FRANKLIN TEMPLETON

Informe Anual y Estados Financieros Auditados

Franklin Templeton Global Funds Plc

Un fondo de tipo paraguas con responsabilidad segregada entre sus subfondos

Para el ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024

Índice

Información general 3

Carta a los accionistas 16

Informe de los Consejeros 17

Informe de los Auditores Independientes 20

Informe del Depositario 22

Cartera de inversiones: FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund 23
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset US Core Bond Fund 25
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund 39
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund 59
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund 62
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset US High Yield Fund 67
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset Global High Yield Fund 72
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund 76
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund 78
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^ 82
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset Global Credit Fund^ 88
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ 92
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ 99
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^ 109
Cartera de inversiones: FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^ 114
Cartera de inversiones: Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund^ 126
Cartera de inversiones: FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund 131
Cartera de inversiones: FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ 135
Cartera de inversiones: FTGF Brandywine Global High Yield Fund^ 138
Cartera de inversiones: FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund 141
Cartera de inversiones: FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund 144
Cartera de inversiones: FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^ 148
Cartera de inversiones: FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ 150
Cartera de inversiones: FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ 152
Cartera de inversiones: FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^ 154
Cartera de inversiones: FTGF ClearBridge Value Fund 155
Cartera de inversiones: FTGF ClearBridge US Appreciation Fund 157
Cartera de inversiones: FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund 158
Cartera de inversiones: FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund 159
Cartera de inversiones: FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund 161
Cartera de inversiones: FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund 163
Cartera de inversiones: FTGF ClearBridge Global Growth Fund^ 165
Cartera de inversiones: Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund^ 166
Cartera de inversiones: FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund 168
Cartera de inversiones: FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^ 170
Cartera de inversiones: FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund 171
Cartera de inversiones: Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund 174
Cartera de inversiones: FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^ 176
Cartera de inversiones: Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^ 177
Cartera de inversiones: Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^ 178
Cartera de inversiones: Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^ 179
Cartera de inversiones: FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^ 180
Cartera de inversiones: FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund 181
Cartera de inversiones: FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^ 182
Cartera de inversiones: FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^ 183
Cartera de inversiones: FTGF Martin Currie Improving Society Fund^ 184
Cartera de inversiones: Franklin Responsible Income 2028 Fund^ 185

Estado de situación financiera – Franklin Templeton Global Funds Plc 188
Estado de ingresos globales – Franklin Templeton Global Funds Plc 208
Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable– Franklin Templeton Global Funds Plc 218

Notas relativas a los estados financieros – Franklin Templeton Global Funds Plc 247

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

Índice *(continuación)*

Información complementaria – Ratios de gastos totales (TER) (sin auditar) – Franklin Templeton Global Funds Plc 316
Información complementaria – Datos de rentabilidad de los fondos (no auditados) – Franklin Templeton Global Funds Plc 323

Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund 337
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Western Asset US Core Bond Fund 337
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund 337
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund 338
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund 338
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Western Asset US High Yield Fund 339
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Western Asset Global High Yield Fund 339
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund 340
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund 340
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^ 340
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Western Asset Global Credit Fund^ 341
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ 341
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ 342
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^ 342
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^ 342
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^ 343
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^ 343
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund^ 343
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^ 344
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund 344
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ 345
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Brandywine Global High Yield Fund^ 345
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund 346
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund 346
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^ 346
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^ 347
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ 348
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ 348
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^ 348
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ 349
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF ClearBridge Value Fund 349
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF ClearBridge US Appreciation Fund 350
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund 350
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund 351
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund 351
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund 352
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF ClearBridge Global Growth Fund^ 352
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ 353
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund 353
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^ 354
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund 354
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Royce US Smaller Companies Fund 354
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^ 355
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^ 355
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^ 356
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^ 356
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund 357
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^ 357
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^ 357
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – FTGF Martin Currie Improving Society Fund^ 358
Estado de cambios importantes en la cartera (sin auditar) – Franklin Responsible Income 2028 Fund^ 358

Política de remuneración del OICVM V (no auditada) 359

Apéndice: Reglamento sobre operaciones de financiación de valores (SFTR) (sin auditar) 360

Apéndice: Divulgación de personas vinculadas (sin auditar) 361

Apéndice: Reglamento sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad (no auditado) 362

^ 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)
Elinor Murray (Reino Unido)[3]
Jaspal Sagger (Reino Unido)
Jane Trust (Estados Unidos)[4]
Craig Tyle (Estados Unidos)[2]

[1] dimitió el 17 de julio de 2023.
[2] nombrado el 27 de julio de 2023.
[3] nombrada el 3 de noviembre de 2023.
[4] dimitió el 21 de febrero de 2024.

Domicilio social

Riverside Two
Sir John Rogerson's Quay
Grand Canal Dock
Dublín 2, D02 KV60
Irlanda

Secretaría

Bradwell Limited (hasta el 1 de abril de 2024)
Ten Earlsfort Terrace
Dublín 2, D02 T380
Irlanda

OGS Corporate Governance Limited (desde el 1 de abril de 2024)
30 Molesworth Street
Dublín 2, D02 AY19
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
Dublín 2, D02 T380
Irlanda

Depositario

The Bank of New York Mellon SA/NV, sucursal de Dublín
Riverside Two
Sir John Rogerson's Quay
Grand Canal Dock
Dublín 2, D02 KV60
Irlanda

Auditores independientes

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

Administrador

BNY Mellon Fund Services (Ireland)
Designated Activity Company
One Dockland Central
Guild Street, IFSC,
Dublín 1, D01 E4X0
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[µ]	27 de febrero de 2004	**Gestor de inversiones:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido **Subgestor de inversiones:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.
FTGF Western Asset US Core Bond Fund*	30 de agosto de 2002	**Gestor de inversiones:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido **Subgestor de inversiones:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund*	20 de abril de 2007	**Gestor de inversiones:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido **Subgestores de inversiones:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU. Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japón
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund*	1 de octubre de 2003	**Gestor de inversiones:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido **Subgestor de inversiones:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund^*[þ]	24 de febrero de 2004 (cesó sus operaciones el 16 de febrero de 2023)	**Gestor de inversiones:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido **Subgestor de inversiones:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund*	29 de agosto de 2002	**Gestor de inversiones:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido **Subgestores de inversiones:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU. Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145

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

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

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

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

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	**Gestor de inversiones:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido **Subgestor de inversiones:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^*	13 de enero de 2016	**Gestor de inversiones:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido **Subgestor de inversiones:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^*þ	17 de noviembre de 2016 (cesó sus operaciones el 23 de octubre de 2023)	**Gestor de inversiones:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido **Subgestores de inversiones:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU. Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^*þ	17 de noviembre de 2016 (cesó sus operaciones el 10 de noviembre de 2023)	**Gestor de inversiones:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido **Subgestor de inversiones:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.
FTGF Western Asset Infrastructure Debt Fund†*^		**Gestor de inversiones:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido **Subgestores de inversiones:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU. Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japón Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145 Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Pres. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo – Brasil

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†*^		**Gestor de inversiones:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido **Subgestor de inversiones:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.
FTGF Western Asset Asian Income Fund*†^		**Gestor de inversiones:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido **Subgestores de inversiones:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU. Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^*	11 de enero de 2021	**Gestor de inversiones:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido **Subgestor de inversiones:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU.
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^*þ	10 de enero de 2022 (cesó sus operaciones el 5 de diciembre de 2023)	**Gestor de inversiones:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido **Subgestores de inversiones:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU. Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145 Western Asset Management Company Pty Limited Level 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australia
FTGF Western Asset China Bond Fund†*^		**Gestor de inversiones:** Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street Londres EC2A 2EN Reino Unido **Subgestores de inversiones:** Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 EE. UU. Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur 049145

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^*þ	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*^þ	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*^þ	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 (cesará sus operaciones el 17 de julio de 2024)	**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 – US Fixed Income Fund*^	6 de noviembre 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 Dynamic US Equity Fund^ᵖ**	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.
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^ᵖ**	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^ᵖ**	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 Sídney NSW 2000 Australia
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^ᵖ**	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 Sídney NSW 2000 Australia

Información general *(continuación)*

Denominación del Fondo	Fecha de lanzamiento de los Fondos	Gestor/Subgestor(es) de inversiones
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund**	30 de abril de 2021	**Gestor de inversiones:** ClearBridge Investments (Norteamérica) Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sídney NSW 2000 Australia
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^ᵖ**	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^ᵖ**	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^ᵖ**	20 de abril de 2007 (cesó sus operaciones el 25 de febrero de 2015)	
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^ᵖ**	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^ᵖ**	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^†**		**Gestor de inversiones:** Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 EE. UU.
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^ᵖ**	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^ᵖ**	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

Información general *(continuación)*

Denominación del Fondo	Fecha de lanzamiento de los Fondos	Gestor/Subgestor(es) de inversiones
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^þ**	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^þ**	11 de marzo de 2016 (cesó sus operaciones el 31 de julio de 2017)	
Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^þ**	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^**	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^**	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†^**		**Gestor de inversiones:** Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edimburgo EH1 2ES Escocia
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^**	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^**	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*†^**		**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 Sídney NSW 2000 Australia
Legg Mason US Equity Fund^þ**	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^þ**	2 de octubre de 2008 (cesó sus operaciones el 30 de noviembre de 2010)	
Franklin Responsible Income 2028 Fund*^	23 de enero de 2023	**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 Income 2029 Fund*†^ (anteriormente Franklin Responsible Series 2 Fund, nombrado de nuevo el 21 de febrero de 2024)	27 de marzo de 2024	**Gestor de inversiones:** Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street Londres EC4N 6HL Reino Unido
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 ejercicio 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).*
þ Revocación pendiente de la autorización del Banco Central.
ϕ A petición de la Sociedad, las autorizaciones fueron revocadas por el Banco Central el 30 de abril de 2024.

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 anual de Franklin Templeton Global Funds Plc (la "Sociedad") para el periodo de 12 meses finalizado el 29 de febrero de 2024. 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

A pesar de la persistente inflación y los diversos conflictos geopolíticos, la economía global se mantuvo resiliente durante el período que abarca el informe. En la actualización de las *Perspectivas de la economía mundial* de enero de 2024, el Fondo Monetario Internacional (FMI) preveía que el crecimiento del producto interior bruto (PIB) mundial se mantendría en el 3,1 % en 2024, sin cambios con respecto al 2023. Según el FMI, "…gracias a la desinflación y el crecimiento constante ha disminuido la probabilidad de un aterrizaje forzoso, y los riesgos para el crecimiento mundial se han equilibrado de manera generalizada". Desde una perspectiva regional, el FMI prevé que para el 2024 el crecimiento del PIB en EE. UU. será del 2,1 % (frente al 2,5 % en 2023); del 0,9 % en la Eurozona (frente al 0,5 % en 2023); del 0,6 % en el Reino Unido (frente al 0,5 % en 2023) y del 0,9 % en Japón (frente al 1,9 % en 2023).

Análisis del mercado: renta fija[i]

El mercado de renta fija mundial en su conjunto ha atravesado periodos de volatilidad, pero ha ido aumentando durante el periodo que abarca el informe. En Estados Unidos, la Junta de la Reserva Federal (Fed) en un primer momento aumentó los tipos de interés dada la persistente inflación. En julio de 2023, la Fed aumentó los tipos hasta 5,25 %-5,50 %, su máximo en 22 años. A partir de ese momento, el Banco Central dejó de aumentar los tipos durante sus siguientes tres reuniones y, en diciembre de 2023, experimentó una "reorientación", al indicar el probable final de las subidas de tipos y sugerir tres recortes de tipos en 2024. Sin embargo, en su reunión de enero de 2024, la Fed volvió a mantener los tipos y anunció que mantendría la cautela en lo que se refería a recortes de tipos. En resumen, los bonos corporativos[iii] con grado de inversión[ii] 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 registraron resultados aún más positivos durante el periodo que abarca el informe.

