USD	561	USD	(8.123)	€	1.468	€	(40.375)	USD	(233)	USD	-	

Estado del resultado global – (continuación)

(en miles)	Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]		Franklin Templeton Global Funds Plc	
	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022
INGRESOS POR INVERSIONES:				
Ingresos brutos por dividendos e intereses de bonos	€ 1.623	€ –	USD 332.686	USD 278.665
Interés	5	–	205	110
Compensación	528	–	(269)	(106)
Otros ingresos	–	–	182	762
Ganancia neta/(pérdida) sobre activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados:				
Ganancia neta realizada/(pérdida) sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	(389)	–	(241.931)	(834.932)
Ganancia neta no realizada/(pérdida) sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	480	–	708.669	(1.602.174)
Inversión total ingreso/(pérdida)	2.247	–	799.542	(2.157.675)
GASTOS:				
Comisiones de gestión (Nota 3)	152	–	58.828	68.952
Comisiones de rentabilidad (Nota 3)	–	–	–	–
Comisiones de Administrador y Depositario (Nota 3)	29	–	6.381	6.826
Comisiones de servicios a los accionistas (Nota 3)	–	–	6.379	6.914
Honorarios judiciales	1	–	244	259
Comisiones de auditoría	9	–	629	696
Gastos de impresión	1	–	169	731
Gastos de dividendos	–	–	–	–
Gastos por intereses	–	–	94	345
Honorarios de los Consejeros (Nota 3)	–	–	90	71
Ajuste de gastos acumulados y otros pasivos	–	–	200	762
Otros gastos	11	–	1.901	2.649
Total de gastos	203	–	74.915	88.205
Exenciones de gastos y reembolsos/deducciones (Nota 3)	(1)	–	(392)	(1,112)
Gastos netos totales	202	–	74.523	87.093
Ganancia neta/(pérdida) antes de costes financieros	2.045	–	725.019	(2.244.768)
COSTES FINANCIEROS:				
Distribuciones a los tenedores de acciones participativas rescatables (Nota 4)	–	–	(84.425)	(49.425)
Ganancia/(pérdida) del ejercicio financiero	2.045	–	640.594	(2.294.193)
Retenciones/(impuestos) sobre dividendos y otros impuestos	(10)	–	(15.212)	(17.967)
Aumento neto/(Disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	€ 2.035	€ –	USD 625.382	USD (2.312.160)

Las cantidades designadas como “–” son o bien 0\$/€0/¥0/£0 o bien inferiores a 1000 \$ / 1000 € / 1000 ¥ / 1000 £.

Las pérdidas y ganancias proceden exclusivamente de operaciones continuadas, salvo en el caso del FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^], el FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^], el FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] y el FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^], que tienen operaciones interrumpidas. No hubo otras ganancias o pérdidas distintas a las tratadas en el Estado de resultado global.

Las cifras en euros de FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] y Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] se han convertido a dólares estadounidenses en la cifra total de Franklin Templeton Global Funds Plc a 31 de agosto de 2023 utilizando el tipo medio USD/EUR de 0,9186 (28 de febrero de 2023: 0,9590).

Las cifras en libras esterlinas del FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] se han convertido en dólares estadounidenses en la cifra total de Franklin Templeton Global Funds Plc a 31 de agosto de 2023 utilizando el tipo medio USD/GBP de 0,7973 (28 de febrero de 2023: 0,8252).

α A partir del 24 de marzo de 2023, FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] y FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^] dejaron de cotizar.

β A partir del 20 de abril de 2023, el FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] dejó de cotizar.

γ A partir del 20 de junio de 2023, se lanza el FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^].

δ A partir de la fecha efectiva de 17 de julio de 2023, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] dejó de cotizar en bolsa.

^ No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

[Esta página se ha dejado intencionadamente en blanco]

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable

(en miles)	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	
	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de diciembre de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de diciembre de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	USD 3.881	USD 353	USD 100	USD (23.208)	USD 11.257	USD (163.099)	€ 3.235	€ (16.029)
OPERACIONES CON PARTICIPACIONES REEMBOLSABLES								
Ingresos netos de la venta de acciones	892.129	785.309	93.855	16.134	154.975	406.503	804	7.423
Ingresos netos de distribuciones reinvertidas	15.427	851	603	374	509	428	4	1
Coste de las acciones readquiridas	(816.133)	(841.015)	(23.001)	(42.699)	(315.412)	(462.033)	(46.187)	(696)
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto de operaciones con Acciones reembolsables	91.423	(54.855)	71.457	(26.191)	(159.928)	(55.102)	(45.379)	6.728
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables	95.304	(54.502)	71.557	(49.399)	(148.671)	(218.201)	(42.144)	(9.301)
PATRIMONIO NETO ATRIBUIBLE A LOS TENEDORES DE ACCIONES PARTICIPATIVAS RESCATABLES								
Inicio del ejercicio	833.615	919.324	131.919	232.906	1.148.700	1.488.090	132.467	149.386
Conversión de divisas	-	-	-	-	-	-	-	-
Fin del ejercicio	USD 928.919	USD 864.822	USD 203.476	USD 183.507	USD 1.000.029	USD 1.269.889	€ 90.323	€ 140.085

(en miles)	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	
	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	USD (780)	USD (10.172)	USD -	USD -	USD -	USD -	USD -	USD (3.242)
OPERACIONES CON PARTICIPACIONES REEMBOLSABLES								
Ingresos netos de la venta de acciones	2.186	4.323	-	-	-	-	-	5.977
Ingresos netos de distribuciones reinvertidas	133	104	-	-	-	-	-	46
Coste de las acciones readquiridas	(7.287)	(14.246)	-	-	-	-	-	(52.270)
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto de operaciones con Acciones reembolsables	(4.968)	(9.819)	-	-	-	-	-	(46.247)
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables	(5.748)	(19.991)	-	-	-	-	-	(49.489)
PATRIMONIO NETO ATRIBUIBLE A LOS TENEDORES DE ACCIONES PARTICIPATIVAS RESCATABLES								
Inicio del ejercicio	57.431	81.978	-	-	-	-	-	59.525
Conversión de divisas	-	-	-	-	-	-	-	-
Fin del ejercicio	USD 51.683	USD 61.987	USD -	USD -	USD -	USD -	USD -	USD 10.036

(en miles)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund ^A		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund ^A		FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund ^A		Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund ^A	
	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	USD 79.814	USD (500.946)	USD -	USD -	USD 15.507	USD (63.479)	USD -	USD -
OPERACIONES CON PARTICIPACIONES REEMBOLSABLES								
Ingresos netos de la venta de acciones	94.495	260.281	-	-	24.364	39.773	-	-
Ingresos netos de distribuciones reinvertidas	374	349	-	-	-	-	-	-
Coste de las acciones readquiridas	(795.024)	(1.317.097)	-	-	(28.074)	(100.127)	-	-
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto de operaciones con Acciones reembolsables	(700.155)	(1.056.467)	-	-	(3.710)	(60.354)	-	-
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables	(620.341)	(1.557.413)	-	-	11.797	(123.833)	-	-
PATRIMONIO NETO ATRIBUIBLE A LOS TENEDORES DE ACCIONES PARTICIPATIVAS RESCATABLES								
Inicio del ejercicio	2.132.501	4.183.834	-	-	275.012	371.899	-	-
Conversión de divisas	-	-	-	-	-	-	-	-
Fin del ejercicio	USD 1.512.160	USD 2.626.421	USD -	USD -	USD 286.809	USD 248.066	USD -	USD -

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 [^]	
para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022
USD	- USD (3.892)	USD 2.267	USD (35.914)	USD 1.090	USD (25.458)	USD -	USD (2.668)	USD -	USD (2.114)
-	4.868	8.619	21.958	4.249	64.811	-	9.347	-	1
-	157	291	226	1.463	1.075	-	549	-	319
-	(15.363)	(16.369)	(36.977)	(26.183)	(109.343)	-	(3.141)	-	(26.054)
-	(10.338)	(7.459)	(14.793)	(20.471)	(43.457)	-	6.755	-	(25.734)
-	(14.230)	(5.192)	(50.707)	(19.381)	(68.915)	-	4.087	-	(27.848)
-	52.992	227.355	302.969	125.240	259.100	-	41.118	-	27.848
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
USD	- USD 38.762	USD 222.163	USD 252.262	USD 105.859	USD 190.185	USD -	USD 45.205	USD -	USD -

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 [^]	
para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022
USD (783)	USD (48.966)	USD 20.634	USD (61.118)	USD 3.735	USD (22.268)	USD 37	USD (7.988)	€ -	€ (2.426)
39.903	17.457	137.909	65.411	19.589	16.477	374	434	-	4
58	47	21	4	-	-	-	-	-	-
(83.420)	(35.776)	(208.326)	(80.735)	(15.563)	(38.046)	(15.102)	(3.164)	-	(35.026)
(43.459)	(18.272)	(70.396)	(15.320)	4.026	(21.569)	(14.728)	(2.730)	-	(35.022)
(44.242)	(67.238)	(49.762)	(76.438)	7.761	(43.837)	(14.691)	(10.718)	-	(37.448)
437.707	509.794	523.970	444.249	146.703	202.948	46.050	77.353	-	37.448
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
USD 393.465	USD 442.556	USD 474.208	USD 367.811	USD 154.464	USD 159.111	USD 31.359	USD 66.635	€ -	€ -

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 [^]	
para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022
USD 8.305	USD (39.224)	USD 3.744	USD (78.364)	£ (1.011)	£ (8.435)	USD 1.369	USD (37.349)	USD (298)	USD (3.224)
253	9.235	2.928	44.563	-	69.541	41	133.770	172	328
-	-	-	-	-	-	-	-	442	275
(52.040)	(366.026)	-	(345)	-	(69.541)	(40.895)	(130.219)	(120)	(342)
(51.787)	(356.791)	2.928	44.218	-	-	(40.854)	3.551	494	261
(43.482)	(396.015)	6.672	(34.146)	(1.011)	(8.435)	(39.485)	(33.798)	196	(2.963)
559.548	1.057.941	1.119.507	1.147.280	45.912	73.633	94.775	175.169	18.441	21.958
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
USD 516.066	USD 661.926	USD 1.126.179	USD 1.113.134	£ 44.901	£ 65.198	USD 55.290	USD 141.371	USD 18.637	USD 18.995

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables (continuación)

(en miles)	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 [^]								
	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022							
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	USD	266USD	(875)	USD	1.121	USD	(31.727)	USD	10.902	USD	(77.166)	USD	1.246	USD	(1.256)
OPERACIONES CON PARTICIPACIONES REEMBOLSABLES															
Ingresos netos de la venta de acciones		–	–	11.355		37.486		18.678		10.821		12.804		19	
Ingresos netos de distribuciones reinvertidas		–	–	297		79		9		5		1		1	
Coste de las acciones readquiridas		(50)	(6)	(20.656)		(35.094)		(312.850)		(148.873)		(123)		–	
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto de operaciones con participaciones reembolsables		(50)	(6)	(9.004)		2.471		(294.163)		(138.047)		12.682		20	
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables		216	(881)	(7.883)		(29.256)		(283.261)		(215.213)		13.928		(1.236)	
PATRIMONIO NETO ATRIBUIBLE A LOS TENEDORES DE ACCIONES PARTICIPATIVAS RESCATABLES															
Inicio del ejercicio		8.995	9.866	162.009		215.635		539.271		752.718		10.394		11.590	
Conversión de divisas		–	–	–		–		–		–		–		–	
Fin del ejercicio	USD	9.211USD	8.985	USD	154.126	USD	186.379	USD	256.010	USD	537.505	USD	24.322	USD	10.354

(en miles)	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 [^]									
	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022								
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	USD	–	USD	–	USD	(123)	USD	(15.874)	USD	504	USD	–	USD	(168)	USD	(354)
OPERACIONES CON PARTICIPACIONES REEMBOLSABLES																
Ingresos netos de la venta de acciones		–	–	–		112		4		–		–		69		
Ingresos netos de distribuciones reinvertidas		–	–	–		–		4		–		–		–		
Coste de las acciones readquiridas		–	–	–		(17.709)		–		–		(2.366)		(7)		
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto de operaciones con Acciones reembolsables		–	–	–		(17.597)		8		–		(2.366)		62		
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables		–	–	(123)		(33.471)		512		–		(2.534)		(292)		
PATRIMONIO NETO ATRIBUIBLE A LOS TENEDORES DE ACCIONES PARTICIPATIVAS RESCATABLES																
Inicio del ejercicio		–	–	69.410		104.231		14.804		–		2.534		2.177		
Conversión de divisas		–	–	–		–		–		–		–		–		
Fin del ejercicio	USD	–	USD	–	USD	69.287	USD	70.760	USD	15.316	USD	–	USD	–	USD	1.885

(en miles)	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund		FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]									
	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022								
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	USD	17.072	USD	(75.554)	USD	2.323	USD	(4.059)	USD	77.476	USD	(177.766)	USD	1.436	USD	(1.669)
OPERACIONES CON PARTICIPACIONES REEMBOLSABLES																
Ingresos netos de la venta de acciones		8.484		4.589		811		3.404		319.430		614.239		1.002		211
Ingresos netos de distribuciones reinvertidas		–		–		4		3		–		–		–		–
Coste de las acciones readquiridas		(34.433)		(54.880)		(6.138)		(2.023)		(442.334)		(402.757)		(740)		(1.888)
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto de operaciones con Acciones reembolsables		(25.949)		(50.291)		(5.323)		1.384		(122.904)		211.482		262		(1.677)
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables		(8.877)		(125.845)		(3.000)		(2.675)		(45.428)		33.716		1.698		(3.346)
PATRIMONIO NETO ATRIBUIBLE A LOS TENEDORES DE ACCIONES PARTICIPATIVAS RESCATABLES																
Inicio del ejercicio		224.793		538.159		38.528		43.279		1.639.979		1.599.315		13.179		16.018
Conversión de divisas		–		–		–		–		–		–		–		–
Fin del ejercicio	USD	215.916	USD	412.314	USD	35.528	USD	40.604	USD	1.594.551	USD	1.633.031	USD	14.877	USD	12.672

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 ^{^α}							
para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022						
USD	2.545	USD	(34.454)	USD	-	USD	(208.762)	USD	(1.228)	USD	(1.065)	USD	(497)	USD	(2.300)
	27.081		1.598		-		134.138		2.279		1.476		-		-
	7		3		-		237		-		-		-		1
	(27.005)		(9.529)		-		(174.889)		(14.541)		(1.565)		(7.892)		-
	83		(7.928)		-		(40.514)		(12.262)		(89)		(7.892)		1
	2.628		(42.382)		-		(25.352)		(13.490)		(1.154)		(8.389)		(2.299)
	205.146		244.396		-		1.210.305		46.756		52.386		8.389		10.163
	-		-		-		-		-		-		-		-
USD	207.774	USD	202.014	USD	-	USD	1.184.953	USD	33.266	USD	51.232	USD	-	USD	7.864

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							
para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022						
USD	47.156	USD	(88.725)	USD	-	USD	-	USD	26.329	USD	(15.091)	USD	287.882	USD	(280.810)
	185.570		183.445		-		-		14.365		14.256		363.086		213.856
	1		4		-		-		2		-		-		-
	(203.380)		(105.991)		-		-		(31.702)		(22.771)		(336.322)		(419.098)
	(17.809)		77.458		-		-		(17.335)		(8.515)		26.764		(205.242)
	29.347		(11.267)		-		-		8.994		(23.606)		314.646		(486.052)
	929.726		892.238		-		-		189.610		213.480		1.225.735		1.772.695
	-		-		-		-		-		-		-		-
USD	959.073	USD	880.971	USD	-	USD	-	USD	198.604	USD	189.874	USD	1.540.381	USD	1.286.643

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							
para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022						
€	(20.220)	€	107.781	USD	-	USD	(299)	USD	(313)	USD	(114.946)	USD	3.186	USD	(7.109)
	190.309		561.163		-		15		31.752		305.392		19.906		4.716
	13		11		-		1		1.181		496		-		-
	(358.725)		(255.798)		-		(2)		(59.438)		(44.110)		(8.755)		(10.172)
	(168.403)		305.376		-		14		(26.505)		261.778		11.151		(5.456)
	(188.623)		413.157		-		(285)		(40.823)		240.679		14.337		(12.565)
	1.062.833		671.424		-		2.665		406.048		173.394		78.098		87.935
	-		-		-		-		-		-		-		-
€	874.210	€	1.084.581	USD	-	USD	2.380	USD	365.225	USD	414.073	USD	92.435	USD	75.370

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables (continuación)

(en miles)	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund ^A				Legg Mason US Equity Fund ^A				Franklin MV European Equity Growth and Income Fund ^A				FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund ^{A,§}			
	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	
	USD		USD		USD		USD		€		€		USD		USD	
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	USD	(17)	USD	(551)	USD	-	USD	-	€	-	€	(931)	USD	812	USD	(3.247)
OPERACIONES CON PARTICIPACIONES REEMBOLSABLES																
Ingresos netos de la venta de acciones		9		1		-		-		-		305		53		1.589
Ingresos netos de distribuciones reinvertidas		-		-		-		-		-		-		98		88
Coste de las acciones readquiridas		(17)		-		-		-		-		(27.711)		(22.053)		(3.353)
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto de operaciones con Acciones reembolsables		(8)		1		-		-		-		(27.406)		(21.902)		(1.676)
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables		(25)		(550)		-		-		-		(28.337)		(21.090)		(4.923)
PATRIMONIO NETO ATRIBUIBLE A LOS TENEDORES DE ACCIONES PARTICIPATIVAS RESCATABLES																
Inicio del ejercicio		4.254		4.534		-		-		-		28.337		21.090		25.883
Conversión de divisas		-		-		-		-		-		-		-		-
Fin del ejercicio	USD	4.229	USD	3.984	USD	-	USD	-	€	-	€	-	USD	-	USD	20.960

(en miles)	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund ^A				Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund ^A				Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund ^A				Legg Mason Martin Currie Greater China Fund ^A			
	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	
	USD		USD		€		€		USD		USD		USD		USD	
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	USD	-	USD	-	€	-	€	-	USD	-	USD	-	USD	-	USD	-
OPERACIONES CON PARTICIPACIONES REEMBOLSABLES																
Ingresos netos de la venta de acciones		-		-		-		-		-		-		-		-
Ingresos netos de distribuciones reinvertidas		-		-		-		-		-		-		-		-
Coste de las acciones readquiridas		-		-		-		-		-		-		-		-
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto de operaciones con participaciones reembolsables		-		-		-		-		-		-		-		-
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables		-		-		-		-		-		-		-		-
PATRIMONIO NETO ATRIBUIBLE A LOS TENEDORES DE ACCIONES PARTICIPATIVAS RESCATABLES																
Inicio del ejercicio		-		-		-		-		-		-		-		-
Conversión de divisas		-		-		-		-		-		-		-		-
Fin del ejercicio	USD	-	USD	-	€	-	€	-	USD	-	USD	-	USD	-	USD	-

(en miles)	Franklin Renta responsable 2028 Fondo ^A				Franklin Templeton Global Funds Plc			
	Para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023		para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	
	€		€		USD		USD	
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	€	2.035	€	-	USD	625.382	USD	(2.312.160)
OPERACIONES CON PARTICIPACIONES REEMBOLSABLES								
Ingresos netos de la venta de acciones		70.915		-		3.075.829		4.431.367
Ingresos netos de distribuciones reinvertidas		-		-		21.345		5.801
Coste de las acciones readquiridas		(21.981)		-		(4.853.609)		(6.180.820)
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto de operaciones con Acciones reembolsables		48.934		-		(1.756.435)		(1.743.652)
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables		50.969		-		(1.131.053)		(4.055.812)
PATRIMONIO NETO ATRIBUIBLE A LOS TENEDORES DE ACCIONES PARTICIPATIVAS RESCATABLES								
Inicio del ejercicio		36.823		-		17.428.030		22.628.678
Conversión de divisas		-		-		41.600		(162.565)
Fin del ejercicio	€	87.792	€	-	USD	16.338.577	USD	18.410.301

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 ^{^j}							
para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022						
USD	-	USD	-	USD	-	USD	166	¥	-	¥	-	USD	127	USD	(2.008)
	-		-		-		-		-		-		12		27
	-		-		-		-		-		-		3		2
	-		-		-		(12.709)		-		-		(3.680)		(265)
	-		-		-		(12.709)		-		-		(3.665)		(236)
	-		-		-		(12.543)		-		-		(3.538)		(2.244)
	-		-		-		12.543		-		-		3.538		16.118
	-		-		-		-		-		-		-		-
USD	-	USD	-	USD	-	USD	-	¥	-	¥	-	USD	-	USD	13.874

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 [^]		FTGF Martin Currie Improving Society Fund ^{^y}											
para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2023	para el periodo de seis meses finalizado el 31 de agosto de 2022										
USD	13.117	USD	(46.302)	USD	(974)	USD	(1.790)	USD	561	USD	(8.123)	€	1.468	€	(40.375)	USD	(233)	USD	-
	14.413		56.471		51		657		1.447		11.301		9.972		23.179		4.999		-
	-		-		161		146		-		-		-		-		-		-
	(18.006)		(28.057)		(3.862)		(1.412)		(3.745)		(17.015)		(12.218)		(86.025)		-		-
	(3.593)		28.414		(3.650)		(609)		(2.298)		(5.714)		(2.246)		(62.846)		4.999		-
	9.524		(17.888)		(4.624)		(2.399)		(1.737)		(13.837)		(778)		(103.221)		4.766		-
	141.049		169.381		25.121		27.934		34.702		47.838		189.097		303.590		-		-
	-		-		-		-		-		-		-		-		-		-
USD	150.573	USD	151.493	USD	20.497	USD	25.535	USD	32.965	USD	34.001	€	188.319	€	200.369	USD	4.766	USD	-

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables — (continuación)

Los importes designados como “-” son cero USD/EUR/JPY/GBP o menos de 1.000 USD/EUR/JPY/GBP.

Todas las cifras en euros, excepto las correspondientes al patrimonio neto atribuible a los titulares de acciones rescatables al inicio del periodo, de FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^α, FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^α, FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^α y Franklin Responsible Income 2028 Fund^α se han convertido a dólares estadounidenses en la cifra total de Franklin Templeton Global Funds Plc correspondiente al periodo financiero finalizado el 31 de agosto de 2023, utilizando el tipo medio USD/EUR de 0,9186 (28 de febrero de 2023: 0,9590).

Los activos netos atribuibles a los titulares de acciones rescatables de FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^α, FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^α, FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^α y Franklin Responsible Income 2028 Fund^α se han convertido a dólares estadounidenses en la cifra total utilizando el tipo de cambio de cierre USD/EUR a 28 de febrero de 2023 de 0,9454 (28 de febrero de 2022: 0,8919).

Todas las cifras en libras esterlinas, a excepción de los Activos netos atribuibles a los titulares de acciones rescatables, correspondientes al FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^α se han convertido a dólares estadounidenses en la cifra total correspondiente a Franklin Templeton Global Funds Plc para el periodo financiero finalizado el 31 de agosto de 2023, utilizando el tipo medio USD/GBP de 0,7973 (28 de febrero de 2023: 0,8252).

Los Activos netos atribuibles a los titulares de acciones rescatables del FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^α al inicio del periodo se han convertido a dólares estadounidenses en la cifra total utilizando el tipo de cambio de cierre USD/GBP a 28 de febrero de 2023 de 0,8314 (28 de febrero de 2022: 0,7454).

α A partir de la fecha efectiva de 24 de marzo de 2023, FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^α y FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^α dejaron de cotizar.

β A partir de la fecha efectiva de 20 de abril de 2023, el FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^α dejó de cotizar.

γ A partir de la fecha efectiva de 20 de junio de 2023, se lanza el FTGF Martin Currie Improving Society Fund^α.

δ A partir de la fecha efectiva de 17 de julio de 2023, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^α dejó de cotizar en bolsa.

α No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables – (continuación)

	Correspondiente al ejercicio cerrado			Correspondiente al ejercicio cerrado	
	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)		31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund			(Disminución)/aumento neto	(3)	1
Clase A USD de Capitalización			Clase GA USD de Capitalización		
Vendido	878	1.094	Redimido	–	(1)
Redimido	(672)	(904)	Disminución neta	–	(1)
Aumento neto	206	190			
Clase A USD de Distribución (D)			FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Vendido	604.431	320.506	Clase A USD de Capitalización		
Redimido	(516.730)	(414.297)	Vendido	57	80
Aumento/(disminución) neto	87.701	(93.791)	Redimido	(93)	(134)
Clase B USD de Capitalización			Disminución neta	(36)	(54)
Redimido	(1)	–	Clase A USD de Distribución (D)		
Disminución neta	(1)	–	Vendido	56	106
Clase B USD de Distribución (D)			Redimido	(26)	(160)
Vendido	–	218	Aumento/(disminución) neto	30	(54)
Redimido	(44)	–	Clase A USD de Distribución (M) Plus		
(Disminución)/aumento neto	(44)	218	Vendido	1	4
Clase C USD de Capitalización			Redimido	(7)	(21)
Redimido	–	(2)	Disminución neta	(6)	(17)
Disminución neta	–	(2)	Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus		
Clase C USD de Distribución (D)			Vendido	8	59
Redimido	(134)	–	Redimido	(105)	(4)
Disminución neta	(134)	–	(Disminución)/aumento neto	(97)	55
Clase X USD de Distribución (D)			Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)		
Vendido	212.512	351.147	Vendido	–	1
Redimido	(231.821)	(332.929)	Redimido	–	(5)
Aumento/(disminución) neto	(19.309)	18.218	Disminución neta	–	(4)
Clase A (G) USD de Distribución (D)			Clase C USD de Capitalización		
Vendido	4	35	Vendido	15	2
Redimido	–	(72)	Redimido	(7)	(33)
Aumento/(disminución) neto	4	(37)	Aumento/(disminución) neto	8	(31)
			Clase C USD de Distribución (D)		
FTGF Western Asset US Core Bond Fund			Vendido	5	1
Clase A USD de Capitalización			Redimido	(3)	(10)
Vendido	40	35	Aumento/(disminución) neto	2	(9)
Redimido	(36)	(43)	Clase E USD de Capitalización		
Aumento/(disminución) neto	4	(8)	Vendido	5	7
Clase A USD de Distribución (D)			Redimido	(13)	(60)
Vendido	46	48	Disminución neta	(8)	(53)
Redimido	(27)	(59)	Clase F USD de Capitalización		
Aumento/(disminución) neto	19	(11)	Vendido	598	1.705
Clase C USD de Capitalización			Redimido	(1.628)	(2.608)
Vendido	2	–	Disminución neta	(1.030)	(903)
Redimido	(12)	(15)	Clase B USD de Distribución (D)		
Disminución neta	(10)	(15)	Vendido	55	11
Clase C USD de Distribución (D)			Redimido	(54)	(28)
Vendido	1	1	Aumento/(disminución) neto	1	(17)
Redimido	(2)	(6)	Clase X USD de Capitalización		
Disminución neta	(1)	(5)	Vendido	13	2
Clase E USD de Capitalización			Redimido	(4)	(9)
Vendido	3	–	Aumento/(disminución) neto	9	(7)
Redimido	(1)	(11)	Clase X USD de Distribución (D)		
Aumento/(disminución) neto	2	(11)	Vendido	1	8
Clase F USD de Capitalización			Redimido	(1)	(2)
Vendido	668	53	Aumento neto	–	6
Redimido	(30)	(211)	Clase X EUR de Capitalización (Cubierta)		
Aumento/(disminución) neto	638	(158)	Redimido	(1)	(3)
Clase F USD de Distribución (D)			Disminución neta	(1)	(3)
Vendido	74	3	Clase Premier USD de Capitalización		
Redimido	(15)	(21)	Vendido	407	1.030
Aumento/(disminución) neto	59	(18)	Redimido	(688)	(629)
Clase X USD de Capitalización			Aumento/(disminución) neto	(281)	401
Vendido	–	1	Clase Premier USD de Distribución (M)		
Redimido	(1)	(1)	Vendido	6	4
Disminución neta	(1)	–	Redimido	–	(1)
Clase Premier USD de Capitalización			Aumento neto	6	3
Redimido	(85)	–	Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)		
Disminución neta	(85)	–	Vendido	60	146
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)			Redimido	–	(18)
Vendido	–	1	Aumento neto	60	128
Redimido	–	(2)			
Disminución neta	–	(1)			
Clase LM EUR de Capitalización					
Vendido	1	2			
Redimido	(4)	(1)			

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables – (continuación)

	Correspondiente al ejercicio cerrado			Correspondiente al ejercicio cerrado	
	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)		31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund (continuación)					
Clase LM USD de Distribución (M)					
Vendido	7	28			
Redimido	(35)	(33)			
Disminución neta	(28)	(5)			
Clase LM EUR de Capitalización					
Redimido	(8)	(1)			
Disminución neta	(8)	(1)			
Clase A (G) USD de Distribución (D)					
Redimido	(1)	(2)			
Disminución neta	(1)	(2)			
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund					
Clase A USD de Distribución (D)					
Vendido	4	–			
Aumento neto	4	–			
Clase A EUR de Distribución (D)					
Redimido	–	(1)			
Disminución neta	–	(1)			
Clase Premier EUR de Capitalización					
Vendido	5	76			
Redimido	(33)	(4)			
(Disminución)/aumento neto	(28)	72			
Clase LM EUR de Capitalización					
Redimido	(450)	(1)			
Disminución neta	(450)	(1)			
Clase GA EUR de Capitalización					
Redimido	(1)	–			
Disminución neta	(1)	–			
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund^A					
Clase A USD de Capitalización					
Vendido	–	4			
Redimido	–	(57)			
Disminución neta	–	(53)			
Clase A USD de Distribución (D)					
Vendido	–	5			
Redimido	–	(25)			
Disminución neta	–	(20)			
Clase A EUR de capitalización (cubierta)					
Vendido	–	1			
Redimido	–	(1)			
Disminución neta	–	–			
Clase A HKD de Distribución (M) Plus					
Vendido	–	2			
Redimido	–	(12)			
Disminución neta	–	(10)			
Clase C USD de Capitalización					
Vendido	–	9			
Redimido	–	(10)			
Disminución neta	–	(1)			
Clase C USD de Distribución (D)					
Redimido	–	(22)			
Disminución neta	–	(22)			
Clase F USD de Capitalización					
Redimido	–	(2)			
Disminución neta	–	(2)			
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	–	23			
Redimido	–	(1)			
Aumento neto	–	22			
Clase A (G) USD de Distribución (D)					
Redimido	–	(2)			
Disminución neta	–	(2)			
Clase L (G) USD de Capitalización					
Redimido	–	(1)			
Disminución neta	–	(1)			
Clase L (G) USD de Distribución (D)					
Redimido	–	(1)			
Disminución neta	–	(1)			
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund					
Clase A USD de Capitalización					
Vendido	15	4			
Redimido	–	–			
Aumento neto	15	4			
Clase A USD de Distribución (D)					
Vendido	–	–			
Redimido	–	–			
Disminución neta	–	–			
Clase A EUR de Distribución (D)					
Vendido	–	–			
Redimido	–	–			
Disminución neta	–	–			
Clase A EUR de Distribución (M) Plus					
Vendido	–	–			
Redimido	–	–			
Disminución neta	–	–			
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	–	–			
Redimido	–	–			
Disminución neta	–	–			
Clase A HKD de Distribución (M) (Cubierta)					
Vendido	–	–			
Redimido	–	–			
Disminución neta	–	–			
Clase A HKD de Distribución (M) Plus					
Vendido	–	–			
Redimido	–	–			
Disminución neta	–	–			
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido	–	–			
Redimido	–	–			
Disminución neta	–	–			
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido	–	–			
Redimido	–	–			
Disminución neta	–	–			
Clase B USD de Distribución (D)					
Vendido	–	–			
Redimido	–	–			
Disminución neta	–	–			
Clase C USD de Capitalización					
Vendido	–	–			
Redimido	–	–			
Disminución neta	–	–			
Clase C USD de Distribución (D)					
Vendido	–	–			
Redimido	–	–			
Disminución neta	–	–			
Clase C USD de Distribución (D)					
Vendido	–	–			
Redimido	–	–			
Disminución neta	–	–			
Clase E USD de Distribución (D)					
Vendido	–	–			
Redimido	–	–			
Disminución neta	–	–			
Clase F USD de Capitalización					
Vendido	–	–			
Redimido	–	–			
Disminución neta	–	–			
Clase X USD de Distribución (D)					
Vendido	–	–			
Redimido	–	–			
Disminución neta	–	–			
Clase X EUR de Distribución (D)					
Vendido	–	–			
Redimido	–	–			
Disminución neta	–	–			
Clase X EUR de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	–	–			
Redimido	–	–			
Disminución neta	–	–			
Clase Premier USD de Capitalización					
Vendido	–	–			
Redimido	–	–			
Disminución neta	–	–			
Clase Premier USD de Distribución (M)					
Vendido	–	–			
Redimido	–	–			
Disminución neta	–	–			
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	–	–			
Redimido	–	–			
Disminución neta	–	–			
Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	–	–			
Redimido	–	–			
Disminución neta	–	–			

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables – (continuación)

	Correspondiente al ejercicio cerrado			Correspondiente al ejercicio cerrado	
	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)		31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund (continuación)					
Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta)					
Redimido	(2)	(13)			
Disminución neta	(2)	(13)			
Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)					
Vendido	–	1			
Redimido	(5)	(17)			
Disminución neta	(5)	(16)			
Clase Premier AUD de Distribución (M) (Cubierta)					
Vendido	42	28			
Aumento neto	42	28			
FTGF Western Asset US High Yield Fund					
Clase A USD de Capitalización					
Vendido	4	15			
Redimido	(16)	(16)			
Disminución neta	(12)	(1)			
Clase A USD de Distribución (D)					
Vendido	12	7			
Redimido	(38)	(19)			
Disminución neta	(26)	(12)			
Clase A USD de Distribución (M) Plus					
Vendido	4	1			
Redimido	(7)	(12)			
Disminución neta	(3)	(11)			
Clase A USD de Distribución (M)					
Vendido	1	4			
Redimido	(3)	(9)			
Disminución neta	(2)	(5)			
Clase A EUR de Distribución (M) (Cubierta)					
Vendido	–	4			
Redimido	(1)	–			
(Disminución)/aumento neto	(1)	4			
Clase A HKD de Distribución (M) Plus					
Vendido	2	–			
Redimido	(1)	–			
Aumento neto	1	–			
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido	66	6			
Redimido	(19)	(145)			
Aumento/(disminución) neto	47	(139)			
Clase B USD de Capitalización					
Redimido	–	(2)			
Disminución neta	–	(2)			
Clase B USD de Distribución (D)					
Redimido	(1)	–			
Disminución neta	(1)	–			
Clase C USD de Capitalización					
Vendido	–	8			
Redimido	(1)	–			
(Disminución)/aumento neto	(1)	8			
Clase C USD de Distribución (D)					
Vendido	–	1			
Redimido	(6)	(4)			
Disminución neta	(6)	(3)			
Clase E USD de Capitalización					
Vendido	–	5			
Redimido	(5)	(4)			
(Disminución)/aumento neto	(5)	1			
Clase E USD de Distribución (D)					
Vendido	–	1			
Redimido	(2)	–			
(Disminución)/aumento neto	(2)	1			
Clase F USD de Capitalización					
Vendido	–	12			
Redimido	(2)	(19)			
Disminución neta	(2)	(7)			
Clase B USD de Distribución (D)					
Vendido	–	2			
Aumento neto	–	2			
Clase Premier USD de Capitalización					
Vendido	13	327			
Redimido	(104)	(560)			
Disminución neta	(91)	(233)			
Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	5	–			
Aumento neto	5	–			
Clase 5 EUR de Distribución (M) (Cubierta)					
Vendido	–	1			
Aumento neto	–	1			
Clase LM USD de Capitalización					
Redimido	–	(17)			
Disminución neta	–	(17)			
Clase LM USD de Distribución (M)					
Vendido	12	8			
Aumento neto	12	8			
Clase A (G) USD de Distribución (D)					
Vendido	1	–			
Redimido	(1)	–			
Aumento neto	–	–			
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^]					
Clase A USD de Capitalización					
Redimido	–	(8)			
Disminución neta	–	(8)			
Clase A USD de Distribución (D)					
Redimido	–	(6)			
Disminución neta	–	(6)			
Clase A USD de Distribución (M) Plus					
Vendido	–	19			
Aumento neto	–	19			
Clase A USD de Distribución (M)					
Redimido	–	(1)			
Disminución neta	–	(1)			
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)					
Redimido	–	(1)			
Disminución neta	–	(1)			
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido	–	5			
Redimido	–	(3)			
Aumento neto	–	2			
Clase C USD de Capitalización					
Redimido	–	(2)			
Disminución neta	–	(2)			
Clase E USD de Distribución (D)					
Redimido	–	(1)			
Disminución neta	–	(1)			
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)					
Redimido	–	(6)			
Disminución neta	–	(6)			
Clase LM USD de Distribución (M) (Cubierta)					
Vendido	–	102			
Aumento neto	–	102			
FTGF Western Asset Global High Yield Fund					
Clase A USD de Capitalización					
Vendido	3	3			
Redimido	(5)	(6)			
Disminución neta	(2)	(3)			
Clase A USD de Distribución (D)					
Vendido	1	4			
Redimido	(2)	(7)			
Disminución neta	(1)	(3)			
Clase A USD de Distribución (M) Plus					
Vendido	–	8			
Redimido	(12)	(51)			
Disminución neta	(12)	(43)			
Clase A USD de Distribución (M)					
Vendido	1	2			
Redimido	(15)	(18)			
Disminución neta	(14)	(16)			
Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido	3	7			
Redimido	(17)	(17)			
Disminución neta	(14)	(10)			
Clase A EUR de Capitalización					
Redimido	(1)	–			
Disminución neta	(1)	–			
Clase A EUR de Distribución (D) (Cubierta)					
Vendido	–	1			
Aumento neto	–	1			
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido	508	333			
Redimido	(482)	(297)			
Aumento neto	26	36			

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables – (continuación)

	Correspondiente al ejercicio cerrado			Correspondiente al ejercicio cerrado	
	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)		31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)
FTGF Western Asset Global High Yield Fund (continuación)					
Clase B USD de Distribución (D)					
Redimido	–	(3)			
Disminución neta	–	(3)			
Clase C USD de Capitalización					
Redimido	–	(2)			
Disminución neta	–	(2)			
Clase C USD de Distribución (D)					
Vendido	1	–			
Redimido	(5)	(2)			
Disminución neta	(4)	(2)			
Clase E USD de Capitalización					
Redimido	(2)	–			
Disminución neta	(2)	–			
Clase F USD de Capitalización					
Vendido	5	9			
Redimido	(5)	(6)			
Aumento neto	–	3			
Clase B USD de Distribución (D)					
Redimido	(1)	(4)			
Disminución neta	(1)	(4)			
Clase X USD de Distribución (D)					
Vendido	2	2			
Redimido	(4)	(4)			
Disminución neta	(2)	(2)			
Clase X GBP de Distribución (D) (Cubierta)					
Vendido	5	4			
Redimido	(4)	(2)			
Aumento neto	1	2			
Clase Premier USD de Capitalización					
Redimido	–	(23)			
Disminución neta	–	(23)			
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	–	1			
Redimido	(5)	–			
(Disminución)/aumento neto	(5)	1			
Clase S Euro de Distribución (M) (Cubierta)					
Vendido	–	1			
Aumento neto	–	1			
Clase A (G) USD de Capitalización					
Redimido	(4)	–			
Disminución neta	(4)	–			
Clase A (G) USD de Distribución (D)					
Redimido	(1)	–			
Disminución neta	(1)	–			
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^]					
Clase A USD de Capitalización					
Vendido	–	17			
Redimido	–	(4)			
Aumento neto	–	13			
Clase A USD de Distribución (A)					
Vendido	–	7			
Redimido	–	(22)			
Disminución neta	–	(15)			
Clase C USD de Capitalización					
Vendido	–	1			
Aumento neto	–	1			
Clase F USD de Capitalización					
Vendido	–	11			
Aumento neto	–	11			
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	–	12			
Redimido	–	(75)			
Disminución neta	–	(63)			
Clase LM EUR de Capitalización					
Redimido	–	(369)			
Disminución neta	–	(369)			
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund					
Clase A USD de Capitalización					
Vendido	14	29			
Redimido	(30)	(62)			
Disminución neta	(16)	(33)			
Clase A USD de Distribución (D)					
Vendido	–	1			
Redimido	(2)	(3)			
Disminución neta	(2)	(2)			
Clase A USD de Distribución (M) Plus					
Vendido	44	32			
Redimido	(63)	(129)			
Disminución neta	(19)	(97)			
Clase A USD de Distribución (M)					
Vendido	7	9			
Redimido	(57)	(7)			
(Disminución)/aumento neto	(50)	2			
Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido	23	24			
Redimido	(47)	(81)			
Disminución neta	(24)	(57)			
Clase A CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido	429	2			
Redimido	(95)	(50)			
Aumento/(disminución) neto	334	(48)			
Clase A EUR de capitalización (cubierta)					
Redimido	–	(2)			
Disminución neta	–	(2)			
Clase A EUR de Capitalización					
Vendido	–	2			
Redimido	(1)	(2)			
Disminución neta	(1)	–			
Clase A HKD de Distribución (M) Plus					
Vendido	6	16			
Redimido	(71)	(163)			
Disminución neta	(65)	(147)			
Clase A SGD de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	123	16			
Redimido	(13)	(52)			
Aumento/(disminución) neto	110	(36)			
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido	9.492	79			
Redimido	(9.099)	(87)			
Aumento/(disminución) neto	393	(8)			
Clase A SGD de Distribución (M) Plus					
Vendido	43	300			
Redimido	(357)	(312)			
Disminución neta	(314)	(12)			
Clase C USD de Distribución (D)					
Redimido	(1)	–			
Disminución neta	(1)	–			
Clase E USD de Capitalización					
Vendido	–	1			
Aumento neto	–	1			
Clase F USD de Capitalización					
Vendido	–	1			
Redimido	–	(1)			
Aumento neto	–	–			
Clase X USD de Capitalización					
Redimido	–	(2)			
Disminución neta	–	(2)			
			Correspondiente al ejercicio cerrado		
			31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)	
Clase X USD de Distribución (M)					
Redimido	–			(26)	
Disminución neta	–			(26)	
Clase Premier USD de Capitalización					
Vendido	76			10	
Redimido	(225)			(13)	
Disminución neta	(149)			(3)	
Clase Premier USD de Distribución (M)					
Vendido	36			–	
Redimido	(48)			–	
Disminución neta	(12)			–	
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	53			12	
Redimido	(25)			(16)	
Aumento/(disminución) neto	28			(4)	

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables – (continuación)

	Correspondiente al ejercicio cerrado		Correspondiente al ejercicio cerrado	
	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – (continuación)				
Clase Premier Euro de Distribución (A)				
Redimido	(21)	–		
Disminución neta	(21)	–		
Clase LM USD de Capitalización				
Redimido	(62)	(9)		
Disminución neta	(62)	(9)		
Clase LM USD de Distribución (M)				
Vendido	1	41		
Redimido	(13)	(2)		
(Disminución)/aumento neto	(12)	39		
Clase LM Euro de Distribución (M) (Cubierta)				
Vendido	3	–		
Aumento neto	3	–		
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund				
Clase A USD de Capitalización				
Vendido	71	75		
Redimido	(63)	(47)		
Aumento neto	8	28		
Clase A USD de Distribución (M)				
Vendido	59	1		
Redimido	(22)	(6)		
Aumento/(disminución) neto	37	(5)		
Clase A EUR de capitalización (cubierta)				
Vendido	70	29		
Redimido	(69)	(37)		
Aumento/(disminución) neto	1	(8)		
Clase A SEK de Capitalización (Cubierta)				
Vendido	710	536		
Redimido	(749)	(1.977)		
Disminución neta	(39)	(1.441)		
Clase B USD de Capitalización				
Redimido	(1)	–		
Disminución neta	(1)	–		
Clase C USD de Capitalización				
Vendido	2	5		
Redimido	(5)	(33)		
Disminución neta	(3)	(28)		
Clase C USD de Distribución (M)				
Vendido	3	32		
Redimido	–	(2)		
Aumento neto	3	30		
Clase E USD de Capitalización				
Vendido	1	1		
Redimido	(1)	(2)		
Disminución neta	–	(1)		
Clase E USD de Distribución (D)				
Vendido	–	1		
Aumento neto	–	1		
Clase F USD de Capitalización				
Vendido	1	–		
Redimido	(2)	(15)		
Disminución neta	(1)	(15)		
Clase B USD de Distribución (D)				
Redimido	(4)	–		
Disminución neta	(4)	–		
Clase X EUR de Capitalización (Cubierta)				
Vendido	179	14		
Redimido	(37)	(33)		
Aumento/(disminución) neto	142	(19)		
Clase Premier USD de Capitalización				
Vendido	21	196		
Redimido	(102)	(50)		
Aumento/(disminución) neto	(81)	146		
Clase Premier CHF de Distribución (M) (Cubierta)				
Vendido	40	–		
Aumento neto	40	–		
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)				
Vendido	174	12		
Redimido	(714)	(64)		
Disminución neta	(540)	(52)		
Clase Premier Euro de Distribución (M) (Cubierta)				
Vendido	2	–		
Aumento neto	2	–		
Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)				
Vendido	–	3		
Redimido	(3)	–		
(Disminución)/aumento neto	(3)	3		
Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta)				
Redimido	–	(9)		
Disminución neta	–	(9)		
Clase S USD de Distribución (M) Plus (e)				
Vendido	33	8		
Redimido	(17)	(39)		
Aumento/(disminución) neto	16	(31)		
Clase S Euro de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)				
Vendido	54	2		
Redimido	(30)	(4)		
Aumento/(disminución) neto	24	(2)		
Clase S GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)				
Vendido	504	119		
Redimido	(755)	(204)		
Disminución neta	(251)	(85)		
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^				
Clase X USD de Capitalización				
Redimido	(1)	(3)		
Disminución neta	(1)	(3)		
Clase Premier USD de Capitalización				
Vendido	19	71		
Redimido	(81)	(109)		
Disminución neta	(62)	(38)		
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)				
Vendido	140	50		
Redimido	(9)	(181)		
Aumento/(disminución) neto	131	(131)		
Clase Premier NZD de Capitalización (cubierta)				
Vendido	25	–		
Redimido	(38)	–		
Disminución neta	(13)	–		
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)				
Vendido	–	1		
Aumento neto	–	1		
Clase LM USD de Capitalización				
Vendido	2	2		
Redimido	(2)	(1)		
Aumento neto	–	1		
Clase LM Euro de Capitalización (Cubierta)				
Vendido	–	1		
Redimido	(4)	(1)		
Disminución neta	(4)	–		
FTGF Western Asset Global Credit Fund^				
Clase A USD de Capitalización				
Redimido	–	(5)		
Disminución neta	–	(5)		
Clase A EUR de capitalización (cubierta)				
Vendido	–	1		
Redimido	(1)	(1)		
Disminución neta	(1)	–		
Clase LM EUR de Capitalización				
Redimido	(99)	(15)		
Disminución neta	(99)	(15)		
Clase LM Euro de Capitalización (Cubierta)				
Vendido	3	4		
Redimido	–	(1)		
Aumento neto	3	3		
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^				
Clase A USD de Capitalización				
Vendido	32	60		
Redimido	(726)	(1.371)		
Disminución neta	(694)	(1.311)		
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)				
Vendido	6	63		
Redimido	(152)	(364)		
Disminución neta	(146)	(301)		
Clase A USD de Distribución (S)				
Vendido	5	20		
Redimido	(39)	(106)		
Disminución neta	(34)	(86)		

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables – (continuación)

	Correspondiente al ejercicio cerrado		Correspondiente al ejercicio cerrado	
	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^] – (continuación)				
Clase A AUD de Capitalización (Cubierta)				
Vendido	9	1	2	–
Redimido	(2)	–	(3)	(8)
Disminución neta			(1)	(8)
Clase F USD de Capitalización				
Vendido	7	1	9	61
Redimido	–	–	(84)	(204)
Disminución neta			(75)	(143)
Clase E USD de Distribución (S)				
Vendido	2	–	7	3
Redimido	(51)	(67)	(12)	(30)
Disminución neta	(49)	(67)	(5)	(27)
Clase A CHF de Capitalización (Cubierta)				
Redimido	(10)	(54)	(12)	(30)
Disminución neta	(10)	(54)	(5)	(27)
Clase A CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)				
Redimido	(86)	(61)	22	3
Disminución neta	(86)	(61)	(150)	(551)
Clase X USD de Capitalización				
Vendido	–	–	(128)	(548)
Redimido	–	–	–	–
Disminución neta			–	–
Clase X USD de Distribución (M) Plus (e)				
Vendido	186	351	–	2
Redimido	(316)	(1.721)	(122)	(125)
Disminución neta	(130)	(1.370)	(122)	(123)
Clase X USD de Distribución (S)				
Vendido	3	–	–	1
Redimido	(8)	(11)	(17)	(60)
Disminución neta	(5)	(11)	(17)	(59)
Clase A Euro de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)				
Redimido	(18)	(9)	–	–
Disminución neta	(18)	(9)	–	–
Clase A Euro de Distribución (S) (Cubierta)				
Vendido	1	8	2	7
Redimido	(5)	(3)	(13)	(71)
(Disminución)/aumento neto	(4)	5	(11)	(64)
Clase X EUR de Capitalización (Cubierta)				
Vendido	–	–	142	1.408
Redimido	–	–	(95)	(622)
Aumento neto			47	786
Clase X EUR de Capitalización				
Redimido	–	–	(1)	(14)
Disminución neta			(1)	(14)
Clase X Euro de Distribución (A) (Cubierta)				
Vendido	–	–	1	7
Redimido	–	–	(79)	(18)
Disminución neta			(78)	(11)
Clase E Euro de Distribución (M) (Cubierta)				
Redimido	–	–	(23)	(31)
Disminución neta			(23)	(31)
Clase X GBP de Capitalización (Cubierta)				
Vendido	–	–	2	25
Redimido	–	–	(58)	(138)
Disminución neta			(56)	(113)
Clase X GBP de Capitalización				
Redimido	–	–	–	(3)
Disminución neta			–	(3)
Clase A GBP de Capitalización (Cubierta)				
Vendido	1	–	–	–
Redimido	(9)	(90)	–	–
Disminución neta	(8)	(90)	–	–
Clase A GBP de Capitalización				
Redimido	(1)	(1)	–	–
Disminución neta	(1)	(1)	–	–
Clase A GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)				
Vendido	–	1	–	–
Redimido	(36)	(7)	–	–
Disminución neta	(36)	(6)	–	–
Clase A HKD de Distribución (M) Plus				
Redimido	(7)	–	–	–
Disminución neta	(7)	–	–	–
Clase A SEK de Capitalización (Cubierta)				
Vendido	4	11	–	–
Redimido	(12)	(57)	–	–
Disminución neta	(8)	(46)	–	–
Clase A SGD de Capitalización (Cubierta)				
Vendido	3.504	–	–	–
Redimido	(4.937)	(12.305)	–	–
Disminución neta	(1.433)	(12.305)	–	–
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)				
Vendido	225	893	–	–
Redimido	(6.314)	(11.870)	–	–
Disminución neta	(6.089)	(10.977)	–	–
Clase B USD de Capitalización				
Redimido	(1)	–	–	–
Disminución neta	(1)	–	–	–
Clase C USD de Capitalización				
Redimido	(35)	(61)	–	–
Disminución neta	(35)	(61)	–	–
Clase C USD de Distribución (S)				
Vendido	1	–	–	–
Redimido	(4)	(10)	–	–
Disminución neta	(3)	(10)	–	–
Clase A NOK de Capitalización (Cubierta)				
Vendido	111	254	–	–
Redimido	(439)	(121)	–	–
(Disminución)/aumento neto	(328)	133	–	–
Clase E USD de Capitalización				
Redimido	(22)	(20)	–	–
Disminución neta	(22)	(20)	–	–
Clase E USD de Distribución (S)				
Redimido	(2)	(5)	–	–
Disminución neta	(2)	(5)	–	–
Clase E EUR de Capitalización (Cubierta)				

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables – (continuación)

	Correspondiente al ejercicio cerrado			Correspondiente al ejercicio cerrado	
	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)		31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^] – (continuación)					
Clase X GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)					
Vendido	–	1			
Redimido	(6)	(21)			
Disminución neta	(6)	(20)			
Clase X SGD de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	266	930			
Redimido	(1.768)	(1.063)			
Disminución neta	(1.502)	(133)			
Clase Premier USD de Capitalización					
Vendido	30	52			
Redimido	(507)	(934)			
Disminución neta	(477)	(882)			
Clase Premier USD de Distribución (S)					
Vendido	6	1			
Redimido	(15)	(218)			
Disminución neta	(9)	(217)			
Clase Premier AUD de Capitalización (cubierta)					
Vendido	–	1			
Redimido	–	(16)			
Disminución neta	–	(15)			
Clase Premier AUD de Distribución (S) (Cubierta)					
Vendido	–	10			
Redimido	(16)	(548)			
Disminución neta	(16)	(538)			
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)					
Vendido	19	92			
Redimido	(253)	(1.998)			
Disminución neta	(234)	(1.906)			
Clase Premier CHF de Capitalización (cubierta)					
Redimido	(5)	(81)			
Disminución neta	(5)	(81)			
Clase Premier CHF de Distribución (S) (Cubierta)					
Redimido	–	(11)			
Disminución neta	–	(11)			
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	134	1.114			
Redimido	(2.327)	(2.581)			
Disminución neta	(2.193)	(1.467)			
Clase Premier EUR de Capitalización					
Vendido	–	11			
Redimido	(131)	(34)			
Disminución neta	(131)	(23)			
Clase Premier Euro de Distribución (S) (Cubierta)					
Vendido	197	1			
Redimido	(258)	(97)			
Disminución neta	(61)	(96)			
Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	5	12			
Redimido	(13)	(482)			
Disminución neta	(8)	(470)			
Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)					
Vendido	4	7			
Redimido	(20)	(1.018)			
Disminución neta	(16)	(1.011)			
Clase Premier JPY de Capitalización (cubierta)					
Vendido	–	99			
Redimido	(15)	(156)			
Disminución neta	(15)	(57)			
Clase Premier JPY de Distribución (S) (Cubierta)					
Redimido	–	(100)			
Disminución neta	–	(100)			
Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)					
Vendido	–	16			
Redimido	(3)	(31)			
Disminución neta	(3)	(15)			
Clase Premier SEK de Capitalización (cubierta)					
Redimido	–	(1)			
Disminución neta	–	(1)			
Clase S USD de Capitalización					
Vendido	8	–			
Redimido	–	(26)			
Aumento/(disminución) neto	8	(26)			
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)					
Vendido	4	–			
Redimido	–	–			
Aumento/(disminución) neto	4	–			
Redimido					
Disminución neta					
Clase LM AUD de Distribución (S) (Cubierta)					
Vendido	13	31			
Redimido	(108)	(565)			
Disminución neta	(95)	(534)			
Clase LM EUR de Capitalización					
Vendido	–	1			
Redimido	(3)	(1)			
Disminución neta	(3)	–			
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]					
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	–	19			
Redimido	–	(15)			
Aumento neto	–	4			
Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)					
Redimido	(2)	(3)			
Disminución neta	(2)	(3)			
Clase S USD de Capitalización					
Vendido	–	1			
Redimido	(1)	(1)			
Disminución neta	(1)	–			
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)					
Vendido	9	35			
Redimido	(8)	(28)			
Aumento neto	1	7			
Clase S GBP de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	27	21			
Redimido	(16)	(10)			
Aumento neto	11	11			
Clase LM AUD de Capitalización (Cubierta)					
Redimido	–	(1.230)			
Disminución neta	–	(1.230)			
Clase LM Euro de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	164	21			
Redimido	(79)	(14)			
Aumento neto	85	7			
Clase LM GBP de capitalización (Cubierta)					
Vendido	20	43			
Redimido	(103)	(22)			
Aumento/(disminución) neto	(83)	21			
Clase LM CAD de capitalización (Cubierta)					
Vendido	–	264			
Redimido	(30)	(4)			
(Disminución)/aumento neto	(30)	260			
Clase S CHF de Distribución (A) (Cubierta)					
Vendido	–	20			
Aumento neto	–	20			
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]					
Clase D USD de Capitalización					
Redimido	(98)	(7)			
Disminución neta	(98)	(7)			
Clase D USD de Distribución (M)					
Redimido	(5)	–			
Disminución neta	(5)	–			
Clase M CHF de Capitalización (Cubierta)					
Redimido	–	(10)			
Disminución neta	–	(10)			
Clase M USD de Distribución (M)					
Vendido	1	–			
Aumento neto	1	–			
Clase Premier USD de Capitalización					
Vendido	1	62			
Redimido	(11)	(1.316)			
Disminución neta	(10)	(1.254)			
Clase Premier USD de Distribución (Q)					
Redimido	(10)	–			
Disminución neta	(10)	–			
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	1	5			
Redimido	(3)	(1.030)			
Disminución neta	(2)	(1.025)			

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables – (continuación)

	Correspondiente al ejercicio cerrado			Correspondiente al ejercicio cerrado	
	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)		31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^] – (continuación)					
Clase Premier Euro de Distribución (Q) (Cubierta)					
Vendido	–	3			
Redimido	(5)	(175)			
Disminución neta	(5)	(172)			
Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)					
Redimido	(1)	(105)			
Disminución neta	(1)	(105)			
Clase Premier JPY de Capitalización (cubierta)					
Redimido	(500)	–			
Disminución neta	(500)	–			
Clase LM USD de Capitalización					
Redimido	–	(209)			
Disminución neta	–	(209)			
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]					
Clase Premier USD de Capitalización					
Vendido	30	420			
Aumento neto	30	420			
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	–	19			
Redimido	–	(3)			
Aumento neto	–	16			
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]					
Clase LM GBP de Capitalización					
Redimido	–	(637)			
Disminución neta	–	(637)			
Clase LM GBP de Distribución (M)					
Vendido	–	695			
Aumento neto	–	695			
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund					
Clase Premier USD de Capitalización					
Vendido	–	5			
Redimido	(6)	(2)			
(Disminución)/aumento neto	(6)	3			
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	–	31			
Redimido	–	(3)			
Aumento neto	–	28			
Clase LM GBP de capitalización (Cubierta)					
Redimido	–	(951)			
Disminución neta	–	(951)			
Clase Premier LM GBP de Distribución (M) (Cubierta)					
Vendido	–	1.065			
Redimido	(352)	–			
(Disminución)/aumento neto	(352)	1.065			
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund[^]					
Clase LM USD de Distribución (Q)					
Vendido	9	7			
Redimido	(2)	(4)			
Aumento neto	7	3			
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]					
Clase Premier USD de Capitalización					
Redimido	(1)	–			
Disminución neta	(1)	–			
Clase Premier BRL de Capitalización (Cubierta)					
Redimido	(1)	(1)			
Disminución neta	(1)	(1)			
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund					
Clase A USD de Capitalización					
Vendido	8	2			
Redimido	(18)	(5)			
Disminución neta	(10)	(3)			
Clase A USD de Distribución (M)					
Vendido	8	1			
Redimido	(7)	(6)			
Aumento/(disminución) neto	1	(5)			
Clase A USD de Distribución (S)					
Vendido	8	12			
Redimido	(4)	(11)			
Aumento neto	4	1			
Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Redimido	(5)	–			
Disminución neta	(5)	–			
Clase A Euro de Capitalización (Cubierta) (IH)					
Vendido	4	1			
Redimido	(8)	(24)			
Disminución neta	(4)	(23)			
Clase A EUR de capitalización (cubierta)					
Vendido	–	2			
Redimido	(2)	(3)			
Disminución neta	(2)	(1)			
Clase A Euro de Distribución (A) (Cubierta)					
Redimido	(2)	(2)			
Disminución neta	(2)	(2)			
Clase A EUR de Distribución (S) (Cubierta) (IH)					
Vendido	1	1			
Redimido	(4)	(3)			
Disminución neta	(3)	(2)			
Clase A GBP de Distribución (M) (Cubierta)					
Redimido	(1)	–			
Disminución neta	(1)	–			
Clase A GBP de Distribución (S) (Cubierta) (IH)					
Redimido	(2)	(2)			
Disminución neta	(2)	(2)			
Clase A SGD de Capitalización					
Vendido	1.831	2			
Redimido	(1.827)	–			
Aumento neto	4	2			
Clase C USD de Capitalización					
Redimido	(1)	(1)			
Disminución neta	(1)	(1)			
Clase C USD de Distribución (S)					
Redimido	–	(1)			
Disminución neta	–	(1)			
Clase E USD de Capitalización					
Vendido	2	–			
Redimido	(1)	–			
Aumento neto	1	–			
Clase E Euro de Capitalización (Cubierta) (IH)					
Redimido	–	(1)			
Disminución neta	–	(1)			
Clase F USD de Capitalización					
Vendido	–	1			
Redimido	–	(2)			
Disminución neta	–	(1)			
Clase X USD de Capitalización					
Vendido	–	59			
Redimido	–	(4)			
Aumento neto	–	55			
Clase X USD de Distribución (S)					
Redimido	–	(2)			
Disminución neta	–	(2)			
Clase X EUR de Capitalización (Cubierta)					
Redimido	–	(8)			
Disminución neta	–	(8)			
Clase A Euro de Distribución (S) (Cubierta) (IH)					
Redimido	–	(4)			
Disminución neta	–	(4)			
Clase X GBP de Capitalización (Cubierta) (IH)					
Redimido	–	(1)			
Disminución neta	–	(1)			
Clase X GBP de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	9	12			
Redimido	(18)	(34)			
Disminución neta	(9)	(22)			

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables – (continuación)

	Correspondiente al ejercicio cerrado			Correspondiente al ejercicio cerrado				
	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)		31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)			
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund (continuación)								
Clase X GBP de Capitalización								
Vendido	15	105	Vendido	2	-			
Redimido	(36)	(61)	Redimido	(286)	-			
Aumento/(disminución) neto	(21)	44	Disminución neta	(284)	-			
Clase X GBP de Distribución (S) (Cubierta) (IH)								
Vendido	4	3	Clase Premier Euro de Distribución (A) (Cubierta)					
Redimido	(5)	(8)	Vendido	11	7			
Disminución neta	(1)	(5)	Aumento neto	11	7			
Clase X GBP de Distribución (S) (Cubierta) (IH)								
Vendido	5	9	Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta)					
Redimido	(11)	(22)	Vendido	109	-			
Disminución neta	(6)	(13)	Redimido	(83)	-			
Clase Premier USD de Capitalización								
Vendido	6	-	Aumento neto	26	-			
Redimido	(8)	(2)	Clase LM AUD de capitalización (Cubierta)					
Disminución neta	(2)	(2)	Redimido	(1.698)	(1.443)			
Clase Premier USD de Distribución (S)								
Redimido	(1)	(9)	Disminución neta	(1.698)	(1.443)			
Disminución neta	(1)	(9)	FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]					
Clase Premier Euro de Capitalización (Cubierta) (IH)								
Vendido	2	1	Clase A USD de Capitalización					
Redimido	(5)	(51)	Vendido	4	-			
Disminución neta	(3)	(50)	Redimido	(1)	-			
Clase Premier EUR de Capitalización								
Vendido	-	1	Aumento neto	3	-			
Redimido	(3)	(4)	Clase Premier USD de Capitalización					
Disminución neta	(3)	(3)	Vendido	32	-			
Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta)								
Redimido	-	(1)	Aumento neto	32	-			
Disminución neta	-	(1)	Clase S Euro de Distribución (A) (Cubierta) (IH)					
Clase Premier GBP de Distribución (S) (Cubierta) (IH)								
Redimido	-	(4)	Vendido	73	-			
Disminución neta	-	(4)	Aumento neto	73	-			
Clase LM US\$ de Capitalización (Cubierta) (IH)								
Vendido	22	103	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund					
Redimido	(31)	(18)	Clase A USD de Capitalización					
(Disminución)/aumento neto	(9)	85	Vendido	24	3			
Clase LM EUR de Capitalización								
Vendido	1	2	Redimido	(9)	(5)			
Redimido	(2)	(1)	Aumento/(disminución) neto	15	(2)			
(Disminución)/aumento neto	(1)	1	Clase A SGD de Capitalización					
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]								
Clase A USD de Capitalización								
Redimido	(1)	-	Vendido	6.710	3			
Disminución neta	(1)	-	Redimido	(6.672)	(34)			
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)								
Redimido	-	(2)	Aumento/(disminución) neto	38	(31)			
Disminución neta	-	(2)	Clase C USD de Capitalización					
Clase A SGD de Capitalización								
Vendido	3.319	3.936	Redimido	-	(9)			
Redimido	(3.260)	(3.936)	Disminución neta	-	(9)			
Aumento neto	59	-	Clase F USD de Capitalización					
Clase C USD de Capitalización								
Vendido	5	-	Redimido	(2)	(2)			
Aumento neto	5	-	Disminución neta	(2)	(2)			
Clase E USD de Capitalización								
Redimido	(1)	-	Clase X GBP de Distribución (M) (Cubierta) (IH)					
Disminución neta	(1)	-	Redimido	(2)	-			
Clase F USD de Capitalización								
Redimido	(5)	-	Disminución neta	(2)	-			
Disminución neta	(5)	-	Clase X GBP de Distribución (M) (Cubierta)					
Clase X GBP de Capitalización (Cubierta)								
Redimido	-	(4)	Redimido	(2)	-			
Disminución neta	-	(4)	Disminución neta	(2)	-			
Clase X GBP de Distribución (M) (Cubierta)								
Vendido	-	3	Clase Premier USD de Capitalización					
Redimido	(3)	-	Vendido	171	5			
(Disminución)/aumento neto	(3)	3	Redimido	(140)	(54)			
Clase Premier USD de Capitalización								
Vendido	34	63	Aumento/(disminución) neto	31	(49)			
Redimido	(892)	(38)	Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta) (IH)					
(Disminución)/aumento neto	(858)	25	Vendido	1	1			
Clase Premier USD de Distribución (A)								
Redimido	(2)	-	Aumento neto	1	1			
Disminución neta	(2)	-	Clase Premier NZD de Capitalización (Cubierta) (IH)					
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)								
Vendido	-	-	Vendido	-	3			
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund								
Clase A USD de Capitalización								
Vendido	187	74	Aumento neto	-	3			
Redimido	(154)	(274)	Clase LM EUR de Capitalización					
Aumento/(disminución) neto	33	(200)	Redimido	(19)	(2)			
Clase A USD de Distribución (A)								
Vendido	1	5	Disminución neta	(19)	(2)			
Redimido	(5)	(7)	Clase LM NZD de Capitalización (Cubierta) (IH)					
Disminución neta	(4)	(2)	Vendido	5	2			
Clase A USD de Distribución (D)								
Vendido	19	7	Redimido	(28)	(6)			
Redimido	(20)	(112)	Disminución neta	(23)	(4)			

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables – (continuación)

	Correspondiente al ejercicio cerrado			Correspondiente al ejercicio cerrado	
	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)		31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund (continuación)					
Disminución neta	(1)	(105)			
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)					
Vendido	57	54			
Redimido	(186)	(354)			
Disminución neta	(129)	(300)			
Clase A USD de Distribución (M) Plus					
Vendido	7	11			
Redimido	(59)	(211)			
Disminución neta	(52)	(200)			
Clase A AUD de Capitalización (Cubierta)					
Redimido	–	(2)			
Disminución neta	–	(2)			
Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido	27	–			
Redimido	(6)	(14)			
Aumento/(disminución) neto	21	(14)			
Clase A CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido	56	3			
Redimido	–	(11)			
Aumento/(disminución) neto	56	(8)			
Clase A EUR de capitalización (cubierta)					
Vendido	139	75			
Redimido	(40)	(157)			
Aumento/(disminución) neto	99	(82)			
Clase A Euro de Distribución (A) (Cubierta)					
Vendido	23	32			
Redimido	(24)	(15)			
(Disminución)/aumento neto	(1)	17			
Clase A Euro de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)					
Vendido	28	44			
Redimido	(49)	(31)			
Aumento/(disminución) neto	(21)	13			
Clase A Euro de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido	1	1			
Redimido	–	(4)			
Aumento/(disminución) neto	1	(3)			
Clase A GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)					
Vendido	7	1			
Redimido	(9)	(8)			
Disminución neta	(2)	(7)			
Clase A GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido	2	5			
Redimido	(1)	(6)			
Aumento/(disminución) neto	1	(1)			
Clase A HKD de Capitalización					
Vendido	9	1			
Redimido	(6)	(14)			
Aumento/(disminución) neto	3	(13)			
Clase A HKD de Distribución (M) Plus					
Vendido	48	15			
Redimido	(44)	(478)			
Aumento/(disminución) neto	4	(463)			
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)					
Vendido	5.024	45.934			
Redimido	(5.277)	(7.819)			
Aumento/(disminución) neto	(253)	38.115			
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido	1.350	2.040			
Redimido	(1.746)	(5.580)			
Disminución neta	(396)	(3.540)			
Clase A SGD de Distribución (M) Plus					
Vendido	32	140			
Redimido	(1.520)	(1.092)			
Disminución neta	(1.488)	(952)			
Clase C USD de Capitalización					
Vendido	48	3			
Redimido	(47)	(130)			
Aumento/(disminución) neto	1	(127)			
Clase C USD de Distribución (D)					
Vendido	3	101			
Redimido	(2)	(2)			
Aumento neto	1	99			
Clase A CZK de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	–	1			
Aumento neto	–	1			
Clase E USD de Capitalización					
Vendido	54	10			
Redimido	(15)	(21)			
Aumento/(disminución) neto	39	(11)			
Clase E USD de Distribución (D)					
Vendido	2	–			
Redimido	(1)	(2)			
Aumento/(disminución) neto	1	(2)			
Clase E EUR de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	7	4			
Redimido	(2)	(7)			
Aumento/(disminución) neto	5	(3)			
Clase F USD de Capitalización					
Vendido	18	30			
Redimido	(21)	(168)			
Disminución neta	(3)	(138)			
Clase B USD de Distribución (D)					
Vendido	4	4			
Redimido	(5)	(14)			
Disminución neta	(1)	(10)			
Clase X USD de Capitalización					
Vendido	12	3			
Redimido	(58)	(12)			
Disminución neta	(46)	(9)			
Clase X USD de Distribución (D)					
Redimido	(2)	(1)			
Disminución neta	(2)	(1)			
Clase X USD de Distribución (M) Plus (e)					
Vendido	–	10			
Redimido	(16)	(52)			
Disminución neta	(16)	(42)			
Clase X CHF de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	–	1			
Redimido	(1)	(6)			
Disminución neta	(1)	(5)			
Clase X CHF de Distribución (A) (Cubierta)					
Redimido	(5)	(20)			
Disminución neta	(5)	(20)			
Clase X EUR de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	5	29			
Redimido	(77)	(199)			
Disminución neta	(72)	(170)			
Clase X EUR de Capitalización					
Vendido	1	–			
Aumento neto	1	–			
Clase X Euro de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)					
Vendido	4	4			
Redimido	(47)	(19)			
Disminución neta	(43)	(15)			
Clase X GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)					
Vendido	–	1			
Redimido	(11)	(11)			
Disminución neta	(11)	(10)			
Clase Premier USD de Capitalización					
Vendido	295	70			
Redimido	(104)	(336)			
Aumento/(disminución) neto	191	(266)			
Clase Premier USD de Distribución (M) Plus (e)					
Vendido	6	4			
Redimido	–	(57)			
Aumento/(disminución) neto	6	(53)			
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)					
Vendido	–	4			
Redimido	(5)	–			
(Disminución)/aumento neto	(5)	4			

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables – (continuación)

	Correspondiente al ejercicio cerrado	
	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund (continuación)		
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)		
Vendido	108	142
Redimido	(143)	(341)
Disminución neta	(35)	(199)
Clase Premier Euro de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)		
Vendido	31	76
Redimido	(107)	(132)
Disminución neta	(76)	(56)
Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)		
Vendido	5	-
Redimido	(58)	(14)
Disminución neta	(53)	(14)
Clase Premier SEK de Capitalización (cubierta)		
Vendido	53	1
Redimido	(15)	(38)
Aumento/(disminución) neto	38	(37)
Clase S USD de Capitalización		
Vendido	-	193
Redimido	(104)	(1.031)
Disminución neta	(104)	(838)
Clase S USD de Distribución (Q) Plus (e)		
Redimido	(1)	-
Disminución neta	(1)	-
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendido	30	158
Redimido	(64)	(235)
Disminución neta	(34)	(77)
Clase S Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)		
Vendido	-	5
Redimido	(8)	(2)
(Disminución)/aumento neto	(8)	3
Clase S GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)		
Vendido	-	2
Redimido	(1)	(12)
Disminución neta	(1)	(10)
Clase LM USD de Capitalización		
Vendido	34	100
Aumento neto	34	100
Clase LM USD de Distribución (M)		
Vendido	2	8
Redimido	(12)	(8)
Disminución neta	(10)	-
Clase LM Euro de Distribución (Q) (Cubierta) Plus (e)		
Vendido	104	910
Redimido	(281)	(6)
(Disminución)/aumento neto	(177)	904
Clase LM GBP de capitalización (Cubierta)		
Vendido	10	25
Redimido	(29)	(106)
Disminución neta	(19)	(81)
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^		
Clase A USD de Capitalización		
Redimido	(105)	-
Disminución neta	(105)	-
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendido	20	12
Redimido	(25)	(13)
Disminución neta	(5)	(1)
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^		
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)		
Redimido	(1)	-
Disminución neta	(1)	-
Clase S Euro Distributing (A) (Hedged) (IH)		
Redimido	(100)	-
Disminución neta	(100)	-
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^		
Clase A USD de Capitalización		
Vendido	-	1
Aumento neto	-	1
Clase A SGD de Capitalización (Cubierta)		
Vendido	-	104
Redimido	-	(5.710)

	Correspondiente al ejercicio cerrado	
	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)
Disminución neta		
	-	(5.606)
Clase LM AUD de capitalización (Cubierta)		
Redimido	-	(237)
Disminución neta	-	(237)
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^		
Clase A USD de Capitalización		
Redimido	(3)	-
Disminución neta	(3)	-
Clase Premier USD de Capitalización		
Redimido	(3)	-
Disminución neta	(3)	-
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)		
Redimido	(7)	-
Disminución neta	(7)	-
FTGF ClearBridge Value Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendido	49	141
Redimido	(125)	(102)
Aumento/(disminución) neto	(76)	39
Clase A USD de Distribución (A)		
Vendido	9	9
Redimido	(18)	(8)
(Disminución)/aumento neto	(9)	1
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)		
Vendido	2	29
Redimido	(23)	(29)
Disminución neta	(21)	-
Clase A EUR de Capitalización		
Vendido	36	28
Redimido	(26)	(23)
Aumento neto	10	5
Clase A EUR de Distribución (A) (Cubierta)		
Redimido	(1)	-
Disminución neta	(1)	-
Clase A SGD de Capitalización (Cubierta)		
Vendido	169	124
Redimido	(344)	(525)
Disminución neta	(175)	(401)
Clase A SGD de Capitalización		
Vendido	845	581
Redimido	(281)	(488)
Aumento neto	564	93
Clase C USD de Capitalización		
Vendido	2	22
Redimido	(19)	(3)
(Disminución)/aumento neto	(17)	19
Clase C USD de Distribución (A)		
Vendido	-	2
Aumento neto	-	2
Clase E USD de Capitalización		
Vendido	1	14
Redimido	(11)	-
(Disminución)/aumento neto	(10)	14
Clase F USD de Capitalización		
Vendido	7	26
Redimido	(22)	(25)
(Disminución)/aumento neto	(15)	1
Clase X USD de Capitalización		
Vendido	-	4
Redimido	-	(3)
Aumento neto	-	1
Clase X USD de Distribución (A)		
Vendido	19	19
Redimido	-	(75)
Aumento/(disminución) neto	19	(56)
Clase X EUR de Capitalización		
Vendido	7	72
Redimido	(26)	(46)
Aumento/(disminución) neto	(19)	26
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendido	184	281
Redimido	(177)	(70)
Aumento neto	7	211
Clase Premier USD de Distribución (A)		
Vendido	-	10

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables – (continuación)

	Correspondiente al ejercicio cerrado		Correspondiente al ejercicio cerrado	
	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)
FTGF ClearBridge Value Fund – (continuación)				
Redimido	(10)	–		
(Disminución)/aumento neto	(10)	10		
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)				
Vendido	651	159		
Redimido	(247)	(45)		
Aumento neto	404	114		
Clase Premier EUR de Capitalización				
Vendido	119	83		
Redimido	(276)	(82)		
Aumento/(disminución) neto	(157)	1		
Clase LM USD de Distribución (A)				
Vendido	2	5		
Redimido	(18)	(31)		
Disminución neta	(16)	(26)		
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund				
Clase A USD de Capitalización				
Vendido	7	7		
Redimido	(18)	(12)		
Disminución neta	(11)	(5)		
Clase A USD de Distribución (A)				
Vendido	–	1		
Redimido	(4)	(7)		
Disminución neta	(4)	(6)		
Clase A EUR de Capitalización				
Vendido	2	–		
Redimido	(1)	–		
Aumento neto	1	–		
Clase B USD de Distribución (A)				
Redimido	–	(1)		
Disminución neta	–	(1)		
Clase C USD de Capitalización				
Vendido	–	1		
Redimido	(1)	(2)		
Disminución neta	(1)	(1)		
Clase C USD de Distribución (A)				
Redimido	(1)	(2)		
Disminución neta	(1)	(2)		
Clase E USD de Capitalización				
Vendido	1	1		
Redimido	(11)	(5)		
Disminución neta	(10)	(4)		
Clase E USD de Distribución (A)				
Redimido	(1)	–		
Disminución neta	(1)	–		
Clase F USD de Capitalización				
Vendido	4	7		
Redimido	(24)	(14)		
Disminución neta	(20)	(7)		
Clase F USD de Distribución (A)				
Vendido	1	1		
Redimido	(2)	–		
(Disminución)/aumento neto	(1)	1		
Clase X USD de Distribución (A)				
Redimido	(2)	–		
Disminución neta	(2)	–		
Clase Premier USD de Capitalización				
Vendido	5	–		
Redimido	(6)	(21)		
Disminución neta	(1)	(21)		
Clase Premier USD de Distribución (A)				
Redimido	(1)	(3)		
Disminución neta	(1)	(3)		
Clase Premier EUR de Capitalización				
Vendido	18	18		
Redimido	(13)	(2)		
Aumento neto	5	16		
Clase LM EUR de Capitalización				
Vendido	–	6		
Redimido	(15)	–		
(Disminución)/aumento neto	(15)	6		
Clase LM EUR de Capitalización				
Redimido	(4)	–		
Disminución neta	(4)	–		
Clase A (G) USD de Capitalización				
Redimido	(1)	–		
Disminución neta	(1)	–		
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund				
Clase A USD de Capitalización				
Vendido	55	54		
Redimido	(83)	(75)		
Disminución neta	(28)	(21)		
Clase A USD de Distribución (A)				
Vendido	4	7		
Redimido	(5)	(7)		
Disminución neta	(1)	–		
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)				
Vendido	14	17		
Redimido	(9)	(18)		
Aumento/(disminución) neto	5	(1)		
Clase A EUR de Distribución (A)				
Vendido	9	11		
Redimido	(11)	(36)		
Disminución neta	(2)	(25)		
Clase C USD de Capitalización				
Vendido	–	2		
Redimido	(7)	(4)		
Disminución neta	(7)	(2)		
Clase C USD de Distribución (A)				
Redimido	(2)	(1)		
Disminución neta	(2)	(1)		
Clase E USD de Capitalización				
Vendido	3	4		
Redimido	(6)	(7)		
Disminución neta	(3)	(3)		
Clase F USD de Capitalización				
Vendido	48	101		
Redimido	(140)	(121)		
Disminución neta	(92)	(20)		
Clase F USD de Distribución (A)				
Vendido	15	2		
Redimido	(14)	(32)		
Aumento/(disminución) neto	1	(30)		
Clase U USD de Capitalización				
Vendido	174	291		
Redimido	(340)	(413)		
Disminución neta	(166)	(122)		
Clase U Euro de Capitalización				
Vendido	289	19		
Redimido	(9)	(137)		
Aumento/(disminución) neto	280	(118)		
Clase X USD de Capitalización				
Vendido	18	19		
Redimido	(30)	(32)		
Disminución neta	(12)	(13)		
Clase X EUR de Capitalización (Cubierta)				
Vendido	6	1		
Redimido	(4)	(12)		
Aumento/(disminución) neto	2	(11)		
Clase X EUR de Capitalización				
Vendido	7	1		
Redimido	(2)	(1)		
Aumento neto	5	–		
Clase X GBP de Capitalización				
Vendido	18	8		
Redimido	(10)	(7)		
Aumento neto	8	1		
Clase Premier USD de Capitalización				
Vendido	416	250		
Redimido	(237)	(607)		
Aumento/(disminución) neto	179	(357)		
Clase Premier USD de Distribución (A)				
Vendido	1	11		
Redimido	(9)	(5)		
(Disminución)/aumento neto	(8)	6		
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)				
Redimido	(228)	(492)		
Disminución neta	(228)	(492)		
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)				
Vendido	263	14		
Redimido	(107)	(34)		
Aumento/(disminución) neto	156	(20)		
Clase Premier EUR de Capitalización				
Vendido	14	11		

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables – (continuación)

	Correspondiente al ejercicio cerrado			Correspondiente al ejercicio cerrado	
	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)		31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund – (continuación)					
Redimido	(36)	(99)	(4)	(1)	
Disminución neta	(22)	(88)	(4)	(1)	
Clase Premier Euro de Distribución (A)					
Vendido	1	4	(2)	(2)	
Redimido	(2)	–	(2)	(2)	
(Disminución)/aumento neto	(1)	4	(3)	(2)	
Clase Premier GBP de Capitalización					
Vendido	88	27	(3)	(2)	
Redimido	(52)	(68)	(3)	(2)	
Aumento/(disminución) neto	36	(41)	1	1	
Clase LM EUR de Capitalización					
Vendido	31	89	(4)	(12)	
Redimido	(193)	(38)	(3)	(11)	
(Disminución)/aumento neto	(162)	51			
Clase LM EUR de Capitalización					
Redimido	(1)	–			
Disminución neta	(1)	–			
Clase A (G) USD de Capitalización					
Redimido	(1)	(1)			
Disminución neta	(1)	(1)			
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund					
Clase A USD de Capitalización					
Vendido	7	7			
Redimido	(44)	(32)			
Disminución neta	(37)	(25)			
Clase A USD de Distribución (A)					
Vendido	–	1			
Redimido	(9)	(4)			
Disminución neta	(9)	(3)			
Clase A AUD de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	3	2			
Redimido	(11)	(3)			
Disminución neta	(8)	(1)			
Clase A CNH de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	54	2			
Redimido	(71)	–			
(Disminución)/aumento neto	(17)	2			
Clase A EUR de Capitalización					
Vendido	1	1			
Redimido	(2)	(1)			
Disminución neta	(1)	–			
Clase A HKD de Capitalización					
Redimido	(4)	(2)			
Disminución neta	(4)	(2)			
Clase A SEK de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	3	1			
Redimido	(3)	(1)			
Aumento neto	–	–			
Clase A SGD de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	2.871	54			
Redimido	(73)	(352)			
Aumento/(disminución) neto	2.798	(298)			
Clase B USD de Capitalización					
Redimido	–	(1)			
Disminución neta	–	(1)			
Clase B USD de Distribución (A)					
Redimido	–	(1)			
Disminución neta	–	(1)			
Clase C USD de Capitalización					
Redimido	–	(3)			
Disminución neta	–	(3)			
Clase C USD de Distribución (A)					
Redimido	(4)	(8)			
Disminución neta	(4)	(8)			
Clase E USD de Capitalización					
Redimido	(6)	(20)			
Disminución neta	(6)	(20)			
Clase E USD de Distribución (A)					
Redimido	(2)	–			
Disminución neta	(2)	–			
Clase F USD de Capitalización					
Vendido	1	2			
Redimido	(5)	(3)			
Disminución neta	(4)	(1)			
Clase F USD de Distribución (A)					
Redimido					
Disminución neta					
Clase X USD de Capitalización					
Redimido					
Disminución neta					
Clase X EUR de Capitalización					
Redimido					
Disminución neta					
Clase X GBP de Capitalización					
Vendido					
Redimido					
Disminución neta					
Clase Premier USD de Capitalización					
Vendido					
Redimido					
Disminución neta					
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)					
Vendido					
Aumento neto					
Clase Premier GBP de Distribución (A)					
Vendido					
Redimido					
Disminución neta					
Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)					
Redimido					
Disminución neta					
Clase LM EUR de Capitalización					
Redimido					
Disminución neta					
Clase A (G) USD de Capitalización					
Redimido					
Disminución neta					
Clase L (G) USD de Capitalización					
Redimido					
Disminución neta					
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund					
Clase A USD de Capitalización					
Vendido					
Redimido					
(Disminución)/aumento neto					
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)					
Redimido					
Disminución neta					
Clase A USD de Distribución (M) Plus					
Vendido					
Redimido					
(Disminución)/aumento neto					
Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido					
Redimido					
(Disminución)/aumento neto					
Clase A CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Redimido					
Disminución neta					
Clase A EUR de capitalización (cubierta)					
Redimido					
Disminución neta					
Clase A EUR de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)					
Redimido					
Disminución neta					
Clase A HKD de Distribución (M) Plus					
Vendido					
Redimido					
Disminución neta					
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido					
Redimido					
(Disminución)/aumento neto					
Clase C USD de Capitalización					
Redimido					
Disminución neta					
Clase C USD de Distribución (A)					
Redimido					
Disminución neta					
Clase F USD de Capitalización					
Vendido					

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables – (continuación)