Análisis del mercado: renta variable global[iv]

El mercado de renta variable a nivel mundial generó una fuerte rentabilidad durante el período que abarca el informe. La opinión de los inversores se vio respaldada por el crecimiento continuo a nivel mundial, la mejora generalizada de las ganancias corporativas, que a menudo fueron superiores a las esperadas, así como por el giro de la Fed. Estos factores compensan a otros tantos, como los diversos conflictos de carácter geopolítico. Para el periodo de 12 meses finalizado el 29 de febrero de 2024, el Índice S&P 500 arrojó un 30,45 %. Fuera de EE. UU., la renta variable internacional desarrollada, medida por el Índice MSCI EAFE (neto), ganó un 14,41 %, mientras que la renta variable de los mercados emergentes, medida por el Índice MSCI Emerging Markets (neto), arrojó un 8,73 %.

Le agradecemos su continuo apoyo.

Atentamente,

Franklin Templeton International Services S.à r.l

Marzo de 2024

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 29 de febrero de 2024 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.

[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.

[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.

Informe de los Consejeros

Los consejeros de la Sociedad (los "Consejeros") presentan su informe anual junto con los estados financieros auditados del ejercicio financiero que finalizó el 29 de febrero de 2024.

Declaración de responsabilidades de los Consejeros

Los Consejeros son responsables de preparar el informe de los consejeros y los estados financieros de conformidad con la ley irlandesa.

El Derecho de sociedades irlandés requiere que los Consejeros elaboren unos estados financieros para cada ejercicio que proporcionen una imagen fiel de los activos, pasivos y la situación financiera de la Sociedad a la fecha de cierre del ejercicio fiscal y de las ganancias o pérdidas de esta durante ese ejercicio. Los Consejeros han elaborado los estados financieros de acuerdo con las normas contables generalmente aceptadas en Irlanda, incluida la Norma de Información Financiera ("NIF") 102: "La norma de información financiera aplicable en el Reino Unido y la República de Irlanda" ("NIF 102").

De conformidad con el Derecho de sociedades irlandés, los Consejeros no aprobarán los estados financieros a menos que estén seguros de proporcionar una imagen fiel de los activos, pasivos y la situación financiera de la Sociedad a la fecha de cierre del ejercicio fiscal y de las ganancias o pérdidas de esta durante dicho ejercicio.

En la preparación de estos estados financieros, se requiere de los Consejeros que:

- seleccionen unas políticas contables adecuadas y que las apliquen de forma coherente;
- realicen juicios y estimaciones que sean razonables y prudentes;
- establezcan si los estados financieros se han preparado de conformidad con las normas contables aplicables e identifiquen las normas en cuestión, siempre que se indiquen y expliquen en las notas a los estados financieros las desviaciones significativas respecto a dichas normas; y
- elaboren los estados financieros según el principio de empresa en funcionamiento, a menos que resulte inadecuado suponer que la Sociedad seguirá operando.

Los Consejeros son responsables de asegurar que se lleven los registros contables adecuados suficientes para:

- registrar y explicar correctamente las transacciones de la Sociedad;
- permitir que se especifiquen en cualquier momento y con una precisión razonable los activos, pasivos, situación financiera y pérdidas y ganancias de la Sociedad; y
- permitir a los Consejeros asegurar que los estados financieros cumplen con los requisitos de la Ley de Sociedades de 2014 y permitir que estos estados financieros se auditen.

Para conseguir este objetivo, los Consejeros han nombrado a un administrador experto, BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company para mantener los registros contables y realizar tareas administrativas adicionales.

Los Consejeros también son responsables de proteger los activos de la Sociedad. En cumplimiento de esta responsabilidad, han nombrado a The Bank of New York Mellon SA/NV, sucursal de Dublín, para proteger los activos de la Sociedad de conformidad con el acta de constitución de la Sociedad. Además, los Consejeros son responsables de tomar las medidas razonables para la prevención y la detección de fraudes y otras irregularidades.

El mantenimiento y la integridad de los estados financieros de la Sociedad incluidos en la página web de las filiales de Franklin Templeton que distribuyen los Fondos es responsabilidad de los Consejeros. La legislación irlandesa que rige la preparación y la difusión de los estados financieros puede diferir de la legislación de otras jurisdicciones.

Análisis del negocio y los acontecimientos futuros

La Carta a los Accionistas de la página 16 contiene un análisis de los factores que contribuyeron a los resultados de los Fondos correspondientes al ejercicio. Los Consejeros no prevén ningún cambio en los objetivos de inversión de los Fondos existentes.

Para conocer los detalles del rendimiento por clases de acciones de cada uno de los Fondos activos, consulte "Información complementaria: datos de rendimiento del Fondo (sin auditar)".

En las Carteras de Inversiones de los Fondos se presentan los activos y pasivos financieros mantenidos a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias al cierre del ejercicio.

A 29 de febrero de 2024, la Sociedad tenía 44 Fondos activos (en 2023: 48 Fondos). Los detalles de los valores de su patrimonio neto a 29 de febrero de 2024 figuran en el Estado de la situación financiera, en las páginas 188 a 207.

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

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

A partir del 20 de junio de 2023, comenzó a operar FTGF Martin Currie Improving Society Fund^.

A partir del 17 de julio de 2023, dejó de operar FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^.

A partir del 22 de septiembre de 2023, comenzó a operar FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^.

A partir del 23 de octubre de 2023, dejó de operar FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^.

A partir del 6 de noviembre de 2023, comenzó a operar FTGF Brandywine Global - US Fixed Income Fund^.

A partir del 10 de noviembre de 2023, dejó de operar FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^.

A partir del 5 de diciembre de 2023, dejó de operar FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^.

Objetivos y políticas de gestión de riesgos

La información relativa a determinados objetivos y políticas de gestión del riesgo de la Sociedad está incluida en la Nota 12 a los estados financieros.

Resultados del ejercicio y situación a 29 de febrero de 2024

El Estado de la situación financiera a 29 de febrero de 2024 y a 28 de febrero de 2023 y el Estado de resultado global del ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024 y para el finalizado el 28 de febrero de 2023 se encuentran en las páginas 188 a 207 y 208 a 216, respectivamente.

Distribuciones a los tenedores de participaciones reembolsables

Las distribuciones a los accionistas con participación reembolsable correspondientes a los ejercicios fiscales finalizados el 29 de febrero de 2024 y el 28 de febrero de 2023 se recogen en el Estado de resultado global.

Hechos relevantes

Consulte en la Nota 14 los detalles de los hechos relevantes durante el ejercicio.

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

Informe de los consejeros *(continuación)*

Hechos posteriores

Consulte en la Nota 16 los detalles de los hechos relevantes posteriores al ejercicio.

Consejeros

Los nombres de las personas que son actualmente Consejeros o que desempeñaron este cargo en cualquier momento del ejercicio fiscal se muestran a continuación.

Joseph Carrier (Estados Unidos)
Fionnuala Doris (Irlanda) (Independiente)
William Jackson (Reino Unido)[1]
Joseph Keane (Irlanda) (Independiente)
Joseph LaRocque (Estados Unidos)
Elinor Murray (Reino Unido)[3]
Jaspal Sagger (Reino Unido)
Jane Trust (Estados Unidos)[4]
Craig Tyle (Estados Unidos)[2]

[1] dimitió el 17 de julio de 2023.
[2] nombrado el 27 de julio de 2023.
[3] nombrada el 3 de noviembre de 2023.
[4] dimitió el 21 de febrero de 2024.

Intereses de los Consejeros y del secretario

A 29 de febrero de 2024 y a 28 de febrero de 2023, los Consejeros, el secretario y sus familiares no poseían intereses en las acciones de la Sociedad. Ningún Consejero ha tenido en ningún momento del ejercicio fiscal un interés significativo en ningún contrato relevante, que subsista durante o al final del ejercicio fiscal, relacionado con la actividad de la Sociedad.

Declaración sobre el gobierno corporativo

El Consejo de Administración de la Sociedad (el "Consejo") ha evaluado las medidas incluidas en el Código de Gobierno Corporativo para Organismos de Inversión Colectiva y Sociedades de Gestión, un código voluntario publicado por los Fondos de Irlanda en diciembre de 2011 (el "Código de Fondos de Irlanda"). El Consejo ha adoptado todas las prácticas y procedimientos de gobierno corporativo del Código de Fondos de Irlanda.

Declaración de cumplimiento de los Consejeros

Es política de la Sociedad cumplir con sus obligaciones correspondientes (tal como se definen en la Ley de Sociedades de 2014). De conformidad con el artículo 225(2) de la Ley de Sociedades de 2014, los Consejeros reconocen ser responsables de garantizar el cumplimiento por parte de la Sociedad de las obligaciones correspondientes. Los Consejeros han elaborado una declaración de política de cumplimiento, según se define en el artículo 225(3)(a) de la Ley de Sociedades de 2014, y una política de cumplimiento que hace referencia a los acuerdos y estructuras existentes y que, en opinión de los Consejeros, están diseñadas para asegurar el cumplimiento material de las obligaciones correspondientes de la Sociedad. En el cumplimiento de sus responsabilidades de acuerdo con el artículo 225, los Consejeros han recurrido, entre otros, a los servicios prestados, el asesoramiento y/o las representaciones de terceros que, a juicio de los Consejeros, cuentan con el conocimiento y la experiencia necesarios para asegurar el cumplimiento material de las obligaciones correspondientes de la Sociedad.

Información relevante de auditoría

En lo que a los Consejeros se refiere, no existe información relevante de auditoría de la que no tengan conocimiento los auditores de la Sociedad y han adoptado todas las medidas necesarias para asegurar que tanto ellos como los auditores de la Sociedad tengan conocimiento de la misma.

Operaciones con partes vinculadas

El Reglamento 43(1) de la Ley del Banco Central (Supervisión y Ejecución) de 2013 (Artículo 48[1]) (Organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios) del Reglamento de 2019 (el "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 fiscal cumplieron con las obligaciones que se estipulan en el Reglamento 43(1).

Auditores independientes

PricewaterhouseCoopers ha manifestado su voluntad de permanecer en el cargo de acuerdo con el artículo 383(2) de la Ley de Sociedades de 2014.

Objetivo y políticas de inversión

Todos los Fondos activos excepto FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^, FTGF Western Asset Global Credit 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^, Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^, FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^, FTGF Brandywine Global High Yield Fund^, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^, FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^, FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^, FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^, FTGF ClearBridge Global Growth Fund^, FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^, FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^, FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^, FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^, FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^, FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^, FTGF Martin Currie Improving Society Fund^ y Franklin Responsible Income 2028 Fund^, han sido autorizados por la Comisión de Valores y Futuros en Hong-Kong. Por lo tanto, la venta al público de los Fondos mencionados anteriormente no está autorizada en Hong Kong. La autorización de la Comisión de Valores y Futuros de Hong Kong no implica una recomendación de inversión en los Fondos.

El principal objetivo de inversión y las políticas de todos los Fondos se establecen en el suplemento al Folleto del Fondo correspondiente. No puede garantizarse que un Fondo vaya a alcanzar su objetivo de inversión y no existe garantía de que una estrategia de inversión logrará alcanzar resultados o niveles de rentabilidad determinados (los términos definidos corresponden a su definición en el folleto (el "Folleto") para el Fondo correspondiente).

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

Informe de los consejeros *(continuación)*

Informes periódicos únicamente para los productos de los artículos 8 y 9 del SFDR

Transparencia de la promoción de las características ambientales y sociales y las inversiones sostenibles en informes periódicos

El Reglamento (UE) 2019/2088 sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (SFDR) exige que la Sociedad incluya una descripción en sus informes periódicos de la medida en que cualquier Fondo clasificado en virtud del artículo 8 del SFDR (un "Fondo del artículo 8") y el artículo 9 del SFDR (un "Fondo del artículo 9") ha cumplido con sus características ambientales o sociales. Además, el SFDR facultó a la Autoridad Bancaria Europea, la Autoridad Europea de Seguros y Pensiones de Jubilación y la Autoridad Europea de Valores y Mercados (denominadas conjuntamente "AES") a elaborar proyectos de normas técnicas de regulación ("RTS") para especificar el formato de presentación e información en los informes periódicos. Las siguientes divulgaciones se han preparado utilizando el conjunto común de divulgaciones de sostenibilidad o requisitos de presentación de informes de la RTS, que entró en vigor el 1 de enero de 2023.

Puede encontrar más información en el Anexo de este informe anual "Reglamento de divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el ámbito financiero (sin auditar)".

Taxonomía

Transparencia de las inversiones ambientalmente sostenibles en los informes periódicos

No obstante, de acuerdo con su metodología ASG, un Fondo del artículo 8 puede mantener inversiones que contribuyen a la mitigación del cambio climático y a la adaptación al mismo. Sin embargo, debido a la falta de datos fiables, oportunos y verificables, actualmente no es posible determinar cómo ni en qué medida las actividades de las inversiones subyacentes se centran en actividades económicas que se clasifican como sostenibles desde el punto de vista ambiental en virtud del Reglamento (UE) 2020/852 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 18 de junio de 2020, sobre el establecimiento de un marco para facilitar la inversión sostenible y por el que se modifica el Reglamento (UE) 2019/2088, en su forma (el "Reglamento sobre la taxonomía"), por lo que no es posible comprometerse con una proporción mínima de las inversiones subyacentes de un Fondo del Artículo 8 que tengan en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas ambientalmente sostenibles, incluidas las actividades de apoyo o de transición, en el sentido del Reglamento sobre la taxonomía.

Las inversiones subyacentes en las que se basan los Fondos en el ámbito de los presentes informes periódicos "RTS" no tienen o no tuvieron en cuenta (hasta la fecha en que dejaron de operar) los criterios de la UE en materia de actividades económicas sostenibles desde el punto de vista medioambiental, incluidas las actividades de apoyo o de transición, en el sentido del Reglamento (UE) 2020/852 (el "Reglamento sobre la taxonomía") en este momento; por lo tanto, es posible que no haya inversiones cuyas actividades económicas se clasifiquen como actividades económicas ambientalmente sostenibles en virtud del Reglamento sobre la taxonomía (véase la sección que aparece a continuación dedicada a la taxonomía de la UE de los informes periódicos de RTS). No obstante, de acuerdo con su metodología de inversión de ASG, un Fondo del artículo 8 puede mantener inversiones que contribuyen a la mitigación del cambio climático y a la adaptación al mismo. Los inversores deben tener en cuenta que el principio de "no causar un perjuicio significativo" estipulado en el Reglamento sobre la taxonomía se aplica únicamente a aquellas inversiones subyacentes al Fondo del artículo 8 que tienen en cuenta los criterios de la UE aplicables a las actividades económicas sostenibles desde el punto de vista medioambiental, en el sentido del Reglamento sobre la taxonomía. Las inversiones subyacentes a la parte restante de un Fondo del artículo 8 no tienen en cuenta los criterios de la UE aplicables a las actividades económicas sostenibles desde el punto de vista medioambiental según el Reglamento sobre la taxonomía. La declaración anterior se aplica o aplicaba (hasta la fecha en que el Fondo en cuestión dejó de operar) en relación con los siguientes Fondos del artículo 8: FTGF Western Asset US Core Bond Fund, FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund, FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund, FTGF Western Asset US High Yield Fund, FTGF Western Asset Global High Yield Fund, FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund, FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^, FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^, FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^, FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^, FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund, FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^, FTGF ClearBridge Value Fund, FTGF ClearBridge US Appreciation Fund, FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund, FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund, FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^, FTGF ClearBridge Global Growth Fund^, FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^, FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers 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 Franklin Responsible Income 2028^.

El FTGF Martin Currie Improving Society Fund^ es un fondo sostenible de conformidad con lo establecido en el artículo 9 del SFDR.

Las inversiones subyacentes a los Fondos restantes que no figuran en la lista anterior no tienen o no tuvieron en cuenta (hasta la fecha en que dejaron de operar) los criterios de la UE en materia de actividades económicas sostenibles desde el punto de vista medioambiental.

En nombre del Consejo de Administración

Fionnuala Doris
Consejera

Joseph Keane
Consejero

13 de junio de 2024

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

La versión española del informe de auditoría es la traducción, a efectos informativos, del informe original redactado en lengua inglesa. En caso de que la versión en inglés de este informe y cualquier traducción del mismo a otro idioma distinto del inglés difieran, prevalecerá la versión en inglés.

Informe de los Auditores Independientes

Informe de los auditores independientes a los miembros de Franklin Templeton Global Funds Plc

Informe sobre la auditoría de los estados financieros

Opinión

En nuestra opinión, los estados financieros de Franklin Templeton Global Funds Plc:

- expresan una imagen veraz y equitativa de los activos, pasivos y la situación financiera de la Sociedad y de los subfondos a 29 de febrero de 2024 y de sus resultados para el ejercicio finalizado en esta fecha;
- han sido elaborados debidamente de conformidad con la práctica contable generalmente aceptada en Irlanda (normas de contabilidad emitidas por el Consejo de Información Financiera del Reino Unido, incluida la Norma de información financiera 102, "la norma de información financiera para el Reino Unido y la República de Irlanda" y la legislación irlandesa); y
- se han elaborado adecuadamente de acuerdo con la Ley de Sociedades de 2014 y el Reglamento de las Comunidades Europeas de 2011 (organismos de inversión colectiva en valores mobiliarios) (con sus modificaciones).

Hemos auditado los estados financieros, incluidos en el informe anual y los estados financieros auditados, que comprenden:

- el estado de la situación financiera a 29 de febrero de 2024;
- el estado de resultado global del ejercicio finalizado en esa fecha;
- el estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los accionistas con participación reembolsable para el ejercicio finalizado en esa fecha;
- la cartera de inversiones de cada uno de los subfondos a 29 de febrero de 2024; y
- las notas a los estados financieros de la Sociedad y los subfondos, que incluyen una descripción de las políticas contables.

Fundamento de la opinión

Nuestra auditoría ha sido efectuada según las Normas Internacionales de Auditoria (Irlanda) ("NIA [Irlanda]") y la ley aplicable.

Nuestras responsabilidades en virtud de las NIA (Irlanda) se describen con más detalle en las responsabilidades de los auditores en la auditoría de la sección de los estados financieros del informe. Creemos que hemos obtenido pruebas de auditoría suficientes y apropiadas para fundamentar nuestra opinión.

Independencia

Nos mantuvimos independientes de la sociedad de acuerdo con los requisitos éticos relevantes para nuestra auditoría de los estados financieros en Irlanda, que incluye el Estándar Ético de IAASA, y hemos cumplido con nuestras otras responsabilidades éticas de acuerdo con estos requisitos.

Énfasis en la cuestión: estados financieros preparados sobre una base distinta al principio de empresa en funcionamiento

Al expresar nuestra opinión sobre los estados financieros, que no se ha modificado, llamamos la atención sobre la nota 2 a los estados financieros que describe las razones por las que los estados financieros de 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 Defensive High Yield Fund, FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^, FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund, FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund y FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund se han elaborado sobre una base distinta a la de empresa en funcionamiento.

Conclusiones relacionadas con el principio de empresa en funcionamiento

Con la excepción de 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 Defensive High Yield Fund, FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^, FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund, FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund, and FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund en los que se ha adoptado una base contable distinta a la de empresa en funcionamiento, tal y como se expone en el apartado "Énfasis en la cuestión: estados financieros elaborados sobre una base distinta al principio de empresa en funcionamiento", sobre la base del trabajo que hemos realizado, no hemos identificado ninguna incertidumbre importante relacionada con hechos o condiciones que, individual o colectivamente, puedan arrojar dudas significativas sobre la capacidad de la Sociedad y los subfondos para continuar como empresa en funcionamiento durante un periodo de al menos 12 meses a partir de la fecha en que se autorice la publicación de los estados financieros.

Con la excepción de FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund, FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^, FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund, FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund, FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^, FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund, FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund y FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund, en los que se ha adoptado una base contable distinta a la de empresa en funcionamiento, tal y como se expone en el apartado "Énfasis de la cuestión: estados financieros elaborados sobre una base distinta de la empresa en funcionamiento" anterior, al auditar los estados financieros, hemos llegado a la conclusión de que es apropiado el uso por parte de los consejeros de la base contable de la empresa en funcionamiento en la elaboración de los estados financieros.

Sin embargo, debido a que no se pueden predecir todos los eventos o condiciones futuros, esta conclusión no es una garantía de la capacidad de la Sociedad y de los subfondos de seguir como empresa en funcionamiento.

Nuestras responsabilidades y las responsabilidades de los consejeros con respecto a la empresa en funcionamiento se describen en las secciones pertinentes de este informe.

Informe sobre otra información

La otra información comprende toda la información del Informe anual y los Estados financieros auditados diferente a los estados financieros y al informe de auditoría de los mismos. Los consejeros son responsables de la otra información. Nuestra opinión sobre los estados financieros no incluye la otra información y, por consiguiente, no expresamos una opinión de auditoría ni ninguna declaración al respecto, a menos que se diga explícitamente lo contrario en este informe. En relación con nuestra auditoría de los estados financieros, es nuestra responsabilidad leer la otra información y, al hacerlo, considerar si la otra información es materialmente inconsistente con los estados financieros o con nuestro conocimiento obtenido en la auditoría, o si parece contener declaraciones erróneas. Si identificamos una aparente incoherencia relevante o inexactitudes importantes, estamos obligados a aplicar procedimientos para concluir si hay una declaración errónea de los estados financieros o de la otra información. Si, con base en el trabajo que hemos realizado, concluimos que hay una declaración errónea de esta otra información, estamos obligados a informar sobre este hecho. No tenemos nada que informar con base en estas responsabilidades.

En relación con el Informe de los Consejeros, también se ha considerado si se ha incluido toda la información exigida por la Ley de Sociedades de 2014.

Informe de los auditores independientes *(continuación)*

Sobre la base de las responsabilidades descritas anteriormente y del trabajo realizado en el curso de la auditoría, las NIA (Irlanda) y la Ley de sociedades de 2014 exigen que comuniquemos determinadas opiniones y asuntos como se describe a continuación:

- En nuestra opinión, basada en el trabajo realizado durante la auditoría, la información contenida en el Informe de los Consejeros correspondiente al ejercicio finalizado a 29 de febrero de 2024 es coherente con los estados financieros y se ha elaborado de acuerdo con los requisitos legales aplicables.
- Basándonos en nuestro conocimiento y comprensión de la Sociedad y su entorno obtenidos en el transcurso de la auditoría, no hemos identificado inexactitudes significativas en el informe de los consejeros.