	Correspondiente al ejercicio cerrado			Correspondiente al ejercicio cerrado	
	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)		31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)
Redimido	(12)	(6)	Aumento neto	83	–
Disminución neta	(12)	(5)	Clase S GBP de Capitalización (Cubierta)		
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund			Vendido	21	33
Clase A USD de Capitalización			Redimido	(63)	(16)
Vendido	28	58	(Disminución)/aumento neto	(42)	17
Redimido	(29)	(28)	Clase S GBP de Capitalización		
(Disminución)/aumento neto	(1)	30	Vendido	86	172
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund – (continuación)			Redimido	(376)	(185)
Clase A USD de Distribución (A)			Disminución neta	(290)	(13)
Vendido	14	13	Clase S GBP de Distribución (Q)		
Redimido	(11)	(15)	Vendido	13	14
Aumento/(disminución) neto	3	(2)	Redimido	(8)	(10)
Clase A EUR de capitalización (cubierta)			Aumento neto	5	4
Vendido	11	43	Clase LM EUR de Capitalización		
Redimido	(23)	(136)	Vendido	24	84
Disminución neta	(12)	(93)	Redimido	(15)	(2)
Clase A EUR de Capitalización			Aumento neto	9	82
Vendido	7	–	FTGF ClearBridge Global Growth Fund^		
Redimido	(5)	–	Clase Premier USD de Capitalización		
Aumento neto	2	–	Vendido	7	1
Clase A SEK de Capitalización			Redimido	(5)	(12)
Vendido	41	58	Aumento/(disminución) neto	2	(11)
Redimido	(222)	(188)	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^		
Disminución neta	(181)	(130)	Clase A USD de Capitalización (Cubierta)		
Clase F USD de Capitalización			Vendido	700	6.788
Vendido	–	1	Redimido	(1.416)	(4.737)
Redimido	(1)	–	Aumento/(disminución) neto	(716)	2.051
(Disminución)/aumento neto	(1)	1	Clase A USD de Capitalización		
Clase X USD de Capitalización			Vendido	120	1.108
Vendido	3	9	Redimido	(1.103)	(1.859)
Redimido	(7)	(94)	Disminución neta	(983)	(751)
Disminución neta	(4)	(85)	Clase A USD de Distribución (M) (Cubierta) Plus		
Clase X USD de Distribución (A)			Vendido	697	2.195
Vendido	–	2	Redimido	(881)	(2.706)
Redimido	(1)	(3)	Disminución neta	(184)	(511)
Disminución neta	(1)	(1)	Clase A USD de Distribución (Q)		
Clase X EUR de Capitalización (Cubierta)			Vendido	19	61
Vendido	15	1	Redimido	(20)	(73)
Redimido	(3)	(2)	Disminución neta	(1)	(12)
Aumento/(disminución) neto	12	(1)	Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus		
Clase X EUR de Capitalización			Vendido	117	314
Vendido	52	–	Redimido	(60)	(751)
Redimido	(3)	–	Aumento/(disminución) neto	57	(437)
Aumento neto	49	–	Clase A CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus		
Clase X GBP de Capitalización (Cubierta)			Vendido	9.697	5.708
Vendido	1	4	Redimido	(2.180)	(4.011)
Redimido	(10)	(4)	Aumento neto	7.517	1.697
Disminución neta	(9)	–			
Clase X GBP de Capitalización					
Vendido	415	829			
Redimido	(641)	(226)			
Aumento/(disminución) neto	(226)	603			
Clase Premier USD de Capitalización					
Vendido	69	226			
Redimido	(93)	(432)			
Disminución neta	(24)	(206)			
Clase Premier USD de Distribución (A)					
Vendido	–	8			
Redimido	(3)	–			
(Disminución)/aumento neto	(3)	8			
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	1	7			
Redimido	(6)	(2)			
(Disminución)/aumento neto	(5)	5			
Clase Premier GBP de Capitalización					
Vendido	55	63			
Redimido	(17)	(47)			
Aumento neto	38	16			
Clase S USD de Capitalización					
Vendido	504	1.096			
Redimido	(550)	(876)			
Aumento/(disminución) neto	(46)	220			
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)					
Vendido	3	2			
Redimido	(2)	(42)			
Aumento/(disminución) neto	1	(40)			
Clase S Euro de Capitalización					
Vendido	86	–			
Redimido	(3)	–			

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables – (continuación)

	Correspondiente al ejercicio cerrado			Correspondiente al ejercicio cerrado	
	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)		31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^] (continuación)					
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta) (PH)					
Vendido	14	317			
Redimido	(172)	(63)			
Aumento/(disminución) neto	(158)	254			
Clase A EUR de Capitalización					
Vendido	1.997	4.336			
Redimido	(2.922)	(1.104)			
Aumento/(disminución) neto	(925)	3.232			
Clase A EUR de Distribución (A)					
Vendido	13	10			
Redimido	(9)	–			
Aumento neto	4	10			
Clase A EUR de Distribución (M) Plus					
Vendido	84	163			
Redimido	(62)	(99)			
Aumento neto	22	64			
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido	2.180	5.156			
Redimido	(1.575)	(3.078)			
Aumento neto	605	2.078			
Clase C USD de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	13	40			
Redimido	(13)	–			
Aumento neto	–	40			
Clase C USD de Capitalización					
Vendido	100	34			
Redimido	(142)	(31)			
Aumento/(disminución) neto	(42)	3			
Clase E USD de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	6	143			
Redimido	(96)	(44)			
(Disminución)/aumento neto	(90)	99			
Clase E USD de Capitalización					
Vendido	7	95			
Redimido	(104)	(61)			
Aumento/(disminución) neto	(97)	34			
Clase F USD de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	19	252			
Redimido	(216)	(27)			
(Disminución)/aumento neto	(197)	225			
Clase F USD de Capitalización					
Vendido	135	393			
Redimido	(107)	(125)			
Aumento neto	28	268			
Clase U Euro de Capitalización					
Vendido	4.208	–			
Redimido	(257)	–			
Aumento neto	3.951	–			
Clase X USD de Capitalización					
Vendido	9	93			
Redimido	(37)	–			
(Disminución)/aumento neto	(28)	93			
Clase X USD de Distribución (A)					
Vendido	–	5			
Aumento neto	–	5			
Clase X Euro de Capitalización (Cubierta) (PH)					
Vendido	215	554			
Redimido	(595)	(131)			
Aumento/(disminución) neto	(380)	423			
Clase X EUR de Capitalización					
Vendido	446	1.347			
Redimido	(1.599)	(682)			
Aumento/(disminución) neto	(1.153)	665			
Clase X GBP de Distribución (Q) (Cubierta)					
Vendido	–	32			
Redimido	(34)	(32)			
Disminución neta	(34)	–			
Clase X GBP de Distribución (Q)					
Vendido	33	36			
Redimido	(63)	(15)			
(Disminución)/aumento neto	(30)	21			
Clase Premier USD de Capitalización					
Vendido	584	4.001			
Redimido	(1.755)	(1.401)			
Aumento/(disminución) neto	(1.171)	2.600			
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)					
Vendido	–	320			
Redimido	(341)	(114)			
Aumento/(disminución) neto	(341)	206			
Clase Premier CAD de Distribución (Q) (Cubierta) (PH) Plus (e)					
Vendido	80	68			
Aumento neto	80	68			
Clase Premier CAD de Distribución (Q) Plus (e)					
Vendido	–	7			
Redimido	–	(108)			
Disminución neta	–	(101)			
Clase Premier Euro de Capitalización (Cubierta) (PH)					
Vendido	638	16			
Redimido	(11)	(2)			
Aumento neto	627	14			
Clase Premier EUR de Capitalización					
Vendido	1.833	7.891			
Redimido	(7.177)	(1.262)			
Aumento/(disminución) neto	(5.344)	6.629			
Clase Premier GBP de Capitalización					
Vendido	1	10			
Redimido	(3)	(77)			
Disminución neta	(2)	(67)			
Clase Premier GBP de Distribución (A) (Cubierta) (PH) Plus (e)					
Vendido	1	351			
Redimido	(423)	(8)			
(Disminución)/aumento neto	(422)	343			
Clase Premier GBP de Distribución (Q)					
Vendido	687	1.204			
Redimido	(915)	(1.373)			
Disminución neta	(228)	(169)			
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund					
Clase A USD de Capitalización					
Vendido	5	124			
Redimido	(54)	(33)			
(Disminución)/aumento neto	(49)	91			
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)					
Vendido	4	172			
Redimido	(65)	(152)			
Aumento/(disminución) neto	(61)	20			
Clase A USD de Distribución (M) Plus					
Vendido	27	407			
Redimido	(80)	(53)			
Aumento/(disminución) neto	(53)	354			
Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido	4	58			
Redimido	(14)	–			
(Disminución)/aumento neto	(10)	58			
Clase A CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido	42	46			
Redimido	(9)	(8)			
Aumento neto	33	38			
Clase A Euro de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido	6	42			
Redimido	(15)	(4)			
(Disminución)/aumento neto	(9)	38			
Clase A GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido	3	29			
Redimido	(3)	–			
Aumento neto	–	29			
Clase A HKD de Distribución (M) Plus					
Vendido	–	62			
Aumento neto	–	62			
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Vendido	4.630	60.001			
Redimido	(10.245)	(6.637)			
Aumento/(disminución) neto	(5.615)	53.364			
Clase U USD de Capitalización					
Vendido	95	–			
Redimido	(23)	–			
Aumento neto	72	–			
Clase U EUR de Capitalización					
Vendido	4	–			
Redimido	(64)	–			
Disminución neta	(60)	–			
Clase U GBP de Capitalización					
Vendido	3	–			
Redimido	(2)	–			
Aumento neto	1	–			
Clase U GBP de Distribución (Q) (Cubierta) Plus (e)					
Vendido	2	–			

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables – (continuación)

	Correspondiente al ejercicio cerrado	
	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund (continuación)		
Aumento neto	2	–
Clase U GBP de Distribución (Q) Plus (e)		
Vendido	5	–
Aumento neto	5	–
Clase X USD de Distribución (M) Plus (e)		
Vendido	2	402
Redimido	(115)	(5)
(Disminución)/aumento neto	(113)	397
Clase X Euro de Distribución (M) (Cubierta)		
Vendido	–	2
Aumento neto	–	2
Clase X Euro de Distribución (Q) (Cubierta) Plus (e)		
Vendido	1	7
Redimido	(11)	(2)
(Disminución)/aumento neto	(10)	5
Clase X GBP de Distribución (Q) (Cubierta) Plus (e)		
Vendido	–	4
Redimido	(5)	(1)
(Disminución)/aumento neto	(5)	3
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendido	2	97
Redimido	(2)	(56)
Aumento neto	–	41
Clase Premier USD de Distribución (M) Plus		
Vendido	70	773
Redimido	(58)	(39)
Aumento neto	12	734
Clase Premier Euro de Distribución (M) (Cubierta)		
Vendido	28	11
Redimido	(13)	–
Aumento neto	15	11
Clase S USD de Capitalización		
Vendido	39	210
Redimido	(19)	(19)
Aumento neto	20	191
Clase S USD de Distribución (M) Plus		
Vendido	3	89
Redimido	(13)	(3)
(Disminución)/aumento neto	(10)	86
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendido	62	46
Redimido	(79)	(132)
Disminución neta	(17)	(86)
Clase A USD de Distribución (A)		
Vendido	1	2
Redimido	(4)	(6)
Disminución neta	(3)	(4)
Clase A AUD de Capitalización (Cubierta)		
Vendido	9	8
Redimido	(14)	(13)
Disminución neta	(5)	(5)
Clase A CNH de Capitalización (Cubierta)		
Vendido	93	9
Redimido	(69)	(4)
Aumento neto	24	5
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)		
Vendido	13	5
Redimido	(41)	(30)
Disminución neta	(28)	(25)
Clase A EUR de Capitalización		
Vendido	23	24
Redimido	(26)	(38)
Disminución neta	(3)	(14)
Clase A Euro de Distribución (A) (Cubierta)		
Vendido	–	1
Redimido	–	(1)
Aumento neto	–	–
Clase A GBP de Capitalización (Cubierta)		
Redimido	(1)	(2)
Disminución neta	(1)	(2)
Clase A SEK de Capitalización (Cubierta)		
Vendido	2	11
Redimido	(2)	(8)
Aumento neto	–	3
Clase A SGD de Capitalización (Cubierta)		
Vendido	3.299	2.460

	Correspondiente al ejercicio cerrado	
	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)
Redimido	(2.222)	(1.907)
Aumento neto	1.077	553
Clase A SGD de Capitalización		
Vendido	561	388
Redimido	(3.780)	(423)
Disminución neta	(3.219)	(35)
Clase C USD de Capitalización		
Vendido	5	2
Redimido	(11)	(3)
Disminución neta	(6)	(1)
Clase E USD de Capitalización		
Vendido	3	5
Redimido	(10)	(5)
Disminución neta	(7)	–
Clase E EUR de Capitalización (Cubierta)		
Vendido	7	1
Redimido	(1)	(1)
Aumento neto	6	–
Clase E EUR de Capitalización		
Vendido	3	1
Redimido	–	(1)
Aumento neto	3	–
Clase F USD de Capitalización		
Vendido	–	1
Redimido	(12)	(18)
Disminución neta	(12)	(17)
Clase X USD de Capitalización		
Vendido	31	40
Redimido	(60)	(78)
Disminución neta	(29)	(38)
Clase X USD de Distribución (A)		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase X EUR de Capitalización (Cubierta)		
Vendido	5	28
Redimido	(23)	(95)
Disminución neta	(18)	(67)
Clase X EUR de Capitalización		
Vendido	6	7
Redimido	(9)	(28)
Disminución neta	(3)	(21)
Clase X GBP de Capitalización		
Vendido	9	12
Redimido	(14)	(21)
Disminución neta	(5)	(9)
Clase X GBP de Distribución (A)		
Vendido	–	2
Redimido	(1)	(2)
Disminución neta	(1)	–
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendido	169	41
Redimido	(218)	(168)
Disminución neta	(49)	(127)
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)		
Redimido	(48)	(201)
Disminución neta	(48)	(201)
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)		
Vendido	7	13
Redimido	(17)	(1)
(Disminución)/aumento neto	(10)	12
Clase Premier EUR de Capitalización		
Vendido	15	50
Redimido	(21)	(82)
Disminución neta	(6)	(32)
Clase Premier GBP de Capitalización		
Vendido	4	9
Redimido	(34)	(35)
Disminución neta	(30)	(26)
Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)		
Vendido	42	–
Redimido	(4)	(48)
Aumento/(disminución) neto	38	(48)
FTGF Royce US Smaller Companies Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendido	26	8
Redimido	(15)	(18)
Aumento/(disminución) neto	11	(10)
Clase A USD de Distribución (A)		
Vendido	1	1

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables – (continuación)

	Correspondiente al ejercicio cerrado			Correspondiente al ejercicio cerrado	
	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)		31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)
Redimido	(3)	(4)	Disminución neta	(1)	–
Disminución neta	(2)	(3)	Clase C USD de Distribución (A)		
Clase A EUR de Capitalización			Redimido	(6)	–
Vendido	1	–	Disminución neta	(6)	–
Redimido	(3)	(1)	Clase F USD de Capitalización		
Disminución neta	(2)	(1)	Redimido	(2)	–
Clase A SEK de Capitalización (Cubierta)			Disminución neta	(2)	–
Vendido	1	5	Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)		
Redimido	(1)	(5)	Redimido	(1)	(66)
Aumento neto	–	–	Disminución neta	(1)	(66)
Clase C USD de Capitalización			Clase GA USD de Capitalización		
Redimido	–	(1)	Redimido	(45)	(1)
Disminución neta	–	(1)	Disminución neta	(45)	(1)
Clase C USD de Distribución (A)			Clase GA EUR de Capitalización		
Redimido	(1)	–	Redimido	(1)	–
Disminución neta	(1)	–	Disminución neta	(1)	–
Clase F USD de Capitalización			Clase GE USD de Capitalización		
Vendido	10	5	Redimido	(4)	–
Redimido	(4)	(4)	Disminución neta	(4)	–
Aumento neto	6	1			
Clase R USD de Capitalización			FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^{αβ}		
Redimido	(1)	–	Clase A USD de Capitalización		
Disminución neta	(1)	–	Redimido	(1)	–
Clase X USD de Capitalización			Disminución neta	(1)	–
Redimido	–	(1)	Clase M GBP de Distribución (A)		
Disminución neta	–	(1)	Vendido	–	1
Clase Premier USD de Capitalización			Redimido	(85)	(12)
Vendido	28	–	Disminución neta	(85)	(11)
Redimido	–	(1)	Clase M USD de Distribución (A)		
Aumento/(disminución) neto	28	(1)	Vendido	–	1
Clase Premier USD de Distribución (A)			Redimido	(26)	–
Vendido	2	3	(Disminución)/aumento neto	(26)	1
Redimido	(4)	(8)	Clase M Euro de Distribución (A)		
Disminución neta	(2)	(5)	Redimido	(4)	–
Clase LM EUR de Capitalización			Disminución neta	(4)	–
Redimido	(2)	(1)	Clase Premier USD de Capitalización		
Disminución neta	(2)	(1)	Redimido	(15)	–
Clase A (G) USD de Capitalización			Disminución neta	(15)	–
Redimido	(1)	–			
Disminución neta	(1)	–	FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^α		
Clase L (G) USD de Capitalización			Clase A USD de Capitalización		
Redimido	–	(1)	Vendido	1	1
Disminución neta	–	(1)	Redimido	(1)	(4)
			Disminución neta	–	(3)
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^{αδ}			Clase A EUR de capitalización (cubierta)		
Clase A USD de Capitalización			Vendido	1	–
Redimido	(12)	(1)	Redimido	–	(48)
Disminución neta	(12)	(1)	Aumento/(disminución) neto	1	(48)
Clase A USD de Distribución (A)			Clase A EUR de Capitalización		
Vendido	–	1	Vendido	1	24
Redimido	(13)	(1)	Redimido	(10)	(5)
Disminución neta	(13)	–	(Disminución)/aumento neto	(9)	19
Clase A USD de Distribución (M) Plus			Clase C USD de Capitalización		
Vendido	–	3	Redimido	(1)	–
Redimido	(38)	(5)	Disminución neta	(1)	–
Disminución neta	(38)	(2)	Clase E USD de Capitalización		
Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus			Redimido	(4)	(8)
Vendido	–	14	Disminución neta	(4)	(8)
Redimido	(45)	(2)	Clase X EUR de Capitalización		
(Disminución)/aumento neto	(45)	12	Vendido	–	1
Clase A CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus			Aumento neto	–	1
Redimido	(16)	–	Clase X GBP de Capitalización (Cubierta)		
Disminución neta	(16)	–	Redimido	(2)	(2)
Clase A EUR de Capitalización			Disminución neta	(2)	(2)
Vendido	–	1	Clase Premier USD de Capitalización		
Redimido	(1)	(1)	Vendido	3	27
Disminución neta	(1)	–	Redimido	(12)	(62)
Clase A HKD de Distribución (M) Plus			Disminución neta	(9)	(35)
Redimido	(139)	(10)	Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)		
Disminución neta	(139)	(10)	Redimido	(2)	–
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus			Disminución neta	(2)	–
Vendido	–	11	Clase S USD de Capitalización		
Redimido	(48)	–	Redimido	(63)	(8)
(Disminución)/aumento neto	(48)	11	Disminución neta	(63)	(8)
Clase C USD de Capitalización			Clase S Euro de Capitalización (cubierta)		
Redimido	(1)	–	Vendido	136	520

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables – (continuación)

	Correspondiente al ejercicio cerrado			Correspondiente al ejercicio cerrado	
	31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)		31 de agosto de 2023 Acciones (en miles)	31 de agosto de 2022 Acciones (en miles)
Redimido	(58)	(107)			
Aumento neto	78	413			
Clase S GBP de Capitalización					
Vendido	3	3			
Redimido	(1)	–			
Aumento neto	2	3			
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund					
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)					
Vendido	2	1			
Redimido	(15)	–			
(Disminución)/aumento neto	(13)	1			
Clase A SGD de Distribución (M) Plus					
Vendido	14	44			
Redimido	(7)	(49)			
Aumento/(disminución) neto	7	(5)			
Clase D AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Redimido	(6)	–			
Disminución neta	(6)	–			
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus					
Redimido	(89)	(807)			
Disminución neta	(89)	(807)			
Clase D USD de Distribución (M) Plus					
Vendido	–	2			
Redimido	(9)	–			
(Disminución)/aumento neto	(9)	2			
Clase D USD de Capitalización					
Redimido	(11)	–			
Disminución neta	(11)	–			
Clase X AUD de Capitalización					
Redimido	(1)	(1)			
Disminución neta	(1)	(1)			
Clase X USD de Capitalización					
Vendido	–	2			
Redimido	–	(1)			
Aumento neto	–	1			
Clase LM AUD de Capitalización					
Redimido	–	(4)			
Disminución neta	–	(4)			
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^					
Clase A USD de Capitalización					
Vendido	–	1			
Redimido	(8)	(26)			
Disminución neta	(8)	(25)			
Clase E USD de Capitalización					
Vendido	–	1			
Aumento neto	–	1			
Clase F USD de Capitalización					
Vendido	12	67			
Redimido	(23)	(32)			
Aumento/(disminución) neto	(11)	35			
Clase X USD de Capitalización					
Redimido	–	(6)			
Disminución neta	–	(6)			
Clase Premier USD de Capitalización					
Vendido	–	25			
Redimido	(3)	(38)			
Disminución neta	(3)	(13)			
Clase S USD de Capitalización					
Vendido	1	1			
Redimido	(1)	(10)			
Disminución neta	–	(9)			
Clase S Euro de Capitalización					
Vendido	–	1			
Redimido	–	(45)			
Disminución neta	–	(44)			
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^					
Clase A EUR de Capitalización					
Vendido	1	4			
Redimido	(2)	(26)			
Disminución neta	(1)	(22)			
Clase X EUR de Capitalización					
Vendido	–	1			
Redimido	(1)	–			
Disminución neta	(1)	–			
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)					
Vendido	12	–			
Redimido	(53)	(54)			
Disminución neta	(41)	(54)			
Clase Premier EUR de Capitalización					
Vendido	1	7			
Redimido	(1)	(168)			
Disminución neta	–	(161)			
Clase S USD de Capitalización					
Vendido	–	5			
Aumento neto	–	5			
Clase S Euro de Capitalización					
Vendido	31	95			
Redimido	(40)	(445)			
Disminución neta	(9)	(350)			
Clase S GBP de Capitalización					
Vendido	61	91			
Redimido	(63)	(13)			
(Disminución)/aumento neto	(2)	78			
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^y					
Clase A USD de Capitalización					
Vendido	1	–			
Aumento neto	1	–			
Clase S USD de Capitalización					
Vendido	47	–			
Aumento neto	47	–			
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)					
Vendido	1	–			
Aumento neto	1	–			
Clase S GBP de Capitalización (Cubierta)					
Vendido	1	–			
Aumento neto	1	–			
Franklin Responsible Income 2028 Fund^					
Clase A EUR de Capitalización					
Vendido	113	–			
Redimido	(3)	–			
Aumento neto	110	–			
Clase A EUR de Distribución (A) Plus					
Redimido	(1)	–			
Disminución neta	(1)	–			
Clase A EUR de Distribución (A)					
Vendido	399	–			
Redimido	(4)	–			
Aumento neto	395	–			
Franklin Responsible Income 2028 Fund^ – (continuación)					
Clase D Euro de Capitalización					
Vendido	13	–			
Redimido	(1)	–			
Aumento neto	12	–			
Clase D EUR de Distribución (A)					
Vendido	2	–			
Redimido	(1)	–			
Aumento neto	1	–			
Clase K EUR de Capitalización					
Redimido	(1)	–			
Disminución neta	(1)	–			
Clase K EUR de Distribución (A)					
Redimido	(1)	–			
Disminución neta	(1)	–			
Clase X EUR de Capitalización					
Vendido	5	–			
Redimido	(97)	–			
Disminución neta	(92)	–			
Clase X EUR de Distribución (A)					
Vendido	192	–			
Redimido	(114)	–			
Aumento neto	78	–			

Estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables – (continuación)

– Los importes que se indican con “–” equivalen a 0 o son inferiores a 1000. Solo se muestran las clases con operaciones durante el ejercicio financiero.

α A partir del 24 de marzo de 2023, FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^α y FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^α dejaron de cotizar.

β A partir del 20 de abril de 2023, el FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^β dejó de cotizar.

γ A partir del 20 de junio de 2023, se lanza el FTGF Martin Currie Improving Society Fund^γ.

δ A partir de la fecha efectiva de 17 de julio de 2023, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^δ dejó de cotizar en bolsa.

^ No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Notas relativas a los estados financieros

1. Políticas contables relevantes

Las principales políticas contables y técnicas de estimación aplicadas en la elaboración de los presentes estados financieros coinciden con las adoptadas por la Sociedad en los estados financieros anuales correspondientes al ejercicio finalizado el 28 de febrero de 2023.

Declaración de conformidad

Los estados financieros del ejercicio financiero cerrado el 31 de agosto de 2023 han sido elaborados de conformidad con la Norma de información financiera ("NIF") 104: "Información financiera intermedia", el Reglamento de las Comunidades Europeas (Organismos de Inversión Colectiva en Valores Mobiliarios) de 2011 (modificado) (el "Reglamento OICVM") y el Reglamento del Banco Central (Supervisión y Ejecución) de 2013 (artículo 48(1)) (Organismos de Inversión Colectiva en Valores Mobiliarios) de 2019 (el "Reglamento OICVM del Banco Central"). Los estados financieros resumidos deben leerse conjuntamente con los estados financieros auditados correspondientes al ejercicio finalizado el 28 de febrero de 2023, que se han elaborado de conformidad con la NIF 102: "La norma de información financiera aplicable en el Reino Unido y la República de Irlanda".

Base de preparación

Los estados financieros han sido elaborados según el principio de empresa en funcionamiento de la Sociedad siguiendo la convención de coste histórico, modificada con la revaluación de los activos y pasivos financieros reconocidos a valor razonable en la cuenta de resultados. Los estados financieros de 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[^], FTGF 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[^] and FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] han sido elaborados sobre la base de no estar en funcionamiento, ya que estos Fondos se cerraron durante el ejercicio financiero actual y el anterior.

El formato y parte de la redacción de los estados financieros se han adaptado a partir de los comprendidos en la Ley de Sociedades de 2014 para que reflejaran con mayor exactitud, en opinión de los Consejeros, la naturaleza de las actividades de la Sociedad como fondo de inversión.

La Sociedad se ha acogido a la exención otorgada a los fondos de inversión con capital variable bajo la Sección 7 "Estado de flujos de efectivo" de la NIF 102, para no preparar un estado de flujos de efectivo sobre la base de que todas las inversiones de la Sociedad tienen una liquidez considerablemente alta y se llevan a cabo a valor razonable y la Sociedad proporciona un estado de cambios en los activos netos atribuibles a los tenedores de acciones participativas rescatables.

2. Gestión eficiente de la cartera

Con sujeción a las condiciones y dentro de los límites establecidos en cada momento por el Banco Central de Irlanda (el "Banco Central"), y salvo que se indique lo contrario en el objetivo y las políticas de inversión de un Fondo, las Gestoras de inversiones y/o las Subgestoras de inversiones podrán emplear técnicas e instrumentos de inversión como futuros, opciones, contratos a plazo sobre divisas y otros derivados con la finalidad de gestionar la cartera de manera eficiente. Además, pueden desarrollarse nuevas técnicas e instrumentos que pueden ser adecuados para su uso por parte de un Fondo en el futuro y un Fondo puede emplear dichas técnicas e instrumentos sujetos a la aprobación previa del Banco Central y a cualquier restricción impuesta por éste.

Para los OICVM que hayan utilizado técnicas e instrumentos de gestión eficiente de la cartera, se exige ofrecer información en virtud del Reglamento sobre OICVM del Banco Central. Un OICVM está obligado a publicar los ingresos derivados de las técnicas e instrumentos de gestión eficaz de la cartera correspondientes a todo el periodo de referencia, junto con las comisiones y costes operativos directos e indirectos incurridos. Consulte la tabla que figura a continuación.

Los detalles de los instrumentos financieros derivados abiertos al final del ejercicio financiero se describen en la Cartera de inversiones de los Fondos. Todas las ganancias y pérdidas realizadas derivadas del uso de contratos derivados para la gestión eficiente de la cartera se incluyen en ganancias/(pérdidas) netas sobre activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados en el Estado del resultado global.

Durante el ejercicio financiero se suscribieron pactos de recompra inversa con el fin de gestionar eficazmente la cartera. Los detalles de todos los acuerdos de recompra inversa al final del ejercicio financiero figuran en la cartera de inversiones.

Contratos de recompra inversa

Una parte de los activos de cada Fondo puede mantenerse en activos líquidos auxiliares. A efectos de una gestión eficaz de la cartera, cada Fondo podrá celebrar acuerdos de recompra y acuerdos de recompra inversa.

El siguiente cuadro muestra los ingresos obtenidos por acuerdos de recompra inversa durante el ejercicio financiero finalizado el 31 de agosto de 2023:

Nombre del Fondo	31 de agosto de 2023 (en miles)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	6.581 \$

No ha habido costes de transacción en las compras y ventas de acuerdos de recompra inversa.

Operaciones de préstamo de valores

Algunos Fondos también pueden utilizar acuerdos de préstamo de valores con el fin de gestionar de manera eficiente la cartera, como se ha descrito anteriormente. En tales operaciones, el Fondo puede transferir temporalmente sus títulos a un prestatario, con el acuerdo del prestatario de devolver títulos equivalentes al Fondo en un momento previamente acordado. Al concertar dichas operaciones, el Fondo tratará de incrementar los rendimientos de su cartera de valores percibiendo una comisión por poner sus valores a disposición del prestatario. No hubo operaciones de préstamo de valores en ninguno de los Fondos durante el ejercicio financiero finalizado el 31 de agosto de 2023.

3. Gastos de explotación y otras operaciones con partes vinculadas

De conformidad con el contrato de gestión entre Franklin Templeton International Services S.à r.l (la "Gestora" o "FTIS") y la Sociedad (el "Contrato de Gestión"), la Gestora tendrá derecho a percibir una comisión de gestión con cargo a los activos del Fondo correspondiente por sus servicios de gestión y distribución de inversiones, que se devengará cada día de negociación y se pagará mensualmente a plazo vencido (las "Comisiones de Gestión"). La Sociedad también será responsable de pagar o reembolsar oportunamente a la Gestora recién nombrada todas las comisiones, las comisiones por transferencia, las comisiones por registro, los impuestos y responsabilidades similares, los costes y los gastos menores que deba pagar o en los que hubiese incurrido FTIS.

La comisión de gestión máxima para cada clase de acciones ((reconocidas como un porcentaje del valor liquidativo del Fondo correspondiente atribuible a dicha clase) al cierre del ejercicio financiero es la siguiente

Nombre del Fondo	Comisión de Gestión máxima	Nombre del Fondo	Comisión de Gestión máxima
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		FTGF Western Asset US Core Bond Fund	
Clase A	0,800%	Clase A	0,800%
Clase B	1,050%	Clase B	1,050%
Clase C	1,300%	Clase C	1,300%
Clase E	1,400%	Clase E	1,400%
Clase X	0,600%	Clase F	0,400%
Clase Premier	0,300%	Clase R	0,550%
Clase LM	Ninguna	Clase T	0,800%
Clase A (G)	0,800%	Clase X	0,300%
Clase L (G)	0,800%	Clase Premier	0,300%
		Clase S	0,200%
		Clase LM	Ninguna
		Clase GA	0,820%
		Clase GE	1,420%

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Notas a los Estados Financieros — (continuación)

3. Gastos de explotación y otras operaciones con partes vinculadas (continuación)

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

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Notas a los Estados Financieros — (continuación)

3. Gastos de explotación y otras operaciones con partes vinculadas (continuación)

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

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Notas a los Estados Financieros — (continuación)

3. Gastos de explotación y otras operaciones con partes vinculadas (continuación)

Nombre del Fondo	Comisión de Gestión máxima	Nombre del Fondo	Comisión de Gestión máxima
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	
Clase A	1,100%	Clase A	1,250%
Clase B	1,350%	Clase B	1,750%
Clase C	1,600%	Clase C	1,750%
Clase E	1,700%	Clase E	2,000%
Clase F	0,800%	Clase F	1,000%
Clase J	0,450%	Clase R	0,800%
Clase R	0,700%	Clase T	1,250%
Clase T	1,100%	Clase X	0,625%
Clase X	0,550%	Clase Premier	0,625%
Clase Premier	0,550%	Clase LM	Ninguna
Clase S	0,450%	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	
Clase LM	Ninguna	Clase A	1,200%
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]		Clase B	1,700%
Clase A	1,200%	Clase C	1,700%
Clase E	1,950%	Clase E	1,950%
Clase F	0,950%	Clase F	0,950%
Clase R	0,700%	Clase R	0,700%
Clase T	1,200%	Clase T	1,200%
Clase X	0,600%	Clase X	0,600%
Clase Premier	0,600%	Clase Premier	0,600%
Clase S	0,500%	Clase S	0,400%
Clase LM	Ninguna	Clase LM	Ninguna
FTGF ClearBridge Value Fund		FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]	
Clase A	1,350%	Clase A	1,300%
Clase B	1,850%	Clase B	1,800%
Clase C	1,850%	Clase C	1,800%
Clase E	2,100%	Clase E	2,050%
Clase F	1,100%	Clase F	1,050%
Clase R	0,850%	Clase R	0,800%
Clase T	1,350%	Clase T	1,300%
Clase X	0,675%	Clase X	0,650%
Clase Premier	0,675%	Clase Premier	0,650%
Clase LM	Ninguna	Clase S	0,550%
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund		Clase LM	Ninguna
Clase A	1,250%	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]	
Clase B	1,750%	Clase A	1,500%
Clase C	1,750%	Clase B	2,000%
Clase E	2,000%	Clase C	2,000%
Clase F	1,000%	Clase E	2,250%
Clase R	0,750%	Clase F	1,250%
Clase T	1,250%	Clase R	1,000%
Clase X	0,625%	Clase T	1,500%
Clase Premier	0,625%	Clase U	0,650%
Clase LM	Ninguna	Clase X	0,750%
Clase A (G)	1,250%	Clase Premier	0,750%
Clase B (G)	1,750%	Clase LM	Ninguna
Clase L (G)	1,750%	Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^]	
Clase GA	1,420%	Clase A	1,650%
Clase GE	2,170%	Clase B	2,150%
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund		Clase C	2,150%
Clase A	1,250%	Clase E	2,400%
Clase B	1,750%	Clase F	1,400%
Clase C	1,750%	Clase R	1,150%
Clase E	2,000%	Clase T	1,650%
Clase F	1,000%	Clase X	1,000%
Clase R	0,750%	Clase Premier	1,000%
Clase T	1,250%	Clase S	0,600%
Clase U	0,525%	Clase LM	Ninguna
Clase X	0,625%	FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	
Clase Premier	0,625%	Clase A	1,500%
Clase LM	Ninguna	Clase B	2,000%
Clase A (G)	1,250%	Clase C	2,000%
Clase L (G)	1,750%	Clase E	2,250%
Clase GA	1,420%	Clase F	1,250%
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		Clase R	1,000%
Clase A	1,300%	Clase T	1,500%
Clase B	1,800%	Clase U	0,600%
Clase C	1,800%	Clase X	0,750%
Clase E	2,050%	Clase Premier	0,750%
Clase F	1,050%	Clase S	0,400%
Clase R	0,800%	Clase LM	Ninguna
Clase T	1,300%	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	
Clase X	0,650%	Clase A	1,500%
Clase Premier	0,650%	Clase B	2,000%
Clase LM	Ninguna	Clase C	2,000%
Clase A (G)	1,300%	Clase E	2,250%
Clase B (G)	1,800%	Clase F	1,250%
Clase L (G)	1,800%	Clase R	1,000%
Clase GA	1,420%	Clase T	1,500%
Clase GE	2,170%	Clase X	0,750%
		Clase Premier	0,750%
		Clase LM	Ninguna

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Notas a los Estados Financieros — (continuación)

3. Gastos de explotación y otras operaciones con partes vinculadas (continuación)

Nombre del Fondo	Comisión de Gestión máxima	Nombre del Fondo	Comisión de Gestión máxima
FTGF Royce US Smaller Companies Fund		FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]	
Clase A	1,500%	Clase A	1,500%
Clase B	2,000%	Clase B	2,000%
Clase C	2,000%	Clase C	2,000%
Clase E	2,250%	Clase E	2,250%
Clase F	1,250%	Clase F	1,250%
Clase R	1,000%	Clase R	1,000%
Clase T	1,500%	Clase T	1,500%
Clase X	0,750%	Clase X	0,750%
Clase Premier	0,750%	Clase Premier	0,750%
Clase LM	Ninguna	Clase S	0,650%
Clase A (G)	1,250%	Clase LM	Ninguna
Clase L (G)	1,750%		
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]		FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	
Clase A	1,500%	Clase A	1,500%
Clase B	2,000%	Clase B	2,000%
Clase C	2,000%	Clase C	2,000%
Clase E	2,250%	Clase D	1,100%
Clase F	1,250%	Clase E	2,250%
Clase R	1,000%	Clase F	1,250%
Clase T	1,500%	Clase R	1,000%
Clase X	0,750%	Clase T	1,500%
Clase Premier	0,750%	Clase X	0,750%
Clase S	0,550%	Clase Premier	0,750%
Clase LM	Ninguna	Clase S	0,440%
		Clase LM	Ninguna
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^]		FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]	
Clase A	1,350%	Clase A	1,500%
Clase B	1,850%	Clase B	2,000%
Clase C	1,850%	Clase C	2,000%
Clase E	2,100%	Clase E	2,250%
Clase F	1,100%	Clase F	1,250%
Clase R	0,850%	Clase J	0,650%
Clase T	1,350%	Clase R	1,000%
Clase X	0,675%	Clase T	1,500%
Clase Premier	0,675%	Clase X	0,750%
Clase S	0,500%	Clase Premier	0,750%
Clase LM	Ninguna	Clase S	0,650%
Clase A (G)	1,350%	Clase LM	Ninguna
Clase B (G)	1,850%		
Clase L (G)	1,850%	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]	
Clase GA	1,420%	Clase A	1,500%
Clase GE	2,170%	Clase B	2,000%
Clase GP	0,850%	Clase C	2,000%
		Clase E	2,250%
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^]		Clase F	1,250%
Clase A	1,350%	Clase R	1,000%
Clase B	1,850%	Clase X	0,750%
Clase C	1,850%	Clase Premier	0,750%
Clase E	2,100%	Clase S	0,650%
Clase F	1,100%	Clase LM	Ninguna
Clase R	0,850%		
Clase T	1,350%	FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^]	
Clase X	0,675%	Clase A	1,500%
Clase Premier	0,675%	Clase B	2,000%
Clase S	0,500%	Clase C	2,000%
Clase LM	Ninguna	Clase E	2,250%
Clase GA	1,620%	Clase F	1,250%
Clase GE	2,370%	Clase R	1,000%
		Clase T	1,500%
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^]		Clase X	0,750%
Clase A	1,350%	Clase Premier	0,750%
Clase B	1,850%	Clase S	0,650%
Clase C	1,850%	Clase LM	Ninguna
Clase E	2,100%		
Clase F	1,100%	Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]	
Clase R	0,850%	Clase A	0,60%
Clase T	1,350%	Clase D	1,15%
Clase X	0,675%	Clase K	0,60%
Clase Premier	0,675%	Clase X	0,20%
Clase S	0,500%		
Clase LM	Ninguna		
Clase GA	1,420%		
Clase GE	2,170%		
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^]			
Clase A	1,500%		
Clase B	2,000%		
Clase C	2,000%		
Clase E	2,250%		
Clase F	1,250%		
Clase M	1,000%		
Clase R	1,000%		
Clase T	1,500%		
Clase Premier	0,750%		
Clase LM	Ninguna		

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Notas a los Estados Financieros — (continuación)

3. Gastos de explotación y otras operaciones con partes vinculadas (continuación)

En las tablas anteriores, las Comisiones de Gestión señaladas para cada Fondo se aplican a cualquiera de las clases de acciones incluidas en la columna correspondiente y ofrecidas por el Fondo. No todas las clases de acciones se ofrecen para cada Fondo y no todas las clases de acciones estaban en circulación al cierre del ejercicio en curso y del anterior. El Folleto informativo, en la medida en que pueda ser modificado o complementado periódicamente, especifica las clases de acciones que ofrece cada Fondo.

En virtud de cada contrato de gestión de inversiones, la Gestora será responsable de pagar las comisiones y los gastos menores de la Gestora de inversiones pertinente.

La Gestora ha acordado voluntariamente renunciar a una parte de sus comisiones y/o reembolsar ciertos gastos, a fin de que los gastos totales no superen ciertas limitaciones de gasto voluntarias establecidas para los Fondos. El Gestor, a su propio criterio, podrá revisar o interrumpir las renunciaciones voluntarias y/o los reembolsos de gastos en cualquier momento.

Para el ejercicio financiero finalizado el 31 de agosto de 2023, las comisiones de gestión exoneradas y reembolsadas y otros gastos recuperados fueron los siguientes:

Nombre del Fondo	Para el periodo finalizado el 31 agosto 2023 (en miles)	
	Renuncia a comisiones de gestión	Reembolso de comisiones de gestión y otros gastos recuperados
FTGF Western Asset US High Yield Fund	- USD	1 \$
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	- USD	29 \$
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	14 \$	15 \$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	15 \$	- USD
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	16 \$	2 \$
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	- USD	6 \$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	27 \$	7 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	11 \$	- USD
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	14 \$	- USD
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	16 \$	2 \$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^]	1 \$	38 \$
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	1 \$	16 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	1 \$	4 \$
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	16 \$	- USD
FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	- USD	19 \$
Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	1 €	- €

Los importes que se indican con “-” equivalen a cero USD/EUR o son inferiores a 1000 USD/EUR.

De conformidad con cada Contrato de gestión de inversiones, cada Gestora de inversiones tiene derecho a percibir una comisión de gestión de inversiones y cada Gestora de inversiones será responsable de pagar las comisiones y los gastos de desembolso de cualquier Subgestora de inversiones con cargo a su propia Comisión de gestión de inversiones (que puede incluir “comisiones de rentabilidad”).

En virtud del Contrato marco de distribución celebrado entre la Gestora, la Sociedad y Franklin Distributors, LLC (el “Distribuidor Principal”), el Distribuidor principal está autorizado a comercializar, promocionar, ofrecer y organizar la venta y el reembolso de acciones de la Sociedad (conjuntamente, los “servicios de distribución”). Además, el Distribuidor principal está autorizado a contratar, a sus propias expensas y costes, a uno o más distribuidores para que le asistan en el desempeño de sus funciones y responsabilidades, siempre que el nombramiento de esas otras empresas se realice de conformidad con lo exigido por las Normas del Banco Central. En virtud de los términos del Contrato de distribución principal entre el Administrador, la Sociedad y el Distribuidor principal, el Distribuidor principal en tales casos seguirá siendo responsable ante el Administrador del cumplimiento de sus obligaciones en virtud de dicho contrato. El Distribuidor principal, de conformidad con los requisitos del Banco Central, ha designado a Franklin Templeton Investments (Asia) Limited (“FTIA”) y Templeton Asset Management Ltd. como Distribuidores adicionales de los Fondos. La Gestora también se ha designado a sí misma y a Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc para prestar determinados servicios de distribución.

La Sociedad también será responsable de pagar o reembolsar oportunamente al Gestor todas las comisiones, las comisiones por transferencia, las comisiones por registro, los impuestos y responsabilidades similares, los costes y los gastos menores que deba pagar o en los que hubiese incurrido el Gestor.

Comisión de Servicios a los Accionistas

De conformidad con el Contrato de Gestión celebrado entre la Sociedad y el Gestor, este tendrá derecho a recibir una comisión por la prestación de servicios al accionista con cargo a los activos de los Fondos correspondientes por sus servicios, que se devengará en cada día de negociación y que será pagadero a meses vencidos (la “Comisión de Servicios a los Accionistas”). Las Comisiones por servicios a los accionistas se abonarán mensualmente a mes vencido y se devengarán cada día de negociación. En virtud del Contrato principal de servicios a los accionistas celebrado entre la Gestora, la Sociedad y Franklin Distributors, LLC (el “Agente principal de servicios a los accionistas”), el Agente principal de servicios a los accionistas tendrá derecho a percibir de la Gestora una comisión de servicios a los accionistas de algunas de las clases de acciones por sus servicios como Agente de servicios a los accionistas.

En virtud del Contrato de agente principal de servicios a los accionistas, el Agente principal de servicios a los accionistas está autorizado a contratar, a sus propias expensas y costes, a una o más partes con el fin de que le asistan en el desempeño de sus funciones en virtud del contrato, siempre que el Agente principal de servicios a los accionistas siga siendo responsable ante el Administrador del cumplimiento de sus obligaciones en virtud de dicho contrato. De conformidad con lo anterior, el Agente principal de servicios a los accionistas ha designado a FTIA y Templeton Asset Management Ltd. como Agentes adicionales de servicios a los accionistas de la Sociedad. La Gestora ha autorizado a Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc a prestar servicios a los accionistas en lo relativo a Taiwán.