Responsabilidades en relación con los estados financieros y la auditoría

Responsabilidades de los consejeros en relación con los estados financieros

Según se explica más detalladamente en la Declaración de responsabilidades de los consejeros que figura en la página 17, los consejeros son responsables de preparar los estados financieros de conformidad con el marco legal aplicable y de asegurar que expresen una imagen veraz y equitativa.

Los consejeros también son responsables del control interno que ellos determinen necesario para posibilitar que la preparación de los estados financieros esté libre de declaraciones erróneas materiales, ya sea por fraude o por error.

En la preparación de los estados financieros, los consejeros son responsables de evaluar la capacidad de la Sociedad y de los subfondos de continuar como empresa en funcionamiento, revelando, según corresponda, los asuntos relacionados con la empresa en funcionamiento y siguiendo la base contable de empresa en funcionamiento; a menos que los consejeros tengan la intención de liquidar la Sociedad o cesar sus operaciones, o no tengan otra alternativa realista más que hacerlo.

Responsabilidades de los auditores en relación con la auditoría de los estados financieros

Nuestros objetivos son obtener garantías razonables sobre si los estados financieros en conjunto están libres de cualquier declaración errónea material, ya sea por fraude o por error, y emitir un informe de los auditores que incluya nuestra opinión. Una garantía razonable es un alto nivel de garantía, pero no garantiza que una auditoría realizada de conformidad con las NIA (Irlanda) detecte siempre una inexactitud significativa cuando la haya. Las declaraciones erróneas pueden proceder de fraude o de error, y se consideran materiales si, individualmente o en conjunto, pudieran influir razonablemente en las decisiones económicas de los usuarios tomadas basándose en estos estados financieros.

Nuestras pruebas de auditoría podrían incluir la comprobación de poblaciones completas de determinadas transacciones y saldos, posiblemente utilizando técnicas de auditoría de datos. Sin embargo, suele implicar la selección de un número limitado de elementos para las pruebas, en lugar de probar poblaciones completas. A menudo tratamos de seleccionar determinados elementos para su comprobación en función de su tamaño o de sus características de riesgo. En otros casos, utilizaremos el muestreo de auditoría para poder sacar una conclusión sobre la población de la que se selecciona la muestra.

En el sitio web de IAASA, se puede encontrar una descripción más detallada de nuestras responsabilidades en la auditoría de los estados financieros:

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

Esta descripción forma parte de nuestro informe de los auditores.

Uso de este informe

Este informe, incluidas las opiniones, se ha elaborado exclusivamente para los accionistas de la Sociedad en su conjunto, con arreglo al artículo 391 de la Ley de Sociedades de 2014, y sin ningún otro fin. Al emitir estas opiniones, no aceptamos ni asumimos la responsabilidad con ningún otro fin ni respecto de cualquier otra persona a la que pueda mostrarse este informe o a cuyas manos pueda llegar, salvo en lo que se haya acordado con nuestro consentimiento escrito previo.

Otros informes requeridos

Opiniones conforme a la Ley de Sociedades 2014 sobre otros asuntos

- Hemos recibido toda la información y explicaciones que consideramos necesarias para los propósitos de nuestra auditoría.
- En nuestra opinión, los registros contables de la Sociedad fueron suficientes para permitir que los estados financieros se auditaran fácil y adecuadamente.
- Los estados financieros son coherentes con los registros contables.

Informe de excepciones de la Ley de Sociedades de 2014

Transacciones y remuneración de los Consejeros

En virtud de la Ley de Sociedades de 2014, estamos obligados a informar de si, en nuestra opinión, no se han revelado las remuneraciones y transacciones de los consejeros especificadas en los artículos 305 a 312 de dicha Ley. No hay excepciones sobre las que informar que surjan de esta responsabilidad.

Andrew O'Callaghan
en nombre y representación de PricewaterhouseCoopers
Censores Jurados de Cuentas y Empresa de Auditoría Legal
Dublín

17 de junio de 2024

Informe del Depositario

Informe del Depositario a los Accionistas a 13 de junio de 2024

Correspondiente al periodo comprendido entre el 1 de marzo de 2023 y el 29 de febrero de 2024 (el "Periodo")

The Bank of New York Mellon SA/NV, sucursal de Dublín (el **"Depositario"**, **"nosotros"**, **"nuestro"** o **"nos"**) ha investigado la conducta de Franklin Templeton Global Funds Plc (la "Sociedad") durante el Periodo, en su condición de Depositario de la Sociedad.

Este informe, incluida la opinión, se ha elaborado exclusivamente para los accionistas de la Sociedad, con arreglo a nuestro papel como Depositario de la Sociedad, y sin ningún otro fin. Al emitir esta opinión, no aceptamos ni asumimos la responsabilidad con ningún otro fin ni respecto de cualquier otra persona a la que pueda mostrarse este informe.

Responsabilidades del Depositario

Nuestras obligaciones y responsabilidades se describen en el artículo 34 del Reglamento de las Comunidades Europeas (Organismos de Inversión Colectiva en Valores Mobiliarios) de 2011 (S.I. n.º 352 de 2011), en su versión modificada (el "Reglamento").

En el informe se indicará si, en nuestra opinión, la Sociedad se ha gestionado durante el período de conformidad con lo dispuesto en la documentación de constitución de la Sociedad y el Reglamento. La Sociedad es plenamente responsable de cumplir con estas disposiciones. Si la Sociedad no se ha gestionado de esta manera, nosotros, como Depositario, debemos declarar en qué aspectos no se ha gestionado de esta manera y las medidas tomadas al respecto.

Fundamento de la opinión del Depositario

El Depositario lleva a cabo las revisiones que, en su opinión razonable, considere necesarias para cumplir con sus deberes y asegurar que, en todos los aspectos importantes, la Sociedad se ha gestionado (i) de conformidad con las limitaciones impuestas a sus facultades de inversión y préstamo por las disposiciones de su documentación de constitución y los reglamentos apropiados; y (ii) de conformidad con la documentación de constitución de la Sociedad y los reglamentos adecuados.

Opinión

En nuestra opinión, la Sociedad se ha gestionado durante el año, en todos los aspectos de alguna importancia:

(i) con arreglo a los límites impuestos a la inversión y a la capacidad de endeudamiento de la Sociedad por la documentación de constitución y el Reglamento; y

(ii) en cualquier otro aspecto, con arreglo a la documentación de constitución y el Reglamento.

En nombre de The Bank of New York Mellon SA/NV,
sucursal de Dublín,
Riverside Two,
Sir John Rogerson's Quay, Dublín 2
D02 KV60,
Irlanda

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones del Estado: 73,28 % (28 de febrero de 2023: 71,90 %)			
Estados Unidos: 73,28 % (28 de febrero de 2023: 71,90 %)			
13.625	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,350 %, con vencimiento el 18/03/2024 *	13.625	1,22
25.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, serie 0000, 5,350 %, con vencimiento el 29/04/2024 *	24.999	2,24
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, serie 0001, 5,390 %, con vencimiento el 06/05/2024 *	10.000	0,90
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, serie 0001, 5,390 %, con vencimiento el 24/05/2024 *	9.999	0,90
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,390 %, con vencimiento el 04/06/2024 *	10.001	0,90
1.600	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,475 %, con vencimiento el 27/06/2024 *	1.601	0,14
1.600	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,490 %, con vencimiento el 16/10/2024 *	1.601	0,14
5.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,340 %, con vencimiento el 27/11/2024 *	5.000	0,45
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 5,495 %, con vencimiento el 10/02/2025 *	10.007	0,90
5.000	Federal Farm Credit Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 22/08/2024	4.874	0,44
10.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 20/03/2024	9.972	0,89
10.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 22/04/2024	9.924	0,89
5.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 31/10/2024	4.843	0,43
10.000	Federal Home Loan Banks, serie 0001, 5,360 %, con vencimiento el 14/03/2024 *	10.000	0,90
20.000	Federal Home Loan Banks, 5,430 %, con vencimiento el 14/03/2024 *	20.000	1,79
10.000	Federal Home Loan Banks, serie 0003, 5,360 %, con vencimiento el 25/03/2024 *	10.000	0,90
10.000	Federal Home Loan Banks, serie 0000, 5,355 %, con vencimiento el 26/03/2024 *	10.000	0,90
10.000	Federal Home Loan Banks, serie 0002, 5,360 %, con vencimiento el 28/03/2024 *	10.000	0,90
4.000	Federal Home Loan Banks, 5,370 %, con vencimiento el 03/05/2024 *	4.000	0,36
10.000	Federal Home Loan Banks, serie 0002, 5,310 %, con vencimiento el 10/05/2024 *	10.000	0,90
15.000	Federal Home Loan Banks, serie 0000, 5,375 %, con vencimiento el 10/05/2024 *	15.000	1,35
10.000	Federal Home Loan Banks, serie 0000, 5,375 %, con vencimiento el 24/05/2024 *	10.000	0,90
10.000	Federal Home Loan Banks, 5,375 %, con vencimiento el 24/05/2024 *	10.000	0,90
10.000	Federal Home Loan Banks, serie 0001, 5,430 %, con vencimiento el 28/05/2024 *	10.000	0,90
15.000	Federal Home Loan Banks, 5,310 %, con vencimiento el 30/05/2024 *	15.000	1,35
10.000	Federal Home Loan Banks, 5,450 %, con vencimiento el 11/06/2024 *	10.000	0,90
15.000	Federal Home Loan Banks, 5,310 %, con vencimiento el 13/06/2024 *	15.000	1,35
10.000	Federal Home Loan Banks, serie 0000, 5,370 %, con vencimiento el 18/06/2024 *	10.000	0,90
10.000	Federal Home Loan Banks, serie 0002, 5,310 %, con vencimiento el 05/07/2024 *	10.000	0,90
15.000	Federal Home Loan Banks, serie 0000, 5,310 %, con vencimiento el 09/07/2024 *	15.000	1,35
15.000	Federal Home Loan Banks, serie 0000, 5,315 %, con vencimiento el 08/08/2024 *	15.000	1,35
10.000	Federal Home Loan Banks, serie 0001, 5,315 %, con vencimiento el 13/08/2024 *	10.000	0,90
5.000	Federal Home Loan Banks, 1,610 %, con vencimiento el 04/09/2024	4.904	0,44
10.000	Federal Home Loan Banks, 2,875 %, con vencimiento el 13/09/2024	9.872	0,88
1.195	Federal Home Loan Banks, 5,425 %, con vencimiento el 06/11/2024 *	1.196	0,11
5.000	Federal Home Loan Banks, 5,620 %, con vencimiento el 12/11/2024	5.000	0,45
5.300	Federal Home Loan Banks, 5,500 %, con vencimiento el 22/11/2024 *	5.306	0,47
10.000	Federal Home Loan Banks, 5,430 %, con vencimiento el 21/02/2025 *	10.006	0,90
5.000	Federal National Mortgage Association, 1,625 %, con vencimiento el 07/01/2025	4.864	0,44
21.700	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 05/03/2024	21.687	1,94
25.000	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 07/03/2024	24.978	2,24
26.500	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 12/03/2024	26.457	2,37
10.000	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 14/03/2024	9.981	0,89
23.500	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 19/03/2024	23.438	2,10
20.000	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 21/03/2024	19.941	1,79
20.000	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 26/03/2024	19.927	1,79
20.000	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 28/03/2024	19.921	1,79
22.600	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 02/04/2024	22.494	2,02
25.000	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 04/04/2024	24.876	2,23
26.100	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 16/04/2024	25.924	2,33
10.000	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 18/04/2024	9.930	0,89
15.000	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 23/04/2024	14.884	1,33
15.000	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 25/04/2024	14.880	1,33
20.000	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 30/04/2024	19.831	1,78
10.000	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 02/05/2024	9.910	0,89
15.000	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 09/05/2024	14.850	1,33
10.000	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 16/05/2024	9.890	0,89
15.000	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 23/05/2024	14.819	1,33
20.000	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 30/05/2024	19.738	1,77
8.000	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 27/06/2024	7.867	0,70
10.000	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 05/07/2024	9.823	0,88
5.000	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 11/07/2024	4.908	0,44
10.000	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 15/08/2024	9.762	0,87
10.000	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 22/08/2024	9.753	0,87
5.000	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 29/08/2024	4.871	0,44
10.000	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, con vencimiento el 31/07/2024	9.902	0,89
15.000	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, con vencimiento el 15/08/2024	14.802	1,33
		816.638	73,28
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 816.638 $)		816.638	73,28
Acuerdos de recompra inversa: 27,78 % (28 de febrero de 2023: 29,37 %)			
Estados Unidos: 27,78 % (28 de febrero de 2023: 29,37 %)			
70.000	El Acuerdo de recompra inversa de Canadian Imperial Bank of Commerce se recomprará por 70.010.286 USD (garantizado por bonos y obligaciones del Tesoro de los Estados Unidos por un valor total de 71.410.554 USD), 5,290 %, con vencimiento el 01/03/2024	70.000	6,28
55.000	El Acuerdo de recompra inversa de HSBC Bank USA se recomprará por 55.008.021 USD (garantizado por bonos y obligaciones del Tesoro de los Estados Unidos por un valor total de 56.108.186 USD), 5,250 %, con vencimiento el 01/03/2024	55.000	4,94
95.000	El Acuerdo de recompra inversa de JP Morgan Securities, LLC se recomprará por 95.013.986 USD (garantizado por bonos y obligaciones del Tesoro de los Estados Unidos por un valor total de 96.914.341 USD), 5,300 %, con vencimiento el 01/03/2024	95.000	8,52
50.000	El Acuerdo de recompra inversa de Royal Bank of Canada se recomprará por 50.007.306 USD (garantizado por bonos y obligaciones del Tesoro de los Estados Unidos por un valor total de 51.000.043 USD), 5,260 %, con vencimiento el 01/03/2024	50.000	4,49
39.597	El Acuerdo de recompra inversa de TD Securities (USA) LLC se recomprará por 39.602.830 USD (garantizado por bonos y obligaciones del Tesoro de los Estados Unidos por un valor total de 40.388.940 USD), 5,300 %, con vencimiento el 01/03/2024	39.597	3,55
		309.597	27,78
Total de Acuerdos de recompra inversa (coste 309.597 $)		309.597	27,78
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		1.126.235	101,06
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		1.126.235	101,06
Excedente de pasivos respecto a otros activos		(11.817)	(1,06)
Patrimonio		1.114.418 $	100,00

– Los importes designados como "–" son 0 USD, menos de 1.000 USD, menos de 1.000 acciones o menos del 0,01 %.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	72,37
Instrumentos del mercado monetario	27,44
Otros activos	0,19
Total de activos	100,00

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por activos: 8,75 % (28 de febrero de 2023: 9,59 %)			
300	37 Capital CLO II, serie 2022 1A, clase A1A, 144A, 7,314 %, con vencimiento el 15/07/2034 *	302	0,16
600	AB BSL CLO 4 Ltd, Serie 2023 4A, Clase A, 144A, 7,318 %, con vencimiento el 20/04/2036 *	606	0,33
1.000	Apidos CLO XXXVII, serie 2021 37A, clase A, 144A, 6,709 %, con vencimiento el 22/10/2034 *	1.001	0,54
260	Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, serie 2023 1A, clase A2, 144A, 7,824 %, con vencimiento el 05/03/2053	269	0,15
415	Argent Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Certificates Series 2003-W7, serie 2003 W3, clase M1, 3,853 %, con vencimiento el 25/09/2033 *	374	0,20
315	Barings Private Credit Corp. CLO 2023-1 Ltd, serie 2023 1A, clase A1, 144A, 7,714 %, con vencimiento el 15/07/2031 *	316	0,17
390	Benefit Street Partners CLO VIII Ltd, serie 2015 8A, clase A1AR, 144A, 6,679 %, con vencimiento el 20/01/2031 *	390	0,21
140	Birch Grove CLO 6 Ltd, serie 2023 6A, clase A1, 144A, 7,518 %, con vencimiento el 20/07/2035 *	142	0,08
450	Birch Grove CLO 8 Ltd, serie 2024 8A, clase A1, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 20/04/2037 *	450	0,24
643	Brazos Higher Education Authority Inc, serie 2011 2, clase A3, 6,623 %, con vencimiento el 27/10/2036 *	643	0,35
210	Brightwood Capital MM CLO 2023-1 Ltd, serie 2023 1A, clase A1A, 144A, 8,111 %, con vencimiento el 15/10/2035 *	212	0,12
630	Canyon CLO 2020-1 Ltd, serie 2020 1A, clase AR, 144A, 6,756 %, con vencimiento el 15/07/2034 *	630	0,34
270	Cayuga Park CLO Ltd, serie 2020 1A, clase AR, 144A, 6,698 %, con vencimiento el 17/07/2034 *	271	0,15
312	CBAM 2017-1 Ltd, serie 2017 1A, clase A1, 144A, 6,829 %, con vencimiento el 20/07/2030 *	312	0,17
66	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, serie 2001 HE22, clase A1, 5,759 %, con vencimiento el 25/02/2032 *	65	0,03
30	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2007-13, serie 2007 13, clase 2A2, 6,235 %, con vencimiento el 25/10/2047 *	27	0,01
132	CWABS Inc. Asset-Backed Certificates Trust 2004-5, serie 2004 5, clase 2A, 5,935 %, con vencimiento el 25/10/2034 *	127	0,07
24	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-F, serie 2006 F, clase 2A1A, 5,572 %, con vencimiento el 15/07/2036 *	23	0,01
134	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Serie 2006-I, Serie 2006 I, Clase 2A, 5,572 %, con vencimiento el 15/01/2037 *	122	0,07
420	Golub Capital Partners Clo 57M Ltd, serie 2021 57A, clase A1, 144A, 7,076 %, con vencimiento el 25/10/2034 *	419	0,23
150	Golub Capital Partners CLO 66B Ltd, Serie 2023 66A, Clase A, 144A, 7,275 %, con vencimiento el 25/04/2036 *	151	0,08
381	Goodleap Sustainable Home Solutions Trust 2023-3, Serie 2023 3C, Clase A, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 20/07/2055	392	0,21
252	Greywolf CLO V Ltd, serie 2015 1A, clase A1R, 144A, 6,746 %, con vencimiento el 27/01/2031 *	252	0,14
480	Jack in the Box Funding LLC, serie 2022 1A, clase A2I, 144A, 3,445 %, con vencimiento el 26/02/2052	445	0,24
308	Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, serie 2021 1GS, clase A, 144A, 2,290 %, con vencimiento el 20/01/2048	247	0,13
536	Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1, serie 2004 1, clase M1, 6,185 %, con vencimiento el 25/02/2034 *	524	0,28
209	Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-4, serie 2004 4, clase M1, 6,335 %, con vencimiento el 25/10/2034 *	201	0,11
407	Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2004-WMC5, serie 2004 WMC5, clase M1, 6,365 %, con vencimiento el 25/07/2035 *	402	0,22
325	MKS CLO 2017-2 Ltd, serie 2017 2A, clase A, 144A, 6,769 %, con vencimiento el 20/01/2031 *	326	0,18
386	Morgan Stanley ABS Capital I Inc. Trust 2004-NC8, serie 2004 NC8, clase M1, 6,350 %, con vencimiento el 25/09/2034 *	379	0,20
25	Morgan Stanley ABS Capital I Inc. Trust 2005-NC2, serie 2005 NC2, clase M4, 6,350 %, con vencimiento el 25/03/2035 *	24	0,01
348	Mosaic Solar Loan Trust 2021-3, serie 2021 3A, clase B, 144A, 1,920 %, con vencimiento el 20/06/2052	261	0,14
313	Navient Student Loan Trust 2017-3, serie 2017 3A, clase A3, 144A, 6,486 %, con vencimiento el 26/07/2066 *	315	0,17
603	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 Ltd, serie 2018 29A, clase A1, 144A, 6,701 %, con vencimiento el 19/10/2031 *	603	0,32
83	NovaStar Mortgage Funding Trust Series 2003-3, serie 2003 3, clase A1, 6,145 %, con vencimiento el 25/12/2033 *	81	0,04
730	Ocean Trails Clo X, Serie 2020 10A, Clase AR, 144A, 6,796 %, con vencimiento el 15/10/2034 *	730	0,39
240	Ocean Trails Clo XI, serie 2021 11A, clase A, 144A, 6,799 %, con vencimiento el 20/07/2034 *	241	0,13
500	Ocean Trails CLO XIV Ltd, serie 2023 14A, clase A1, 144A, 7,318 %, con vencimiento el 20/01/2035 *	504	0,27
490	Palmer Square CLO 2022-5 Ltd, serie 2022 5A, clase A, 144A, 7,318 %, con vencimiento el 20/10/2035 *	494	0,27
57	SBA Small Business Investment Cos, serie 2018 10B, clase 1, 3,548 %, con vencimiento el 10/09/2028	54	0,03
65	SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A, serie 2007 A, clase A4A, Clase A4A, 5,886 %, con vencimiento el 16/12/2041 *	64	0,03
296	SLM Private Education Loan Trust 2010-C, serie 2010 C, clase A5, 144A, 10,182 %, con vencimiento el 15/10/2041 *	319	0,17
128	SMB Private Education Loan Trust 2020-A, serie 2020 A, clase A2A, 144A, 2,230 %, con vencimiento el 15/09/2037 *	120	0,07
333	Stonepeak 2021-1 ABS, serie 2021 1A, clase AA, 144A, 2,301 %, con vencimiento el 28/02/2033	310	0,17
500	Symphony CLO 40 Ltd, serie 2023 40A, clase A1, 144A, 6,984 %, con vencimiento el 14/01/2034 *	504	0,27
490	Trinitas CLO XVI Ltd, serie 2021 16A, clase A1, 144A, 6,759 %, con vencimiento el 20/07/2034 *	490	0,26
460	Trinitas CLO XXV Ltd, serie 2023 25A, clase A1, 144A, 7,181 %, con vencimiento el 23/01/2037 *	464	0,25
632	Voya CLO 2016-3 Ltd, Serie 2016 3A, Clase A1R, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 18/10/2031 *	633	0,34
Total de valores garantizados por activos (coste 16.223 $)		16.231	8,75
Valores garantizados por hipotecas: 42,48 % (28 de febrero de 2023: 36,20 %)			
510	AREIT 2022-CRE7 LLC, serie 2022 CRE7, clase A, 144A, 7,562 %, con vencimiento el 17/06/2039 *	511	0,28
210	BANK 2018-BNK10, serie 2018 BN10, clase A5, 3,688 %, con vencimiento el 15/02/2061	198	0,11
130	Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, Serie 2018 B1, Clase A5, 3,666 %, con vencimiento el 15/01/2051 *	121	0,07
10.069	Benchmark 2018-B5 Mortgage Trust, serie 2018 B5, clase XA, 0,460 %, con vencimiento el 15/07/2051 *	159	0,09
879	BHMS 2018-ATLS, Serie 2018 ATLS, Clase A, 144A, 6,865 %, con vencimiento el 15/07/2035 *	877	0,47
450	BRAVO Residential Funding Trust 2024-NQM2, serie 2024 NQM2, clase A1, 144A, 6,285 %, con vencimiento el 25/02/2064	451	0,24
100	CD 2017-CD3 Mortgage Trust, serie 2017 CD3, clase A4, 3,631 %, con vencimiento el 10/02/2050	93	0,05
130	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, serie 2014 GC23, clase B, 4,175 %, con vencimiento el 10/07/2047 *	127	0,07
3.754	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C3, Serie 2016 C3, Clase XA, 0,982 %, con vencimiento el 15/11/2049 *	77	0,04
186	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-C4, serie 2017 C4, clase A3, 3,209 %, con vencimiento el 12/10/2050	173	0,09
23	COMM 2015-LC19 Mortgage Trust, serie 2015 LC19, clase ASB, 3,040 %, con vencimiento el 10/02/2048	23	0,01
200	COMM 2015-PC1 Mortgage Trust, Serie 2015 PC1, Clase A5, 3,902 %, con vencimiento el 10/07/2050	196	0,11
340	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, Serie 2022 R04, Clase 1M2, 144A, 8,422 %, con vencimiento el 25/03/2042 *	354	0,19
430	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R06, serie 2023 R06, clase 1M2, 144A, 8,022 %, con vencimiento el 25/07/2043 *	444	0,24
250	Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01, Serie 2024 R01, Clase 1M2, 144A, 7,122 %, con vencimiento el 25/01/2044 *	251	0,14
100	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, serie 2015 C1, clase AS, 3,791 %, con vencimiento el 15/04/2050 *	97	0,05
338	CSMC Trust 2018-J1 Trust, serie 2018 J1, clase A2, 144A, 3,500 %, con vencimiento el 25/02/2048 *	299	0,16
955	CSMC Trust 2018-J1 Trust, serie 2018 J1, clase B2, 144A, 3,583 %, con vencimiento el 25/02/2048 *	840	0,45
126	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, serie 2014 C03, clase 1M2, 8,436 %, con vencimiento el 25/07/2024 *	127	0,07
1	Fannie Mae Interest Strip 390, clase C3, 6,000 %, con vencimiento el 25/07/2038	–	–
3	Fannie Mae Interest Strip 407, clase 41, 6,000 %, con vencimiento el 25/01/2038	1	–
7	Fannie Mae Interest Strip 409, Clase C13, 3,500 %, con vencimiento el 25/11/2041	1	–
7	Fannie Mae Interest Strip 409, clase C18, 4,000 %, con vencimiento el 25/04/2042	1	–
4	Fannie Mae Interest Strip 409, clase C2, 3,000 %, con vencimiento el 25/04/2027	–	–
300	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,500 % ±	284	0,15
800	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,500 % ±	758	0,41
600	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 5,000 % ±	582	0,31
31	Fannie Mae Pool '890604', 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2044	30	0,02