El importe total de las Comisiones de servicios a los accionistas abonadas por cada clase de acciones será o ha sido igual a lo siguiente:

- (i) 0,15 por ciento anual del valor liquidativo de 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[^] y FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]; y
- (ii) 0,35 por ciento anual del valor liquidativo de 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[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] y FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^].

Las Comisiones de servicios al accionista se pagan en todas las clases, excepto las clases de acciones F, J, U, Y, Premier, S, LM, Grandfathered y Galleon (según se definen en el Folleto), y tampoco se pagan en todas las clases de acciones ofrecidas por FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^] y Franklin Responsible Income 2028 Fund[^].

Para el ejercicio financiero finalizado el 31 de agosto de 2023, las comisiones de servicios a los accionistas a las que se renunció fueron las siguientes:

Nombre del Fondo	Comisión de servicios a los accionistas condonada para el periodo finalizado el 31 de agosto de 2023 (en miles)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	8 \$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	3 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	1 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	13 \$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	3 \$
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	4 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	11 \$
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	46 \$

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Notas a los Estados Financieros — (continuación)

3. Gastos de explotación y otras operaciones con partes vinculadas (continuación)

Nombre del Fondo	Comisión de servicios a los accionistas condonada para el periodo finalizado el
	31 de agosto de 2023 (en miles)
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	1 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	2 \$
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	7 \$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^]	2 \$
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	1 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	16 \$
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	2 \$

Los importes que se indican con “-” equivalen a cero USD/EUR o son inferiores a 1000 USD/EUR.

Además, ciertos gastos de explotación, incluidos, entre otros, los honorarios pagaderos a filiales de Franklin Templeton por la prestación de apoyo de gobernanza y elaboración de informes al Consejo, servicios de seguros al Consejo y servicios de registro continuo para jurisdicciones en las que se ofrezcan los Fondos públicamente. Para el ejercicio financiero finalizado el 31 de diciembre de 2023, estos gastos ascendieron a 581.299 USD.

Partes vinculadas

Jane Trust, Jaspal Sagger, William Jackson (hasta la fecha de su dimisión) y Craig Tyle son o han sido Consejeros de la Sociedad y también han sido consejeros o ejecutivos de ciertas filiales de la Gestora, la Gestora de inversiones, los Distribuidores y los Agentes de servicios a los accionistas. Joseph Carrier ha sido Consejero de la Sociedad y, hasta la fecha de cese de su actividad en Franklin Templeton Investments el 3 de octubre de 2022, también ha sido consejero o ejecutivo de ciertas filiales del Gestor, los Gestores de Inversiones, los Distribuidores y los Agentes de Servicios a los Accionistas. William Jackson ha sido Consejero de FTIS (hasta la fecha de su dimisión). Jane Trust también es Consejera de FTIS. El resto de Consejeros de la Sociedad, tal como se indica anteriormente, son o han sido todos empleados de FTIS o de una de sus filiales. Salvo en la medida expuesta anteriormente, ninguno de los Consejeros tiene interés alguno, ya sea de naturaleza directa o indirecta, en contrato o convenio alguno que subsista a la fecha del presente que sea significativo en relación con la actividad mercantil de la Sociedad.

A 31 de agosto de 2023, los Fondos en la tabla que figura a continuación mantenían inversiones en planes de inversión colectiva que han designado a la misma Gestora, Gestoras de inversiones, o Subgestora de inversiones que el Fondo, o que han designado a una parte vinculada de esa Gestora, Gestoras de inversiones o Subgestoras de inversiones.

La tabla siguiente muestra el porcentaje de participación de la Sociedad en tales planes de inversión colectiva:

Fondo	Planes de inversión colectiva subyacentes	31 de agosto de 2023	
		%	Valor (miles)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,38%	10.768 \$
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,02%	520 €
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – LM Class US\$ de Capitalización	20,99%	3.032 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,01%	143 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,09%	2.645 \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,14%	3.957 \$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Franklin Templeton China Funds - Western Asset China Bond Fund - Class LM	3,40%	11.973 \$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – LM Class US\$ de Capitalización	2,15%	310 \$
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,01%	222 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,06%	1.606 \$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,57%	15.887 \$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,13%	3.712 \$
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,03%	750 \$
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,00%	130 \$
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,01%	365 \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,16%	4.355 \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,28%	7.710 \$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,03%	846 \$
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,32%	8.871 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	2,19%	61.400 \$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,02%	630 \$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,03%	931 \$
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	1,40%	39.321 \$
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,04 %	1.044 \$
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,01 %	171 \$
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,02 %	573 \$
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	0,01 %	241 \$

Las inversiones cruzadas entre Fondos de la Sociedad se muestran en la Nota 13 a los estados financieros.

Operaciones con partes vinculadas

El Reglamento 43(1) del Reglamento sobre OICVM del Banco Central establece que una “persona responsable garantizará que todas las transacciones entre un OICVM y una persona relacionada se realicen: a) en condiciones de independencia mutua; y b) en interés de los partícipes del OICVM”.

Según exige el Reglamento 81(4) de los Reglamentos sobre OICVM del Banco Central, el Consejo confirma (a) la existencia de mecanismos y procedimientos escritos establecidos para asegurar que las obligaciones que se estipulan en el Reglamento 43(1) se apliquen a todas las transacciones con personas vinculadas; y (b) que todas las transacciones con personas vinculadas que se formalizaron durante el ejercicio financiero cumplieron con las obligaciones que se estipulan en el Reglamento 43(1).

Comisiones de Administrador y Depositario

Bank of New York Mellon SA/NV, sucursal de Dublín, actúa como depositario (el “Depositario”) y BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company actúa como administrador (el “Administrador”) de todos los Fondos de la Sociedad. Por los servicios de administración, contabilidad, accionariado, fideicomiso y depositario, perciben colectivamente de los Fondos una comisión de hasta el 0,15% del valor liquidativo de cada Fondo.

Remuneración de los consejeros

Los honorarios de los consejeros y los gastos varios cargados en la cuenta de resultados dentro del Estado del resultado global y pertenecientes al ejercicio financiero finalizado el 31 de agosto de 2023 ascendieron a 90.000 USD.

Los honorarios de los consejeros no se abonan para Jane Trust, Jaspal Sagger, William Jackson (hasta la fecha de su dimisión) y Craig Tyle, que son o han sido empleados de la Gestora, las Gestoras de inversiones o sus filiales. Los honorarios de los consejeros no se abonaron para Joseph Carrier hasta el 3 de octubre de 2022, la fecha de cese de su trabajo a tiempo completo en Franklin Templeton Investments. El Sr. Carrier seguirá actuando como Consejero no ejecutivo de la Sociedad y a partir del 3 de octubre de 2022 será remunerado en línea con los demás Consejeros no ejecutivos de la Sociedad.

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Notas a los Estados Financieros — (continuación)

3. Gastos de explotación y otras operaciones con partes vinculadas (continuación)

Otras operaciones con partes vinculadas

En la tabla siguiente se muestra el porcentaje de participación de los accionistas relevantes con más del 20% del capital social emitido del Fondo:

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

Global Credit Facility

La Sociedad, junto con otros fondos de inversión europeos y estadounidenses registrados y gestionados por Franklin Templeton Investments (individualmente, el "Prestatario" y colectivamente los "Prestatarios"), formalizaron una línea de crédito preferente conjunta, sin garantía personal y sindicada, por un importe total de 2675 millones de USD (la "línea de crédito global") para proporcionar fondos a los Prestatarios que les permitiera atender necesidades temporales y de emergencia, así como la posibilidad de atender futuras solicitudes de reembolso imprevistas o por importes atípicamente elevados.

Según los términos estipulados en la Línea de crédito global, la Sociedad, además de los intereses cargados de los préstamos suscritos a su nombre y otros costes en que haya incurrido, pagará el porcentaje de comisiones y gastos que le corresponda en concepto de apertura y mantenimiento de dicha Línea de crédito, en función de su cuota relativa del patrimonio neto conjunto mantenido por todos los Prestatarios, incluida una comisión de asignación anual basada en la parte no utilizada de la Línea de crédito global.

Todos los Fondos de la Sociedad, a excepción del FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, están incluidos en el ámbito de aplicación de la Línea de crédito global.

4. Distribuciones a los tenedores de participaciones reembolsables

Clases de Acciones de Distribución

La letra entre paréntesis al final del nombre de cada Clase de acciones de distribución indica una frecuencia concreta de declaraciones y pagos de dividendos, tal como se detalla en la tabla siguiente.

Designación de la clase de acciones de distribución	Frecuencia de declaraciones de dividendo	Frecuencia de pagos de dividendo
(D)	Diaria	Mensual
(M)	Mensual	Mensual
(T)	Trimestral	Trimestral (marzo, junio, septiembre, diciembre)
(S)	Semestral	Semestral (marzo, septiembre)
(A)	Anual	Anual (marzo)

Para cada Clase de acciones de distribución de cada Fondo de renta fija (Fondo de renta fija según se define en la página 15), en el momento de cada declaración de dividendos: (1) la totalidad, o una parte, de los ingresos netos, en caso de existir, se declararán como dividendos; y (2) la totalidad, o una parte, de las plusvalías de capital netas materializadas y latentes, una vez deducidas las pérdidas de capital materializadas y latentes, pueden ser declaradas como dividendos, pero no están obligadas a serlo.

Para cada Clase de acciones de distribución de cada Fondo de renta variable (Fondo de renta variable según se define en la página 15), en el momento de cada declaración de dividendos, todos o parte de los rendimientos netos de las inversiones, si los hubiera, se declararán como dividendo. Para cada Accionista de cada Clase de acciones de distribución, las distribuciones se realizarán en la moneda en la que el Accionista suscribió las acciones, a menos que el Accionista solicite lo contrario.

Para cada Clase de acciones de distribución de cada Fondo multiactivo (Fondo multiactivo según se define en la página 15), en el momento de cada declaración de dividendos, todos o parte de los rendimientos netos de las inversiones, si los hubiera, se declararán como dividendo. Para cada Accionista de cada Clase de Acciones de Distribución, las distribuciones se realizarán en la moneda en la que el Accionista suscribió las acciones, a menos que el Accionista solicite lo contrario.

Las Clases de acciones plus de distribución pueden declarar y pagar distribuciones con cargo al capital. Los inversores en estas clases de acciones deben ser conscientes de que el pago de dividendos con cargo al capital equivale a una devolución o retirada de parte de la inversión original del inversor o de las plusvalías atribuibles a dicha inversión original, y tales distribuciones darán lugar a la correspon-

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Notas a los Estados Financieros — (continuación)

4. Distribuciones a los tenedores de participaciones reembolsables (continuación)

diente disminución inmediata del valor liquidativo por acción de la clase de acciones. Por consiguiente, el pago de distribuciones con cargo al capital provocará una erosión del capital y puede lograrse renunciando al potencial de crecimiento futuro del capital.

Durante el ejercicio financiero, los siguientes Fondos han pagado distribuciones con cargo al capital de las Clases de acciones plus de distribución:

	Distribuciones de capital para el período finalizado el 31 de agosto de 2023 (en miles)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund - Class A US\$ Distributing (M) Plus	24 \$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund - Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	7 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund - Class A US\$ Distributing (M) Plus	5 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund - Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	1 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund - Class A HKD Distributing (M) Plus	- USD
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund - Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	7 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund - Class A ZAR Distributing (M) (Hedged) Plus	14 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund - Class A US\$ Distributing (M) Plus	15 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund - Class A HKD Distributing (M) Plus	- USD
FTGF Western Asset US High Yield Fund - Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	3 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund - Class A US\$ Distributing (M) Plus	53 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund - Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	54 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund - Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	20 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund - Class A US\$ Distribuible (M) Plus	408 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund - Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	177 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund - Class A CNH Distributing (M) (Hedged) Plus	98 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund - Class A HKD Distributing (M) Plus	88 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund - Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	41 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund - Class A SGD Distribuidor (M) Plus	6 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] - Class A HKD Distributing (M) Plus	- USD
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^] - Class D US\$ Distributing (M) Plus	1 \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund - Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	1 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - Class A US\$ Distributing (M) Plus	242 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	9 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	261 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - Class A SGD Distributing (M) Plus	31 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - Class A CNH Distributing (Monthly) Hedged Plus	8 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - Class A HKD Distributing (M) Plus	70 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - Class A GBP Distributing (M) (Hedged) Plus	16 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - Class A Euro Distributing (M) (Hedged) Plus	7 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund - Class A US\$ Distributing (M) Plus	29 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund - Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	11 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund - Class A CNH Distributing (M) (Hedged) Plus	1 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund - Class A HKD Distributing (M) Plus	2 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund - Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	5 \$
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] - Class A US\$ Distributing (M) (Hedged) Plus	954 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] - Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	42 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] - Class A CNH Distributing (M) (Hedged) Plus	355 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] - Class A Euro Distributing (M) Plus	52 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] - Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	74 €
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund - Class A CNH Distributing (M) (Hedged) Plus	8 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund - Class A US\$ Distributing (M) Plus	412 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund - Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	42 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund - Class A Euro Distributing (M) (Hedged) Plus	40 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund - Class A GBP Distributing (M) (Hedged) Plus	29 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund - Class A HKD Distributing (M) Plus	8 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund - Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	336 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund - S Class US\$ Distributing (M) Plus	23 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund - Premier Class US\$ Distributing (M) Plus	237 \$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^] - Class A US\$ Distributing (M) Plus	7 \$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^] - Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	5 \$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^] - Class A CNH Distributing (M) (Hedged) Plus	- USD
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^] - Class A HKD Distributing (M) Plus	4 \$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^] - Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	- USD
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund - Class A AUD Distributing (M) Plus	4 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund - Class A SGD Distributing (M) Plus	- USD
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund - Class D US\$ Distributing (M) Plus	5 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund - Class D HKD Distributing (M) Plus	- USD
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund - Class D CNH Distributing (M) (Hedged) Plus	- USD
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund - Class D AUD Distributing (M) (Hedged) Plus	1 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund - Class D SGD Distributing (M) (Hedged) Plus	2 \$

Los importes que se indican con “-” equivalen a cero USD/EUR o son inferiores a 1000 USD/EUR.

Las Clases de acciones de distribución plus (e) y distribución plus (u) ofrecidas por algunos de los Fondos pueden cargar determinadas comisiones y gastos al capital en lugar de a los ingresos. La imputación total o parcial de las comisiones y gastos al capital dará lugar a un aumento de los ingresos para su distribución; sin embargo, el capital que estas Clases de acciones de distribución plus (e) y de distribución plus (u) tienen disponible para invertir en el futuro, y el crecimiento del capital, pueden verse reducidos. Los accionistas deben tener en cuenta que existe un mayor riesgo de que, en el momento del reembolso de las acciones de las Clases de acciones de distribución plus (e) y de distribución plus (u), los accionistas no reciban la totalidad del importe invertido. Para los inversores de las Clases de acciones de distribución plus (e) y de distribución plus (u), esto puede dar lugar a la erosión de la inversión de capital de los inversores, a pesar de la rentabilidad del Fondo correspondiente, o de las plusvalías atribuibles a esa inversión original, lo que probablemente disminuirá el valor de los rendimientos futuros. El aumento del pago de dividendos como consecuencia de la imputación de comisiones y gastos al capital equivale efectivamente a una devolución o retirada de la inversión original de capital de un inversor o de las plusvalías atribuibles a esa inversión original. El mayor nivel de pago de dividendos en virtud de este mecanismo de tarificación dará lugar a la correspondiente disminución inmediata del valor liquidativo de las clases de acciones en la fecha ex-dividendo. Los Accionistas deben tener en cuenta que, en la medida en que los gastos se carguen al capital, algunas o todas las distribuciones realizadas por las Clases de acciones de distribución plus (e) y de distribución plus (u) deben considerarse una forma de reembolso del capital. Todos los gastos de las Clases de acciones de distribución plus (e) se han cargado al capital.

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Notas a los Estados Financieros — (continuación)

4. Distribuciones a los tenedores de participaciones reembolsables (continuación)

Durante el ejercicio financiero, los siguientes Fondos han cargado comisiones y gastos al capital en Clases de acciones de distribución plus (e):

	Comisiones y gastos cargados al capital para el periodo finalizado el 31 de agosto de 2023 (en miles)
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund - Class A Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	1 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund - Premier Class GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	1 \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund - S Class US\$ Distributing (M) Plus (e)	55 \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund - S Class Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	3 \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund - S Class GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	2 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] - Class A US\$ Distributing (M) Plus (e)	1,043 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] - Class A AUD Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	117 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] - Class A CNH Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	17 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] - Class A Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	44 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] - Class A GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	75 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] - Class A HKD Distributing (M) Plus (e)	- USD
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] - Class A JPY Distributing (M) Plus (e)	1 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] - Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	205 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] - Class A SGD Distributing (M) Plus (e)	- USD
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] - Class X US\$ Distributing (M) Plus (e)	60 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] - Class X GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	10 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] - Premier Class GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	107 \$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] - Class A US\$ Distributing (M) Plus (e)	- USD
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] - Premier Class GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	- USD
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^] - Premier Class GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	- USD
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^] - Class A US\$ Distributing (M) Plus (e)	- USD
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - Class A US\$ Distributing (M) Plus (e)	663 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - Class A Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	229 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - Class A GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	41 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - Class A SGD Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	73 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - Class X US\$ Distributing (M) Plus (e)	60 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - Class X Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	55 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - Class X GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	17 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - Premier Class US\$ Distributing (M) Plus (e)	56 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - Premier Class Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	118 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - Premier Class GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	16 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - S Class US\$ Distributing (Q) Plus (e)	- USD
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - S Class Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	12 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - S Class GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	1 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund - LM Class Euro Distributing (Q) (Hedged) Plus (e)	58 \$
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^] - Class X GBP Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	- USD
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^] - Class A US\$ Distributing (M) Plus (e)	1 \$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^] - S Class Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	- USD
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund - Class A US\$ Distributing (M) Plus (e)	- USD
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund - Class A Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	- USD
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund - Class X Euro Distributing (M) (Hedged) Plus (e)	- USD
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] - Premier Class CAD Distributing (Q) (Hedged) (PH) Plus (e)	204 €
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund - Class A US\$ Distributing (M) Plus (e)	596 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund - Class A Euro Distributing (A) Plus (e)	- USD
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund - Class U Euro Distributing (Q) Plus (e)	- USD
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund - Class U GBP Distributing (Q) Plus (e)	1 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund - Class U GBP Distributing (Q) (Hedged) Plus (e)	- USD
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund - Class X US\$ Distributing (M) Plus (e)	62 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund - Class X Euro Distributing (Q) (Hedged) Plus (e)	8 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund - Class X GBP Distributing (Q) (Hedged) Plus (e)	2 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund - Class A US\$ Distributing (M) Plus (e)	54 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund - Class A Euro Distributing (M) Plus (e)	5 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund - S Class GBP Distributing (M) Plus (e)	1 \$

Los importes que se indican con “-” equivalen a cero USD/EUR o son inferiores a 1000 USD/EUR.

Clases de Acciones de Capitalización

En lo referente a las Clases de Acciones de Capitalización, la intención es que en el curso normal de las operaciones no se declaren distribuciones y que todo ingreso por inversión neto en cada Clase de Acciones de Capitalización se acumule a diario en el valor liquidativo por acción de la correspondiente clase de acciones.

5. Capital accionario y participaciones reembolsables

Capital accionario

La Sociedad se constituyó con un capital accionario inicial de 39.000 € representado por 39.000 acciones constitutivas sin valor nominal. Todas menos tres de las acciones suscritas han sido recompradas por la empresa. Los Accionistas de estas tres acciones de suscriptores están facultados para asistir y votar en todas las juntas de la Sociedad, pero no tienen derecho a participar en los dividendos o activos netos de ningún Fondo o de la Sociedad.

Participaciones reembolsables

El capital accionario de la Sociedad deberá ser, en todo momento, igual al valor liquidativo. Los Administradores están facultados para emitir hasta quinientos mil millones de acciones sin valor nominal de la Sociedad al valor liquidativo por acción en las condiciones que consideren oportunas. No existen derechos de preferencia sobre la emisión de acciones de la Sociedad.

Cada una de las acciones faculta al Accionista a participar en forma equitativa y proporcional en los dividendos y activos netos del Fondo respecto del cual se emitieron las acciones, salvo en el caso de los dividendos declarados antes de convertirse en accionista.

El producto de la emisión de acciones se aplicará al Fondo correspondiente en los libros de la Sociedad y se usará para la adquisición, en representación del Fondo correspondiente, de activos en los cuales el Fondo pueda invertir. Los registros y los estados contables de cada Fondo se mantendrán por separado.

Cada Fondo ofrece diferentes clases de acciones, como se indica en el folleto de la Sociedad. Estas diferentes clases de acciones difieren principalmente en cuanto a sus gastos de venta, comisiones, tasas de gastos, política de distribución y denominación de divisas. De este modo, los inversores pueden elegir la clase de acciones que mejor se adapte a sus necesidades de inversión, teniendo en cuenta el importe de la inversión y el periodo de tenencia previsto.

Cada clase de acciones se designa como Clase de acciones de distribución o Clase de acciones de acumulación. Las Clases de acciones de acumulación no distribuyen rendimientos netos ni plusvalías netas realizadas o latentes, mientras que las Clases de acciones de distribución distribuirán a determinados intervalos, que variarán en función de la letra que figure entre paréntesis al final del nombre de la Clase de acciones de distribución, como se explica en la Nota 5 - Distribuciones a los titulares de Acciones de participación canjeables. Además, la empresa tiene acciones de abonado en circulación. Las acciones de suscriptor no dan derecho a participar en los activos de ningún Fondo.

Cada Fondo puede ofrecer clases de acciones designadas en divisas distintas de la divisa base del Fondo. Para cada una de estas clases de acciones, a menos que se indique “(Hedged)” en el nombre de la clase de acciones, la Gestora de inversiones y la Subgestora de inversiones correspondientes no emplearán ninguna técnica para cubrir la exposición de la clase de acciones a las variaciones de los tipos de cambio entre la moneda base del Fondo y la moneda de la clase de acciones.

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Notas a los Estados Financieros — (continuación)

5. Capital accionario y acciones participativas rescatables (continuación)

Las Acciones de Clase A están disponibles para todos los inversores. Los distribuidores pueden pagar comisiones/reembolsos a intermediarios u otros inversores que tengan un acuerdo con un distribuidor con respecto a dichas acciones. Las acciones de las Clases B, C, D, E y K están disponibles para todos los inversores que sean clientes de intermediarios designados por un distribuidor con respecto a dichas acciones. Los distribuidores pueden pagar comisiones a los distribuidores o a otros inversores que tengan un acuerdo con un distribuidor con respecto a dichas acciones. Las Acciones de Clase F están disponibles para inversores profesionales e inversores con un acuerdo de inversión discrecional con un distribuidor designado por el distribuidor con respecto a dichas acciones. Los distribuidores pueden pagar comisiones/reembolsos a intermediarios u otros inversores que tengan un acuerdo con el distribuidor con respecto a dichas acciones. Las Acciones de Clase J son para distribución en Japón, a discreción de los Consejeros o distribuidores. Las Acciones de Clase M están disponibles para inversores profesionales e inversores con un acuerdo de inversión discrecional con un distribuidor u otra entidad designada por un distribuidor con respecto a dichas acciones. Las Acciones de Clase R están disponibles para todos los inversores que tengan un acuerdo basado en comisiones con un intermediario del que hayan recibido una recomendación personal en relación con su inversión en los Fondos. Las Acciones de Clase T son para distribución en Taiwán, a discreción de los Consejeros o Distribuidores. Las Acciones de Clase X están disponibles para intermediarios, gestores de carteras o plataformas que, de conformidad con los requisitos reglamentarios o sobre la base de acuerdos de comisiones con sus clientes, no están autorizados a aceptar y retener comisiones de seguimiento; e inversores institucionales (para los inversores de la Unión Europea, esto significa "Contrapartes elegibles" según se define en MIFID II) que inviertan por cuenta propia. Las Acciones de Clase U, Y y S están disponibles para inversores institucionales a discreción de los Consejeros o distribuidores. Las Clases de Acciones BW LM están disponibles a discreción de los Consejeros o distribuidores para inversores cualificados que sean miembros del grupo Franklin Templeton o clientes de dichos miembros. Las Clases de Acciones LM están disponibles a discreción de los Consejeros o distribuidores para inversores cualificados del grupo Franklin Templeton, planes de jubilación y planes de naturaleza similar patrocinados por miembros del grupo Franklin Templeton, o clientes de dichos miembros. Para los inversores radicados en la Unión Europea, las Clases de Acciones BW Premier están disponibles, a discreción de los Consejeros o distribuidores, para las "Contrapartes elegibles" según se definen en MIFID II; para los inversores radicados fuera de la Unión Europea, las Clases de Acciones BW Premier están disponibles para inversores institucionales, a discreción de los Consejeros o distribuidores, o para inversores cualificados que sean miembros del grupo Franklin Templeton o clientes de dichos miembros. Para los inversores radicados en la Unión Europea, las Clases de Acciones Premier están disponibles para las "Contrapartes elegibles" tal y como se definen en MIFID II; para los inversores radicados fuera de la Unión Europea, las Clases de Acciones Premier están disponibles para inversores institucionales.

En el caso de las clases de acciones que incluyan "(Hedged)" en su nombre después de la denominación de la divisa, se pretende que dichas clases de acciones estén cubiertas frente a las fluctuaciones de los tipos de cambio entre la divisa de la clase de acciones y la divisa base del Fondo correspondiente. Determinadas clases de acciones de Fondos gestionados por Brandywine Global Investment Management, LLC están cubiertas en relación con un índice, como indica la inclusión de un "(IH)" en el nombre de la clase de acción. Los Fondos gestionados por Brandywine Global Investment Management, LLC y el FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund gestionado por ClearBridge Investments (North America) Pty Limited ofrecen clases de acciones con cobertura de cartera, como indica la inclusión de un "(PH)" en el nombre de la clase de acción. Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^A (dejó de cotizar en bolsa el 1 de junio de 2021) ofrecía clases de acciones que podían haber pagado una comisión de rentabilidad, como indicaba "(PF)" en el nombre de la clase de acciones.

Algunos Fondos también han emitido acciones de clases de acción protegidas, como indica la inclusión de "GA", "GE", "GP" o "(G)" en el nombre de la clase de acciones. Las clases de acción protegidas sólo están disponibles para los partícipes de los fondos afiliados. Las Acciones de Clase con derechos adquiridos están cerradas a cualquier suscripción posterior, tanto por parte de los accionistas existentes en la clase de acciones como por parte de nuevos inversores, salvo que se puedan seguir adquiriendo acciones mediante (1) reinversión de dividendos; (2) conversiones automáticas de una Clase de Acciones B (G) del Fondo a una Clase de Acciones A (G) del mismo Fondo; y (3) canjes de acciones de una Clase de acciones con derechos adquiridos con la misma letra de designación. No obstante lo anterior, tal y como se indica en los Suplementos de los Fondos, algunas Clases de acciones con derechos adquiridos de determinados Fondos podrán estar disponibles para suscripciones posteriores por parte de los accionistas existentes en la clase de acciones a discreción exclusiva de los Consejeros.

6. Régimen fiscal

De conformidad con la ley y la práctica vigentes en Irlanda, la Sociedad está calificada como una empresa de inversión de acuerdo con la definición de la sección 739B de la Ley de Consolidación Fiscal de 1997 (en su versión modificada). Sobre esta base, la Sociedad no estará generalmente sujeta al pago de impuestos sobre sus ingresos y ganancias, salvo que se produzca un hecho imponible. En general, se produce un hecho imponible con ocasión de cualquier pago de distribución, rescate, recompra, cancelación, transferencia de acciones, o al finalizar un "Período Relevante", que se define como un período de ocho años que comienza con la adquisición de las acciones por parte de los accionistas y cada período subsiguiente de ocho años que comienza inmediatamente después del Período Relevante precedente.

No se aplicará ningún impuesto irlandés a la Sociedad por los hechos impositivos relativos a:

- (i) un accionista que no sea ni residente en Irlanda ni residente habitual en Irlanda a efectos fiscales, en el momento del hecho imponible, siempre que exista una declaración válida adecuada, o que la Sociedad haya sido autorizada por la administración tributaria irlandesa a realizar pagos brutos en ausencia de declaraciones apropiadas; y
- (ii) determinados accionistas residentes en Irlanda exentos de impuestos que hayan proporcionado a la Sociedad las declaraciones legales firmadas necesarias.

Además, ninguna transacción (que de otro modo pudiera ser un hecho imponible) relacionada con acciones que se mantengan en un sistema de compensación reconocido designado por orden de los Revenue Commissioners (administración tributaria irlandesa) no se considerará un hecho imponible.

A falta de una declaración pertinente, la Sociedad deberá abonar el impuesto irlandés cuando se produzca un hecho imponible.

Las plusvalías, los dividendos y los intereses percibidos pueden estar sujetos a impuestos, incluidas retenciones fiscales que aplique el país de origen, y dichos impuestos podrían no ser recuperables para el Fondo ni para sus accionistas.

7. Efectivo y equivalentes de efectivo y cuentas de margen

El efectivo y los equivalentes al efectivo se valoran a su valor nominal con los intereses devengados, en su caso. El efectivo y equivalentes de efectivo y los saldos de descubierto de efectivo de cualquier Fondo se mantienen con el Depositario. "Cuentas de margen y efectivo restringido" en el Estado de situación financiera representan depósitos de margen, garantías en efectivo y ganancias y pérdidas realizadas en contratos de futuros aún no entregados. Los depósitos de margen y las garantías en efectivo, mantenidos en relación con la negociación de derivados OTC y negociados en bolsa a 31 de agosto de 2023, se mantienen con los siguientes intermediarios: Bank of America Merrill Lynch, Barclays, BNP Paribas, BNY Mellon, Citi, Goldman Sachs, HSBC, JP Morgan, Morgan Stanley y UBS.

8. Compromisos y responsabilidades contingentes

No se registraron compromisos ni responsabilidades contingentes significativas a 31 de agosto de 2023.

9. Acuerdos de comisiones en especie

La Sociedad tiene políticas diseñadas para garantizar que sus proveedores de servicios actúen en el mejor interés de los Fondos cuando ejecutan decisiones para negociar en nombre de esos Fondos en el contexto de la gestión de las carteras de los Fondos. A estos efectos, deben tomarse todas las medidas razonables para obtener el mejor resultado posible para los Fondos, teniendo en cuenta el precio, los costes, la rapidez, la probabilidad de ejecución y liquidación, el tamaño y la naturaleza de la orden, o cualquier otra consideración relevante para la ejecución de la orden. La Gestora de inversiones, la Subgestora de inversiones o cualquiera de sus personas vinculadas no retendrán ningún reembolso en efectivo recibido de un agente o intermediario como contraprestación por las operaciones de intermediación del Fondo dirigidas a dicho agente o intermediario. La Sociedad no sufragará los costes de la investigación externa obtenida por las Gestoras de inversiones y las Subgestoras de inversiones. Dichos costes correrán a cargo de la correspondiente Gestora o Subgestora de inversiones. La información sobre las políticas de ejecución de los Fondos está a disposición de los Accionistas que la soliciten sin coste alguno.

Durante el ejercicio financiero finalizado el 31 de agosto de 2023, Royce & Associates, LP ("Royce") suscribió acuerdos de comisiones en condiciones favorables con intermediarios, pero reembolsó a los Fondos correspondientes los gastos de investigación incurridos en el marco de dichos acuerdos.

^A No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Notas a los Estados Financieros — (continuación)

10. Tipos de cambio

En los presentes estados financieros se han utilizado los siguientes tipos de cambio para obtener los importes equivalentes en dólares estadounidenses, euros y libras esterlinas de los respectivos Fondos con divisas basadas en dólares estadounidenses, euros y libras esterlinas, respectivamente:

	Moneda	Tipos de cambio a 31 de agosto de 2023
Fondos denominados en USD	Peso argentino	729,8774*
	Dólar australiano	1,5433
	Real brasileño	4,9521
	Libra británica	0,7894
	Dólar canadiense	1,3512
	Renminbi chino (CNH)	7,2777
	Renminbi chino (CNY)	7,2902
	Peso colombiano	4,090,5000
	Corona checa	22,1958
	Corona danesa	6,8731
	Libra egipcia	30,9000
	Euro	0,9222
	Dólar de Hong Kong	7,8424
	Forinto húngaro	351,6393
	Rupia india	82,7863
	Rupia indonesia	15,230,0000
	Yen japonés	145,4950
	Ringgit malasio	4,6400
	Peso mexicano	17,0505
	Dólar neozelandés	1,6770
	Corona noruega	10,6317
	Nuevo sol peruano	3,6955
	Peso filipino	56,6200
	Zloty polaco	4,1257
	Rublo ruso	95,8750
	Rial saudí	3,7507
	Dólar de Singapur	1,3515
	Rand sudafricano	18,8850
	Won surcoreano	1,321,7500
	Corona sueca	10,9485
	Franco suizo	0,8834
	Dólar taiwanés	31,8465
Bat tailandés	35,0175	
Lira turca	26,7203	
Fondos denominados en EUR	Moneda	Tipos de cambio a 31 de agosto de 2023
	Dólar australiano	1,6735
	Real brasileño	5,3698
	Libra británica	0,8560
	Dólar canadiense	1,4652
	Corona danesa	7,4528
	Yen japonés	157,7676
	Zloty polaco	4,4737
	Rand sudafricano	20,4780
	Corona sueca	11,8720
	Franco suizo	0,9579
Dólar estadounidense	1,0844	
Fondos denominados en GBP	Moneda	Tipos de cambio a 31 de agosto de 2023
	Euro	1,1683
	Yen japonés	184,3132
	Dólar estadounidense	1,2668

* Tasa diaria descontada, basada en el índice ARS Eqy EqWgt Impli (UNOFFICIAL), según instrucciones de FTIS.

11. Estimación del valor razonable

La Sociedad ha clasificado medidas de valor razonable mediante la utilización de una jerarquía de valor razonable que refleja la importancia de las variables utilizadas al hacer las medidas. La jerarquía de valor razonable tiene los siguientes niveles:

Las variables del nivel 1 corresponden a precios cotizados no ajustados en un mercado activo para activos o pasivos idénticos a los que la entidad puede acceder en la fecha de valoración.

Las variables del nivel 2 son variables que difieren de los precios cotizados incluidos en el nivel 1 observables (es decir, desarrollados con datos de mercado), directa o indirectamente, para el activo o el pasivo.

Las variables del nivel 3 son variables no observables (es decir, para las que no se dispone de datos de mercado) para el activo o el pasivo.

Una inversión se clasifica siempre en su totalidad como nivel 1, 2 o 3. En ciertos casos, el cálculo del valor razonable para una inversión puede emplear una serie de variables diferentes que corresponden a niveles diferentes de la jerarquía de valor razonable. En estos casos, el nivel de una inversión dentro de la jerarquía de valor razonable se basa en el nivel más bajo de variable que sea relevante para la determinación del valor razonable. La valoración de la importancia de una variable en particular respecto al cálculo del valor razonable requiere consideración y es específica de la inversión.

Las variables o la metodología utilizadas para valorar títulos no son necesariamente indicativas del riesgo asociado a la inversión en dichos títulos.

Notas a los Estados Financieros — (continuación)

11. Estimación del valor razonable (continuación)

En la siguiente tabla se analizan, según la jerarquía de valor razonable, los activos y los pasivos financieros de los Fondos calculados a su valor razonable a 31 de agosto de 2023

	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset US Core Bond Fund a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund a 31 de agosto de 2023 (en miles)	
Nivel 1						
Bonos y obligaciones	USD	– USD	– USD	– €	– USD	–
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–	376
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	637	4.720	322	221	221
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	(347)	(2.905)	(91)	(166)	(166)
		290	1.815	231	431	
Nivel 2						
Bonos y obligaciones	USD	702.821 USD	215.372 USD	1.006.983 €	85.946 USD	207.139
instrumentos del mercado monetario	–	247.520	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	10.768	–	520	3.032
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	1.321	10.106	26	535
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	(20)	(3.933)	(179)	(1.411)
		950.341	227.441	1.013.156	86.313	209.295
Nivel 3						
Bonos y obligaciones	USD	– USD	607 USD	805 €	– USD	–
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–	–
		607	805	–	–	–
Total de inversiones	USD	950.341 USD	228.338 USD	1.015.776 €	86.544 USD	209.726
Nivel 1						
Bonos y obligaciones	USD	– USD	– USD	– USD	– USD	–
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	1	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	50	–	–	718	404
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	(10)	(269)	(705)	(245)
		50	(9)	(269)	13	159
Nivel 2						
Bonos y obligaciones	USD	100.606 USD	50.685 USD	388.384 USD	460.222 USD	151.281
instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	143	–	2.645	3.957	12.283
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	101	32	6	2.481	998
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	(88)	(105)	(618)	(3.573)	(1.300)
		100.762	50.612	390.417	463.087	163.262
Nivel 3						
Bonos y obligaciones	USD	659 USD	– USD	– USD	– USD	–
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	292	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–	–
		951	–	–	–	–
Total de inversiones	USD	101.763 USD	50.603 USD	390.148 USD	463.100 USD	163.421

^ No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Notas a los Estados Financieros — (continuación)

11. Estimación del valor razonable (continuación)

	FTGF Western Asset Global Credit Fund^ a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^ a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^ a 31 de agosto de 2023 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	USD	– USD	– USD	– USD	– USD
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	110	76.459	1.665	–	1.098
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(41)	(99.527)	(560)	(538)	(94)
	69	(23.068)	1.105	(538)	1.004
Nivel 2					
Bonos y obligaciones	USD	29.238 USD	1.480.486 USD	273.990 USD	479.117 USD
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	222	1.606	–	15.887	3.712
Activos en derivados mantenidos para negociación	216	126.963	1.371	577	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(171)	(68.018)	(2.785)	(664)	–
	29.505	1.541.037	272.576	494.917	1.134.430
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	USD	– USD	7.340 USD	731 USD	17.995 USD
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	1.116	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	7.340	1.847	17.995	–
Total de inversiones	USD	29.574 USD	1.525.309 USD	275.528 USD	512.374 USD
					1.135.434
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^ a 31 de agosto de 2023 (en miles)					
		FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund a 31 de agosto de 2023 (en miles)	Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund^ a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^ a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund a 31 de agosto de 2023 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	£	– USD	– USD	– USD	– USD
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	192	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	90	50	301	26	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(24)	(17)	(172)	(13)	–
	66	225	129	13	–
Nivel 2					
Bonos y obligaciones	£	43.046 USD	59.077 USD	18.207 USD	8.537 USD
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	750	130	365	4.355
Activos en derivados mantenidos para negociación	8	147	532	77	1.454
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(11)	(878)	(73)	(161)	(3.353)
	43.043	59.096	18.796	8.818	150.098
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	£	– USD	– USD	– USD	– USD
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Total de inversiones	£	43.109 USD	59.321 USD	18.925 USD	8.831 USD
					150.098

^ No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Notas a los Estados Financieros — (continuación)

11. Estimación del valor razonable (continuación)

	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund ^a a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Brandywine Global High Yield Fund ^a a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund ^a a 31 de agosto de 2023 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	USD	– USD	– USD	– USD	– USD
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	16
Activos en derivados mantenidos para negociación	512	42	–	6.156	18
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	(177)
	512	42	–	6.156	(143)
Nivel 2					
Bonos y obligaciones	USD	252.450 USD	23.082 USD	199.024 USD	1.094.717 USD
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	7.710	846	8.871	61.400	630
Activos en derivados mantenidos para negociación	7.522	12	1.150	2.658	225
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(16.536)	(245)	(4.628)	(21.063)	(236)
	251.146	23.695	204.417	1.137.712	32.667
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	USD	– USD	– USD	– USD	– USD
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Total de inversiones	USD	251.658 USD	23.737 USD	204.417 USD	1.143.868 USD

	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund ^a a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund ^a a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF ClearBridge Value Fund a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF ClearBridge US Appreciation Fund al 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund a 31 de agosto de 2023 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	USD	– USD	– USD	– USD	– USD
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	914.073	197.279	1.512.094
Activos en derivados mantenidos para negociación	55	66	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(130)	–	–	–	–
	(75)	66	914.073	197.279	1.512.094
Nivel 2					
Bonos y obligaciones	USD	63.486 USD	13.884 USD	– USD	– USD
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	3.787	931	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	266	42	28	–	280
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(2.543)	(115)	(1.547)	–	(2.302)
	64.996	14.742	(1.519)	–	(2.022)
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	USD	– USD	– USD	– USD	– USD
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Total de inversiones	USD	64.921 USD	14.808 USD	912.554 USD	197.279 USD

^a No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Notas a los Estados Financieros — (continuación)

11. Estimación del valor razonable (continuación)

	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF ClearBridge Global Growth Fund^ al 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ a 31 de agosto de 2023 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	USD	– USD	– USD	– USD	– €
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	213.403	35.254	1.553.421	14.730	847.640
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	213.403	35.254	1.553.421	14.730	847.640
Nivel 2					
Bonos y obligaciones	USD	– USD	– USD	– USD	– €
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	4	–	31	–	1.728
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(86)	(16)	(863)	–	(210)
	(82)	(16)	(832)	–	1.518
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	USD	– USD	– USD	– USD	– €
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Total de inversiones	USD 213.321	USD 35.238	USD 1.552.589	USD 14.730	€ 849.158

	FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Royce US Smaller Companies Fund a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^ a 31 de agosto de 2023 (en miles)	Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^ a 31 de agosto de 2023 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	USD	– USD	– USD	– USD	– €
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	355.274	640.372	91.631	4.059	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	355.274	640.372	91.631	4.059	–
Nivel 2					
Bonos y obligaciones	USD	– USD	– USD	– USD	– €
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	39.321	1.044	171	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	6	94	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(1.018)	(945)	(2)	–	–
	(1.012)	38.470	1.042	171	–
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	USD	– USD	– USD	– USD	– €
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Total de inversiones	USD 354.262	USD 678.842	USD 92.673	USD 4.230	€ –

^ No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Notas a los Estados Financieros — (continuación)

11. Estimación del valor razonable (continuación)

	Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^] a 31 de agosto de 2023 (en miles)	Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund; Fund [^] a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^] a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^] a 31 de agosto de 2023 (en miles)	
Nivel 1						
Bonos y obligaciones	USD	– USD	– USD	– USD	–	
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–	
Instrumentos de renta variable	–	–	151.696	20.210	32.841	
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–	
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–	
			151.696	20.210	32.841	
Nivel 2						
Bonos y obligaciones	USD	– USD	– USD	– USD	–	
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–	
Instrumentos de renta variable	–	–	573	–	241	
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	33	–	–	
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	(1.479)	(1)	–	
			(873)	(1)	241	
Nivel 3						
Bonos y obligaciones	USD	– USD	– USD	– USD	–	
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–	
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–	
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–	
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–	
Total de inversiones	USD	– USD	– USD	150.823 USD	20.209 USD	33.082

	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^] a 31 de agosto de 2023 (en miles)	FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^] a 31 de agosto de 2023 (en miles)	Fondo Franklin Responsible Income 2028 Fund [^] a 31 de agosto de 2023 (en miles)	
Nivel 1				
Bonos y obligaciones	€	– USD	– €	
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	
Instrumentos de renta variable	187.464	4.524	–	
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	
	187.464	4.524	–	
Nivel 2				
Bonos y obligaciones	€	– USD	– €	
Instrumentos del mercado monetario	–	–	86.453	
Instrumentos de renta variable	–	–	–	
Activos en derivados mantenidos para negociación	11	–	–	
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(28)	(2)	–	
	(17)	(2)	86.453	
Nivel 3				
Bonos y obligaciones	€	– USD	– €	
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	
Instrumentos de renta variable	–	–	–	
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	
Total de inversiones	€	187.447 USD	4.522 €	86.453

F El 14 de abril de 2021, Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund dejó de cotizar en bolsa.