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
20	Fannie Mae Pool 'AB9594', 4,000 %, con vencimiento el 01/06/2043	19	0,01
189	Fannie Mae Pool 'AH4536', 4,000 %, con vencimiento el 01/02/2041	179	0,10
8	Fannie Mae Pool 'AL4324', 6,500 %, con vencimiento el 01/05/2040	8	–
63	Fannie Mae Pool 'AL9397', 3,000 %, con vencimiento el 01/10/2046	55	0,03
46	Fannie Mae Pool 'AL9546', 3,500 %, con vencimiento el 01/11/2046	42	0,02
36	Fannie Mae Pool 'AL9631', 3,000 %, con vencimiento el 01/12/2046	31	0,02
20	Fannie Mae Pool 'AM8674', 2,810 %, con vencimiento el 01/04/2025	19	0,01
43	Fannie Mae Pool 'AO7501', 4,000 %, con vencimiento el 01/06/2042	40	0,02
21	Fannie Mae Pool 'AP4781', 3,000 %, con vencimiento el 01/09/2042	19	0,01
17	Fannie Mae Pool 'AR7399', 3,000 %, con vencimiento el 01/06/2043	15	0,01
39	Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, con vencimiento el 01/07/2043	34	0,02
206	Fannie Mae Pool 'AS7313', 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2046	188	0,10
87	Fannie Mae Pool 'AS7738', 3,000 %, con vencimiento el 01/08/2046	75	0,04
55	Fannie Mae Pool 'AS7844', 3,000 %, con vencimiento el 01/09/2046	48	0,03
20	Fannie Mae Pool 'AS8740', 3,500 %, con vencimiento el 01/02/2037	18	0,01
37	Fannie Mae Pool 'AS8745', 3,000 %, con vencimiento el 01/02/2047	32	0,02
41	Fannie Mae Pool 'AS9588', 4,000 %, con vencimiento el 01/05/2047	39	0,02
15	Fannie Mae Pool 'AT4281', 4,000 %, con vencimiento el 01/06/2043	15	0,01
24	Fannie Mae Pool 'AU6735', 3,000 %, con vencimiento el 01/10/2043	21	0,01
39	Fannie Mae Pool 'BC0884', 3,000 %, con vencimiento el 01/05/2046	34	0,02
62	Fannie Mae Pool 'BC1509', 3,000 %, con vencimiento el 01/08/2046	54	0,03
87	Fannie Mae Pool 'BC2817', 3,000 %, con vencimiento el 01/09/2046	76	0,04
35	Fannie Mae Pool 'BD2455', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2047	30	0,02
37	Fannie Mae Pool 'BD8104', 3,000 %, con vencimiento el 01/10/2046	33	0,02
179	Fannie Mae Pool 'BF0104', 4,000 %, con vencimiento el 01/02/2056	170	0,09
203	Fannie Mae Pool 'BF0133', 4,000 %, con vencimiento el 01/08/2056	188	0,10
43	Fannie Mae Pool 'BF0163', 5,000 %, con vencimiento el 01/11/2046	42	0,02
81	Fannie Mae Pool 'BF0183', 4,000 %, con vencimiento el 01/01/2057	75	0,04
172	Fannie Mae Pool 'BF0191', 4,000 %, con vencimiento el 01/06/2057	161	0,09
35	Fannie Mae Pool 'BF0301', 4,500 %, con vencimiento el 01/08/2058	33	0,02
186	Fannie Mae Pool 'BF0646', 2,500 %, con vencimiento el 01/06/2062	148	0,08
132	Fannie Mae Pool 'BM3473', 3,500 %, con vencimiento el 01/11/2047	119	0,06
14	Fannie Mae Pool 'BM3904', 5,000 %, con vencimiento el 01/05/2048	14	0,01
393	Fannie Mae Pool 'BM4579', 3,000 %, con vencimiento el 01/04/2047	343	0,18
33	Fannie Mae Pool 'BM4751', 3,500 %, con vencimiento el 01/03/2043	31	0,02
549	Fannie Mae Pool 'BN3898', 4,500 %, con vencimiento el 01/12/2048	530	0,29
71	Fannie Mae Pool 'BQ1163', 2,000 %, con vencimiento el 01/08/2050	57	0,03
75	Fannie Mae Pool 'BQ3331', 2,000 %, con vencimiento el 01/08/2050	60	0,03
72	Fannie Mae Pool 'BQ4926', 2,000 %, con vencimiento el 01/10/2050	57	0,03
78	Fannie Mae Pool 'BQ5876', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2050	65	0,04
73	Fannie Mae Pool 'BR2641', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	59	0,03
68	Fannie Mae Pool 'BR2643', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	54	0,03
67	Fannie Mae Pool 'BR2644', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	54	0,03
68	Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	56	0,03
71	Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	57	0,03
74	Fannie Mae Pool 'BR3286', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	59	0,03
70	Fannie Mae Pool 'BR4722', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	56	0,03
79	Fannie Mae Pool 'BR4753', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	63	0,03
68	Fannie Mae Pool 'BR4756', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	54	0,03
78	Fannie Mae Pool 'BR5587', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	63	0,03
78	Fannie Mae Pool 'BR5633', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	62	0,03
79	Fannie Mae Pool 'BT0846', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2051	66	0,04
145	Fannie Mae Pool 'BT1311', 2,000 %, con vencimiento el 01/07/2051	115	0,06
82	Fannie Mae Pool 'BT3270', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	68	0,04
79	Fannie Mae Pool 'BT3303', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	66	0,04
1.805	Fannie Mae Pool 'BU1118', 2,500 %, con vencimiento el 01/10/2051	1.494	0,81
88	Fannie Mae Pool 'BU1421', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2052	76	0,04
84	Fannie Mae Pool 'BU2599', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2052	70	0,04
83	Fannie Mae Pool 'BV3089', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2052	69	0,04
246	Fannie Mae Pool 'BV4195', 3,000 %, con vencimiento el 01/03/2052	214	0,12
93	Fannie Mae Pool 'BW9916', 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2052	90	0,05
90	Fannie Mae Pool 'BX0553', 5,500 %, con vencimiento el 01/10/2052	89	0,05
842	Fannie Mae Pool 'BX8180', 5,500 %, con vencimiento el 01/04/2053	835	0,45
183	Fannie Mae Pool 'BX9419', 5,000 %, con vencimiento el 01/03/2053	178	0,10
288	Fannie Mae Pool 'CA1692', 4,000 %, con vencimiento el 01/05/2048	270	0,15
28	Fannie Mae Pool 'CA2472', 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2048	26	0,01
72	Fannie Mae Pool 'CA7023', 2,000 %, con vencimiento el 01/09/2050	57	0,03
72	Fannie Mae Pool 'CA7224', 2,000 %, con vencimiento el 01/10/2050	57	0,03
208	Fannie Mae Pool 'CA7422', 2,000 %, con vencimiento el 01/10/2040	175	0,09
71	Fannie Mae Pool 'CA7531', 3,000 %, con vencimiento el 01/10/2050	62	0,03
158	Fannie Mae Pool 'CB0470', 2,500 %, con vencimiento el 01/05/2041	137	0,07
1.451	Fannie Mae Pool 'CB1301', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	1.202	0,65
521	Fannie Mae Pool 'CB1538', 2,500 %, con vencimiento el 01/09/2051	437	0,24
258	Fannie Mae Pool 'CB2664', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2052	221	0,12
769	Fannie Mae Pool 'CB2775', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2052	641	0,35
89	Fannie Mae Pool 'CB3044', 2,500 %, con vencimiento el 01/03/2052	74	0,04
176	Fannie Mae Pool 'CB3234', 3,000 %, con vencimiento el 01/04/2052	152	0,08
174	Fannie Mae Pool 'CB3272', 4,000 %, con vencimiento el 01/04/2052	162	0,09
87	Fannie Mae Pool 'CB3282', 3,500 %, con vencimiento el 01/04/2052	77	0,04
9	Fannie Mae Pool 'CB3899', 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2052	8	–
87	Fannie Mae Pool 'CB4103', 5,000 %, con vencimiento el 01/07/2052	86	0,05
90	Fannie Mae Pool 'CB4788', 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2052	87	0,05
92	Fannie Mae Pool 'CB5104', 4,500 %, con vencimiento el 01/11/2052	87	0,05
561	Fannie Mae Pool 'CB5108', 5,500 %, con vencimiento el 01/11/2052	557	0,30
179	Fannie Mae Pool 'CB5497', 6,500 %, con vencimiento el 01/01/2053	184	0,10
95	Fannie Mae Pool 'CB5892', 4,500 %, con vencimiento el 01/03/2053	90	0,05
97	Fannie Mae Pool 'CB6030', 4,500 %, con vencimiento el 01/04/2053	92	0,05
95	Fannie Mae Pool 'CB6322', 5,500 %, con vencimiento el 01/05/2053	94	0,05
380	Fannie Mae Pool 'CB6753', 6,000 %, con vencimiento el 01/07/2053	384	0,21
46	Fannie Mae Pool 'FM0068', 3,500 %, con vencimiento el 01/02/2040	43	0,02
37	Fannie Mae Pool 'FM0071', 3,500 %, con vencimiento el 01/02/2040	34	0,02