Ω El 27 de abril de 2022, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] dejó de cotizar en bolsa.

M El 11 de julio de 2022, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] dejó de cotizar en bolsa.

12. Garantía de valores

El riesgo de crédito se aborda mediante el uso diversificado de contrapartes y emisores, y mediante calificaciones mínimas de los valores y calificaciones medias de la cartera. La Gestora de inversiones y/o las Subgestoras de inversiones respectivas pueden establecer límites de cartera e invertir en función de parámetros internos con límites mutuamente acordados fijados al inicio de un Fondo, incluidas limitaciones de emisión y emisor, mínimos de crédito y calidad crediticia media, y la cuenta se supervisa de forma continua para garantizar que sigue cumpliendo estos parámetros. También puede realizarse un riguroso análisis independiente de todos los títulos de crédito antes de la compra, incluyendo la modelización financiera, el análisis de escenarios y el seguimiento de los cambios en el perfil de riesgo. En general, no se puede invertir más del 5% de la cartera en un solo emisor corporativo en el momento de la compra.

Las transacciones que dan lugar a grandes plusvalías latentes para un Fondo pueden requerir que éste mantenga una garantía recibida de un intermediario. En estos casos, el riesgo de crédito del Fondo se reduce por el valor de la garantía. En caso de que un intermediario se declare en quiebra, en EE.UU. (aunque la normativa puede variar según la jurisdicción), las garantías constituidas en relación con determinados instrumentos financieros derivados están exentas de la suspensión automática aplicada al inicio de un procedimiento de quiebra. Esta exención de los instrumentos financieros derivados permitiría a un Fondo ejecutar inmediatamente las garantías constituidas por la parte insolvente para satisfacer los créditos contra dicha parte insolvente.

La Sociedad supervisa su riesgo examinando periódicamente la calidad crediticia y la situación financiera de las contrapartes a las que recurren los Fondos. Los Fondos sólo pueden negociar con contrapartes autorizadas.

El valor de los valores subyacentes recibidos como garantía en relación con la negociación de derivados mantenidos por los siguientes Fondos fue el siguiente:

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Notas a los Estados Financieros — (continuación)

12. Garantía de valores (continuación)

Fondo	Agente de bolsa	A 31 de agosto de 2023, valor de mercado de las garantías en miles
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Morgan Stanley	134 \$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Citi	322 \$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	JP Morgan	78 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Bank of America Merrill Lynch	3.275 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	BNP Paribas	7.900 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Goldman Sachs	1.219 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	JP Morgan	2.380 \$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	BNP Paribas	61 \$

Se mantiene una lista de contrapartes autorizadas. Las adiciones a esta lista se revisan trimestralmente y anualmente se lleva a cabo una reevaluación exhaustiva de todas las contrapartes. La revisión incluye el análisis de la adecuación del capital, la rentabilidad, la liquidez y otros factores de la contraparte, según proceda.

A efectos de una gestión eficaz de la cartera, cada Fondo podrá celebrar acuerdos de recompra, acuerdos de recompra inversa y acuerdos de préstamo de valores, con sujeción a las condiciones y límites establecidos en el Reglamento sobre OICVM del Banco Central.

Has ta el vencimiento de los acuerdos de recompra, los acuerdos de recompra inversa y las operaciones de préstamo de valores, las garantías obtenidas en virtud de dichos contratos u operaciones:

- (i) deben ajustarse diariamente al valor de mercado;
- (ii) debe ser iguales o superiores, en valor, en todo momento, al valor del importe invertido o de los valores prestados;
- (iii) debe transferirse al fideicomisario, o a su agente; y
- (iv) deben estar inmediatamente a disposición del sistema, sin recurso a la contraparte, en caso de incumplimiento por parte de dicha entidad.

Cualquier garantía no monetaria recibida por la empresa no puede venderse ni reafianzarse; debe mantenerse a riesgo de crédito de la contraparte; y debe ser emitida por una entidad independiente de la contraparte.

El Comité de valoración se reúne al menos una vez al mes y siempre que las circunstancias lo requieran, para examinar y deliberar sobre cuestiones de valoración, incluido el riesgo de crédito. Las respectivas Gestoras y/o Subgestoras de inversiones presentan semestralmente al Consejo y al Comité un análisis de riesgos.

Prácticamente todo el efectivo y los valores de los Fondos se mantienen en el Depositario, que tiene una calificación crediticia de AA-. La quiebra o insolvencia del Depositario puede hacer que los derechos de los Fondos con respecto al efectivo mantenido sufran retrasos o limitaciones. El Depositario tiene una calificación de solvencia elevada otorgada por las agencias de calificación más prestigiosas. Si la calidad crediticia o la posición financiera del Depositario se deterioran significativamente, la Gestora de inversiones y/o las Subgestoras de inversiones respectivas podrán trasladar las tenencias de efectivo a otro banco.

Los valores depositados como garantía se consignan en la cartera de inversiones. El efectivo y los equivalentes de efectivo mantenidos en el Depositario y las cuentas de margen y el efectivo restringido se indican en el Estado de situación financiera.

Si un Fondo ha depositado una garantía a una contraparte, en caso de insolvencia de la contraparte, dicho Fondo puede tener derecho, en virtud de los acuerdos comerciales con la contraparte, a recuperar dicha garantía depositada. En la práctica, sin embargo, el Fondo puede tratar de reducir los importes adeudados a la contraparte para liquidar cualquier operación abierta compensando los importes adeudados con la garantía constituida. Si al Fondo se le devolviera alguna garantía después de compensarla con las cantidades adeudadas (por ejemplo, si la posición del Fondo estuviera sobregarantizada), es probable que el Fondo tuviera una reclamación no garantizada contra la contraparte en el procedimiento de insolvencia por la cantidad en exceso que se le adeudara.

Para mitigar el riesgo de crédito de contraparte, algunos derivados extrabursátiles se compensan a través de cámaras de compensación central. En virtud de este acuerdo, las operaciones realizadas con las contrapartes se ceden a las cámaras de compensación, que tras su aceptación sustituyen de hecho a la contraparte en los aspectos de riesgo de la operación.

El siguiente cuadro representa el valor de mercado de los valores que se han depositado como garantía en intermediarios en relación con la negociación de derivados:

Fondo	Agente de bolsa	A 31 de agosto de 2023, valor de mercado de las garantías en miles
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Bank of America Merrill Lynch	235 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Bank of America Merrill Lynch	57.208 \$

13. Divulgación de inversiones cruzadas por fondos dentro de la empresa

Algunos Fondos invierten en otros Fondos de la Sociedad. Estas inversiones cruzadas se han eliminado en los estados financieros de la Sociedad, como se indica a continuación:

- los valores de mercado de los organismos de inversión colectiva subyacentes se han eliminado en los importes totales de la Sociedad en el Estado de situación financiera;
- las pérdidas y ganancias realizadas, incluidos los movimientos en las pérdidas y ganancias no realizadas, y los ingresos por dividendos y distribuciones pertinentes de las inversiones cruzadas se han eliminado en los importes totales de la Sociedad que figuran en el Estado del resultado global; y
- los importes monetarios de las compras y ventas de participaciones en dichos organismos de inversión colectiva se han eliminado del producto neto de las ventas de acciones y del coste de las acciones readquiridas, respectivamente, en los importes totales de la Sociedad que figuran en el Estado de cambios en los Activos netos atribuibles a los Titulares de Acciones participativas reembolsables.

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] poseía 29.816 acciones de FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^] al cierre del periodo. Las operaciones con estas acciones y las correspondientes ganancias, pérdidas y distribuciones durante el periodo fueron:

	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]
	Para el periodo finalizado el 31 de agosto de 2023 (en miles)
Emisión de acciones	- USD
Amortización de acciones	-
Ganancia/(pérdida) neta realizada sobre activos financieros a valor razonable con cambios en resultados	-
Distribuciones recibidas	-
Coste	3.500
Valor razonable	3.787
Ganancia neta no realizada sobre activos financieros a valor razonable con cambios en resultados	287 \$

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Notas a los Estados Financieros — (continuación)

14. Hechos relevantes

A partir del 24 de marzo de 2023, FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] y FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^] dejaron de cotizar en bolsa.

A partir del 20 de abril de 2023, el FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] dejó de cotizar en bolsa.

El 12 de junio de 2023, la Sociedad emitió un Suplemento del FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^], un Folleto suplementario y un Folleto especializado para Franklin Templeton Global Funds Plc, de los que tomó nota el Banco Central.

A partir del 20 de junio de 2023, el FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^] comenzó a cotizar en bolsa.

A partir del 17 de julio de 2023, FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^] dejó de cotizar en bolsa.

A partir del 17 de julio de 2023, William Jackson dimitió como Consejero de la Sociedad.

A partir del 27 de julio de 2023, Craig Tyle fue nombrado miembro del Consejo de Administración de la Sociedad.

15. Responsabilidad segregada

El 24 de febrero de 2022, Rusia inició sus operaciones militares en el territorio soberano de Ucrania. La actual incertidumbre política y financiera que rodea a Rusia y Ucrania puede aumentar la volatilidad del mercado y el riesgo económico de invertir en valores en estos países y otros países afectados dentro de la región. Debido a las sanciones, las medidas aplicadas por los gobiernos y los acontecimientos producidos en la propia Ucrania y otras circunstancias, el Gestor sigue evaluando el efecto sobre la valoración y la liquidez, y tomará las medidas potenciales necesarias, según las políticas y los procedimientos de valoración de los Fondos.

No se produjeron otros hechos relevantes durante el ejercicio financiero finalizado el 31 de agosto de 2023.

La Sociedad ha adoptado responsabilidad segregada entre sus Fondos. Como tal, en virtud de la legislación irlandesa, los activos de cada uno de los Fondos no estarán expuestos a los pasivos de los demás Fondos de la Sociedad. Sin perjuicio de lo anterior, no se puede garantizar que se mantendrá necesariamente la naturaleza segregada de los Fondos en caso de que se emprenda una acción contra la Sociedad en los tribunales de otra jurisdicción.

16. Hechos posteriores

El 18 de septiembre de 2023, la Sociedad emitió un Suplemento del FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^], un Folleto suplementario y un Folleto actualizado para Franklin Templeton Global Funds Plc, de los que tomó nota el Banco Central.

A partir del 22 de septiembre de 2023, el FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^] comenzó a cotizar en bolsa.

No se han producido otros acontecimientos importantes con posterioridad a la fecha del Estado de la situación financiera que deban figurar en los estados financieros.

17. Aprobación del informe semestral y de los estados financieros no auditados

El 17 de octubre de 2023, se presentaron al Consejo de Administración el informe semestral y los estados financieros intermedios no auditados y fueron aprobados para su notificación al Banco Central y para su distribución a los accionistas.

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Información complementaria — Ratios de gastos totales (TER)

	Ratio de explotación total Gastos en u.m.(1) a media Activos netos diarios del fondo en u.m.(1)(%) Correspondiente al ejercicio cerrado 31 de agosto de 2023**	Ratio de explotación total Gastos en u.m.(1) a media Activos netos diarios del fondo en u.m.(1)(%) Correspondiente al ejercicio cerrado 31 de agosto de 2023**
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		
Clase A USD de Capitalización	0,65	
Clase A USD de Distribución (D)	0,65	
Clase B USD de Capitalización	1,10	
Clase B USD de Distribución (D)	1,10	
Clase C USD de Capitalización	1,35	
Clase X USD de Distribución (D)	0,45	
Clase A (G) USD de Capitalización	0,65	
Clase A (G) USD de Distribución (D)	0,65	
Clase L (G) USD de Distribución (D)	0,69	
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		
Clase A USD de Capitalización	1,08	
Clase A USD de Distribución (D)	1,09	
Clase C USD de Capitalización	1,59	
Clase C USD de Distribución (D)	1,58	
Clase E USD de Capitalización	1,76	
Clase F USD de Capitalización	0,73	
Clase F USD de Distribución (D)	0,75	
Clase X USD de Capitalización	0,58	
Clase X USD de Distribución (D)	0,59	
Clase Premier USD de Capitalización	0,56	
Clase LM USD de Capitalización	0,21	
Clase GA USD de Capitalización	1,03	
Clase GE USD de Capitalización	1,63	
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Clase A USD de Capitalización	1,27	
Clase A USD de Distribución (D)	1,27	
Clase A USD de Distribución (M) Plus	1,27	
Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,28	
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)	1,27	
Clase B USD de Distribución (D)	1,52	
Clase C USD de Capitalización	1,77	
Clase C USD de Distribución (D)	1,77	
Clase E USD de Capitalización	1,88	
Clase F USD de Capitalización	0,68	
Clase F USD de Distribución (D)	0,67	
Clase X USD de Capitalización	0,58	
Clase X USD de Distribución (D)	0,58	
Clase X EUR de Capitalización (Cubierta)	0,57	
Clase Premier USD de Capitalización	0,43	
Clase Premier USD de Distribución (M)	0,42	
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)	0,42	
Clase LM USD de Distribución (M)	0,13	
Clase LM EUR de Capitalización	0,14	
Clase LM GBP de Capitalización (Cubierta)	0,12	
Clase A (G) USD de Capitalización	1,28	
Clase A (G) USD de Distribución (D)	1,28	
Clase B (G) USD de Distribución (D)	1,78	
Clase L (G) USD de Capitalización	1,78	
Clase L (G) USD de Distribución (D)	1,78	
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		
Clase A USD de Distribución (D)	1,10	
Clase A EUR de Distribución (D)	1,08	
Clase C USD de Distribución (D)	1,58	
Clase Premier EUR de Capitalización	0,43	
Clase LM EUR de Capitalización	0,13	
Clase GA EUR de Capitalización	0,95	
Clase GA EUR de Distribución (A)	0,95	
Clase GE EUR de Capitalización	1,55	
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Clase A USD de Capitalización	1,37	
Clase A USD de Distribución (D)	1,37	
Clase A USD de Distribución (M)	1,37	
Clase A USD de Distribución (M) Plus	1,37	
Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,37	
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)	1,37	
Clase A EUR de Distribución (M) (Cubierta)	1,37	
Clase A EUR de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	1,37	
Clase A GBP de Distribución (M) (Cubierta)	1,37	
Clase A HKD de Distribución (M) Plus	1,37	
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,37	
Clase B USD de Distribución (D)	1,62	
Clase C USD de Capitalización	1,87	
Clase C USD de Distribución (D)	1,87	
Clase A ZAR de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,37	
Clase E USD de Capitalización	1,97	
Clase E USD de Distribución (D)	1,97	
Clase E EUR de Capitalización (Cubierta)	1,97	
Clase E EUR de Distribución (M) (Cubierta)	1,97	
Clase F USD de Capitalización	0,77	
Clase F USD de Distribución (D)	0,77	
Clase X USD de Distribución (D)	0,82	
Clase X EUR de Capitalización (Cubierta)	0,82	
Clase X GBP de Distribución (D) (Cubierta)	0,82	
Clase Premier USD de Capitalización	0,52	
Clase Premier USD de Distribución (M)	0,52	
Clase Premier CHF de Capitalización (Cubierta)	0,52	
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)	0,52	
Clase Premier EUR de Distribución (M) (Cubierta)	0,52	
Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta)	0,52	
Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	0,52	
Clase Premier PLN de Capitalización (Cubierta)	0,52	
Clase LM AUD de Distribución (M) (Cubierta)	0,12	
Clase LM GBP de Capitalización (Cubierta)	0,12	
FTGF Western Asset US High Yield Fund		
Clase A USD de Capitalización	1,24	
Clase A USD de Distribución (D)	1,24	
Clase A USD de Distribución (M)	1,24	
Clase A USD de Distribución (M) Plus	1,24	
Clase A EUR de Distribución (M) (Cubierta)	1,24	
Clase A HKD de Distribución (M) Plus	1,24	
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,24	
Clase C USD de Capitalización	1,74	
Clase C USD de Distribución (D)	1,74	
Clase E USD de Capitalización	1,85	
Clase E USD de Distribución (D)	1,85	
Clase E EUR de Capitalización (Cubierta)	1,85	
Clase F USD de Capitalización	0,85	
Clase F USD de Distribución (D)	0,85	
Clase Premier USD de Capitalización	0,60	
Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)	0,59	
Clase S USD de Distribución (M)	0,45	
Clase S EUR de Distribución (M) (Cubierta)	0,44	
Clase LM USD de Distribución (M)	0,14	
Clase LM GBP de Capitalización (Cubierta)	0,14	
Clase A (G) USD de Capitalización	1,30	
Clase A (G) USD de Distribución (D)	1,30	
Clase L (G) USD de Capitalización	1,80	
Clase L (G) USD de Distribución (D)	1,80	
Clase GF USD de Capitalización	1,09	

Información complementaria - Ratios de gastos totales (TER) - (continuación)

	Ratio de explotación total Gastos en u.m.(1) a media Activos netos diarios del fondo en u.m.(1)(%) Correspondiente al ejercicio cerrado 31 de agosto de 2023**	Ratio de explotación total Gastos en u.m.(1) a media Activos netos diarios del fondo en u.m.(1)(%) Correspondiente al ejercicio cerrado 31 de agosto de 2023**
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		
Clase A USD de Capitalización	1,24	
Clase A USD de Distribución (D)	1,24	
Clase A USD de Distribución (M)	1,24	
Clase A USD de Distribución (M) Plus	1,24	
Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,24	
Clase A EUR de Capitalización	1,24	
Clase A EUR de Distribución (D) (Cubierta)	1,24	
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,24	
Clase B USD de Distribución (D)	1,49	
Clase C USD de Capitalización	1,74	
Clase C USD de Distribución (D)	1,74	
Clase E USD de Capitalización	1,92	
Clase E USD de Distribución (D)	1,92	
Clase E EUR de Distribución (M) (Cubierta)	1,92	
Clase F USD de Capitalización	0,92	
Clase F USD de Distribución (D)	0,92	
Clase X USD de Distribución (D)	0,82	
Clase X GBP de Distribución (D) (Cubierta)	0,82	
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)	0,67	
Clase Premier GBP de Distribución (D) (Cubierta)	0,67	
Clase S USD de Distribución (M)	0,45	
Clase S EUR de Distribución (M) (Cubierta)	0,44	
Clase A (G) USD de Capitalización	1,47	
Clase A (G) USD de Distribución (D)	1,47	
Clase L (G) USD de Capitalización	1,97	
Clase L (G) USD de Distribución (D)	1,97	
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Clase A USD de Capitalización	1,36	
Clase A USD de Distribución (D)	1,36	
Clase A USD de Distribución (M)	1,36	
Clase A USD de Distribución (M) Plus	1,36	
Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,36	
Clase A CHF de Capitalización (Cubierta)	1,36	
Clase A CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,36	
Clase A EUR de Capitalización	1,36	
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)	1,36	
Clase A EUR de Distribución (A)	1,36	
Clase A HKD de Distribución (M) Plus	1,36	
Clase A SGD de Capitalización (Cubierta)	1,36	
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,36	
Clase A SGD de Distribución (M) Plus	1,36	
Clase B USD de Capitalización	1,61	
Clase C USD de Capitalización	1,86	
Clase C USD de Distribución (D)	1,86	
Clase E USD de Capitalización	1,96	
Clase E USD de Distribución (D)	1,96	
Clase F USD de Capitalización	0,96	
Clase F USD de Distribución (D)	0,96	
Clase X USD de Distribución (M)	0,86	
Clase X EUR de Capitalización (Cubierta)	0,86	
Clase Premier USD de Capitalización	0,71	
Clase Premier USD de Distribución (M)	0,71	
Clase Premier EUR de Capitalización	0,71	
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)	0,71	
Clase Premier EUR de Distribución (A)	0,71	
Clase Premier EUR de Distribución (M)	0,71	
Clase Premier GBP de Distribución (M)	0,71	
Clase LM USD de Capitalización	0,11	
Clase LM USD de Distribución (M)	0,11	
Clase LM EUR de Distribución (M) (Cubierta)	0,11	
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Clase A USD de Capitalización	1,10	
Clase A USD de Distribución (M)	1,10	
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)	1,10	
Clase A EUR de Distribución (M) (Cubierta)	1,11	
Clase A SEK de Capitalización (Cubierta)	1,10	
Clase A SEK de Distribución (M) (Cubierta)	0,99	
Clase C USD de Capitalización	1,60	
Clase C USD de Distribución (M)	1,60	
Clase E USD de Capitalización	1,70	
Clase E USD de Distribución (D)	1,70	
Clase F USD de Capitalización	0,71	
Clase F USD de Distribución (D)	0,70	
Clase X EUR de Capitalización (Cubierta)	0,61	
Clase Premier USD de Capitalización	0,45	
Clase Premier CHF de Distribución (M) (Cubierta)	0,46	
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)	0,45	
Clase Premier EUR de Distribución (M) (Cubierta)	0,46	
Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)	0,45	
Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta)	0,45	
Clase S USD de Distribución (M) Plus (e)	0,35	
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	0,35	
Clase S EUR de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	0,35	
Clase S GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	0,35	
Clase LM AUD de Capitalización (Cubierta)	0,10	
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^		
Clase A USD de Distribución (A)	1,16	
Clase X USD de Capitalización	0,69	
Clase Premier USD de Capitalización	0,54	
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)	0,54	
Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)	0,55	
Clase Premier NZD de Capitalización (cubierta)	0,53	
Clase S USD de Capitalización	0,45	
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	0,44	
Clase LM USD de Capitalización	0,14	
Clase LM EUR de Capitalización (Cubierta)	0,14	
Clase LM CAD de Capitalización (Cubierta)	0,14	
FTGF Western Asset Global Credit Fund^		
Clase A USD de Capitalización	1,19	
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)	1,19	
Clase X USD de Capitalización	0,58	
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)	0,54	
Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)	0,54	
Clase LM USD de Capitalización	0,18	
Clase LM EUR de Capitalización (Cubierta)	0,19	

^ No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Información complementaria - Ratios de gastos totales (TER) - (continuación)

	Ratio de explotación total Gastos en u.m.(1) a media Activos netos diarios del fondo en u.m.(1)(%) Correspondiente al ejercicio cerrado 31 de agosto de 2023**	Ratio de explotación total Gastos en u.m.(1) a media Activos netos diarios del fondo en u.m.(1)(%) Correspondiente al ejercicio cerrado 31 de agosto de 2023**
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]		
Clase A USD de Capitalización	1,74	
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	1,74	
Clase A USD de Distribución (S)	1,74	
Clase A AUD de Capitalización (Cubierta)	1,73	
Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	1,74	
Clase A CHF de Capitalización (Cubierta)	1,74	
Clase A CNH de Capitalización (Cubierta)	1,74	
Clase A CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	1,74	
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)	1,73	
Clase A EUR de Distribución (A)	1,74	
Clase A EUR de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	1,74	
Clase A EUR de Distribución (S) (Cubierta)	1,73	
Clase A GBP de Capitalización	1,74	
Clase A GBP de Capitalización (Cubierta)	1,74	
Clase A GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	1,74	
Clase A SEK de Capitalización (Cubierta)	1,74	
Clase A SGD de Capitalización (Cubierta)	1,74	
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	1,74	
Clase A SGD de Distribución (M) Plus (e)	1,74	
Clase C USD de Capitalización	2,24	
Clase C USD de Distribución (S)	2,24	
Clase A JPY de Distribución (M) Plus (e)	1,74	
Clase A NOK de Capitalización (Cubierta)	1,74	
Clase E USD de Capitalización	2,34	
Clase E USD de Distribución (S)	2,34	
Clase E EUR de Capitalización (Cubierta)	2,34	
Clase F USD de Capitalización	1,34	
Clase F USD de Distribución (S)	1,34	
Clase X USD de Capitalización	1,24	
Clase X USD de Distribución (M) Plus (e)	1,24	
Clase X USD de Distribución (S)	1,24	
Clase X CHF de Capitalización (Cubierta)	1,24	
Clase X EUR de Capitalización	1,24	
Clase X EUR de Capitalización (Cubierta)	1,24	
Clase X EUR de Distribución (A) (Cubierta)	1,24	
Clase X EUR de Distribución (M) (Cubierta)	1,24	
Clase X GBP de Capitalización	1,23	
Clase X GBP de Capitalización (Cubierta)	1,24	
Clase X GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	1,24	
Clase X SGD de Capitalización (Cubierta)	1,23	
Clase Premier USD de Capitalización	1,08	
Clase Premier USD de Distribución (S)	1,09	
Clase Premier AUD de Capitalización (cubierta)	1,08	
Clase Premier AUD de Distribución (S) (Cubierta)	1,09	
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)	1,09	
Clase Premier CHF de Capitalización (cubierta)	1,09	
Clase Premier CHF de Distribución (S) (Cubierta)	1,08	
Clase Premier EUR de Capitalización	1,09	
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)	1,09	
Clase Premier EUR de Distribución (S) (Cubierta)	1,08	
Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)	1,09	
Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	1,08	
Clase Premier JPY de Capitalización (cubierta)	1,08	
Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)	1,08	
Clase Premier SEK de Capitalización (cubierta)	1,08	
Clase S USD de Capitalización	0,71	
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	0,69	
Clase LM AUD de Distribución (S) (Cubierta)	0,09	
Clase LM EUR de Capitalización	0,09	
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		
Clase A USD de Capitalización	1,51	
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	1,51	
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)	1,51	
Clase C USD de Capitalización	2,05	
Clase X CHF Distribución (M) (Cubierta)	0,89	
Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	0,72	
Clase S USD de Capitalización	0,52	
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	0,51	
Clase S GBP de Capitalización (Cubierta)	0,51	
Clase LM EUR de Capitalización (Cubierta)	0,12	
Clase LM GBP de Capitalización (Cubierta)	0,11	
Clase LM CAD de Capitalización (Cubierta)	0,12	
Clase S CHF de Distribución (A)	0,52	
Clase S CHF de Distribución (A) (Cubierta)	0,51	
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]		
Clase D EUR de Capitalización (Cubierta)	1,45	
Clase D EUR de Distribución (M) (Cubierta)	1,45	
Clase D USD de Capitalización	1,45	
Clase D USD de Distribución (M)	1,45	
Clase D USD de Distribución (M) Plus	1,45	
Clase M CHF de Capitalización (Cubierta)	0,85	
Clase M USD de Distribución (M)	0,85	
Clase M EUR de Capitalización (cubierta)	0,85	
Clase Premier USD de Capitalización	0,70	
Clase Premier USD de Distribución (Q)	0,70	
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)	0,70	
Clase Premier EUR de Distribución (Q) (Cubierta)	0,70	
Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	0,70	
Clase Premier JPY de Capitalización (cubierta)	0,70	
Clase LM USD de Capitalización	0,10	
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]		
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	1,26	
Clase Premier USD de Capitalización	0,40	
Clase LM USD de Capitalización	0,10	
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]		
Clase A GBP de Capitalización	1,10	
Clase Premier GBP de Capitalización	0,59	
Clase LM GBP de Distribución (M)	0,14	
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund		
Clase A USD de Capitalización	1,08	
Clase Premier USD de Capitalización	0,44	
Clase S USD de Capitalización	0,35	
Clase LM GBP de Distribución (M) (Cubierta)	0,14	
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^]		
Clase LM USD de Distribución (Q)	n/d	
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]		
Clase A USD de Capitalización	1,15	
Clase F USD de Capitalización	0,75	
Clase Premier USD de Capitalización	0,50	
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)	0,50	
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)	0,50	
Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)	0,50	
Clase S USD de Capitalización	0,40	
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	0,40	
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		
Clase A USD de Capitalización	1,37	
Clase A USD de Distribución (M)	1,38	
Clase A USD de Distribución (S)	1,37	
Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,37	
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)	1,37	
Clase A EUR de Capitalización (cubierta) (IH)	1,37	
Clase A EUR de Distribución (A) (Cubierta)	1,37	
Clase A EUR de Distribución (S)	1,37	
Clase A EUR de Distribución (S) (Cubierta) (IH)	1,37	
Clase A GBP de Capitalización	1,37	
Clase A GBP de Distribución (M) (Cubierta)	1,37	
Clase A GBP de Distribución (S) (Cubierta) (IH)	1,37	
Clase A SGD de Capitalización	1,39	
Clase B USD de Capitalización	1,64	
Clase B USD de Distribución (S)	1,62	
Clase C USD de Capitalización	1,87	
Clase C USD de Distribución (S)	1,87	
Clase E USD de Capitalización	1,98	
Clase E EUR de Capitalización (Cubierta) (IH)	1,97	
Clase F USD de Capitalización	0,96	
Clase F USD de Distribución (S)	0,97	
Clase R GBP de Distribución (S) (Cubierta) (IH)	0,97	
Clase X USD de Capitalización	0,87	
Clase X USD de Distribución (S)	0,87	
Clase X EUR de Capitalización (Cubierta)	0,87	
Clase X EUR de Capitalización (Cubierta) (IH)	0,87	
Clase X GBP de Capitalización	0,87	
Clase X GBP de Capitalización (Cubierta)	0,87	
Clase X GBP de Capitalización (Cubierta) (IH)	0,87	
Clase X GBP de Distribución (S) (Cubierta)	0,87	
Clase X GBP de Distribución (S) (Cubierta) (IH)	0,87	
Clase Premier USD de Capitalización	0,72	
Clase Premier USD de Distribución (S)	0,72	
Clase Premier EUR de Capitalización	0,72	
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)	0,72	
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta) (IH)	0,72	
Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)	0,73	
Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta)	0,72	
Clase Premier GBP de Distribución (S) (Cubierta) (IH)	0,72	
Clase LM USD de Capitalización	0,12	
Clase LM USD de Capitalización (Cubierta) (IH)	0,12	

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Información complementaria - Ratios de gastos totales (TER) - (continuación)

	Ratio de explotación total Gastos en u.m.(1) a media Activos netos diarios del fondo en u.m.(1)(%) Correspondiente al ejercicio cerrado 31 de agosto de 2023**	Ratio de explotación total Gastos en u.m.(1) a media Activos netos diarios del fondo en u.m.(1)(%) Correspondiente al ejercicio cerrado 31 de agosto de 2023**
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]		
Clase A USD de Capitalización	1,60	
Clase A USD de Distribución (A)	1,60	
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)	1,60	
Clase A SGD de Capitalización	1,61	
Clase C USD de Capitalización	2,11	
Clase E USD de Distribución (A)	2,20	
Clase F USD de Capitalización	1,20	
Clase X USD de Capitalización	1,15	
Clase X GBP de Capitalización (Cubierta)	1,15	
Clase X GBP de Distribución (M) (Cubierta)	1,15	
Clase Premier USD de Capitalización	1,00	
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)	1,00	
Clase Premier EUR de Distribución (A) (Cubierta)	1,00	
Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta)	1,00	
Clase LM USD de Capitalización	0,10	
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]		
Clase A USD de Capitalización	1,39	
Clase A USD de Distribución (D)	1,39	
Clase Premier USD de Capitalización	0,75	
Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta) (IH)	0,74	
Clase S EUR de Distribución (A) (Cubierta) (IH)	0,48	
Clase S CAD de Capitalización (cubierta) (IH)	0,50	
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Clase A USD de Capitalización	1,42	
Clase A USD de Distribución (M)	1,42	
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)	1,45	
Clase A SGD de Capitalización	1,42	
Clase C USD de Capitalización	1,92	
Clase E USD de Capitalización	2,02	
Clase F USD de Capitalización	1,02	
Clase F USD de Distribución (M)	1,02	
Clase X USD de Capitalización	0,92	
Clase X GBP de Distribución (M) (Cubierta)	0,91	
Clase X GBP de Distribución (M) (Cubierta) (IH)	0,92	
Clase Premier USD de Capitalización	0,77	
Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta) (IH)	0,77	
Clase Premier NZD de Capitalización (Cubierta) (IH)	0,77	
Clase LM EUR de Capitalización	0,11	
Clase LM NZD de Capitalización (Cubierta) (IH)	0,12	
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Clase A USD de Capitalización	1,37	
Clase A USD de Distribución (A)	1,37	
Clase A USD de Distribución (D)	1,37	
Clase A USD de Distribución (M) Plus	1,37	
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	1,37	
Clase A AUD de Capitalización (Cubierta)	1,37	
Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,37	
Clase A CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,37	
Clase A EUR de Capitalización	1,40	
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)	1,37	
Clase A EUR de Distribución (A) (Cubierta)	1,37	
Clase A EUR de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,37	
Clase A EUR de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	1,37	
Clase A GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,37	
Clase A GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	1,37	
Clase A HKD de Capitalización	1,37	
Clase A HKD de Distribución (M) Plus	1,37	
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,37	
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	1,37	
Clase A SGD de Distribución (M) Plus	1,37	
Clase C USD de Capitalización	1,87	
Clase C USD de Distribución (D)	1,87	
Clase A CZK de Capitalización (Cubierta)	1,37	
Clase E USD de Capitalización	1,97	
Clase E USD de Distribución (D)	1,97	
Clase E EUR de Capitalización (Cubierta)	1,97	
Clase F USD de Capitalización	0,92	
Clase F USD de Distribución (D)	0,92	
Clase X USD de Capitalización	0,75	
Clase X USD de Distribución (D)	0,72	
Clase X USD de Distribución (M) Plus (e)	0,74	
Clase X EUR de Capitalización	0,74	
Clase X EUR de Capitalización (Cubierta)	0,74	
Clase X EUR de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	0,74	
Clase X GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	0,75	
Clase Premier USD de Capitalización	0,59	
Clase Premier USD de Distribución (M) Plus (e)	0,59	
Clase Premier BRL de Capitalización (Cubierta)	0,59	
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)	0,59	
Clase Premier EUR de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	0,59	
Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	0,57	
Clase Premier SEK de Capitalización (Cubierta)	0,59	
Clase S USD de Capitalización	0,47	
Clase S USD de Distribución (Q) Plus (e)	0,47	
Clase S Euro de Capitalización (Cubierta)	0,47	
Clase S EUR de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	0,47	
Clase S GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	0,47	
Clase LM USD de Capitalización	0,12	
Clase LM USD de Distribución (M)	0,12	
Clase LM EUR de Distribución (Q) (Cubierta) Plus (e)	0,12	
Clase LM GBP de Capitalización (Cubierta)	0,12	
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]		
Clase A USD de Capitalización	1,94	
Clase X USD de Distribución (M)	1,45	
Clase Premier USD de Capitalización	1,30	
Clase LM USD de Capitalización	0,15	
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]		
Clase A USD de Capitalización	2,28	
Clase A SGD de Capitalización (Cubierta)	2,28	
Clase X GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	1,45	
Clase LM AUD de Capitalización (Cubierta)	0,14	
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]		
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	1,40	
Clase S USD de Capitalización	0,50	
Clase S EUR de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	0,51	
Clase S GBP de Capitalización (Cubierta)	0,48	

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Información complementaria - Ratios de gastos totales (TER) - (continuación)

	Ratio de explotación total Gastos en u.m.(1) a media Activos netos diarios del fondo en u.m.(1)(%) Correspondiente al ejercicio cerrado 31 de agosto de 2023**	Ratio de explotación total Gastos en u.m.(1) a media Activos netos diarios del fondo en u.m.(1)(%) Correspondiente al ejercicio cerrado 31 de agosto de 2023**
FTGF ClearBridge Value Fund		
Clase A USD de Capitalización	1,81	
Clase A USD de Distribución (A)	1,81	
Clase A EUR de Capitalización	1,81	
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)	1,81	
Clase A EUR de Distribución (A) (Cubierta)	1,81	
Clase A GBP de Distribución (A)	1,81	
Clase A SGD de Capitalización	1,81	
Clase A SGD de Capitalización (Cubierta)	1,81	
Clase C USD de Capitalización	2,31	
Clase C USD de Distribución (A)	2,31	
Clase E USD de Capitalización	2,56	
Clase F USD de Capitalización	1,21	
Clase F USD de Distribución (A)	1,20	
Clase X USD de Capitalización	1,13	
Clase X USD de Distribución (A)	1,13	
Clase X EUR de Capitalización	1,13	
Clase Premier USD de Capitalización	0,78	
Clase Premier USD de Distribución (A)	0,78	
Clase Premier EUR de Capitalización	0,78	
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)	0,78	
Clase LM USD Distributivas (A)	0,11	
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund		
Clase A USD de Capitalización	1,74	
Clase A USD de Distribución (A)	1,74	
Clase A EUR de Capitalización	1,76	
Clase B USD de Capitalización	2,23	
Clase B USD de Distribución (A)	2,23	
Clase C USD de Capitalización	2,23	
Clase C USD de Distribución (A)	2,23	
Clase E USD de Capitalización	2,51	
Clase E USD de Distribución (A)	2,51	
Clase F USD de Capitalización	1,16	
Clase F USD de Distribución (A)	1,16	
Clase X USD de Distribución (A)	1,13	
Clase X EUR de Capitalización	1,13	
Clase Premier USD de Capitalización	0,79	
Clase Premier USD de Distribución (A)	0,79	
Clase Premier EUR de Capitalización	0,78	
Clase LM USD de Capitalización	0,16	
Clase LM EUR de Capitalización	0,17	
Clase A (G) USD de Capitalización	1,41	
Clase B (G) USD de Capitalización	2,35	
Clase L (G) USD de Capitalización	1,91	
Clase GA USD de Capitalización	1,58	
Clase GA EUR de Capitalización	1,58	
Clase GA EUR de Distribución (A)	1,58	
Clase GE USD de Capitalización	2,33	
Clase GE EUR de Capitalización	2,33	
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund		
Clase A USD de Capitalización	1,70	
Clase A USD de Distribución (A)	1,70	
Clase A EUR de Capitalización	1,70	
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)	1,70	
Clase B USD de Capitalización	2,20	
Clase B USD de Distribución (A)	2,20	
Clase C USD de Capitalización	2,20	
Clase C USD de Distribución (A)	2,20	
Clase E USD de Capitalización	2,45	
Clase E USD de Distribución (A)	2,46	
Clase F USD de Capitalización	1,10	
Clase F USD de Distribución (A)	1,10	
Clase U USD de Capitalización	0,63	
Clase U EUR de Capitalización	0,63	
Clase X USD de Capitalización	1,08	
Clase X EUR de Capitalización	1,08	
Clase X EUR de Capitalización (Cubierta)	1,08	
Clase X GBP de Capitalización	1,08	
Clase Premier USD de Capitalización	0,73	
Clase Premier USD de Distribución (A)	0,73	
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)	0,73	
Clase Premier EUR de Capitalización	0,73	
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)	0,72	
Clase Premier EUR de Distribución (A)	0,73	
Clase Premier GBP de Capitalización	0,73	
Clase LM USD de Capitalización	0,11	
Clase LM EUR de Capitalización	0,11	
Clase A (G) USD de Capitalización	1,35	
Clase L (G) USD de Capitalización	1,85	
Clase GA USD de Capitalización	1,52	
Clase GA EUR de Capitalización	1,52	
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		
Clase A USD de Capitalización	1,77	
Clase A USD de Distribución (A)	1,77	
Clase A AUD de Capitalización (Cubierta)	1,77	
Clase A CHF de Capitalización (Cubierta)	1,77	
Clase A CNH de Capitalización (Cubierta)	1,77	
Clase A EUR de Capitalización	1,77	
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)	1,77	
Clase A EUR de Distribución (A) (Cubierta)	1,77	
Clase A GBP de Capitalización	1,77	
Clase A HKD de Capitalización	1,77	
Clase A SEK de Capitalización (Cubierta)	1,77	
Clase A SGD de Capitalización (Cubierta)	1,78	
Clase B USD de Distribución (A)	2,30	
Clase C USD de Capitalización	2,27	
Clase C USD de Distribución (A)	2,27	
Clase E USD de Capitalización	2,52	
Clase E USD de Distribución (A)	2,52	
Clase E EUR de Capitalización	2,52	
Clase E EUR de Capitalización (Cubierta)	2,52	
Clase F USD de Capitalización	1,17	
Clase F USD de Distribución (A)	1,17	
Clase X USD de Capitalización	1,12	
Clase X USD de Distribución (A)	1,12	
Clase X EUR de Capitalización	1,12	
Clase X EUR de Capitalización (Cubierta)	1,12	
Clase X GBP de Capitalización	1,12	
Clase Premier USD de Capitalización	0,75	
Clase Premier EUR de Capitalización	0,77	
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)	0,79	
Clase Premier GBP de Capitalización	0,77	
Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)	0,77	
Clase Premier GBP de Distribución (A)	0,77	
Clase LM EUR de Capitalización	0,12	
Clase A (G) USD de Capitalización	1,42	
Clase B (G) USD de Capitalización	1,92	
Clase L (G) USD de Capitalización	1,92	
Clase GA EUR de Capitalización	1,54	
Clase GA EUR de Distribución (A)	1,54	
Clase GE USD de Capitalización	2,29	
Clase GE EUR de Capitalización	2,29	
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		
Clase A USD de Capitalización	1,74	
Clase A USD de Distribución (A)	1,74	
Clase A USD de Distribución (M) Plus	1,74	
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	1,74	
Clase A USD de Distribución (Q)	1,74	
Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,74	
Clase A CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,74	
Clase A EUR de Capitalización	1,74	
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)	1,74	
Clase A EUR de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	1,74	
Clase A HKD de Distribución (M) Plus	1,74	
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,74	
Clase C USD de Capitalización	2,24	
Clase C USD de Distribución (A)	2,24	
Clase C USD de Distribución (Q)	2,24	
Clase F USD de Capitalización	1,14	
Clase F EUR de Capitalización	1,14	
Clase F EUR de Distribución (A)	1,14	
Clase X EUR de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	1,12	
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund		
Clase A USD de Capitalización	1,66	
Clase A USD de Distribución (A)	1,66	
Clase A EUR de Capitalización	1,66	
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)	1,65	
Clase A SEK de Capitalización	1,50	
Clase F USD de Capitalización	1,06	
Clase X USD de Capitalización	1,06	
Clase X USD de Distribución (A)	1,06	
Clase X EUR de Capitalización	1,06	
Clase X EUR de Capitalización (Cubierta)	1,06	
Clase X GBP de Capitalización	1,06	
Clase X GBP de Capitalización (Cubierta)	1,05	
Clase Premier USD de Capitalización	0,70	
Clase Premier USD de Distribución (A)	0,71	
Clase Premier EUR de Capitalización	0,75	
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)	0,71	
Clase Premier GBP de Capitalización	0,71	
Clase S USD de Capitalización	0,51	
Clase S EUR de Capitalización	0,51	
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	0,51	
Clase S GBP de Capitalización	0,51	
Clase S GBP de Capitalización (Cubierta)	0,51	
Clase S GBP de Distribución (Q)	0,51	
Clase LM EUR de Capitalización	0,11	

^ No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Información complementaria - Ratios de gastos totales (TER) - (continuación)

	Ratio de explotación total Gastos en u.m.(1) a media Activos netos diarios del fondo en u.m.(1)(%) Correspondiente al ejercicio cerrado 31 de agosto de 2023**	Ratio de explotación total Gastos en u.m.(1) a media Activos netos diarios del fondo en u.m.(1)(%) Correspondiente al ejercicio cerrado 31 de agosto de 2023**
FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]		
Clase A USD de Capitalización	1,79	
Clase Premier USD de Capitalización	0,80	
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]		
Clase A USD de Capitalización	1,95	
Clase A USD de Capitalización (Cubierta)	1,95	
Clase A USD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,95	
Clase A USD de Distribución (Q)	1,95	
Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,95	
Clase A CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,95	
Clase A EUR de Capitalización	1,95	
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta) (PH)	1,95	
Clase A EUR de Distribución (A)	1,95	
Clase A EUR de Distribución (M) Plus	1,95	
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,95	
Clase C USD de Capitalización	2,45	
Clase C USD de Capitalización (Cubierta)	2,45	
Clase E USD de Capitalización	2,70	
Clase E USD de Capitalización (Cubierta)	2,70	
Clase E EUR de Capitalización	2,75	
Clase E EUR de Distribución (A)	2,75	
Clase F USD de Capitalización	1,35	
Clase F USD de Capitalización (Cubierta)	1,35	
Clase U EUR de Capitalización	0,71	
Clase X USD de Capitalización	1,05	
Clase X USD de Distribución (A)	1,05	
Clase X EUR de Capitalización	1,05	
Clase X EUR de Capitalización (Cubierta) (PH)	1,05	
Clase X GBP de Distribución (Q)	1,05	
Clase Premier USD de Capitalización	0,85	
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)	0,85	
Clase Premier CAD de Distribución (Q) (Cubierta) (PH) Plus (e)	0,85	
Clase Premier EUR de Capitalización	0,85	
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta) (PH)	0,85	
Clase Premier GBP de Capitalización	0,85	
Clase Premier GBP de Distribución (A) (Cubierta) (PH) Plus (e)	0,85	
Clase Premier GBP de Distribución (Q)	0,85	
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		
Clase A USD de Capitalización	1,96	
Clase A USD de Distribución (M) Plus	1,96	
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	1,96	
Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,96	
Clase A CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,97	
Clase A EUR de Distribución (A) Plus (e)	1,97	
Clase A EUR de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,97	
Clase A GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,97	
Clase A HKD de Distribución (M) Plus	1,96	
Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,96	
Clase U USD de Capitalización	0,72	
Clase U EUR de Capitalización	0,72	
Clase A EUR de Distribución (Q) Plus (e)	0,72	
Clase U GBP de Capitalización	0,72	
Clase U GBP de Capitalización (Cubierta)	0,72	
Clase U GBP de Distribución (Q) (Cubierta) Plus (e)	0,72	
Clase U GBP de Distribución (Q) Plus (e)	0,71	
Clase X USD de Distribución (M) Plus (e)	1,21	
Clase X EUR de Distribución (M) (Cubierta)	1,22	
Clase X EUR de Distribución (Q) (Cubierta) Plus (e)	1,22	
Clase X GBP de Distribución (Q) (Cubierta) Plus (e)	1,22	
Clase Premier USD de Capitalización	0,86	
Clase Premier USD de Distribución (M) Plus	0,86	
Clase Premier EUR de Distribución (M) (Cubierta)	0,87	
Clase S USD de Capitalización	0,52	
Clase S USD de Distribución (M) Plus	0,51	
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		
Clase A USD de Capitalización	1,96	
Clase A USD de Distribución (A)	1,96	
Clase A AUD de Capitalización (Cubierta)	1,96	
Clase A CNH de Capitalización (Cubierta)	1,96	
Clase A EUR de Capitalización	1,96	
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)	1,96	
Clase A EUR de Distribución (A) (Cubierta)	1,96	
Clase A GBP de Capitalización (Cubierta)	1,96	
Clase A GBP de Distribución (A)	1,96	
Clase A SEK de Capitalización (Cubierta)	1,96	
Clase A SGD de Capitalización	1,96	
Clase A SGD de Capitalización (Cubierta)	1,96	
Clase B USD de Capitalización	2,46	
Clase B USD de Distribución (A)	2,46	
Clase C USD de Capitalización	2,46	
Clase C USD de Distribución (A)	2,46	
Clase E USD de Capitalización	2,71	
Clase E USD de Distribución (A)	2,71	
Clase E EUR de Capitalización	2,71	
Clase E EUR de Capitalización (Cubierta)	2,71	
Clase F USD de Capitalización	1,36	
Clase F USD de Distribución (A)	1,36	
Clase R USD de Capitalización	0,90	
Clase R EUR de Capitalización	1,46	
Clase X USD de Capitalización	1,21	
Clase X USD de Distribución (A)	1,21	
Clase X EUR de Capitalización	1,21	
Clase X EUR de Capitalización (Cubierta)	1,21	
Clase X GBP de Capitalización	1,21	
Clase X GBP de Distribución (A)	1,21	
Clase Premier USD de Capitalización	0,86	
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)	0,86	
Clase Premier EUR de Capitalización	0,86	
Clase Premier EUR de Capitalización (Cubierta)	0,86	
Clase Premier GBP de Capitalización	0,86	
Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)	0,86	
FTGF Royce US Smaller Companies Fund		
Clase A USD de Capitalización	1,99	
Clase A USD de Distribución (A)	2,04	
Clase A EUR de Capitalización	2,04	
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)	2,04	
Clase A EUR de Distribución (A)	2,04	
Clase A GBP de Distribución (A)	2,04	
Clase A SEK de Capitalización (Cubierta)	2,00	
Clase C USD de Capitalización	2,49	
Clase C USD de Distribución (A)	2,53	
Clase E USD de Capitalización	2,79	
Clase E USD de Distribución (A)	2,79	
Clase E EUR de Capitalización	2,79	
Clase F USD de Capitalización	1,43	
Clase F USD de Distribución (A)	1,43	
Clase R USD de Capitalización	1,54	
Clase X USD de Capitalización	1,29	
Clase X USD de Distribución (A)	1,28	
Clase Premier USD de Capitalización	0,92	
Clase Premier USD de Distribución (A)	0,94	
Clase Premier GBP de Distribución (A)	0,94	
Clase LM EUR de Capitalización	0,19	
Clase A (G) USD de Capitalización	1,44	
Clase L (G) USD de Capitalización	1,93	
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]		
Clase A USD de Capitalización	2,00	
Clase X USD de Capitalización	1,23	
Clase X GBP de Capitalización	1,25	
Clase Premier USD de Capitalización	0,90	
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]		
Clase A USD de Capitalización	1,98	
Clase A EUR de Capitalización	1,98	
Clase A EUR de Capitalización (Cubierta)	1,98	
Clase C USD de Capitalización	2,48	
Clase E USD de Capitalización	2,73	
Clase F USD de Capitalización	1,38	
Clase X USD de Capitalización	1,23	
Clase X EUR de Capitalización	1,23	
Clase X GBP de Capitalización	1,23	
Clase X GBP de Capitalización (Cubierta)	1,23	
Clase Premier USD de Capitalización	0,88	
Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)	0,88	
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	0,53	
Clase S GBP de Capitalización	0,53	

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.
[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Información complementaria - Ratios de gastos totales (TER) - (continuación)

	Ratio de explotación total Gastos en u.m.(1) a media Activos netos diarios del fondo en u.m.(1)(%) Correspondiente al ejercicio cerrado 31 de agosto de 2023**
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	2,00
Clase A AUD de Distribución (M) Plus	2,00
Clase A EUR de Distribución (M) Plus (e)	2,00
Clase A SGD de Distribución (M) Plus	1,99
Clase D AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,59
Clase D CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,60
Clase D HKD de Distribución (M) Plus	1,60
Clase D SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	1,60
Clase D USD de Distribución (M) Plus	1,60
Clase D USD de Capitalización	1,60
Clase X AUD de Capitalización	1,25
Clase X USD de Capitalización	1,25
Clase S GBP de Capitalización	0,59
Clase S GBP de Distribución (M) Plus (e)	0,59
Clase LM AUD de Capitalización	0,15
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	
Clase A USD de Capitalización	1,99
Clase E USD de Capitalización	2,74
Clase F USD de Capitalización	1,39
Clase X USD de Capitalización	1,25
Clase Premier USD de Capitalización	0,90
Clase S USD de Capitalización	0,70
Clase S EUR de Capitalización	0,70
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^	
Clase A USD de Capitalización (Cubierta)	1,97
Clase A EUR de Capitalización	1,97
Clase E USD de Capitalización (Cubierta)	2,72
Clase X EUR de Capitalización	1,22
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)	0,87
Clase Premier EUR de Capitalización	0,87
Clase S USD de Capitalización	0,50
Clase S EUR de Capitalización	0,47
Clase S GBP de Capitalización	0,47
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^	
Clase A USD de Capitalización	2,00
Clase X GBP de Capitalización (Cubierta)	1,25
Clase S USD de Capitalización	0,15
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	0,15
Clase S GBP de Capitalización (Cubierta)	0,15
Franklin Responsible Income 2028 Fund^	
Clase A EUR de Capitalización	0,74
Clase A EUR de Distribución (A)	0,74
Clase D EUR de Capitalización	1,29
Clase D EUR de Distribución (A)	1,29
Clase X EUR de Capitalización	0,34
Clase X EUR de Distribución (A)	0,34

El método de cálculo de los Ratios de Gastos Totales (TER) se describe en la página web de la Asociación Suiza de Gestión de Activos (AMAS) (www.am-switzerland.ch).

(1) u.m. = unidades monetarias en la moneda contable del Fondo.

** Anualizado para periodos inferiores a un año.

Estado de cambios importantes en la cartera

Para el ejercicio financiero finalizado el 31 de agosto de 2023

De acuerdo con el Reglamento sobre OICVM, se ofrece un estado con los cambios significativos en la composición de la Cartera de Inversiones de cada Fondo durante el periodo analizado para garantizar que los Accionistas puedan identificar los cambios en las inversiones de los Fondos. Se definen como las compras y ventas agregadas de una inversión (incluidos los vencimientos pero excluidos los contratos de recompra inversa, los pagarés de descuento a un día y los depósitos a plazo, que se emplean principalmente como medio para tratar de garantizar una gestión eficaz de la cartera) que superan el 1,00 % del valor total de las compras y ventas del periodo. Como mínimo, se indican las veinte compras y ventas más voluminosas. Si un Fondo realizó menos de veinte adquisiciones o ventas durante el periodo analizado, se ofrecen todas las operaciones.

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, vencimiento 26/06/2023	42.382	Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, vencimiento 26/06/2023	42.400
Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 21/06/2023	40.505	Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 21/06/2023	40.600
United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 18/05/2023	37.892	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 18/05/2023	37.900
Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 14/03/2023	34.996	Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 14/03/2023	35.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 15/05/2023	34.986	Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 15/05/2023	35.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 13/03/2023	32.288	Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 13/03/2023	32.300
Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 18/08/2023	29.617	Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 18/08/2023	30.000
Federal Home Loan Banks, serie 0002, 5,330 %, vencimiento 25/09/2023	26.198	Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 16/05/2023	25.300
Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 15/03/2023	24.997	Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 15/03/2023	25.000
United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 06/06/2023	24.838	Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 16/03/2023	25.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 16/05/2023	25.264	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 06/06/2023	25.000
Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,450 %, vencimiento 20/03/2024	25.001	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 14/03/2023	25.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 17/09/2023	21.431	Federal Home Loan Bank, 4,600 %, vencimiento 01/03/2023 FRN	22.900
Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 25/05/2023	21.103	Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 17/09/2023	21.500
Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 26/07/2023	20.512	Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 25/05/2023	21.200
Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 26/07/2023	20.047	Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 24/05/2023	21.000
Federal Home Loan Bank, 5,420 %, vencimiento 14/03/2024	20.008	Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 19/05/2023	20.600
Federal Home Loan Bank, 4,630 %, vencimiento 14/06/2023	20.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 26/07/2023	20.515
United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 11/07/2023	19.953	Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 26/07/2023	20.310
Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, vencimiento 03/05/2023	19.925	Federal Farm Credit Discount, cupón cero, vencimiento 08/03/2023	20.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 27/06/2023	19.897	Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, vencimiento 03/05/2023	20.000
		Federal Home Loan Bank, 4,850 %, vencimiento 03/05/2023 FRN	20.000
		Federal Home Loan Bank, 4,910 %, vencimiento 06/04/2023 FRN	20.000
		Federal Home Loan Bank, 5,130 %, vencimiento 14/06/2023 FRN	20.000
		United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 10/08/2023	20.000
		United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 11/07/2023	20.000
		United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 31/08/2023	20.000
		United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 04/04/2023	19.981
		Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 27/06/2023	19.900
		Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 17/05/2023	19.897
		Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 2,610 %, vencimiento 09/06/2023	19.000

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund — Clase WA (Distribución)	57.041	Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund — Clase WA (Distribución)	48.014
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	8.458	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	8.448
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, vencimiento 15/05/2053	7.752	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	7.472
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	7.473	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	5.537
United States Treasury Note/Bond, 4,125%, con vencimiento el 31/07/2028	6.091	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	4.425
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	5.565	United States Treasury Note/Bond, 3,875%, vencimiento 31/12/2027	4.079
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	4.434	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	4.042
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	4.004	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.994
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.903	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.666
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	3.731	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.519
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.678	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.500
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.560	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.114
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.514	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	2.775
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 31/08/2030	3.323	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	2.518
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.149	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 5,000 %	2.427
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, con vencimiento el 31/05/2028	3.063	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	2.302
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	2.782	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	2.147
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	2.518	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	2.113
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,000 %	2.493	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	2.087
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 5,500 %	2.460	United States Treasury Note/Bond, 0,000%, con vencimiento el 18/04/2023	2.050

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	27.049	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	27.473
United States Treasury Note/Bond, 4,000%, con vencimiento el 29/02/2028	24.520	United States Treasury Note/Bond, 4,000%, con vencimiento el 29/02/2028	24.827
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, con vencimiento el 31/05/2028	23.945	United States Treasury Note/Bond, 3,625%, con vencimiento el 31/05/2028	23.890
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,500 %	17.327	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,500 %	22.824
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,000 %	16.648	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 3,000 %	17.858
United States Treasury Note/Bond, 4,125%, con vencimiento el 31/08/2030	16.384	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,500 %	17.546
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,500 %	14.862	United States Treasury Note/Bond, 3,500%, con vencimiento el 31/01/2028	17.256
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	14.791	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,000 %	16.606
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,000 %	14.248	United States Treasury Note/Bond, 4,125%, con vencimiento el 31/08/2030	16.388
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	12.993	United States Treasury Note/Bond, 4,125%, con vencimiento el 31/01/2025	15.342
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,000 %	12.086	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,500 %	14.970
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,000 %	12.003	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	14.797
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 4,500 %	11.358	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,000 %	14.316
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,500 %	11.315	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	12.927

Estado de cambios importantes en la cartera – (continuación)

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund (continuación)

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS
	(en miles) USD		(en miles) USD
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 %	11.266	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 %	12.343
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,500 %	11.204	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,000 %	12.325
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	11.115	United States Treasury Note/Bond, 4,500%, vencimiento 30/11/2024	12.322
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,000 %	11.013	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,000 %	11.891
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, vencimiento 15/05/2053	10.613	United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 28/03/2023	11.650
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,000 %	10.494	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500%	11.508
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 4,000 %	10.276	Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 08/03/2023	11.450
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 5,000 %	9.497	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 4,500 %	11.380
		Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,500 %	11.321
		Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 %	11.285
		Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,500 %	11.280
		Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,000 %	11.203

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE	PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS
	(en miles) EUR		(en miles) EUR
Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund — Clase WA (Distribución)	6.852	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, con vencimiento el 15/02/2031	9.825
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, vencimiento 15/08/2032	1.971	Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund — Clase WA (Distribución)	6.965
Goldman Sachs Group Inc/The, 0,875 %, vencimiento 09/05/2029	1.220	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, vencimiento 15/08/2032	2.349
Bundesrepublik Deutschland, 0,000 %, vencimiento 10/04/2026	900	Netherlands Government Bond, 144A, 0,000 %, vencimiento 15/07/2030	1.895
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	829	Spain Government Bond, Serie 30Y, 144A, 2,700 %, vencimiento 31/10/2048	1.788
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	816	French Republic Government Bond OAT, 3,250%, vencimiento 25/05/2045	1.745
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	786	French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, con vencimiento el 25/11/2030	1.676
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	708	Italia Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie 31Y, 144A, 3,250 %, vencimiento 01/09/2046	1.640
Vodafone Group Plc, 2,875 %, vencimiento 20/11/2037	694	Mexico Government International Bond, 4,600 %, vencimiento 23/01/2046	1.435
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	684	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie CPI, 144A, 0,400 %, vencimiento 15/05/2030	1.421
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	629	European Stability Mechanism, Serie EUR, 0,750 %, vencimiento 05/09/2028	1.247
--BRF NV, 4,25%, vencimiento 04/07/2039	618	HSBC Holdings Plc, 3,019%, vencimiento 15/06/2027	1.245
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	593	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000 %, con vencimiento el 01/11/2028	1.196
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	522	Natwest Group Plc, 2,500%, vencimiento 22/03/2023	1.190
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	447	Republic of Austria Government Bond, 144A, 0,900 %, vencimiento 20/02/2032	1.076
Bundesrepublik Deutschland, 0,000 %, vencimiento 15/08/2052	377	Wells Fargo & Co, 2,250 %, vencimiento 02/05/2023	1.050
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	338	Kingdom of Belgium Government Bond, Series 71, 3,750 %, vencimiento 22/06/2045	953
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	328	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	827
Cellnex Finance Co SA, 2,000 %, vencimiento 15/09/2032	308	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	816
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	267	Republic of South Africa Government International Bond, 4,300 %, vencimiento 12/10/2028	811
		French Republic Government Bond OAT, 0,750 %, con vencimiento el 25/05/2028	798
		Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	793
		Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, vencimiento 02/03/2028	760
		French Republic Government Bond OAT, 1,000%, vencimiento 25/05/2027	744
		Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	704

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS
	(en miles) USD		(en miles) USD
United States Treasury Note/Bond, 4,125%, con vencimiento el 31/10/2027	11.729	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, vencimiento 13/11/2042	4.021
Bono internacional del Estado de México, 8,500 %, con vencimiento el 31/05/2029	4.019	JPMorgan Chase & Co, Serie U, 6,125 %, Perpetuo	1.743
United States Treasury Note/Bond, 2,000%, con vencimiento el 15/11/2026	3.981	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, vencimiento 15/08/2027	1.522
United States Treasury Note/Bond, 0,625%, con vencimiento el 31/03/2027	1.964	Gabon Government International Bond, 144A, 7,000 %, vencimiento 24/11/2031	1.290
Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, vencimiento 15/08/2027	1.513	Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 144A, 5,250 %, vencimiento 27/04/2029	1.278
United States Treasury Note/Bond, 4,000%, con vencimiento el 15/11/2042	1.417	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, vencimiento 21/07/2023	1.162
Victoria Plc, 8,000%, vencimiento 30/08/2086	1.252	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc — Western Asset European Loan Fund — Clase LM EUR de Capitalización	1.141
Banco Santander SA, 5,750 %, vencimiento 23/08/2033	1.083	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,875 %, vencimiento 15/01/2028	1.085
Sedgwick Claims Management Services Inc, 8,324 %, vencimiento 17/02/2028	913	Vale Overseas Ltd, 6,250 %, vencimiento 10/08/2026	1.079
Intesa Sanpaolo SpA, 6,500 %, vencimiento 14/03/2029	908	Transportadora de Gas del Peru SA, 4,250 %, vencimiento 30/04/2028	1.066
Alice Financing SA/France, 2,250 %, vencimiento 15/01/2025	817	Deutsche Bank AG, 4,000 %, vencimiento 24/06/2026	1.031
Alice France SA, 2,125 %, vencimiento 15/02/2025	811	Credit Suisse Group AG, 6,373%, vencimiento 15/07/2026	1.030
Via Celere Desarrollos Inmobiliari, 5,250 %, vencimiento 01/04/2026	761	Match Group Holdings II LLC, 144A, 5,000 %, vencimiento 15/12/2027	1.018
Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, vencimiento 01/01/2027	625	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, vencimiento 01/05/2025	951
Republic of South Africa Government International Bond, 6,500 %, vencimiento 28/02/2041	613	Sedgwick Claims Management Services Inc, 5,622 %, con vencimiento el 31/12/2025	913
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, con vencimiento el 31/03/2028	501	DP World Ltd/Emiratos Arabes Unidos, 5,625 %, vencimiento 25/09/2048	892
Connecticut Avenue Securities Trust, Serie 2041, 8,169 %, vencimiento 25/10/2041	452	Intesa Sanpaolo SpA, 6,375%, Perpetuo	886
Indonesia Treasury Bond, Serie FR59, 7,000 %, vencimiento 15/05/2027	401	Renk AG/Frankfurt am Main, 5,750 %, con vencimiento el 15/07/2025	869
Connecticut Avenue Securities Trust, Serie 2043, 0,000%, vencimiento 25/06/2043	390	Clarios Global LP, 5,622 %, vencimiento 30/04/2026	811
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, vencimiento 15/05/2053	376	IPD 3 BV, 5,500 %, vencimiento 01/12/2025	639
		Castor SpA, 6,000 %, vencimiento 15/02/2029	575
		Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, vencimiento 01/04/2028	565
		Panama Government International Bond, 4,500 %, vencimiento 01/04/2056	499
		CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, vencimiento 01/06/2033	453
		Sands China Ltd, 3,100 %, vencimiento 08/03/2029	448
		Delta Air Lines Inc, 7,375%, vencimiento 15/01/2026	445
		Icici Bank Ltd/Dubai, 4,000 %, vencimiento 18/03/2026	405
		Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 4,375%, vencimiento 15/01/2028	403
		Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, vencimiento 20/10/2028	385
		Navigant Corp, 5,875 %, vencimiento 25/10/2024	335
		Antofagasta Plc, 2,375 %, vencimiento 14/10/2034	333

^ No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Estado de cambios importantes en la cartera – (continuación)

FTGF Western Asset US High Yield Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund — Clase WA (Distribución)	17.354	Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund — Clase WA (Distribución)	18.872
Open Text Corp, 144A, 6,900 %, vencimiento 01/12/2027	1.543	Open Text Corp, 144A, 6,900 %, vencimiento 01/12/2027	1.499
ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, vencimiento 14/04/2030	952	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, vencimiento 15/10/2027	1.345
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, vencimiento 01/06/2031	938	Ford Motor Co, 6,100 %, vencimiento 19/08/2032	897
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, vencimiento 15/01/2026	674	Western Midstream Operating, LP, 5,450 %, vencimiento 01/04/2044	787
LifePoint Health Inc, 144A, 9,875 %, vencimiento 15/08/2030	610	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, vencimiento 01/11/2033	715
Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, vencimiento 08/08/2024	581	Penn Virginia Holdings LLC, 144A, 9,250 %, vencimiento 15/08/2026	641
DCert Buyer, Inc., 12331 %, vencimiento 16/02/2029	569	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, vencimiento 09/05/2029	629
GFL Environmental Inc, 144A, 4,750 %, vencimiento 15/06/2029	553	Occidental Petroleum Corp, 8,875 %, vencimiento 15/07/2030	623
Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, Perpetuo	501	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, vencimiento 20/06/2027	622
R.R. Donnelley, 14,500 %, vencimiento 08/03/2028	485	Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, vencimiento 15/05/2025	620
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, vencimiento 15/09/2031	460	US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, con vencimiento el 15/07/2027	606
Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, vencimiento 15/08/2027	439	StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, vencimiento 15/05/2029	600
Royal Caribbean Cruises Ltd, 3,700 %, vencimiento 15/03/2028	375	Bombardier Inc, 144A, 7,875 %, vencimiento 15/04/2027	577
Royal Caribbean Cruises Ltd, 5,375 %, vencimiento 15/07/2027	364	DCert Buyer, Inc., 9,372 %, con vencimiento el 16/02/2029	569
Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 9,250 %, vencimiento 01/07/2031	345	Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, vencimiento 15/06/2025	553
US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, vencimiento 28/06/2028	344	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, vencimiento 15/08/2027	541
Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Perpetuo	322	Transocean Inc, 144A, 8,750 %, vencimiento 15/02/2030	527
Toronto-Dominion Bank/The, 8,125 %, vencimiento el 31/10/2082	320	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, vencimiento 01/05/2032	504
BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, Perpetuo	309	Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, vencimiento 15/05/2029	502

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, con vencimiento el 30/04/2026	905	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, con vencimiento el 01/10/2026	992
ZF North America Capital Inc, 144A, 6,875 %, vencimiento 14/04/2028	578	Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, vencimiento 16/02/2028	765
United Rentals North America Inc, 3,875 %, vencimiento 15/11/2027	512	VZ Secured Financing BV, 144A, 5,000 %, vencimiento 15/01/2032	631
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2033	502	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 15/01/2034	598
Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, vencimiento 15/08/2029	501	Bono internacional del Estado de Turquía, 4,250 %, vencimiento 14/04/2026	539
Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,375 %, vencimiento 01/05/2025	499	Saga Plc, 5,500 %, vencimiento 15/07/2026	508
Panama Government International Bond, 2,252 %, vencimiento 29/09/2032	498	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, vencimiento 31/12/2023	487
Victoria Plc, 4,125 %, vencimiento 30/05/2025	395	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, con vencimiento el 28/02/2027	470
GFL Environmental Inc, 144A, 4,250 %, vencimiento 01/06/2025	386	Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, vencimiento 15/05/2029	440
American Airlines Group Inc, 144A, 3,750 %, vencimiento 01/03/2025	384	Level 3 Financing Inc, 144A, 3,625 %, vencimiento 15/01/2029	364
Nigeria Government International Bond, 144A, 7,143 %, vencimiento 23/02/2030	270	NCL Finance Ltd, 144A, 6,125 %, vencimiento 15/03/2028	344
Colombia Government International Bond, 3,125 %, vencimiento 15/04/2031	261	Sands China Ltd, 3,500 %, vencimiento 08/08/2031	332
Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, Perpetuo	253	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, con vencimiento el 30/04/2026	318
Comerica Bank, 2,500 %, vencimiento 23/07/2024	253	Carnival Corp, 144A, 10,500 %, vencimiento 01/06/2030	296
CSC Holdings LLC, 11,250 %, vencimiento 15/05/2028	250	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, vencimiento 15/04/2029	288
Ritchie Bros Holdings Inc, 144A, 7,750 %, vencimiento 15/03/2031	250	MGM China Holdings Ltd, 144A, 4,750 %, vencimiento 01/02/2027	255
United States Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 05/09/2023	249	Ghana Government International Bond, 144A, 10,750 %, vencimiento 14/10/2030	246
Bono internacional del Estado de México, 2,659 %, vencimiento 24/05/2031	249	CSC Holdings LLC, 11,250 %, vencimiento 15/05/2028	243
T-Mobile USA Inc, 2,625 %, vencimiento 15/04/2026	235	Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, vencimiento 15/10/2029	223
Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, Perpetuo	219	Credit Suisse Group AG, 144A, 6,537 %, vencimiento 12/08/2033	218
Turkey Government International Bond, 4,875 %, vencimiento 16/04/2043	208	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, con vencimiento el 29/02/2024	195
ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, vencimiento 14/04/2030	203	Altice France Holding SA, 144A, 6,000 %, vencimiento 15/02/2028	191
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, vencimiento 01/06/2031	200	NCL Corp Ltd, 144A, 3,625 %, , vencimiento 15/12/2024	191
Telecom Italia SpA/Milano, 144A, 5,303 %, vencimiento 30/05/2024	196	Dominican Republic International Bond, 144A, 6,000 %, vencimiento 22/02/2033	189
Delta Air Lines Inc, 2,900 %, con vencimiento el 28/10/2024	193	APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625 %, vencimiento 15/01/2027	186
Service Corp International/US, 5,125 %, vencimiento 01/06/2029	187	Wheel Bidco Ltd, 6,750 %, vencimiento 15/07/2026	185
Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 144A, 5,250 %, vencimiento 27/04/2029	185	StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, vencimiento 15/05/2029	180
Dominican Republic International Bond, 4,875 %, vencimiento 23/09/2032	182	Marks & Spencer Plc, 3,750 %, vencimiento 19/05/2026	173
Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, vencimiento 01/09/2026	179	Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, vencimiento 04/12/2029	167
CSC Holdings LLC, 144A, 3,375 %, vencimiento 15/02/2031	172	Match Group Holdings II LLC, 144A, 3,625 %, vencimiento 01/10/2031	166
Titan International Inc, 7,000 %, vencimiento 30/04/2028	159	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, vencimiento 15/08/2027	157
Ashtead Capital Inc, 144A, 2,450 %, vencimiento 12/08/2031	156	Ford Motor Co, 3,250 %, vencimiento 12/02/2032	152
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, vencimiento 01/06/2032	151	Altice Financing SA, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 15/01/2028	151
MicroStrategy Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 15/06/2026	148	ZF North America Capital Inc, 144A, 6,875 %, vencimiento 14/04/2028	150
Southwestern Energy Co, 5,375 %, vencimiento 15/03/2030	135	Southwestern Energy Co, 5,375 %, vencimiento 15/03/2030	139
Ecopetrol SA, 5,875 %, vencimiento 28/05/2045	132	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc — Western Asset European Loan Fund – Clase LM EUR de Capitalización	136
Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, vencimiento 07/04/2026	119	Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 144A, 6,375 %, vencimiento 01/09/2037	129
Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, vencimiento 08/08/2024	116		

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund — Clase WA (Distribución)	74.563	Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund — Clase WA (Distribución)	75.780
Singapore Government Bond, 2,625 %, vencimiento 01/08/2032	11.183	Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, cupón cero, vencimiento 07/07/2023	8.856
Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR89, 6,875 %, con vencimiento el 15/08/2051	10.613	Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, cupón cero, vencimiento 10/04/2023	8.524
European Bank for Reconstruction & Development, 5,150 %, vencimiento 16/02/2024	9.564	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, con vencimiento el 31/07/2023	7.920
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, cupón cero, vencimiento 07/07/2023	8.924	Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, cupón cero, vencimiento 21/07/2023	7.880
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, con vencimiento el 31/07/2023	7.914	Bono del Tesoro de Corea, Serie 2409, 3,125 %, vencimiento 10/09/2024	7.607
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, cupón cero, vencimiento 21/07/2023	7.846	Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, cupón cero, vencimiento 10/03/2023	7.413
Australia Government Bond, 3,750 %, vencimiento 21/04/2037	6.514	United Overseas Bank Ltd, 3,875 %, Perpetuo	6.896

Estado de cambios importantes en la cartera – (continuación)

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – (continuación)

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, cupón cero, vencimiento 28/04/2023	4.506	Indonesia Treasury Bond, Series FR56, 8,375%, vencimiento 15/09/2026	6.868
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, cupón cero, vencimiento 23/06/2023	4.478	Mercatus Co-operative Ltd, Serie DMTN, 2,800 %, vencimiento 26/07/2024	6.752
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, cupón cero, vencimiento 31/03/2023	4.288	Bono del Tesoro de Corea, Serie 3206, 3,375 %, vencimiento 10/06/2032	6.604
HSBC Holdings Plc, 5,300 %, vencimiento 14/03/2023	3.692	Malaysia Government Bond, Serie 0411, 4,232 %, vencimiento 30/06/2031	6.157
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, cupón cero, vencimiento 13/10/2023	3.445	United States Treasury Note/Bond, 0,125%, con vencimiento el 15/12/2023	5.192
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, cupón cero, vencimiento 15/09/2023	2.949	India Government Bond, 7,380%, vencimiento 20/06/2027	4.857
Vietnam Government International Bond, 4,800 %, vencimiento 19/11/2024	2.947	United States Treasury Note/Bond, 3,000%, vencimiento 15/02/2048	4.679
Korea Electric Power Corp, 5,375 %, vencimiento 31/07/2026	2.595	Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, cupón cero, vencimiento 28/04/2023	4.497
Bank Mandiri, 5,500 %, vencimiento 04/04/2026	2.539	Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, cupón cero, vencimiento 23/06/2023	4.436
Singapore Government Bond, 3,375 %, con vencimiento el 01/09/2033	2.302	Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, cupón cero, vencimiento 31/03/2023	4.358
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, cupón cero, vencimiento 28/07/2023	745	Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, cupón cero, vencimiento 03/03/2023	4.241
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, cupón cero, vencimiento 14/07/2023	744	HSBC Holdings Plc, 5,300 %, vencimiento 14/03/2023	3.753
		Singapore Government Bond, 2,625 %, vencimiento 01/08/2032	3.550
		Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR77, 8,125 %, con vencimiento el 15/05/2024	3.499
		Bank Mandiri, 5,500 %, vencimiento 04/04/2026	2.550
		Coastal Emerald Ltd, 4,300 %, Perpetuo	2.433
		Minejesa Capital BV, 5,625 %, vencimiento 10/08/2037	2.357
		Singapore Government Bond, 3,375 %, con vencimiento el 01/09/2033	2.316

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund — Clase WA (Distribución)	144.801	Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund — Clase WA (Distribución)	157.885
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,650 %, vencimiento 19/05/2030	7.986	United States Treasury Note/Bond, 1,000%, vencimiento 15/12/2024	25.035
United States Treasury Note/Bond, 3,500%, con vencimiento el 15/02/2033	5.380	United States Treasury Note/Bond, 0,625%, vencimiento 15/05/2030	12.540
Bank of New York Mellon Corp/The, 4,947 %, vencimiento 26/04/2027	5.200	Exxon Mobil Corp, 0,142 %, vencimiento 26/06/2024	6.157
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, 3,375 %, vencimiento 21/10/2025	4.698	Charles Schwab Corp/The, 1,950 %, vencimiento 01/12/2031	5.813
Cargill Inc, 144A, 4,500 %, vencimiento 24/06/2026	3.992	Nykredit Realkredit AS, 0,250 %, vencimiento 13/01/2026	5.587
Banco Santander SA, 4,250 %, vencimiento 12/06/2030	3.425	United States Treasury Note/Bond, 3,500%, con vencimiento el 15/02/2033	5.302
Nestle Holdings Inc, 144A, 5,250 %, vencimiento 13/03/2026	3.001	United States Treasury Note/Bond, 1,500%, vencimiento 15/02/2030	4.632
Linde Plc, 3,375 %, vencimiento 12/06/2029	2.989	Siemens Financieringsmaatschappij, 3,375 %, vencimiento 24/08/2031	3.929
ABN AMRO Bank NV, 5,250 %, vencimiento 26/05/2026	2.987	Verizon Communications Inc, 4,329 %, vencimiento 21/09/2028	3.816
Robert Bosch GmbH, 3,625 %, vencimiento 02/06/2027	2.681	ABN AMRO Bank NV, 0,875%, vencimiento al 15/01/2024	3.133
Bank of America Corp, 4,134 %, vencimiento 12/06/2028	2.678	Home Depot Inc/The, 2,500 %, vencimiento 15/04/2027	2.609
Bundesrepublik Deutschland, 0,500 % vencimiento 15/02/2026	2.224	UBS Group AG, 2,125 %, vencimiento 04/03/2024	2.524
Nationwide Building Society, 6,125 %, vencimiento 21/08/2028	2.010	Merck & Co Inc, 1,900 %, vencimiento 10/12/2028	2.395
HSBC Holdings Plc, 6,161 %, vencimiento 09/03/2029	1.800	NIKE Inc, 2,400 %, vencimiento 27/03/2025	2.394
Sika Capital BV, 3,750 %, vencimiento 03/11/2026	1.710	Roche Holdings Inc, 144A, 1,930 %, vencimiento 13/12/2028	2.389
Cargill Inc, 3,875 %, vencimiento 24/04/2030	1.481	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, 3,375 %, vencimiento 21/10/2025	2.383
Neste Oyj, 3,875 %, vencimiento 16/03/2029	1.286	EssilorLuxottica SA, 0,000 %, vencimiento 27/05/2023	2.360
easyJet FinCo BV, 3,750 %, vencimiento al 03/05/2030	1.146	AstraZeneca Plc, 3,625%, vencimiento 03/03/2027	2.343
		Bank of Nova Scotia/The, 0,500 %, vencimiento 30/04/2024	2.328

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
United States Treasury Note/Bond, 0,375%, con vencimiento el 15/04/2024	12.754	United States Treasury Note/Bond, 1,125%, con vencimiento el 28/02/2025	11.101
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250%, vencimiento 15/08/2028	8.312	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	6.231
United States Treasury Note/Bond, 0,250%, con vencimiento el 31/08/2025	6.271	United States Treasury Note/Bond, 0,125 %, vencimiento 30/06/2023	4.716
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	6.258	United States Treasury Note/Bond, 0,375%, con vencimiento el 15/04/2024	3.988
United States Treasury Note/Bond, 0,250%, con vencimiento el 31/08/2025	4.706	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	3.660
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	3.676	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	3.576
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	3.595	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,000 %	3.562
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,000 %	3.581	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	3.350
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,000 %	3.569	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,000 %	3.229
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 %	3.394	United States Treasury Note/Bond, cupón cero, vencimiento 30/11/2023	3.121
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,000 %	3.256	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, vencimiento 31/10/2027	2.898
United States Treasury Note/Bond, 1,375%, con vencimiento el 31/10/2028	3.176	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,000 %	2.658
United States Treasury Note/Bond, 4,125%, con vencimiento el 31/10/2027	2.928	Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 21, 0,100 %, vencimiento 20/03/2026	2.585
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,000 %	2.418	Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 21, 0,100 %, vencimiento 10/03/2026	2.388
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,000 %	2.260	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,000 %	2.385
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,000 %	2.251	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,000 %	2.248
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,000 %	2.172	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	2.169
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	2.117	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,000 %	2.153
Franklin Templeton China Funds — Western Asset China Bond Fund — Clase LM	2.028	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,500 %	1.995
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,500 %	1.997	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,000 %	1.879
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,000 %	1.893	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500%	1.854
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,000 %	1.766	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,000 %	1.758
Fannie Mae or Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,000 %	1.761	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,000 %	1.680

FTGF Western Asset Global Credit Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund — Clase WA (Distribución)	11.451	Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund — Clase WA (Distribución)	11.788
JPMorgan Chase & Co, 0,389 %, vencimiento 24/02/2028	607	Bundesobligation, Serie 182, 0,000%, vencimiento 10/10/2025	569
Morgan Stanley, 4,656 %, vencimiento 02/03/2029	581	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, con vencimiento el 15/08/2029	547
McDonald's Corp, 5,450 %, vencimiento 14/08/2053	379	Banco Santander SA, 1,750 %, due 17/02/2027	430
Danske Bank A/S, 4,750 %, vencimiento 21/06/2030	367	BNP Paribas SA, 1,875 %, vencimiento 14/12/2027	430
Bank of America Corp, 1,662 %, vencimiento 25/04/2028	284	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, con vencimiento el 15/02/2027	418

^ No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Estado de cambios importantes en la cartera – (continuación)

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^] – (continuación)

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS
	(en miles) USD		(en miles) USD
Corning Inc, 4,125 %, vencimiento 15/05/2031	284	United States Treasury Note/Bond, 4,000%, con vencimiento el 15/11/2052	390
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, con vencimiento el 15/08/2031	272	Stellantis NV, 5,250 %, vencimiento 15/04/2023	360
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, con vencimiento el 15/02/2031	254	United States Treasury Note/Bond, 4,000%, con vencimiento el 15/11/2052	345
CRH SMW Finance DAC, 4,000 %, vencimiento 11/07/2031	250	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, con vencimiento el 15/05/2052	336
Wells Fargo & Co, 5,389 %, vencimiento 24/04/2034	250	United States Treasury Note/Bond, 2,000%, con vencimiento el 15/11/2026	328
Victoria Plc, 8,000%, vencimiento 30/08/2086	246	Suzano Austria GmbH, 7,000 %, vencimiento 16/03/2047	303
UBS Group AG, 144A, 1,305 %, vencimiento 02/02/2027	229	HSBC Holdings Plc, 5,875 %, Perpetuo	291
United Kingdom Gilt, 4,125 %, vencimiento 29/01/2027	223	Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, vencimiento 01/10/2024	290
Floene Energias SA, 4,875 %, vencimiento 03/07/2028	218	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, con vencimiento el 15/02/2025	286
Bouygues SA, 3,875 %, vencimiento 17/07/2031	214	Glencore Finance Europe Ltd, 1,875 %, vencimiento 13/09/2023	282
United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, con vencimiento el 15/05/2043	207	Corning Inc, 4,125 %, vencimiento 15/05/2031	281
United States Treasury Note/Bond, 4,000%, con vencimiento el 15/11/2052	203	CPUK Finance Ltd, 7,239 %, vencimiento 28/02/2024	281
Electricité de France SA, 9,125 %, Perpetuo	200	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, con vencimiento el 15/05/2028	268
HSBC Holdings Plc, 6,332%, con vencimiento el 09/03/2044	200	Danske Bank A/S, 5,375 %, vencimiento 12/01/2024	268

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS
	(en miles) USD		(en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund — Clase WA (Distribución)	862.344	Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund — Clase WA (Distribución)	877.107
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	115.959	United States Treasury Note/Bond, 3,500%, con vencimiento el 31/01/2028	148.666
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	114.318	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	115.959
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 31/03/2028	101.356	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	114.318
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	97.556	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 31/03/2028	101.058
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento 15/05/2053	88.311	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	97.577
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	79.123	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento 15/05/2053	83.113
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 31/05/2028	72.352	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	79.176
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 6,000 %	58.165	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 31/05/2028	72.115
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	57.983	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	58.176
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 5,500 %	57.413	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 6,000 %	57.795
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	57.159	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	57.420
United States Treasury Note/Bond, 3,750 %, con vencimiento el 31/05/2030	54.085	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 5,500 %	56.905
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 31/08/2030	49.629	United States Treasury Note/Bond, 3,750 %, con vencimiento el 31/05/2030	54.317
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, con vencimiento el 30/04/2028	42.250	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 31/08/2030	49.643
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,500 %	40.630	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, con vencimiento el 30/04/2028	42.042
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 5,500 %	40.210	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 5,500 %	40.649
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,500 %	39.926	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,500 %	39.924
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 6,000 %	36.660	United States Treasury Note/Bond, 4,000%, con vencimiento el 31/10/2029	35.932
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 15/02/2053	34.620	Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR82, 8,375 %, con vencimiento el 15/03/2024	35.025
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, con vencimiento el 15/05/2023	28.449	United States Treasury Note/Bond, 4,000%, con vencimiento el 15/11/2052	33.382
		United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 15/02/2053	31.107

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS
	(en miles) USD		(en miles) USD
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	3.466	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	3.526
Cinemark USA Inc, 9,069 %, vencimiento 24/05/2030	1.734	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	2.383
Occidental Petroleum Corp, 7,950 %, vencimiento 15/06/2039	1.556	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 31/10/2027	1.605
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	1.369	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	1.365
Comerica Bank, 2,500 %, vencimiento 23/07/2024	1.306	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	1.259
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 7,375 %, con vencimiento el 01/03/2031	1.295	Hardee's Funding LLC, 3,981 %, con vencimiento 20/12/2050	1.199
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	1.264	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	1.151
Triumph Group Inc, 144A, 9,000 %, con vencimiento 15/03/2028	1.220	MPLX LP, Serie A	1.137
CSC Holdings LLC, 144A, 11,250 %, con vencimiento el 15/05/2028	1.192	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, con vencimiento 20/01/2026	1.068
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	1.151	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, con vencimiento 01/05/2025	973
ROBLOX Corp, 144A, 5,750%, con vencimiento el 01/03/2027	1.052	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 7,875 %, con vencimiento 15/11/2025	972
NCL Corp, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 15/03/2026	1.030	Voya CLO 2017-1 Ltd FRN, Serie 2017 1A, Clase C, 144A, 6,070 %, con vencimiento 17/04/2030	961
VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 9,500 %, con vencimiento 01/06/2028	900	ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento 29/04/2025	897
Harbor Freight Tools USA Inc, 8,196 %, con vencimiento 19/10/2027	864	XPO CNW Inc, 6,700 %, con vencimiento 01/05/2034	873
GFL Environmental Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento 15/06/2029	846	Cinemark USA Inc, 9,069 %, con vencimiento 24/05/2030	867
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, con vencimiento 01/06/2031	840	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities FRN, Serie 2017 C05, Clase 1B1, 6,044 %, con vencimiento 25/01/2030	834
Tutor Perini Corp, 144A, 6,875 %, con vencimiento 01/05/2025	821	Structured Asset Investment Loan Trust FRN, 5,550 %, con vencimiento 25/03/2034	823
CIFC Funding 2018-I Ltd, Serie 2018 1A, Clase C, 144A, 7,322 %, con vencimiento 18/04/2031	815	CSC Funding LLC, 144A, 6,500 %, con vencimiento 01/02/2029	719
Goldentree Loan Management US Clo 3 Ltd, Serie 2018 3A, Clase D, 144A, 8,438 %, con vencimiento 20/04/2030	801	Penn Virginia Holdings LLC, 144A, 9,250 %, con vencimiento 15/08/2026	716
Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, con vencimiento 07/04/2026	794	Magallanes Inc, 144A, 3,755 %, con vencimiento 15/03/2027	714