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
39	Fannie Mae Pool 'FM1263', 4,500 %, con vencimiento el 01/07/2049	37	0,02
181	Fannie Mae Pool 'FM1727', 5,000 %, con vencimiento el 01/09/2049	179	0,10
88	Fannie Mae Pool 'FM2761', 5,000 %, con vencimiento el 01/03/2050	87	0,05
79	Fannie Mae Pool 'FM3049', 4,000 %, con vencimiento el 01/04/2044	74	0,04
190	Fannie Mae Pool 'FM3773', 3,500 %, con vencimiento el 01/11/2048	173	0,09
252	Fannie Mae Pool 'FM4650', 2,500 %, con vencimiento el 01/10/2040	219	0,12
47	Fannie Mae Pool 'FM5783', 3,000 %, con vencimiento el 01/06/2038	43	0,02
56	Fannie Mae Pool 'FM5904', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2051	47	0,03
73	Fannie Mae Pool 'FM6460', 2,500 %, con vencimiento el 01/03/2051	61	0,03
233	Fannie Mae Pool 'FM7673', 2,500 %, con vencimiento el 01/06/2051	193	0,10
65	Fannie Mae Pool 'FM7675', 2,500 %, con vencimiento el 01/06/2051	55	0,03
50	Fannie Mae Pool 'FM7786', 4,000 %, con vencimiento el 01/01/2049	47	0,03
58	Fannie Mae Pool 'FM7796', 4,000 %, con vencimiento el 01/06/2048	54	0,03
80	Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2051	67	0,04
149	Fannie Mae Pool 'FM8577', 3,000 %, con vencimiento el 01/08/2051	130	0,07
77	Fannie Mae Pool 'FM8648', 3,000 %, con vencimiento el 01/09/2051	66	0,04
63	Fannie Mae Pool 'FM8813', 3,500 %, con vencimiento el 01/09/2051	57	0,03
79	Fannie Mae Pool 'FM9365', 3,000 %, con vencimiento el 01/11/2051	69	0,04
80	Fannie Mae Pool 'FM9464', 3,000 %, con vencimiento el 01/11/2051	70	0,04
94	Fannie Mae Pool 'FP0028', 2,000 %, con vencimiento el 01/08/2040	79	0,04
74	Fannie Mae Pool 'FS0024', 2,500 %, con vencimiento el 01/09/2051	63	0,03
71	Fannie Mae Pool 'FS0037', 3,000 %, con vencimiento el 01/08/2051	63	0,03
68	Fannie Mae Pool 'FS0067', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2051	65	0,04
82	Fannie Mae Pool 'FS0240', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2052	72	0,04
586	Fannie Mae Pool 'FS0273', 2,500 %, con vencimiento el 01/12/2051	493	0,27
84	Fannie Mae Pool 'FS0366', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2052	71	0,04
169	Fannie Mae Pool 'FS0424', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2052	141	0,08
86	Fannie Mae Pool 'FS0582', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2052	72	0,04
87	Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2052	69	0,04
248	Fannie Mae Pool 'FS0697', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2042	214	0,12
316	Fannie Mae Pool 'FS0735', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2052	273	0,15
85	Fannie Mae Pool 'FS0751', 3,000 %, con vencimiento el 01/03/2052	73	0,04
88	Fannie Mae Pool 'FS0957', 3,000 %, con vencimiento el 01/03/2052	76	0,04
85	Fannie Mae Pool 'FS0995', 2,500 %, con vencimiento el 01/03/2042	74	0,04
85	Fannie Mae Pool 'FS1014', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2052	68	0,04
512	Fannie Mae Pool 'FS1074', 3,000 %, con vencimiento el 01/03/2052	446	0,24
345	Fannie Mae Pool 'FS1112', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2052	277	0,15
252	Fannie Mae Pool 'FS1171', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2052	216	0,12
84	Fannie Mae Pool 'FS1289', 3,000 %, con vencimiento el 01/03/2052	73	0,04
88	Fannie Mae Pool 'FS1603', 3,500 %, con vencimiento el 01/05/2052	79	0,04
89	Fannie Mae Pool 'FS2707', 3,500 %, con vencimiento el 01/04/2052	80	0,04
154	Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2049	140	0,08
276	Fannie Mae Pool 'FS3162', 2,500 %, con vencimiento el 01/04/2052	228	0,12
87	Fannie Mae Pool 'FS3249', 5,000 %, con vencimiento el 01/11/2052	85	0,05
183	Fannie Mae Pool 'FS3339', 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2052	163	0,09
96	Fannie Mae Pool 'FS3672', 5,500 %, con vencimiento el 01/02/2053	96	0,05
93	Fannie Mae Pool 'FS3836', 4,500 %, con vencimiento el 01/01/2053	88	0,05
94	Fannie Mae Pool 'FS3941', 5,000 %, con vencimiento el 01/02/2053	91	0,05
86	Fannie Mae Pool 'FS4000', 6,000 %, con vencimiento el 01/07/2041	89	0,05
97	Fannie Mae Pool 'FS4136', 5,000 %, con vencimiento el 01/04/2053	94	0,05
283	Fannie Mae Pool 'FS4269', 2,000 %, con vencimiento el 01/10/2051	227	0,12
383	Fannie Mae Pool 'FS4524', 5,000 %, con vencimiento el 01/05/2053	372	0,20
1.042	Fannie Mae Pool 'FS4654', 2,000 %, con vencimiento el 01/07/2051	826	0,45
98	Fannie Mae Pool 'FS4805', 5,500 %, con vencimiento el 01/05/2053	98	0,05
187	Fannie Mae Pool 'FS5059', 3,500 %, con vencimiento el 01/11/2048	170	0,09
95	Fannie Mae Pool 'FS5306', 6,000 %, con vencimiento el 01/07/2053	97	0,05
1.712	Fannie Mae Pool 'FS5313', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2050	1.548	0,83
288	Fannie Mae Pool 'FS5450', 3,000 %, con vencimiento el 01/11/2051	251	0,14
193	Fannie Mae Pool 'FS5647', 5,500 %, con vencimiento el 01/07/2053	192	0,10
192	Fannie Mae Pool 'FS5708', 5,000 %, con vencimiento el 01/06/2053	188	0,10
97	Fannie Mae Pool 'FS6779', 6,500 %, con vencimiento el 01/12/2053	99	0,05
100	Fannie Mae Pool 'FS7170', 2,000 %, con vencimiento el 01/08/2042	84	0,05
27	Fannie Mae Pool 'MA1217', 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2042	26	0,01
14	Fannie Mae Pool 'MA1253', 4,000 %, con vencimiento el 01/11/2042	13	0,01
20	Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2043	20	0,01
38	Fannie Mae Pool 'MA2110', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2034	36	0,02
26	Fannie Mae Pool 'MA2138', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2035	24	0,01
51	Fannie Mae Pool 'MA2320', 3,000 %, con vencimiento el 01/07/2035	47	0,03
82	Fannie Mae Pool 'MA2523', 3,000 %, con vencimiento el 01/02/2036	76	0,04
60	Fannie Mae Pool 'MA2579', 3,000 %, con vencimiento el 01/04/2036	56	0,03
146	Fannie Mae Pool 'MA2672', 3,000 %, con vencimiento el 01/07/2036	134	0,07
96	Fannie Mae Pool 'MA2707', 3,000 %, con vencimiento el 01/08/2036	89	0,05
22	Fannie Mae Pool 'MA4031', 4,500 %, con vencimiento el 01/05/2050	21	0,01
211	Fannie Mae Pool 'MA4158', 2,000 %, con vencimiento el 01/10/2050	168	0,09
57	Fannie Mae Pool 'MA4177', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2040	50	0,03
81	Fannie Mae Pool 'MA4236', 1,500 %, con vencimiento el 01/01/2051	61	0,03
301	Fannie Mae Pool 'MA4237', 2,000 %, con vencimiento el 01/01/2051	238	0,13
158	Fannie Mae Pool 'MA4364', 2,000 %, con vencimiento el 01/06/2041	133	0,07
1.131	Fannie Mae Pool 'MA4422', 2,000 %, con vencimiento el 01/09/2041	945	0,51
407	Fannie Mae Pool 'MA4446', 2,000 %, con vencimiento el 01/10/2041	340	0,18
248	Fannie Mae Pool 'MA4474', 2,000 %, con vencimiento el 01/11/2041	207	0,11
175	Fannie Mae Pool 'MA4587', 2,500 %, con vencimiento el 01/04/2042	151	0,08
88	Fannie Mae Pool 'MA4607', 2,500 %, con vencimiento el 01/05/2042	76	0,04
177	Fannie Mae Pool 'MA4643', 3,000 %, con vencimiento el 01/05/2042	156	0,08
8	Fannie Mae REMICS, serie 2001 81, clase GE, 6,000 %, con vencimiento el 25/01/2032	8	–
16	Fannie Mae REMICS, serie 2005 29, clase ZA, 5,500 %, con vencimiento el 25/04/2035	17	0,01
3	Fannie Mae REMICS, serie 2011 87, clase SG, 1,114 %, con vencimiento el 25/04/2040 *	–	–
7	Fannie Mae REMICS, serie 2012 101, clase AI, 3,000 %, con vencimiento el 25/06/2027	–	–
127	Fannie Mae REMICS, serie 2012 118, clase VZ, 3,000 %, con vencimiento el 25/11/2042	113	0,06
65	Fannie Mae REMICS, serie 2012 134, clase SK, 0,714 %, con vencimiento el 25/12/2042 *	7	–
5	Fannie Mae REMICS, serie 2012 46, clase BA, 6,000 %, con vencimiento el 25/05/2042	5	–