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS
	(en miles) USD		(en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund — Clase WA (Distribución)	81.441	Western Asset Liquidity Funds Plc — Western Asset US Dollar Liquidity Fund — Clase WA (Distribución)	82.766
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	4.985	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	4.983
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 5,000 %	4.711	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 5,000 %	4.705
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	4.492	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	4.478
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	4.090	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C06, Clase 1B1, 6,594 %, con vencimiento 25/02/2030	4.288
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	3.801	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C06, Clase 1B1, 9,152 %, con vencimiento el 25/03/2031	4.156
Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Clase A3, 144A, 6,319 %, con vencimiento 25/05/2068	3.620		

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Estado de cambios importantes en la cartera – (continuación)

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^] – (continuación)

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
Chase Mortgage Finance Trust Series 2007-A1, Serie 2007 A1, Clase 11M1, 4,081 %, vencimiento 25/03/2037	3.199	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, zero coupon	4.093
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	2.963	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, zero coupon	3.807
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	2.898	BHMS 2018-MZB, Serie 2018 MZB, Clase MZB, 144A, 12,244 %, vencimiento 15/07/2025	3.511
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1, Serie 2015 JP1, Clase C, 4,881 %, vencimiento 15/01/2049	2.880	Notas de deuda de riesgo crediticio de agencia estructurada de Freddie Mac, Serie 2017 DNA2, Clase B2, 16,652 %, vencimiento 25/10/2029	3.459
GS Mortgage Securities Trust 2015-GC28, Serie 2015 GC28, Clase D, 144A, 4,452 %, vencimiento 10/02/2048	2.732	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C07, Clase 1B1, 6,444 %, con vencimiento el 25/05/2030	3.436
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, Serie 2014 GC23, Clase C, 4,572 %, vencimiento 10/07/2047	2.717	Nomura Resecuritization Trust 2015-4R, Serie 2015 4R, Clase 4A7, 144A, 3,359 %, vencimiento 26/03/2037	3.383
Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Clase B1, 144A, 8,239 %, con vencimiento el 25/05/2068 *	2.640	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-3, Serie 2017 3, Clase M2, 144A, 4,750 %, vencimiento 25/07/2056	2.983
Fannie Mae o Freddie Mac, 4,500 %, vencimiento 01/10/2052, cupón cero	2.061	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, zero coupon	2.943
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28, Serie 2015 C28, Clase D, 4,216 %, vencimiento 15/05/2048	2.000	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, zero coupon	2.875
Freddie Mac Pool, 4,000 %, vencimiento 01/04/2053	1.234	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA2, Serie 2019 DNA2, Clase B2, 144A, 12,944 %, vencimiento 25/03/2049	2.643
GS Mortgage Securities Trust 2015-GC32, Serie 2015 GC32, Clase D, 3,345 %, vencimiento 10/07/2048	1.223	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Serie INABS 2005-B, Serie 2005 B, Clase M6, 3,509 %, vencimiento 25/08/2035	2.455
Freddie Mac Pool, 4,000 %, con vencimiento el 01/05/2053	1.220	National Collegiate Student Loan Trust 2005-3, Serie 2005 3, Clase B, 5,929 %, vencimiento 27/07/2037	2.213
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, zero coupon	1.097	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C03, Clase 1B1, 6,194 %, con vencimiento el 25/10/2030	2.198
		FRESB 2018-SB48 Mortgage Trust, Serie 2018 SB48, Clase B, 144A, 4,285 %, vencimiento 25/02/2038	2.129
		Fannie Mae o Freddie Mac, 4,500 %, vencimiento 01/10/2052	2.041
		RBSGC Mortgage Loan Trust 2007-A, Serie 2007 A, Clase 3A1, 2,794 %, vencimiento 25/01/2037	1.806

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

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	134.544	Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	131.986
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,500 %	24.658	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,500 %	26.971
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,500 %	20.902	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,500 %	20.911
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	19.922	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	17.979
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	17.968	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,500 %	17.871
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,500 %	17.853	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	17.758
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	17.757	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	16.815
Freddie Mac Pool 'SD2245', 5,500 %, vencimiento 01/12/2052	17.352	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	16.249
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	16.243	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,500 %	16.006
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,500 %	16.031	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 3,000 %	15.812
Ginnie Mae II Pool 'MA7768', 3,000 %, vencimiento 20/12/2051	15.856	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	13.778
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 3,000 %	15.812	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	13.699
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	13.718	Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, vencimiento 20/09/2051	13.064
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	13.601	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,500 %	13.028
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,500 %	13.048	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	11.953
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	11.946	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,500 %	11.830
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,500 %	11.857	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	11.762
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	11.744	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	11.493
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	11.484	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,500 %	11.456
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	10.198	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	10.261
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	9.076	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	9.229
Freddie Mac Pool 'S12048', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2050	8.558	Fannie Mae Pool 'CB0414', 2,500 %, vencimiento 01/05/2051	8.469
Ginnie Mae II Pool, 5,000 %, vencimiento 20/07/2053	8.230	United States Treasury Note/Bond, 0,000 %, vencimiento 09/05/2023	8.239
		United States Treasury Note/Bond, 0,000 %, con vencimiento el 20/07/2023	8.171
		Ginnie Mae II Pool, 5,000 %, vencimiento 20/07/2053	8.148
		Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	8.147

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) GBP	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) £
Intesa Sanpaolo SpA, 6,500 %, vencimiento al 14/03/2029	359	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,500 %, con vencimiento el 02/05/2025	362
Tesco Corporate Treasury Services Plc, 1,875 %, vencimiento 02/11/2028	354	Barclays Plc, 3,375 %, vencimiento 02/04/2025	317
Engie SA, 5,625 %, vencimiento 03/04/2053	296	UniCredit SpA, 7,296 %, vencimiento 02/04/2034	297
United Kingdom Gilt, 4,250 %, vencimiento 07/12/2027	267	Close Brothers Group Plc, 2,000 %, vencimiento 11/09/2031	267
ABN AMRO Bank NV, 5,250 %, con vencimiento el 26/05/2026	199	South Eastern Power Networks Plc, 5,500 %, vencimiento 05/06/2026	255
United Kingdom Gilt, 0,375 %, con vencimiento el 22/10/2026	198	BNP Paribas SA, 1,875 %, con vencimiento el 14/12/2027	253
United Kingdom Gilt, 1,500 %, vencimiento 22/07/2026	196	AT&T Inc, Serie GBP, 7,000 %, vencimiento 30/04/2040	206
CPUK Finance Ltd, 5,876 %, vencimiento 28/08/2027	190	AT&T Inc, Serie GBP, 2,900 %, vencimiento 04/12/2026	197
Northern Gas Networks Finance Plc, 6,125 %, vencimiento 02/06/2033	179	HSBC Holdings Plc, 5,875 %, Perpetuo	189
United Kingdom Gilt, 4,250 %, vencimiento 07/12/2040	178	Deutsche Bank AG, 4,000 %, con vencimiento el 24/06/2026	187
United Kingdom Gilt, 0,500 %, con vencimiento el 31/01/2029	176	AT&T Inc, 4,375 %, con vencimiento el 14/09/2029	172
HSBC Holdings Plc, 6,332 %, con vencimiento el 09/03/2044	167	United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, vencimiento 15/08/2042	153
Cadent Finance Plc, 5,750 %, vencimiento 14/03/2034	150	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, con vencimiento el 15/08/2049	141
United Utilities Water Finance Plc, 5,125 %, vencimiento 06/10/2038	139	National Express Group Plc, 2,375 %, vencimiento 20/11/2028	124
United Kingdom Gilt, 1,625 %, con vencimiento el 22/10/2028	122	Crh Finance UK Plc, 4,125 %, vencimiento 02/12/2029	109
Weir Group Plc/The, 6,875 %, vencimiento 14/06/2028	110	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, con vencimiento el 15/02/2050	40
NatWest Group Plc, 3,619 %, con vencimiento el 29/03/2029	106	Aspire Defence Finance Plc, Serie A, 4,674 %, vencimiento 31/03/2040	6
National Gas Transmission Plc, 5,750 %, vencimiento 05/04/2035	100	Greene King Finance Plc, Serie A2, 5,318 %, vencimiento 15/09/2031	5
		INEOS Quattro Finance 6 Plc, 5,411 %, vencimiento 13/07/2044	4
		Mitchells & Butlers Finance Plc, Serie B2, 6,013 %, vencimiento 15/12/2028	3

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Estado de cambios importantes en la cartera – (continuación)

	COSTE (en miles) USD		PRODUCTOS (en miles) USD
PRINCIPALES COMPRAS		PRINCIPALES VENTAS	
Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	19.007	Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	18.257
United States Treasury Note/Bond, 3,375%, con vencimiento el 15/05/2033	1.820	United States Treasury Note/Bond, 3,375%, con vencimiento el 15/05/2033	1.811
United States Treasury Note/Bond, 3,500%, con vencimiento el 15/02/2033	1.053	Credit Suisse AG/New York, 1,000 %, vencimiento 05/05/2023	1.250
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, con vencimiento el 15/02/2053	1.032	United States Treasury Note/Bond, 3,500%, con vencimiento el 15/02/2033	1.099
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, con vencimiento el 15/05/2053	686	United States Treasury Note/Bond, 3,625%, con vencimiento el 15/02/2053	992
Credit Suisse AG/New York, 1,000 %, vencimiento 05/05/2023	490	Credit Suisse AG/New York, 1,000 %, vencimiento 05/05/2023	930
HSBC Holdings Plc, 6,254%, con vencimiento el 09/03/2034	460	JPMorgan Chase & Co, 5,546 %, con vencimiento el 15/12/2025	709
HEICO Corp, 5,250 %, vencimiento 01/08/2028	459	United States Treasury Note/Bond, 3,625%, con vencimiento el 15/05/2053	617
Bank of America Corp, 2,972 %, con vencimiento el 04/02/2033	446	Enel Finance International NV, 144A, 6,800 %, vencimiento 14/10/2025	603
HCA Inc, 5,500 %, vencimiento 01/06/2033	420	Sands China Ltd, 5,375%, con vencimiento el 08/08/2025	563
Bank of America Corp, 5,288 %, vencimiento 25/04/2034 VAR	410	Amgen Inc, 5,250 %, vencimiento 02/03/2033	560
Electricite de France SA, 6,250 %, vencimiento 23/05/2033	400	Credit Agricole SA, 144A, 5,301 %, vencimiento 12/07/2028	558
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,750%, vencimiento 19/05/2033	395	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 20/01/2026	543
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, vencimiento 26/06/2024	390	DISH DBS Corp, 144A, 5,000 %, vencimiento 15/03/2023	520
Morgan Stanley Bank NA, 4,754 %, vencimiento 21/04/2026	390	UBS Group AG, 144A, 6,537 %, con vencimiento el 12/08/2033	499
United Airlines 2023-1 Clase A Pass Through Trust, 5,800 %, vencimiento 15/01/2036	390	DNB Bank ASA, 144A, 2.968%, vencimiento 28/03/2025	482
ONEOK Inc, 6,050 %, con vencimiento el 01/09/2033	370	Danske Bank A/S, 144A, 6,466 %, vencimiento 09/01/2026	480
Morgan Stanley, 5,449 %, con vencimiento 20/07/2029	360	BNP Paribas SA, 144A, 5,125 %, con vencimiento 13/01/2029	450
ONEOK Inc, 6,625 %, con vencimiento el 01/09/2053	358	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855%, con vencimiento 12/02/2026	436
General Electric Co, 6,750 %, con vencimiento 15/03/2032	347	Verizon Communications Inc, 4,272 %, con vencimiento el 15/01/2036	428
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^]			
	COSTE (en miles) USD		PRODUCTOS (en miles) USD
PRINCIPALES COMPRAS		PRINCIPALES VENTAS	
Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	3.473	Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	4.684
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, con vencimiento el 31/03/2028	938	United States Treasury Note/Bond, 3,625%, con vencimiento el 31/03/2028	655
United States Treasury Note/Bond, 4,125%, con vencimiento el 31/08/2030	686	United States Treasury Note/Bond, 3,500%, con vencimiento el 30/04/2028	470
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, con vencimiento el 15/05/2053	582	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	199
United States Treasury Note/Bond, 3,500%, con vencimiento el 15/05/2053	470	Ameritrust Mortgage Securities Inc, FRN, 6,672 %, con vencimiento 25/11/2034	198
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125%, con vencimiento 15/01/2033	261	United States Treasury Note/Bond, 1,875%, con vencimiento el 15/02/2051	163
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, con vencimiento el 31/03/2030	250	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, con vencimiento 21/07/2023	119
United States Treasury Note/Bond, 4,000%, con vencimiento el 31/07/2030	209	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	100
United States Treasury Note/Bond, 4,375%, con vencimiento el 15/08/2043	157	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	100
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, con vencimiento el 15/02/2053	157	Ginnie Mae II, 5,000 %, con vencimiento 20/12/2052	100
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2015 C03, Clase 1M2, 10,402 %, con vencimiento el 25/07/2025	141	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	99
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, Serie 2022 DNA3, Clase B1, 144A, 10,938 %, con vencimiento 25/04/2042	104	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	98
Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Clase 1B1, 144A, 8,388 %, con vencimiento 25/10/2041	100	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	96
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	100	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	94
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	100	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	93
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	100	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	92
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	100	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	90
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	100	Saxon Asset Securities Trust 2006-3, Serie 2006 3, Clase A4, 3,220 %, con vencimiento 25/10/2046	83
Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Clase A1, 144A, 5,811 %, con vencimiento el 25/05/2068 *	100	Citadel Securities, 7,422 %, con vencimiento 27/02/2028	49
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	99	RAMP Series 2006-NC3 Trust, Serie 2006 NC3, Clase M1, 5,195 %, con vencimiento 25/08/2036	47
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 %	99		
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	98		
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 %	96		
United States Treasury Note/Bond, 3,000%, con vencimiento el 15/02/2049	95		
Ginnie Mae II Pool, 3,500 %, con vencimiento el 20/11/2052	94		
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	93		
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]			
	COSTE (en miles) USD		PRODUCTOS (en miles) USD
PRINCIPALES COMPRAS		PRINCIPALES VENTAS	
Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	1.620	Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	1.285
European Investment Bank, 0,050 %, con vencimiento 15/11/2029	401	United States Treasury Note/Bond, 3,375%, con vencimiento el 15/05/2033	249
United States Treasury Note/Bond, 3,375%, con vencimiento el 15/05/2033	381	Danske Bank A/S, 144A, 5,375%, con vencimiento 12/01/2024	199
European Investment Bank, 3,750 %, con vencimiento el 14/02/2033	303	HSBC Holdings Plc, 4,950 %, con vencimiento 31/03/2030	195
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, con vencimiento el 15/08/2031	264	BNP Paribas SA, 144A, 3,052 %, con vencimiento el 13/01/2031	194
McDonald's Corp, 5,450 %, con vencimiento el 15/08/2053	189	Bundesrepublik Deutschland, 0,000 %, con vencimiento el 15/08/2031	171
Tesco Corporate Treasury Services Plc, 1,875 %, con vencimiento 02/11/2028	115	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, con vencimiento 01/06/2032	149
E.ON SE, 3,750 %, con vencimiento 01/03/2029	108	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,500 %, con vencimiento el 02/05/2025	121
Danske Bank AS, 4,750 %, con vencimiento 21/06/2030	108	Verizon Communications Inc, 5,250 %, con vencimiento el 16/03/2037	118
Intesa Sanpaolo SpA, 5,125 %, con vencimiento al 29/08/2031	108	AXA SA, 5,125 %, con vencimiento 04/07/2043	110
BPCE SA, 3,875 %, con vencimiento el 17/07/2031	107	Intesa Sanpaolo SpA, 5,125 %, con vencimiento al 29/08/2031	109
Morgan Stanley, 4,656 %, con vencimiento el 02/03/2029	106	Pandora A/S, 4,500 %, con vencimiento 10/04/2028	109
Pandora A/S, 4,500 %, con vencimiento 10/04/2028	106	Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, con vencimiento al 02/03/2028	106
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, con vencimiento el 15/02/2053	102	Bundesrepublik Deutschland, 0,500 %, con vencimiento el 15/02/2028	99
Bundesrepublik Deutschland, 0,500 %, con vencimiento el 15/02/2028	99	Bundesrepublik Deutschland, 4,750%, con vencimiento 04/07/2034	93
Bank of America Corp, 1,662 %, con vencimiento el 25/04/2028	98	UCB SA, 1,000 %, con vencimiento 30/03/2028	92
Pfizer Investment Enterprises Pte, 5,300 %, con vencimiento 19/05/2053	50	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, con vencimiento el 15/02/2029	92
Pfizer Investment Enterprises Pte, 4,750%, con vencimiento 19/05/2033	50	Bundesrepublik Deutschland, 0,000 %, con vencimiento el 15/08/2029	86
Wells Fargo & Co, 5,389 % con vencimiento 24/04/2034	40	Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 1,375 %, con vencimiento 26/01/2032	86
Citigroup Inc, 6,174 % con vencimiento 25/05/2034	30	Vonovia SE, 0,750 %, con vencimiento 01/09/2032	77
		Bank of America Corp, 3,550%, con vencimiento 05/03/2024	60

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Estado de cambios importantes en la cartera – (continuación)

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^ (continuación)

PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
McDonald's Corp, 5,45 %, con vencimiento el 15/08/2053	60
AT&T Inc, 3,500 %, con vencimiento el 15/09/2053	48
United States Treasury Note/Bond, 2,875%, con vencimiento el 15/05/2032	47
United States Treasury Note/Bond, 3,625%, con vencimiento el 15/02/2053	45

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reperto)	42.843	Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reperto)	38.487
United States Treasury Note/Bond, 3,500%, con vencimiento el 15/02/2033	17.149	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,250 %, vencimiento 19/10/2023	11.250
Australia Government Bond, Serie 137, 2,750 %, vencimiento 21/04/2024	9.290	United States Treasury Note/Bond, 4,850%, con vencimiento el 31/07/2024	10.711
German Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 20/09/2023	9.094	Bundesrepublik. Deutschland, 1,700 %, vencimiento 15/08/2032	9.086
Norway Government Bond, Serie 476, 144A, 3,000 %, vencimiento 14/03/2024	8.727	Australia Government Bond, Serie 4412, 2,750%, con vencimiento el 10/12/2044	9.008
United Kingdom Gilt, 3,250 %, con vencimiento el 31/01/2033	8.316	TES colombianos, Serie B, 6,000%, con vencimiento el 28/04/2028	8.416
United Kingdom Gilt, 1,250 %, con vencimiento el 31/07/2051	7.875	Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750 %, vencimiento 25/04/2032	7.884
Colombian TES, Serie B, 9,250 %, vencimiento 28/05/2042	7.395	United States Treasury Note/Bond, 0,750%, con vencimiento el 22/07/2023	7.223
France Government International Bond, 0,750 %, vencimiento 25/05/2053	6.697	France Government International Bond, 0,750 %, vencimiento 25/05/2053	6.839
Mexican Bonos, Serie MS, 8,000 %, vencimiento 24/05/2035	5.121	United States Treasury Note/Bond, 1,875%, con vencimiento el 15/11/2051	6.125
United States Treasury Floating Rate Note — A la emisión, 4,931 %, vencimiento 31/01/2025	4.388	Norway Government Bond, Serie 476, 144A, 2,000%, vencimiento 31/05/2023	5.833
Chile Government International Bond, 4,950 %, vencimiento 05/01/2036	3.285	Bonos Mexicanos, serie M 30, 8,500%, vencimiento 18/11/2038	5.745
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,250 %, vencimiento 19/10/2023	2.448	Bonos Mexicanos, Serie M 20, 8,500 %, con vencimiento el 31/05/2029	5.485
Bonos Mexicanos, Series M, 8,000%, con vencimiento el 31/07/2053	2.306	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund — Clase Institucional	4.256
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 5,498%, due 31/07/2025	880	Australia Government Bond, Serie 137, 2,750 %, vencimiento 21/04/2024	3.824
United States Treasury Note/Bond, 2,250%, con vencimiento el 15/02/2052	839	German Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 20/09/2023	3.694
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund — Clase Institucional	161	Norway Government Bond, Serie 476, 144A, 3,000 %, vencimiento 14/03/2024	3.385
		United States Treasury Floating Rate Note — A la emisión, 4,931 %, vencimiento 31/01/2025	2.504
		International Bank for Reconstruction & Development, 7,250 %, vencimiento 21/01/2027	579
		Colombian TES, Serie B, 9,250 %, vencimiento 28/05/2042	366

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reperto)	201.918	Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reperto)	194.208
United States Treasury Floating Rate Note — A la emisión, 4,931 %, vencimiento 31/01/2025	55.362	United States Treasury Note/Bond, 2,750%, con vencimiento el 15/08/2032	70.945
Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000%, con vencimiento el 01/01/2033	21.435	United States Treasury Floating Rate Note — A la emisión, 4,931 %, vencimiento 31/01/2025	53.835
United States Treasury Note/Bond, 2,750%, con vencimiento el 15/08/2032	20.098	United States Treasury Floating Rate Note — A la emisión, 4,931 %, vencimiento 31/03/2024 FRN	46.137
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 5,418%, due 30/04/2025	17.145	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund — Clase Institucional	31.630
Colombian TES, Serie B, 9,250 %, vencimiento 28/05/2042	11.646	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000%, con vencimiento el 01/01/2031	31.072
United Kingdom Gilt, 1,250 %, con vencimiento el 31/07/2051	10.949	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000%, con vencimiento el 01/01/2033	26.331
General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, vencimiento 06/04/2026	10.802	Republic of Poland Government bond 1,750 %, vencimiento 25/04/2032	26.079
Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, vencimiento 18/05/2026	8.602	Colombian TES, Serie B, 9,250 %, vencimiento 28/05/2042	19.808
Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2053	8.582	Bonos Mexicanos, Series M, 8,000%, con vencimiento el 31/07/2053	12.910
Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000 %, con vencimiento el 20/06/2053	6.707	Peru Government Bond, 6,150 %, vencimiento 12/08/2032	12.087
Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, con vencimiento el 20/05/2053	5.892	TES colombianos, Serie B, 7,250%, con vencimiento el 26/10/2050	11.277
Republic of South Africa Government Bond, Serie 2048, 8,750 %, vencimiento 28/02/2048	5.608	Macquarie Group Ltd, 6,207 %, vencimiento 22/11/2024	10.651
Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500 %, con vencimiento el 20/02/2053	4.759	Commercial Mortgage Backed Securities, 3,510 %, vencimiento 10/09/2050	10.608
Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500 %, con vencimiento el 20/06/2053	4.540	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund — Clase institucional 5,700 %, vencimiento 01/11/2024	10.263
Petróleos Mexicanos, 6,950 %, vencimiento 28/01/2060	4.390	Republic of South Africa Government Bond, Serie 2048, 8,750 %, vencimiento 28/02/2048	10.256
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund — Clase Institucional	1.065	Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	9.400
		Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,955 %, vencimiento 14/03/2025	9.163
		TES colombianos, Serie B, 6,000%, con vencimiento el 28/04/2028	8.536
		Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, 3,276 %, vencimiento 15/11/2052	7.593
		New Zealand Government Bond, Serie 0551, 2,750%, vencimiento 15/05/2051	7.459

FTGF Brandywine Global High Yield Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reperto)	10.383	Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reperto)	9.537
Sabre GBL Inc, 144A, 9,250 %, vencimiento 15/04/2025	945	Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000%, con vencimiento el 15/05/2025	629
Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, vencimiento 01/10/2026	774	Sabre GBL Inc, 144A, 9,250 %, vencimiento 15/04/2025	591
Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp, 144A, 4,875 %, vencimiento 01/05/2029	751	Sabre GBL Inc, 144A, 7,375 %, vencimiento 01/09/2025	563
Petróleos Mexicanos, 5,950 %, con vencimiento el 28/01/2031	673	Lindblad Expeditions Holdings Inc, 9,000 %, vencimiento 15/05/2028	521
Athabasca Oil Corp, 144A, 9,750 %, vencimiento 01/11/2026	666	PRA Group Inc, 144A, 8,375 %, vencimiento 01/02/2028	502
Allwyn Entertainment Financing UK Plc, 7,250 %, vencimiento 30/04/2030	632	Arko Corp, 144A, 5,125 %, vencimiento 15/11/2029	501
Valvoline Inc, 144A, 4,250 %, vencimiento 15/02/2030	589	MercadoLibre Inc, 3,125 %, vencimiento 14/01/2031	473
GrubHub Holdings Inc, 144A, 5,500 %, vencimiento 01/07/2027	588	Cargo Aircraft Management Inc, 144A, 4,750 %, vencimiento 01/02/2028	472
Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, vencimiento 01/02/2029	588	Petróleos Mexicanos, 5,950 %, con vencimiento el 28/01/2031	459
Station Casinos LLC, 144A, 4,625 %, vencimiento 01/12/2031	578	Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp, 144A, 4,875 %, vencimiento 01/05/2029	453
Lindblad Expeditions Holdings Inc, 9,000 %, vencimiento 15/05/2028	512	Electricite de France SA, 6,250 %, vencimiento 23/05/2033	452

^ No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Estado de cambios importantes en la cartera – (continuación)

FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^] – (continuación)

	COSTE (en miles) USD		PRODUCTOS (en miles) USD
PRINCIPALES COMPRAS		PRINCIPALES VENTAS	
PRA Group Inc, 144A, 8,375 %, vencimiento 01/02/2028	495	United States Cellular Corp, 6,700 %, vencimiento 15/12/2033	433
Cargo Aircraft Management Inc, 144A, 4,750 %, vencimiento 01/02/2028	476	Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, vencimiento 01/08/2026	428
United States Cellular Corp, 6,700 %, vencimiento 15/12/2033	463	Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, vencimiento 01/10/2026	418
FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, vencimiento 01/01/2030	459	Syneos Health Inc, 3,625 %, vencimiento 15/01/2029	413
Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, vencimiento 15/12/2027	458	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund — Clase Institucional	403
Sabre Global Inc, 144A, 7,375 %, vencimiento 01/09/2025	455	Lenovo Group Ltd, 144A, 6,536 %, vencimiento 27/07/2032	400
Electricite de France SA, 6,250 %, vencimiento 23/05/2033	450	ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, vencimiento 15/08/2028	349
ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, vencimiento 15/08/2028	444	Playtika Holding Corp, 144A, 4,250 %, vencimiento 15/03/2029	342

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

	COSTE (en miles) USD		PRODUCTOS (en miles) USD
PRINCIPALES COMPRAS		PRINCIPALES VENTAS	
Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reperto)	75.952	Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reperto)	67.081
United States Treasury Note/Bond, 3,500%, con vencimiento el 15/02/2033	26.713	United States Treasury Floating Rate Note — A la emisión, 4,931 %, vencimiento 31/01/2025	27.101
United States Treasury Floating Rate Note — A la emisión, 4,931 %, vencimiento 31/01/2025	17.864	Bundesrepublik Deutschland, 1,700 %, con vencimiento el 15/08/2032	10.807
Australia Government Bond, Serie 137, 2,750 %, vencimiento 21/04/2024	15.608	Australia Government Bond, Serie 3106, 2,000%, con vencimiento el 10/06/2031	10.611
German Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 20/09/2023	15.436	United States Treasury Note/Bond, 1,875%, con vencimiento el 15/11/2051	10.301
Norway Government Bond, Serie 476, 144A, 3,000 %, vencimiento 14/03/2024	14.847	Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750 %, vencimiento 25/04/2032	9.640
United Kingdom Gilt, 3,250 %, con vencimiento el 31/01/2033	11.006	France Government Bond, 0,750 %, vencimiento 25/05/2053	8.759
United Kingdom Gilt, 1,250 %, con vencimiento el 31/07/2051	10.428	German Treasury Bill, cupón cero, vencimiento 20/09/2023	7.145
France Government Bond, 0,750 %, vencimiento 25/05/2053	8.590	United States Treasury Floating Rate Note - Cuando se emita, 2,796%, vencimiento 31/07/2024	7.073
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 5,498%, due 31/07/2025	4.840	Bonos Mexicanos, Serie M 20, 8,500 %, con vencimiento el 31/05/2029	6.869
Canada Government Bond, 2,000 %, vencimiento 01/09/2023	4.561	Australia Government Bond, Serie 137, 2,750 %, vencimiento 21/04/2024	6.728
Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000%, con vencimiento el 01/01/2033	3.577	Canada Government Bond, 2,000 %, vencimiento 01/09/2023	6.410
Bonos Mexicanos, Series M, 8,000%, con vencimiento el 31/07/2053	3.338	Norway Government Bond, Serie 476, 144A, 3,000 %, vencimiento 14/03/2024	5.910
Republic of South Africa Government Bond, Serie 2048, 8,750 %, vencimiento 28/02/2048	2.752	TES colombianos, Serie B, 6,000%, con vencimiento el 28/04/2028	4.573
Norway Government Bond, Serie 475, 144A, 2,000%, vencimiento 24/05/2023	2.670	Commonwealth Bank of Australia Floating Rate Note — A la emisión, 5,650 %, vencimiento 14/03/2025	4.243
Bundesrepublik Deutschland, 1,500 %, con vencimiento el 15/05/2023	2.530	Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207 %, vencimiento 22/11/2024	4.225
UK Treasury Note/Bond, 0,750 %, vencimiento 22/07/2023	2.493	UK Treasury Note/Bond, 0,750 %, vencimiento 22/07/2023	4.190
Colombian TES, Serie B, 9,250 %, vencimiento 28/05/2042	2.260	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund — Clase Institucional	4.174
Petroleos Mexicanos, 6,950 %, vencimiento 28/01/2060	1.951	Bundesrepublik Deutschland, 1,500 %, con vencimiento el 15/05/2023	4.100
Freddie Mac Pool 'SD8257', 4,500%, vencimiento 01/10/2052	1.834	Norway Government Bond, 2,000 %, vencimiento 24/05/2023	4.020
		Jackson National Life Global Funding Floating Rate Note — A la emisión, 5,950 %, vencimiento 28/06/2024	3.913
		Australia Government Bond, Serie 5103, 1,875%, con vencimiento el 10/03/2051	3.623
		Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000%, con vencimiento el 01/01/2033	3.578
		Malaysia Government Bond, Serie 0313, 3,480%, con vencimiento el 15/03/2023	2.995
		Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000%, con vencimiento el 01/01/2027	2.748

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

	COSTE (en miles) USD		PRODUCTOS (en miles) USD
PRINCIPALES COMPRAS		PRINCIPALES VENTAS	
Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reperto)	479.031	Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reperto)	417.631
United States Treasury Floating Rate Note — A la emisión, 4,931 %, vencimiento 31/01/2025	227.318	United States Treasury Floating Rate Note — A la emisión, 4,931 %, vencimiento 31/01/2025	174.134
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,375 %, con vencimiento el 18/07/2025	37.616	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund — Clase Institucional	109.237
United States Treasury Note/Bond, 3,500%, con vencimiento el 15/02/2033	35.584	Bonos Mexicanos, Series M, 8,000%, con vencimiento el 31/07/2053	46.281
United Kingdom Gilt 3,750 %, vencimiento 22/10/2053	33.429	United Kingdom Gilt 3,750 %, vencimiento 22/10/2053	31.802
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund — Clase Institucional	23.883	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2,125 %, vencimiento 08/07/2023	23.315
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2,125 %, vencimiento 08/07/2023	23.248	Bundesrepublik Deutschland, 1,800 %, con vencimiento el 15/08/2053	20.600
Peru Government Bond, 6,150 %, vencimiento 12/08/2032	22.929	Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	20.519
Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2053	20.748	Notas de deuda de riesgo crediticio de agencia estructurada de Freddie Mac, Serie 2021 DNA2, Clase M2, 144A, 7,588 %, vencimiento 25/08/2033	19.391
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,250 %, 08/03/2024	19.029	TES colombianos, Serie B, 7,000%, con vencimiento el 26/03/2031	15.798
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2,625 %, con vencimiento el 28/02/2024	18.813	Spain Government Bond, 3,550 %, vencimiento 31/10/2033	14.505
TES colombianos, Serie B, 7,000%, con vencimiento el 26/03/2031	17.776	Towd Point Mortgage Trust 2018-2, Serie 2018 2, Clase B1, 144A, 3,308 %, vencimiento 25/03/2058	13.291
Spain Government Bond, 3,550 %, vencimiento 31/10/2033	14.402	Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC, 144A, 7,875 %, vencimiento 15/02/2025	13.113
Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000%, con vencimiento el 01/01/2033	10.732	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14, Series 2014 LC14, Class D, 144A, 4,586%, vencimiento 15/03/2047	11.943
Hudbay Minerals Inc, 144A, 4,500 %, vencimiento 01/04/2026	10.608	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, vencimiento 01/03/2025	9.759
UBS Group AG, 144A, 6,537 %, con vencimiento el 12/08/2033	9.238	AT&T Inc, 2,750 %, con vencimiento el 01/06/2031	9.671
GGAM Finance Ltd, 144A, 7,750 %, con vencimiento el 15/05/2026	8.945	Valero Energy Corp, 3,650 %, vencimiento 01/12/2051	9.552
Bonos Mexicanos, Series M, 8,000%, con vencimiento el 31/07/2053	8.807	Triangle Re 2021-3 Ltd, Serie 2021 3, Clase M1A, 144A, 7,188 %, vencimiento 25/02/2034	9.056
Venture Global Lng Inc, 144A, 8,125 %, vencimiento 01/06/2028	8.100	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Serie 2020 DNA3, Clase B1, 144A, 10,502 %, con vencimiento el 25/06/2050	9.010
KeyBank NA/Cleveland OH, Serie BKNT, 5,535 %, vencimiento 14/06/2024	7.327	Arab Petroleum Investments Corp, 1,483 %, vencimiento 06/10/2026	7.817

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Estado de cambios importantes en la cartera – (continuación)

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]

	COSTE (en miles) USD		PRODUCTOS (en miles) USD
PRINCIPALES COMPRAS		PRINCIPALES VENTAS	
Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	17.261	Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	16.631
United States Treasury Floating Rate Note — A la emisión, 4,931 %, vencimiento 31/01/2025	7.702	United States Treasury Floating Rate Note — A la emisión, 4,931 %, vencimiento 31/01/2025	4.408
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 5,418%, due 30/04/2025	2.493	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund — Clase Institucional	2.216
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Serie 2020 DNA3, Clase B1, 144A, 10,502 %, con vencimiento el 25/06/2050	1.997	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC15, Serie 2013 GC15, Clase AS, 5,335 %, con vencimiento el 10/09/2046	2.091
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA3, Serie 2020 HQA3, Clase B1, 144A, 11,152 %, con vencimiento el 25/07/2050	1.659	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021 Floating Rate Note, 7,073 %, vencimiento 25/10/2033	1.863
PDC Energy Inc, 5,750 %, vencimiento 15/05/2026	1.030	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C14, Serie 2014 C14, Clase A5, 4,064 %, vencimiento 15/02/2047	1.805
Connecticut Avenue Securities Trust Floating Rate Note, cupón cero, vencimiento 25/04/2043	780	GC Pastor Hipotecario 5 FTA 5, Clase A2, 3,721 %, vencimiento 21/06/2046	1.658
Bono internacional del Estado de México, 8,000 %, con vencimiento el 31/07/2053	660	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Clase 1M2, 7,652 %, con vencimiento el 25/07/2030	1.642
Dream Finders Homes Inc, 144A, 8,250 %, vencimiento 15/08/2028	415	Fannie Mae Pool 'MA4876', 6,000%, vencimiento 01/12/2052	1.523
Fannie Mae — CAS Floating Rate Note, cupón cero, vencimiento 25/06/2043	370	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C03, Clase 1B1, 6,194 %, con vencimiento el 25/10/2030	1.500
FirstCash Inc, 144A, 4,625%, con vencimiento el 01/09/2028	358	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Clase 1B1, 5,994 %, con vencimiento el 25/07/2030	1.369
Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, vencimiento 15/08/2027	350	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Serie 2019 R07, Clase 1B1, 144A, 5,844 %, con vencimiento el 25/10/2039	1.173
Freddie Mac STACR REMIC Trust 202 Floating Rate Note, cupón cero, vencimiento 25/05/2043	350	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC17, Serie 2013 GC17, Clase AS, 5,252 %, con vencimiento el 10/11/2046	1.226
Ford Motor Credit Co LLC, 5,584%, vencimiento 18/03/2024	348	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R06, Serie 2019 R06, Clase 2B1, 144A, 6,194 %, con vencimiento el 25/09/2039	1.171
Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 8,875 %, vencimiento 15/07/2028	335	TES colombianos, Serie B, 7,250%, con vencimiento el 26/10/2050	969
Ecopetrol SA, 8,625 %, con vencimiento el 19/01/2029	330	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000%, con vencimiento el 01/01/2033	950
Petroleos Mexicanos, 6,950 %, vencimiento 28/01/2060	321	Bellemeade Re 2020-2 Ltd, Serie 2020 2A, Clase M2, 144A, 8,444 %, vencimiento 26/08/2030	924
Freddie Mac Structured Agency Credit Floating Rate Note, cupón cero, vencimiento 25/06/2043	320	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C28, Serie 2015 C28, Clase C, 4,281 %, vencimiento 15/10/2048	795
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875%, con vencimiento el 15/10/2027	313	Connecticut Avenue Securities Trus Floating Rate Note, cupón cero, vencimiento 25/04/2043	782
Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, vencimiento 15/02/2026	309	Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	761
		COMM 2014-CCRE18 Mortgage Trust, Serie 2014 CR18, Clase AM, 4,103 %, vencimiento 15/07/2047	719
		Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, vencimiento 15/08/2027	715
		Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C01, Clase 1B1, 8,194 %, con vencimiento el 25/07/2029	665
		Bono internacional del Estado de México, 8,000 %, con vencimiento el 31/07/2053	633
		Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000%, con vencimiento el 15/05/2025	556
		Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C06, Clase 1B1, 6,594 %, con vencimiento el 25/02/2030	460

FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]

	COSTE (en miles) USD		PRODUCTOS (en miles) USD
PRINCIPALES COMPRAS		PRINCIPALES VENTAS	
Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	1.058	Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	1.058
Openlane inc, 5,125 %, vencimiento 01/06/2025	97	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund — Clase Institucional	411
Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, vencimiento 01/10/2026	63	Uber Technologies Inc, 7,500 %, vencimiento 15/05/2025	366
Sabre Global Inc, 144A, 9,250 %, vencimiento 15/04/2025	61	Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625 %, vencimiento 01/09/2028	309
Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, vencimiento 01/02/2026	60	TransDigm Inc, 144A, 6,250%, vencimiento 15/03/2026	272
FirstCash Inc, 144A, 4,625%, con vencimiento el 01/09/2028	39	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, vencimiento 21/07/2023	248
Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, vencimiento 30/03/2028	18	Horizon Therapeutics USA Inc, 5,500 %, vencimiento 01/08/2027	227
Nordstrom Inc, 4,250 %, vencimiento 01/08/2031	18	Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, vencimiento 01/02/2029	227
		Affinity Gaming, 144A, 6,875 %, vencimiento 15/12/2027	218
		Freedom Mortgage Corp, 144A, 7,625%, vencimiento 01/05/2026	206
		Arko Corp, 144A, 5,125 %, vencimiento 15/11/2029	201
		First Quantum Minerals Ltd, 6,500 %, vencimiento 01/03/2024	199
		Lenovo Group Ltd, 144A, 6,536 %, vencimiento 27/07/2032	198
		Turning Point Brands Inc, 144A, 5,625 %, vencimiento 15/02/2026	196
		MercadoLibre Inc, 3,125 %, vencimiento 14/01/2031	187
		LCPR Senior Secured Financing DAC, 144A, 6,750 %, vencimiento 15/10/2027	183
		Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, vencimiento 01/08/2026	178
		ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, vencimiento 15/08/2028	174
		Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, vencimiento 01/10/2026	172
		Playtika Holding Corp, 144A, 4,250 %, vencimiento 15/03/2029	168
		Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/04/2030	167
		Nissan Motor Acceptance Co LLC, 3,450 %, vencimiento 15/03/2023	167
		CSC Holdings LLC, 144A, 9,250 %, con vencimiento el 15/08/2026	153
		Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, vencimiento 15/02/2026	151
		Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 6,750 %, vencimiento 01/10/2026	148
		Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, vencimiento 15/11/2029	146
		United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, vencimiento 15/04/2029	140
		Credit Acceptance Corp, 144A, 5,125 %, vencimiento 31/12/2024	134
		PDC Energy Inc, 5,750 %, vencimiento 15/05/2026	129
		Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, vencimiento 30/06/2030	126
		Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, vencimiento 01/02/2026	120
		Freedom Mortgage Corp, 144A, 6,625 %, vencimiento 15/01/2027	117
		Carnival Corp, 4,000 %, vencimiento 01/08/2028	107

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Estado de cambios importantes en la cartera – (continuación)

FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] (continuación)

PRODUCTOS (en miles) USD
PRINCIPALES VENTAS
Energiean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, vencimiento 30/03/2028
Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, vencimiento 15/08/2027
Ciramex Energy Co, 4,375 %, vencimiento 15/03/2029
Home BancShares Inc/AR, 3,125 %, vencimiento 30/01/2032
Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, vencimiento 15/04/2029

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
United States Treasury Floating Rate Note — A la emisión, 4,931 %, vencimiento 31/01/2025	9.323	United States Treasury Floating Rate Note - Cuando se emita, 2,796%, vencimiento 31/07/2024	7.556
Petroleos Mexicanos, 6,950 %, vencimiento 28/01/2060	2.126	United States Treasury Floating Rate Note — A la emisión, 4,931 %, vencimiento 31/01/2025	4.637
Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2053	1.605	Australia Government Bond, Series 3106, 2,000%, con vencimiento el 10/06/2031	3.468
General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, vencimiento 06/04/2026	1.416	Bonos Mexicanos, Series M 20, 8,500 %, con vencimiento el 31/05/2029	2.269
Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, vencimiento 18/05/2026	1.298	Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207 %, vencimiento 22/11/2024	1.439
Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000 %, con vencimiento el 20/06/2053	1.294	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,700 %, con vencimiento el 01/11/2024	1.383
Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, con vencimiento el 20/05/2053	1.108	Australia Government Bond, Series 5103, 1,875%, con vencimiento el 10/03/2051	1.146
Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500 %, con vencimiento el 20/06/2053	910	Jackson National Life Global Funding, 144A, 6,403 %, con vencimiento 28/06/2024	970
Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500 %, con vencimiento el 20/02/2053	891	Malaysia Government Bond, Series 0313, 3,480%, con vencimiento el 15/03/2023	910
Bonos Mexicanos, Series M, 7,750%, con vencimiento el 13/11/2042	230	Malaysia Government Bond, Series 0417, 3,899%, con vencimiento el 16/11/2027	703
Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000%, con vencimiento el 01/01/2029	138	Bonos Mexicanos, Series M, 7,750%, con vencimiento el 13/11/2042	580
Goldman Sachs Group Inc/The, 5,700 %, con vencimiento el 01/11/2024	121	Republic of South Africa Government Bond, Serie 2048, 8,750 %, vencimiento 28/02/2048	259
Republic of South Africa Government Bond, Serie 2048, 8,750 %, vencimiento 28/02/2048	111	TES colombianos, Serie B, 7,000%, con vencimiento el 30/06/2032	224
TES colombianos, Serie B, 7,000%, con vencimiento el 30/06/2032	105	Malaysia Government Bond, Series 0115, 3,955%, con vencimiento 15/09/2025	210
Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000%, con vencimiento el 01/01/2031	102	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000%, con vencimiento el 01/01/2029	192
Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	93	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000%, con vencimiento el 01/01/2031	186
Czech Republic Government Bond, Series 138, 1,750 %, con vencimiento 23/06/2032	92	Czech Republic Government Bond, Series 138, 1,750 %, con vencimiento 23/06/2032	182
Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207 %, con vencimiento 22/11/2024	71	Bonos Mexicanos, Series M, 8,500%, con vencimiento el 18/11/2038	155
Freddie Mac Pool 'RA7790', 5,000 %, con vencimiento el 01/08/2052	67	Mexican Bonos, Series M, 8,000 %, con vencimiento 07/11/2047	117
		Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	78

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reperto)	4.433	Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reperto)	3.502
United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 5,243%, due 31/01/2025	3.946	Notas de deuda de riesgo crediticio de agencia estructurada de Freddie Mac, Serie 2042, 9,066 %, con vencimiento 25/07/2042	622
Bonos Mexicanos, Series M, 8,000%, con vencimiento el 24/05/2035	311	Bonos Mexicanos, Series M, 8,000%, con vencimiento el 31/07/2053	618
Colombian TES, Series B, 7,000 %, con vencimiento 26/03/2031	215	Connecticut Avenue Securities Trust, Serie 2041, 6,966%, con vencimiento 25/12/2041	584
Banco Do Brasil SA/Cayman, 144A, 6,250 %, con vencimiento 18/04/2030	197	Bonos Mexicanos, Series M, 8,000%, con vencimiento el 24/05/2035	300
Spain Government Bond, 3,550 %, con vencimiento 31/10/2033	182	Connecticut Avenue Securities Trust, Serie 2042, 6,484%, con vencimiento 25/03/2042	249
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 % con vencimiento 01/01/2033	148	Var Energi Asa, 144A, 7,500 %, con vencimiento 15/01/2028	211
Bonos Mexicanos, Series M, 8,000%, con vencimiento el 31/07/2053	148	World Acceptance Corp, 7,000 %, con vencimiento 01/11/2026	206
Venture Global Lng Inc, 8,125 %, con vencimiento 01/06/2028	105	BRF SA, 144A, 3,950%, con vencimiento 22/05/2023	200
laa Inc, 5,500 %, con vencimiento 15/06/2027	81	Natwest Group Plc, 2,359 %, con vencimiento 22/05/2024	200
ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125%, con vencimiento 14/04/2030	80	Stellantis NV, 5,250 %, con vencimiento 15/04/2023	200
Civitas Resources Inc, 8,375 %, con vencimiento 01/07/2028	60	Arab Petroleum Investments Corp, 144A, 1,483 %, con vencimiento 06/10/2026	198
Leviathan Bond Ltd, 6,125 %, con vencimiento 30/06/2025	39	Kenbourne Invest SA, 6,875%, con vencimiento 26/11/2024	186
Emerald Debt Merger Sub LLC, 6,625 %, con vencimiento 15/12/2030	30	Spain Government Bond, 3,550 %, con vencimiento 31/10/2033	183
Charles Schwab Corp/The, 5,853 %, con vencimiento 19/05/2034	20	Blue Owl Capital Corp, 2,625 %, con vencimiento 15/01/2027	153
		Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc, 7,875 %, con vencimiento 15/02/2025	153
		AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Group, 5,625 %, con vencimiento 20/05/2024	152
		HP Inc, 4,750%, con vencimiento 15/01/2028	152
		AT&T Inc, 2,750 %, con vencimiento el 01/06/2031	151
		Colombian TES, Series B, 7,000 % con vencimiento 26/03/2031	150
		United States Treasury Floating Rate Note - When Issued, 5,489%, due 31/01/2025	150
		Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 2,742 %, con vencimiento 31/12/2039	106

FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reperto)	74	Cisco Systems Inc	111
Amgen Inc	40	Union Pacific Corp	84
Norfolk Southern Corp	20	Chubb Ltd	80
CSX Corp	18	3M Co	79
Marathon Petroleum Corp	17	Caterpillar Inc	76
The Cigna Group	16	Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reperto)	74
Williams Companies Inc	15	Amgen Inc	71
Chubb Ltd	10	KLA Corp	67
3M Co	9	Aflac Inc	63
Exelon Corp	9	Kroger Co/The	63
KLA Corp	9	Travelers Cos Inc/The	62
Pioneer Natural Resources	9	iShares Russell 1000 Value ETF	61
Union Pacific Corp	9	American International Group Inc	59
Lyondellbasell Industries NV	8	PIONEER NATURAL RESOURCES CO USD0.01	57

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Estado de cambios importantes en la cartera – (continuación)

FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ — (continuación)

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE		PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS	
	(en miles)	USD		(en miles)	USD
Mosaic Co/The	5		The Cigna Group		56
Aflac Inc	4		Ulta Beauty Inc		52
American International Group Inc	4		Ameriprise Financial Inc		51
Expeditors Intern of Washington Inc	4		Marathon Petroleum Corp		51
Marathon Oil Corp	4		CSX Corp		49
Reinsurance Group Of America Inc	4		Laboratory Corp of America Holdings		48
Travelers Cos Inc/The	4		Fed Ex Corporation		47
			Quest Diagnostics Inc		47
			Exelon Corp		42
			Target Corp		42
			Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund — Clase Institucional		41
			Omnicom Group Inc		41
			Capital One Financial Corp		39
			Southern Copper Corp		36
			Johnson & Johnson		35
			Hartford Financial Services Group Inc/The		34
			LKQ Corp		34
			Tyson Foods Inc 'A'		32
			Builders FirstSource Inc		31
			Servicios financieros diversificados		30
			Principal Financial Group Inc		29
			Fifth Third Bancorp		27
			Lyondellbasell Industries NV		27

FTGF ClearBridge Value Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE		PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS	
	(en miles)	USD		(en miles)	USD
Johnson & Johnson	35.490		Meta Platforms Inc 'A'		36.259
Pioneer Natural Resources Co	22.606		Bank of America Corp		26.037
Eastman Chemical Co	15.232		BioMarin Pharmaceutical Inc		19.519
Union Pacific Corp	15.131		Hess Corp		18.336
Gilead Sciences Inc	15.045		Zimmer Biomet Holdings Inc		17.968
American Tower Corp	14.643		Vertex Pharmaceuticals Inc		15.570
First Horizon Corp	14.573		Airbus Group		14.599
Apollo Global Management Inc	14.480		T-Mobile US Inc		13.949
Block Inc	11.328		M&T Bank Corp		12.654
Canadian Pacific Kansas City Ltd	11.049		CVS Health Corp		11.742
UnitedHealth Group Inc	10.562		Oracle Corp		11.272
Microsoft Corp	9.778		Black Knight Inc		10.969
Alibaba Group Holding Ltd	9.052		Uber Technologies Inc		10.595
Clean Harbors Inc	8.404		EQT Corp		9.442
Flowserve Corp	7.867		MGM Resorts International		9.277
Western Alliance Bancorporation	7.596		Tenet Healthcare Corp		9.231
Teck Resources Ltd.	7.251		SolarEdge Technologies Inc		8.786
Ross Stores Inc	7.096		Coty Inc 'A'		8.685
Everest Group Ltd	6.189		TotalEnergies SE ADR		8.046
BioNTech SE ADR	5.765		Mosaic Co/The		8.045
Micron Technology Inc	5.218		Signature Bank/New York NY		7.998
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	4.610		Alcoa Corp		7.548
United Airlines Holdings Inc	4.582		OneMain Holdings Inc		7.084
Siemens AG	4.264		General Motors Co		6.832
Meta Platforms Inc 'A'	3.800		Baker Hughes Co 'A'		5.590
APA Corp	3.464		Micron Technology Inc		5.017
Biogen Inc	3.198		Western Alliance Bancorporation		4.694
			CNH Industrial NV		4.577
			Royal Gold Inc		4.199
			Freeport-McMoRan Inc		4.075

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE		PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS	
	(en miles)	USD		(en miles)	USD
Netflix Inc	1.945		Microsoft Corp		1.650
AbbVie Inc	1.185		T-Mobile US Inc		1.362
Apple Inc	1.067		Verizon Communications Inc		1.287
Meta Platforms Inc 'A'	986		Bank of America Corp		1.147
Becton Dickinson & Co	865		Apple Inc		1.049
Microsoft Corp	830		JPMorgan Chase & Co		1.049
Marvell Technology Inc	816		UnitedHealth Group Inc		1.026
US Bancorp	773		Amazon.com Inc		879
NVIDIA Corp	763		General Motors Co		745
Emerson Electric Co	631		Marriott International Inc/MD		744
Progressive Corp/The	611		Pfizer Inc		697
Amazon.com Inc	398		Pioneer Natural Resources Co		693
ASML Holding NV	302		Home Depot Inc/The		670
Hartford Financial Services Group Inc/The	288		Thermo Fisher Scientific Inc		660
Intercontinental Exchange Inc	280		Johnson & Johnson		639
UnitedHealth Group Inc	257		ArcelorMittal SA		622
Visa Inc 'A'	241		Travelers Cos Inc/The		532
NextEra Energy Inc	238		Air Products & Chemicals Inc		523
Merck & Co Inc	224		Alphabet Inc		513
JPMorgan Chase & Co	207				

^ No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Estado de cambios importantes en la cartera – (continuación)

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund (continuación)

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS
	(en miles) USD		(en miles) USD
ArcelorMittal SA	202	Enphase Energy Inc	505
Honeywell International Inc	198	Comcast Corp	504
TJX Cos Inc/The	191	Alphabet Inc 'A'	482
Johnson & Johnson	190	Visa Inc 'A'	464
Thermo Fisher Scientific Inc	189	United Parcel Service Inc 'B'	434
		Merck & Co Inc	427
		Walt Disney Co/The	413
		Eaton Corp Plc	405
		TJX Cos Inc/The	382
		Honeywell International Inc	377
		Automatic Data Processing Inc	309
		Waste Management Inc	277

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS
	(en miles) USD		(en miles) USD
S&P Global Inc	26.035	S&P Global Inc	26.035
Atlassian Corp	21.384	Atlassian Corp	21.384
Intuit Inc	17.648	Unity Software Inc	13.673
Union Pacific Corp	16.529	Visa Inc 'A'	11.604
Unity Software Inc	13.673	Advance Auto Parts Inc	11.180
Meta Platforms Inc 'A'	11.650	Honeywell International Inc	8.220
Eli Lilly & Co	10.196	Zoetis Inc	8.029
Microsoft Corp	8.461	Eaton Corp Plc	7.470
Adobe Inc	7.646	Palo Alto Networks Inc	6.772
Amazon.com Inc	7.018	WW Grainger Inc	6.575
Apple Inc	6.735	Thermo Fisher Scientific Inc	5.855
NextEra Energy Inc	6.141	NVIDIA Corp	5.684
Visa Inc 'A'	5.943	S&P Global Inc	5.271
NVIDIA Corp	5.827	Stryker Corp	4.626
Sherwin-Williams Co/The	5.713	UnitedHealth Group Inc	4.547
Estee Lauder Cos., Inc. (The) 'A'	5.018	Monster Beverage Corp	4.336
Honeywell International Inc	4.023	NIKE Inc	3.608
UnitedHealth Group Inc	3.928	Microsoft Corp	3.551
Target Corp	3.428	United Parcel Service Inc 'B'	3.484
Netflix Inc	3.077	Marsh & McLennan Cos Inc	2.938
WW Grainger Inc	2.895	Amazon.com Inc	2.902
S&P Global Inc	2.701	Alcon Inc	2.681
Monster Beverage Corp	2.697	Sea Ltd ADR	2.254
Palo Alto Networks Inc	2.688	Apple Inc	2.131
Salesforce Inc	2.558		
Zoetis Inc	2.441		
Thermo Fisher Scientific Inc	2.432		
Eaton Corp Plc	2.398		

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS
	(en miles) USD		(en miles) USD
TJX Cos Inc/The	2.833	Broadcom Inc	5.967
Pinterest Inc	2.598	TE Connectivity Ltd	4.508
Broadcom Inc	2.476	Liberty Broadband Corp	2.540
Starbucks Corp	1.691	Vertex Pharmaceuticals Inc	2.222
Accenture Plc 'A'	1.370	Seagate Technology Holdings Plc	2.084
Freeport-McMoRan Inc	872	Broadcom Inc	2.006
Diageo Plc ADR	613	Madison Square Garden Entertainment Corp	1.380
Etsy Inc	349	Guardant Health Inc	1.165
Airbnb Inc	312	HubSpot Inc	1.120
CrowdStrike Holdings Inc	303	Lyft Inc	965
Warner Bros Discovery Inc	285	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	887
HubSpot Inc	266	Ionis Pharmaceuticals Inc	834
Match Group Inc	147	Match Group Inc	706
Doximity Inc	102	Doximity Inc	656
AbbVie Inc	82	AMC Networks Inc	581
		Comcast Corp	456
		UnitedHealth Group Inc	440
		Autodesk Inc	426
		Liberty Media Corp-Liberty	264
		Western Digital Corp	247

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS
	(en miles) USD		(en miles) USD
Apollo Global Management Inc	724	Bank of America Corp	593
Digital Realty Trust Inc	450	Danaher Corp	586
Blackstone Inc	439	American Airlines Group Inc, 6,500 %, vencimiento 01/07/2025	513
Extra Space Storage Inc	366	RTX Corp	459
Prologis Inc	322	Microsoft Corp	439
Union Pacific Corp	308	AGNC Investment Corp	429
AbbVie Inc	278	Aptiv Plc, Serie A	411
PPL Corp	295	Verizon Communications Inc	411

^ No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Estado de cambios importantes en la cartera – (continuación)

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – (continuación)

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE		PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS	
	(en miles)	USD		(en miles)	USD
Pioneer Natural Resources Co		275	Kimberly-Clark Corp		402
Amphenol Corp 'A'		265	Texas Instruments Inc		368
Sempra		241	TC Energy Corp		358
Chubb Ltd		230	Broadcom Inc		349
US Bancorp Delaware		203	American Tower Corp		326
Starwood Property Trust Inc		195	Equitrans Midstream Corp		302
ConocoPhillips		193	KKR & Co Inc, Serie C		276
L3Harris Technologies Inc		187	Apollo Global Management Inc		255
Goldman Sachs Group Inc/The		185	Otis Worldwide Corp		200
American Homes 4 Rent 'A'		184	Starwood Property Trust Inc		191
Ares Capital Corp		152	TE Connectivity Ltd		189
American Tower Corp		106	Barings BDC Inc		170
NextEra Energy Partners LP		105	Apple Inc		167
QUALCOMM Inc		93	US Bancorp Delaware		164
Gaming and Leisure Properties Inc		79	SBA Communications Corp 'A'		162
Blue Owl Capital Inc 'A'		74	Stanley Black & Decker Inc		161
			Crown Castle Inc		157
			Trinity Capital Inc		155
			Boston Scientific Corp		150
			Blackstone Inc		116
			Pfizer Inc		116
			Amgen Inc		113
			NextEra Energy Inc		107

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE		PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS	
	(en miles)	USD		(en miles)	USD
JPMorgan Chase & Co		42.685	ON Semiconductor Corp		37.734
Procter & Gamble Co/The		28.499	Bank of America Corp		37.054
Colgate-Palmolive Co		27.781	TE Connectivity Ltd		33.484
Lam Research Corp		16.859	Booking Holdings Inc		13.381
Ormat Technologies Inc		16.692	Trane Technologies Plc		10.755
NextEra Energy Partners LP		5.128	Progressive Corp/The		10.741
Microsoft Corp		3.680	Microsoft Corp		10.728
NIKE Inc		3.382	Apple Inc		10.521
UnitedHealth Group Inc		3.168	Hartford Financial Services Group Inc/The		10.068
CVS Health Corp		2.800	Regal Rexnord Corp		8.938
Apple Inc		2.721	Novo Nordisk A/S, ADR		8.929
Walt Disney Co/The		2.400	Costco Wholesale Corp		8.726
Morgan Stanley		2.279	Morgan Stanley		7.160
Equinix Inc		2.261	Synopsys Inc		7.107
Shoals Technologies Group Inc 'A'		2.226	Visa Inc 'A'		6.809
Deere & Co		1.955	First Republic Bank/CA		6.352
Hartford Financial Services Group Inc/The		1.876	Charles Schwab Corp/The		6.112
Charles Schwab Corp/The		1.817	Salesforce Inc		5.907
Home Depot Inc/The		1.762	McCormick & Co Inc/MD		5.617
Johnson & Johnson		1.449	ASML Holding NV		5.133
			Williams-Sonoma Inc		4.805
			Progyny Inc		4.770
			Aptiv Plc		4.322
			Brookfield Renewable Corp		4.314
			UnitedHealth Group Inc		3.855
			BioMarin Pharmaceutical Inc		3.794
			JPMorgan Chase & Co		3.618
			Alphabet Inc 'A'		3.505

FTGF ClearBridge Global Growth Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE		PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS	
	(en miles)	USD		(en miles)	USD
Marvell Technology Inc		254	BNP Paribas SA		172
Apple Inc		225	Marvell Technology Inc		170
Adobe Inc		215	Nestle SA		170
Tokyo Electron Ltd		202	Rentokil Initial Plc		170
HDFC Bank Ltd ADR		193	Raymond James Financial Inc		161
Kering SA		169	Arista Networks Inc		147
Haleon Plc		160	NVIDIA Corp		146
Walt Disney Co/The		159	Thomson Reuters Corp		146
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd		146	Straumann Holding AG		144
Intuit Inc		143	RELX Plc		143
Amazon.com Inc		141	Keyence Corp		133
Estee Lauder Cos., Inc. (The) 'A'		140	CRH Plc ADR		127
Arista Networks Inc		124	United Parcel Service Inc 'B'		122
Trex Co Inc		115	Sensient Technologies Corp		120
Waste Connections Inc		115	Target Corp		120
Amphenol Corp 'A'		108	United Rentals Inc		112
Grupo Bimbo SAB de CV		107	Avantor Inc		111
Alphabet Inc 'A'		105	Iberdrola SA ADR		109
London Stock Exchange Group Plc		104	Kroger Co/The		98
Netflix Inc		104	Old Dominion Freight Line Inc		96

^ No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Estado de cambios importantes en la cartera – (continuación)

FTGF ClearBridge Global Growth Fund^ – (continuación)

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS
	(en miles) USD		(en miles) USD
SAP SE	102	Microsoft Corp	92
Salesforce Inc	100	Aflac Inc	85
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	84	SolarEdge Technologies Inc	84
Daiichi Sankyo Co Ltd	83	Tesla Inc	83
SMC Corp	73	Workday Inc 'A'	69
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	70	EDP - Energias de Portugal SA	66
Deere & Co	68	Haleon Plc	66
Microsoft Corp	66	EssilorLuxottica SA	65
Xero Ltd	66	Apple Inc	59
Alcon Inc	63	Marriott International Inc/MD	59
Tesla Inc	61	Alcon Inc	47
UnitedHealth Group Inc	58		
ASML Holding NV	57		
Pliant Therapeutics Inc	57		
MercadoLibre Inc	52		

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS
	(en miles) EUR		(en miles) EUR
CenterPoint Energy Inc	39.852	Iberdrola SA	39.128
Enel SpA	38.232	TC Energy Corp	34.797
Aéroports de Paris	21.834	SSE Plc	27.763
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	20.112	Union Pacific Corp	27.094
Ferrovial SA	14.662	Vinci SA	25.884
Norfolk Southern Corp	13.873	Aena SME SA, 144A	25.787
Rumo SA	13.277	Southwest Gas Holdings, Inc.	19.545
PG&E Corp	10.571	Severn Trent Plc	17.942
Union Pacific Corp	10.095	East Japan Railway Co	16.930
Entergy Corp	8.244	Terna - Rete Elettrica Nazionale	10.235
American Tower Corp	7.554	NextEra Energy Inc	9.711
PPL Corp	7.514	Centrais Eletricas Brasileiras SA	9.120
CSX Corp	6.198	American Tower Corp	8.189
Terna - Rete Elettrica Nazionale	5.288	Getlink SE	8.111
NextEra Energy Inc	4.546	CSX Corp	7.452
Centrais Eletricas Brasileiras SA	3.283	PG&E Corp	7.284
Gibson Energy Inc	2.856	PPL Corp	6.931
Severn Trent Plc	2.698	Public Service Enterprise Group Inc	6.561
SSE Plc	750	Cellnex Telecom SA, 144A	6.236
		EDP - Energias de Portugal SA	6.146
		United Utilities Group Plc	5.997
		Transurban Group	5.816
		Constellation Energy Corp	5.563
		Entergy Corp	5.555
		CenterPoint Energy Inc	5.353
		OGE Energy Corp	4.992
		Pembina Pipeline Corp	4.804
		Cheniere Energy Inc	4.556
		Central Japan Railway Co	4.408
		Gibson Energy Inc	4.338
		American Water Works Co Inc	4.158

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS
	(en miles) USD		(en miles) USD
Williams Cos Inc/The	22.914	Williams Cos Inc/The	28.499
Enel SpA	22.117	Iberdrola SA	25.255
NextEra Energy Inc	14.464	SSE Plc	16.819
Enbridge Inc	14.148	TC Energy Corp	15.922
Iberdrola SA	12.256	Enbridge Inc	15.351
Edison International	9.528	United Utilities Group Plc	8.013
Snam SpA	8.431	National Grid Plc	7.633
National Grid Plc	7.450	Snam SpA	7.356
Redeia Corp SA	6.467	Southwest Gas Holdings, Inc.	6.699
TC Energy Corp	6.157	Clearway Energy Inc 'C'	6.231
SSE Plc	5.575	Enel SpA	5.995
Union Pacific Corp	5.076	Enagas SA	5.762
China Resources Gas Group Ltd	4.459	Redeia Corp SA	4.547
Entergy Corp	4.110	Engie Brasil Energia SA	3.937
NextEra Energy Partners LP	3.406	Public Service Enterprise Group Inc	3.621
Southern Co/The	3.368	Centrais Eletricas Brasileiras SA	3.621
OGE Energy Corp	3.092	Union Pacific Corp	3.620
Centrais Eletricas Brasileiras SA	2.697	Gibson Energy Inc	2.678
Severn Trent Plc	2.496	Italgas SpA	2.667
Gibson Energy Inc	2.048	CPFL Energia SA	2.432
Brookfield Renewable Corp	1.934	Transurban Group	2.361
CCR SA	1.904	West Japan Railway Co	2.265
American Tower Corp	1.898	EDP - Energias de Portugal SA	2.097
Pembina Pipeline Corp	1.883		

^ No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Estado de cambios importantes en la cartera – (continuación)

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	89.158	Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	82.381
Alpha & Omega Semiconductor Ltd	4.325	Earthstone Energy Inc 'A'	5.769
CECO Environmental Corp	3.221	CIRCOR International Inc	5.221
Fabrinet	2.606	Modine Manufacturing Co	4.603
BrightHouse Financial Inc	2.570	Heritage-Crystal Clean Inc	4.331
Clearfield Inc	2.527	Hexcel Corp	4.142
Leonardo DRS Inc	2.438	Avid Technology Inc	3.919
Udemy Inc	2.399	Limbach Holdings Inc	3.877
Canaccord Genuity Group Inc	2.246	Dorian LPG Ltd	3.850
Xerox Holdings Corp	2.222	Option Care Health Inc	3.671
Patterson-UTI Energy Inc	2.178	Sterling Infrastructure Inc	3.265
Mativ Holdings Inc	2.089	Ruth's Hospitality Group Inc	3.108
IMAX Corp	1.999	Cleveland-Cliffs Inc	2.946
Capstone Copper Corp	1.927	Barnes Group Inc	2.915
Select Water Solutions Inc	1.901	EnPro Industries Inc	2.889
Perella Weinberg Partners 'A'	1.875	Alpha & Omega Semiconductor Ltd	2.842
GCM Grosvenor Inc	1.839	Coherent Corp	2.765
Azenta Inc	1.772	Macerich Co/The	2.744
Terex Corp	1.755	Fabrinet	2.695
TTEC Holdings Inc	1.649	Leonardo DRS Inc	2.523

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	14.862	Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	14.917
EnPro Industries Inc	1.156	Avid Technology Inc	1.550
Ziff Davis Inc	966	Ironwood Pharmaceuticals Inc 'A'	988
iShares Russell 2000 Value ETF — ETF	907	Forward Air Corp	951
Korn Ferry	896	Computer Task Group Inc	895
Catalyst Pharmaceuticals Inc	868	iShares Russell 2000 Value ETF — ETF	834
Ryerson Holding Corp	823	Cohu Inc	658
John Bean Technologies Corp	811	Inter Parfums Inc	608
Lazard Ltd 'A'	775	Heritage-Crystal Clean Inc	597
Steven Madden Ltd	764	FormFactor Inc	582
FormFactor Inc	739	Harmony Biosciences Holdings Inc	570
Marcus & Millichap Inc	720	Onto Innovation Inc	570
Inter Parfums Inc	703	Louisiana-Pacific Corp	548
MKS Instruments Inc	687	Simulations Plus Inc	524
Cirrus Logic Inc	653	FARO Technologies Inc	481
Innospec Inc	645	Wolverine World Wide Inc	479
Skyline Champion Corp	629	MKS Instruments Inc	448
Dun & Bradstreet Holdings Inc	628	Kulicke & Soffa Industries Inc	408
Brady Corp 'A'	603	IAA Inc	404
White Mountains Insurance Group Ltd	582	Enovis Corp	381
Fabrinet	569	Arcosa Inc	346
Cass Information Systems Inc	553	Skyline Champion Corp	333
Houlihan Lokey Inc 'A'	552	Bio-Techne Corp	329
AMN Healthcare Services Inc	540	Esab Corp	328
Carter's Inc	539		
Kadant Inc	533		
Kennedy-Wilson Holdings Inc	528		
Louisiana-Pacific Corp	512		
ESCO Technologies Inc	492		
Brunswick Corp/DE	449		
Crane NXT Co	442		
Vishay Precision Group Inc	434		
Bio-Techne Corp	432		

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	297	Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	306
FirstService Corp	109	FirstService Corporation	103
Colliers International Group Inc	95	Colliers International Group Inc	86
Auction Technology Group Plc	66	Forward Air Corp	59
Azelis Group NV	46	OBIC Business Consultants Co Ltd	59
Miura Co Ltd	46	Inter Parfums Inc	43
Fox Factory Holding Corp	35	Douzone Bizon Co Ltd	29
Lectra	33	Ralph Lauren Corp 'A'	28
TOTVS SA	33	Meitec Corp	27
EnPro Industries Inc	22	Fukui Computer Holdings Inc	24
Rogers Corp	21	Esab Corp	23
Marlowe Plc	19	DiscoverIE Group Plc	20
New Work SE	19	GVS SpA, 144A	20
NICE Information Service Co Ltd	19	FormFactor Inc	19
Marel hf, 144A	18	New Work SE	19
Restore Plc	18	Avid Technology Inc	18
Learning Technologies Group Plc	17	Marlowe Plc	18

^ No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Estado de cambios importantes en la cartera – (continuación)

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^ – (continuación)

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS
	(en miles) USD		(en miles) USD
Hansen Technologies Ltd	15	RB Global Inc	18
MKS Instruments Inc	14	Croda International Plc	17
Karnov Group AB	13	TechTarget Inc	15
As One Corp	12	Arcosa Inc	14
Croda International Plc	12	GenTex Corp	13
		IAA Inc	13

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

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS
	(en miles) USD		(en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reperto)	3.356	Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reperto)	3.356
NTPC Ltd	240	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.262
Hon Hai Precision Industry Co Ltd	174	Samsung Electronics Co Ltd	1.191
		Lite-On Technology Corp	464
		BHP Group Ltd	435
		PetroChina Co Ltd	411
		NHPC Ltd	393
		REC Ltd	387
		Rio Tinto Ltd	382
		China Construction Bank Corp	372
		McMillan Shakespeare Ltd	367
		Bank of China Ltd	366
		Uni-President Enterprises Corp	366
		Power Grid Corp of India Ltd	338
		Giordano International Ltd	335
		China Shenhua Energy Co Ltd	331
		Infosys Ltd	322
		PICC Property & Casualty Co Ltd	320
		Aurizon Holdings Ltd	304
		Coles Group Ltd	303
		Aboitiz Power Corp	301
		AIA Group Ltd	297
		Jardine Cycle & Carriage Ltd	295
		Bank of Communications Co Ltd	293
		Uni-President China Holdings Ltd	289
		CITIC Telecom International Holdings Ltd	287
		Indofood Sukses Makmur Tbk PT	287
		Far East Horizon Ltd	280
		Tisco Financial Group PCL, NVDR	277
		Postal Savings Bank of China Co Ltd, 144A	270
		NTPC Ltd	267
		Jardine Matheson Holdings Ltd	260
		Telkom Indonesia Persero Tbk PT	260
		China Communications Services Corp Ltd	259
		Orora Ltd	259
		Stella International Holdings Ltd	259
		Astra International Tbk PT	254

FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS
	(en miles) USD		(en miles) USD
Innox Advanced Materials Co Ltd	35	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	302
LG Chem Ltd	30	Samsung Electronics Co Ltd	255
Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	21	Tencent Holdings Ltd	238
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	17	HDFC Bank Limited	209
		AIA Group Limited	186
		LG Chem Ltd	170
		Alibaba Group Holding Limited	164
		United Overseas Bank Limited	156
		Singapore Telecommunications Ltd	153
		Ishares Core Msci Asia E-HKD	149
		Singapore Technologies Engineering Ltd	131
		Venture Corporation Limited	131
		Accton Technology Corporation	130
		ENN Energy Holdings Limited	117
		CSPC Pharmaceutical Group LTD	115
		Mintth Group Ltd	112
		Hansol Chemical Co Ltd	103
		Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	97
		Ping An Insurance Group	94
		Techtronic Industries Company Limited	89
		Guangdong Investment Limited	86
		LG Energy Solution Ltd	84
		Tongcheng Travel Holdings Ltd	79
		Telkom Indonesia Persero Tbk	76
		TravelSky Technology Limited	76
		Shenzhen International Group Holdings Limited	63
		LEENO Industrial Inc	60
		JD.com, Inc	57
		TATA Consultancy Services Limited	53
		Innox Advanced Materials Co Ltd	43

^ No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Estado de cambios importantes en la cartera – (continuación)

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

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS
	(en miles) USD		(en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	15.505	Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	14.932
Estee Lauder Cos., Inc. (The) 'A'	5.133	AIA Group Ltd	4.417
Mettler-Toledo International Inc	4.898	Kerry Group Plc	3.252
Adyen NV, 144A	4.849	NVIDIA Corp	2.678
Croda International Plc	2.371	ASML Holding NV	1.202
CSL Ltd	1.292	Microsoft Corp	1.144
Moncler SpA	766	Linde Plc	1.023
NVIDIA Corp	591	Moncler SpA	977
ASML Holding NV	496	L'Oreal SA	900
Microsoft Corp	461	Ferrari NV	897
Linde Plc	424	Atlas Copco AB	818
L'Oreal SA	382	ResMed Inc	783
Ferrari NV	363	Mastercard Inc	774
Atlas Copco AB	337	Kingspan Group Plc	729
ResMed Inc	337	Coloplast A/S	708
Mastercard Inc	322	ANSYS Inc	620
Coloplast A/S	312	Pernod Ricard SA	604
Kingspan Group Plc	294	Hexagon AB	593
ANSYS Inc	252	Adobe Inc	585
Pernod Ricard SA	260	Zoetis Inc	585
		CSL Ltd	581
		NIKE Inc	559
		Masimo Corp	545
		Assa Abloy AB	533
		Veeva Systems Inc 'A'	517
		Kering SA	502
		Autodesk Inc	468
		Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	454
		Croda International Plc	452
		Adyen NV, 144A	446

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS
	(en miles) USD		(en miles) USD
Link REIT	674	NHPC Ltd	774
Indus Towers Ltd	647	AGL Energy Ltd	648
Aurizon Holdings Ltd	539	Transurban Group	622
CLP Holdings Ltd	433	CLP Holdings Ltd	603
Guangdong Investment Ltd	388	CapitaLand Integrated Commercial Trust	577
Chorus Ltd	329	Contact Energy Ltd	497
Scentre Group	274	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd	402
Vicinity Ltd	246	Region RE Ltd	398
Charter Hall Retail REIT	203	China Tower Corp Ltd, 144A	319
Embassy Office Parks REIT	194	Power Grid Corp of India Ltd	318
AGL Energy Ltd	190	Chorus Ltd	239
Digital Telecommunications Infrastructure Fund	167	Charter Hall Retail REIT	214
NETLINK NBN TRUST	141	China Merchants Port Holdings Co Ltd	208
Manila Electric Co	121	Link REIT	204
Capitaland India Trust	109	Indus Towers Ltd	188
HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd	64	Guangdong Investment Ltd	184
Fortune Real Estate Investment Trust	51	Vicinity Ltd	183
Wharf Real Estate Investment Co Ltd	47	Scentre Group	182
APA Group	40	Aurizon Holdings Ltd	178
Westports Holdings Bhd	31	GPT Group/The	172
		Embassy Office Parks REIT	165
		Fortune Real Estate Investment Trust	143
		Digital Telecommunications Infrastructure Fund	112
		Westports Holdings Bhd	112
		Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	103
		Capitaland India Trust	98
		Mapletree Industrial Trust	95

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS
	(en miles) USD		(en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	2.694	Western Asset Liquidity Funds Plc- Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Class WA (Reparto)	2.453
HDFC Bank Ltd	528	ICICI Bank Ltd	465
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	303	Samsung Electronics Co Ltd	314
Capitec Bank Holdings Ltd	209	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	250
Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co	209	EPAM Systems Inc	212
Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	178	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	207
		SK Hynix Inc	179
		Tencent Holdings Ltd	157
		Globalwafers Co Ltd	95
		HDFC Bank Ltd	92
		Alibaba Group Holding Ltd ADR	86
		Jio Financial Services Ltd	82
		Reliance Industries Ltd	78
		Titan Co Ltd	77

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Estado de cambios importantes en la cartera – (continuación)

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^] — (continuación)

PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
AIA Group Ltd	65
Meituan 'B', 144A	60
WEG SA	59
Antofagasta Plc	54
Ping An Insurance Group Co of China Ltd	54
Grupo Financiero Banorte SAB de CV	51

FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) EUR	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) EUR
Adyen NV, 144A	6.153	Kerry Group Plc	5.337
BE Semiconductor Industries NV	4.205	Infineon Technologies AG	4.214
Croda International Plc	3.558	Ferrari NV	3.406
Sartorius Stedim Biotech	2.401	Allfunds Group Plc	3.283
Moncler SpA	2.007	Mettler-Toledo International Inc	2.543
ASML Holding NV	928	Dr. Martens Plc	1.295
L'Oreal SA	498	ASML Holding NV	734
Atlas Copco AB	470	Moncler SpA	580
Linde Plc	454	L'Oreal SA	435
Mettler-Toledo International Inc	438	Kering SA	406
Hexagon AB	421	Linde Plc	392
Dassault Systemes SE	415	Sartorius Stedim Biotech	376
Assa Abloy AB	407	Atlas-Copco AB	367
Kering SA	394	Kingspan Group	361
Nemetschek SE	368	Assa Abloy AB	350
Coloplast A/S	361	Dassault Systemes SE	334
Kingspan Group	347	Hexagon AB	330
Partners Group Holding AG	297	Coloplast A/S	328
Pernod Ricard SA	288	Nemetschek SE	324
Infineon Technologies AG	248	Pernod Ricard SA	288
		Partners Group Holding AG	268

FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^]

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) USD
Intuitive Surgical Inc	314	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	302
Xylem Inc/NY	305	Verra Mobility Corp 'A'	35
HDFC Bank Ltd ADR	294	Ecolab Inc	20
Valmont Industries Inc	265		
Ecolab Inc	251		
Novozymes A/S	248		
Croda International Plc	247		
Illumina Inc	246		
Revity Inc	244		
Veolia Environnement SA	238		
Amplifon SpA	236		
Airtel Africa Plc, 144A	222		
Masimo Corp	218		
Deere & Co	213		
Veeva Systems Inc 'A'	202		
MercadoLibre Inc	201		
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	148		
Vistry Group Plc	109		
Verra Mobility Corp 'A'	105		
Energy Recovery Inc	89		
Planet Fitness Inc 'A'	82		
MIPS AB	73		
Courseera Inc	63		
Everbridge Inc	59		
Stride Inc	51		

Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) EUR	PRINCIPALES VENTAS	PRODUCTOS (en miles) EUR
ING Groep NV, 4,875 %, vencimiento 14/11/2027	1.317	Werfen SA/Spain, 4,625 %, vencimiento 06/06/2028	1.290
Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,375 %, vencimiento 21/06/2028	1.313	International Business Machines Co, 0,300 %, vencimiento 11/02/2028	1.130
Thermo Fisher Scientific Inc, 0,500 %, vencimiento 01/03/2028	1.309	Banco Santander SA, 3,875 %, vencimiento al 16/01/2028	1.091
Schneider Electric SE, 1,500 %, vencimiento 15/01/2028	1.297	UBS Group AG, VAR, vencimiento 17/03/2028	999
Abertis Infraestructuras SA, 4,125 %, vencimiento 31/01/2028	1.296	Thames Water Utilities Finance PLC, 0,875 %, vencimiento 31/01/2028	924
Telenor ASA, 0,250 %, vencimiento 14/02/2028	1.295	Vonovia Finance BV, 1,500 %, vencimiento al 14/01/2028	768
BNP Paribas SA, 0,500 %, con vencimiento el 19/02/2028	1.294	Abanca Corp Bancaria SA, VAR, vencimiento 14/09/2028	689
UBS Group AG, 4,625 %, vencimiento 17/03/2028	1.293	UBS Group AG, VAR, con vencimiento el 14/01/2028	630
Werfen SA/Spain, 4,625 %, vencimiento 06/06/2028	1.290	Apple Inc, 2,000 %, vencimiento al 17/09/2027	477
Werfen SA/Spain, 4,625 %, vencimiento 06/06/2028	1.290	Eurobank SA, VAR, vencimiento 14/03/2028	425
Tele2 AB, 2,125 %, vencimiento 15/05/2028	1.286	NatWest Markets PLC, 1,375 %, vencimiento 02/03/2027	371
Teleperformance SE, 0,250 %, vencimiento 26/11/2027	1.284	Hemso Tesoro Oyj, 0,750 %, vencimiento al 14/12/2028	241
TenneT Holding BV, 1,375 %, vencimiento 05/06/2028	1.280	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,000 %, vencimiento al 04/05/2028	155
NTT Finance Corp, 0,399 %, vencimiento 13/12/2028	1.270		
Motability Operations Group Plc, 0,125 %, vencimiento 20/07/2028	1.264		
Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1,625 %, vencimiento 27/11/2027	1.255		

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Estado de cambios importantes en la cartera – (continuación)

Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] — (continuación)

	COSTE (en miles) EUR
PRINCIPALES COMPRAS	
H Lundbeck A/S, 0,875 %, vencimiento 14/10/2027	1.223
Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, vencimiento 27/01/2028	1.217
HSBC Holdings Plc, 4,752%, con vencimiento el 10/03/2028	1.202
TDF Infrastructure SASU, 5,625 %, vencimiento 21/07/2028	1.198
LKQ European Holdings BV, 4,125 %, vencimiento 01/04/2028	1.183
Credit Agricole SA, 0,375 %, vencimiento 20/04/2028	1.168
Verizon Communications Inc, 1,375 %, vencimiento 02/11/2028	1.073
UBS Group AG, VAR, vencimiento 17/03/2028	1.001
Crown European Holdings SA, 5,000 %, vencimiento 15/05/2028	1.000
Romanian Government International Bond, 2,125 %, vencimiento al 07/03/2028	947
Deutsche Lufthansa AG, 3,750 %, vencimiento 11/02/2028	919
Azelis Finance NV, 5,750 %, vencimiento 15/03/2028	908
Bank of Ireland Group Plc, 4,875%, vencimiento 16/07/2028	904
Cloverie Plc para Zurich Insurance Co Ltd, 1,500%, con vencimiento el 15/12/2028	881
Volvo Car AB, 4,250 %, vencimiento 31/05/2028	855
Svenska Handelsbanken AB, 3,750 %, vencimiento al 01/11/2027	798
DXC Capital Funding DAC, 0,450 %, vencimiento al 15/09/2027	793
National Grid Plc, 0,163 %, vencimiento al 20/01/2028	760
Macquarie Group Ltd, 0,350%, due 03/03/2028	744
PVH Corp, 3,125 %, vencimiento al 15/12/2027	727
OP Corporate Bank plc, 0,375 %, vencimiento al 16/06/2028	667
--BRF NV, 1,539%, vencimiento 03/08/2028	658
JPMorgan Chase & Co, 1,638 %, con vencimiento el 18/05/2028	634
Intesa Sanpaolo SpA, 1,750 %, vencimiento al 20/03/2028	629
Barclays Plc, 0,877%, vencimiento 28/01/2028	609
RCI Banque SA, 4,875 %, vencimiento al 21/09/2028	608
International Business Machines Co, 0,300 %, vencimiento 11/02/2028	606

[^] No está autorizado para la venta al público en Hong Kong.

Apéndice: Reglamento sobre operaciones de financiación de valores (SFTR)

En los cuadros siguientes se detalla el valor notional agregado bruto de los contratos de recompra inversa, así como el valor razonable absoluto como proporción del valor liquidativo de cada Fondo, analizado por contraparte, a 31 de agosto de 2023:

Contratos de recompra inversa

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

Contraparte	País de constitución	Valor notional agregado bruto (en miles) USD	Valor razonable absoluto (en miles) USD	% del valor liquidativo
Canadian Imperial Bank of Commerce	Canadá	50.000	50.000	5,39
HSBC Bank (USA)	Reino Unido	55.000	55.000	5,92
JP Morgan Securities LLC	Estados Unidos	80.000	80.000	8,61
Royal Bank of Canada	Canadá	50.000	50.000	5,38
TD Securities (USA) LLC	Canadá	12.520	12.520	1,35
		247.520	247.520	26,65

El siguiente cuadro enumera los diez mayores emisores de garantías en función del valor de las garantías no monetarias recibidas y la divisa de las garantías no monetarias recibidas a 31 de agosto de 2023:

Fondo	Emisor de garantías*	Moneda	Valor agregado de las garantías (en miles)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	Estados Unidos**	Dólar estadounidense	252.499\$

* Cuando hay menos de diez emisores de garantías a 31 de agosto de 2023, se han incluido todos los emisores.

** Los bonos y pagarés subyacentes mantenidos como garantía son emitidos por el Departamento del Tesoro de EE. UU.

El siguiente cuadro ofrece un análisis del tipo y la calidad de las garantías no monetarias recibidas a 31 de agosto de 2023:

Fondo	Tipo de garantía	Calidad de las garantías	Valor agregado de las garantías (en miles)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	Bonos y obligaciones del Estado	Investment Grade	252.499\$

El análisis del vencimiento que figura a continuación se ha basado en la fecha de vencimiento contractual de los contratos de recompra inversa y las garantías asociadas recibidas/aportadas a 31 de agosto de 2023:

Fondo	Tipo de derivado/garantía	de 1							Total (en miles)
		Menos de 1 día (en miles)	de 1 día a 1 semana (en miles)	de 1 semana a 1 mes (en miles)	de 1 mes a 3 meses (en miles)	de 3 meses a 1 año (en miles)	Más de 1 año (en miles)	Madurez abierta (en miles)	
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	Contratos de recompra inversa	-	247.520\$	-	-	-	-	-	247.520\$
	Garantías no monetarias recibidas	-	-	-	13.005\$	33.500\$	205.994\$	-	252.499\$

Los contratos de recompra inversa mantenidos en FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund son acuerdos tripartitos. Las garantías recibidas por el Fondo en relación con los contratos de recompra inversa abiertos a 31 de agosto de 2023 se mantienen en The Bank of New York Mellon, en cuentas separadas a nombre de la Sociedad. Las garantías recibidas no se reutilizan.

Todos los costes y rendimientos de los contratos de recompra inversa devengan íntegramente al Fondo.

[Esta página se ha dejado intencionadamente en blanco]