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
6	Fannie Mae REMICS, serie 2012 75, clase NS, 1,164 %, con vencimiento el 25/07/2042 *	1	–
353	Fannie Mae REMICS, serie 2012 96, clase SB, 0,614 %, con vencimiento el 25/09/2042 *	26	0,01
7	Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Clase BC, 6,500 %, con vencimiento el 25/07/2042	8	–
10	Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Clase CB, 5,500 %, con vencimiento el 25/04/2042	10	0,01
607	Fannie Mae REMICS, serie 2020 37, clase IM, 4,000 %, con vencimiento el 25/06/2050	122	0,07
108	Fannie Mae REMICS, Serie 2020 47, Clase GZ, 2,000 %, con vencimiento el 25/07/2050	62	0,03
75	Fannie Mae REMICS, serie 2020 56, clase DI, 2,500 %, con vencimiento el 25/08/2050	12	0,01
145	Fannie Mae REMICS, serie 2020 57, clase TA, 2,000 %, con vencimiento el 25/04/2050	124	0,07
73	Fannie Mae REMICS, Serie 2020 74, Clase EI, 2,500 %, con vencimiento el 25/10/2050	12	0,01
510	Fannie Mae REMICS, Serie 2020 89, Clase DI, 2,500 %, con vencimiento el 25/12/2050	78	0,04
429	Fannie Mae REMICS, serie 2020 97, clase AI, 2,000 %, con vencimiento el 25/01/2051	58	0,03
764	Fannie Mae REMICS, serie 2021 3, clase QI, 2,500 %, con vencimiento el 25/02/2051	116	0,06
72	Fannie Mae REMICS, serie 2021 65, clase JA, 2,000 %, con vencimiento el 25/01/2046	62	0,03
400	Fannie Mae-Aces, serie 2018 M15, clase 1A2, 3,700 %, con vencimiento el 25/01/2036	364	0,20
525	Fannie Mae-Aces, serie 2020 M36, clase X1, 1,448 %, con vencimiento el 25/09/2034 *	26	0,01
9	Freddie Mac Gold Pool 'G06409', 6,000 %, con vencimiento el 01/11/2039	9	–
4	Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500 %, con vencimiento el 01/09/2039	4	–
147	Freddie Mac Gold Pool 'G61637', 3,000 %, con vencimiento el 01/09/2047	127	0,07
19	Freddie Mac Gold Pool 'Q17792', 3,500 %, con vencimiento el 01/05/2043	18	0,01
36	Freddie Mac Gold Pool 'Q29184', 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2044	34	0,02
37	Freddie Mac Gold Pool 'Q45560', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2047	32	0,02
73	Freddie Mac Gold Pool 'Q45737', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2047	64	0,03
42	Freddie Mac Gold Pool 'Q45819', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2047	36	0,02
15	Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2042	14	0,01
46	Freddie Mac Gold Pool 'U99124', 3,500 %, con vencimiento el 01/03/2045	41	0,02
2.886	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K124, Clase X1, 0,718 %, con vencimiento el 25/12/2030 *	111	0,06
3.992	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K130, clase X1, 1,037 %, con vencimiento el 25/06/2031 *	234	0,13
10.400	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Serie K 157, Clase X1, 0,254 %, con vencimiento el 25/05/2033 *	234	0,13
67	Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 2,107 %, con vencimiento el 01/03/2047 *	62	0,03
331	Freddie Mac Non Gold Pool '841076', 3,006 %, con vencimiento el 01/11/2048 *	312	0,17
108	Freddie Mac Non Gold Pool '841077', 2,875 %, con vencimiento el 01/11/2047 *	104	0,06
107	Freddie Mac Non Gold Pool '841081', 3,096 %, con vencimiento el 01/02/2050 *	101	0,05
360	Freddie Mac Pool 'QB3535', 2,000 %, con vencimiento el 01/09/2050	285	0,15
72	Freddie Mac Pool 'QB4985', 2,000 %, con vencimiento el 01/11/2050	57	0,03
70	Freddie Mac Pool 'QB5092', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2050	59	0,03
73	Freddie Mac Pool 'QB5093', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2050	61	0,03
67	Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	54	0,03
276	Freddie Mac Pool 'QB9087', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	221	0,12
72	Freddie Mac Pool 'QB9482', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	58	0,03
83	Freddie Mac Pool 'QC3690', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2051	69	0,04
80	Freddie Mac Pool 'QC4824', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	67	0,04
249	Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	208	0,11
87	Freddie Mac Pool 'QC9154', 3,000 %, con vencimiento el 01/10/2051	76	0,04
89	Freddie Mac Pool 'QD5827', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2052	72	0,04
151	Freddie Mac Pool 'RA3882', 2,000 %, con vencimiento el 01/11/2050	121	0,07
419	Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2050	352	0,19
231	Freddie Mac Pool 'RA4703', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	184	0,10
452	Freddie Mac Pool 'RA5117', 2,000 %, con vencimiento el 01/05/2051	361	0,19
82	Freddie Mac Pool 'RA5373', 2,000 %, con vencimiento el 01/06/2051	66	0,04
252	Freddie Mac Pool 'RA6397', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2051	211	0,11
82	Freddie Mac Pool 'RA6562', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2052	69	0,04
357	Freddie Mac Pool 'RA6694', 2,000 %, con vencimiento el 01/01/2052	282	0,15
261	Freddie Mac Pool 'RA7185', 4,000 %, con vencimiento el 01/04/2052	241	0,13
430	Freddie Mac Pool 'RA7186', 4,000 %, con vencimiento el 01/04/2052	399	0,22
363	Freddie Mac Pool 'RA7928', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	344	0,19
97	Freddie Mac Pool 'RA8790', 5,000 %, con vencimiento el 01/04/2053	95	0,05
2.323	Freddie Mac Pool 'RA9639', 6,000 %, con vencimiento el 01/08/2053	2.347	1,27
424	Freddie Mac Pool 'RB0714', 2,000 %, con vencimiento el 01/12/2041	354	0,19
217	Freddie Mac Pool 'RB5084', 1,500 %, con vencimiento el 01/11/2040	174	0,09
240	Freddie Mac Pool 'RB5110', 1,500 %, con vencimiento el 01/05/2041	193	0,10
245	Freddie Mac Pool 'RB5117', 1,500 %, con vencimiento el 01/07/2041	197	0,11
324	Freddie Mac Pool 'RB5125', 2,000 %, con vencimiento el 01/09/2041	271	0,15
101	Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, con vencimiento el 01/10/2041	81	0,04
741	Freddie Mac Pool 'RB5131', 2,000 %, con vencimiento el 01/10/2041	619	0,33
51	Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, con vencimiento el 01/11/2041	41	0,02
84	Freddie Mac Pool 'RB5138', 2,000 %, con vencimiento el 01/12/2041	70	0,04
86	Freddie Mac Pool 'RB5145', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2042	72	0,04
88	Freddie Mac Pool 'RB5154', 2,500 %, con vencimiento el 01/04/2042	75	0,04
178	Freddie Mac Pool 'RB5166', 3,000 %, con vencimiento el 01/07/2042	157	0,08
452	Freddie Mac Pool 'SC0313', 2,000 %, con vencimiento el 01/01/2042	377	0,20
275	Freddie Mac Pool 'SC0340', 3,000 %, con vencimiento el 01/09/2042	243	0,13
188	Freddie Mac Pool 'SC0384', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2042	158	0,09
777	Freddie Mac Pool 'SD0502', 3,000 %, con vencimiento el 01/08/2050	674	0,36
67	Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2051	55	0,03
83	Freddie Mac Pool 'SD0615', 4,500 %, con vencimiento el 01/01/2051	80	0,04
85	Freddie Mac Pool 'SD0745', 2,000 %, con vencimiento el 01/11/2051	68	0,04
84	Freddie Mac Pool 'SD0849', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2052	70	0,04
265	Freddie Mac Pool 'SD0857', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2052	219	0,12
904	Freddie Mac Pool 'SD1218', 4,000 %, con vencimiento el 01/07/2049	849	0,46
180	Freddie Mac Pool 'SD1549', 3,500 %, con vencimiento el 01/04/2052	160	0,09
92	Freddie Mac Pool 'SD1807', 4,500 %, con vencimiento el 01/07/2052	88	0,05
185	Freddie Mac Pool 'SD1936', 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2052	165	0,09
95	Freddie Mac Pool 'SD2245', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	94	0,05
90	Freddie Mac Pool 'SD2284', 6,000 %, con vencimiento el 01/12/2052	91	0,05
92	Freddie Mac Pool 'SD2394', 4,500 %, con vencimiento el 01/11/2052	87	0,05
90	Freddie Mac Pool 'SD2395', 5,000 %, con vencimiento el 01/01/2053	87	0,05
96	Freddie Mac Pool 'SD2443', 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2052	91	0,05
90	Freddie Mac Pool 'SD2452', 6,500 %, con vencimiento el 01/02/2053	92	0,05
93	Freddie Mac Pool 'SD2591', 5,000 %, con vencimiento el 01/03/2053	91	0,05
94	Freddie Mac Pool 'SD2688', 5,500 %, con vencimiento el 01/04/2053	94	0,05

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
94	Freddie Mac Pool 'SD2723', 5,500 %, con vencimiento el 01/03/2053	94	0,05
96	Freddie Mac Pool 'SD2762', 5,500 %, con vencimiento el 01/05/2053	95	0,05
89	Freddie Mac Pool 'SD2792', 4,500 %, con vencimiento el 01/03/2047	86	0,05
93	Freddie Mac Pool 'SD2892', 5,500 %, con vencimiento el 01/05/2053	93	0,05
92	Freddie Mac Pool 'SD2961', 5,000 %, con vencimiento el 01/11/2052	90	0,05
455	Freddie Mac Pool 'SD2981', 6,500 %, con vencimiento el 01/05/2053	464	0,25
93	Freddie Mac Pool 'SD2991', 2,500 %, con vencimiento el 01/09/2051	78	0,04
376	Freddie Mac Pool 'SD3171', 5,500 %, con vencimiento el 01/06/2053	373	0,20
192	Freddie Mac Pool 'SD3382', 5,000 %, con vencimiento el 01/06/2053	186	0,10
293	Freddie Mac Pool 'SD3400', 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2052	278	0,15
94	Freddie Mac Pool 'SD3432', 6,000 %, con vencimiento el 01/07/2053	95	0,05
193	Freddie Mac Pool 'SD3642', 6,000 %, con vencimiento el 01/09/2053	196	0,11
188	Freddie Mac Pool 'SD3722', 5,000 %, con vencimiento el 01/05/2053	184	0,10
45	Freddie Mac Pool 'SD7509', 3,000 %, con vencimiento el 01/11/2049	39	0,02
134	Freddie Mac Pool 'SD7525', 2,500 %, con vencimiento el 01/10/2050	113	0,06
142	Freddie Mac Pool 'SD7534', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2051	120	0,06
543	Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2051	455	0,25
186	Freddie Mac Pool 'SD7560', 4,000 %, con vencimiento el 01/02/2053	173	0,09
276	Freddie Mac Pool 'SD8209', 1,500 %, con vencimiento el 01/03/2052	206	0,11
377	Freddie Mac Pool 'SI2056', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2050	340	0,18
42	Freddie Mac Pool 'ZA2489', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2038	39	0,02
7	Freddie Mac Pool 'ZI7269', 5,000 %, con vencimiento el 01/03/2038	7	–
23	Freddie Mac Pool 'ZN0538', 3,500 %, con vencimiento el 01/11/2042	21	0,01
14	Freddie Mac Pool 'ZN1436', 5,000 %, con vencimiento el 01/11/2048	14	0,01
4	Freddie Mac Pool 'ZS3059', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2038	4	–
6	Freddie Mac Pool 'ZS3569', 6,000 %, con vencimiento el 01/10/2036	6	–
43	Freddie Mac Pool 'ZT1257', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2046	38	0,02
3	Freddie Mac REMICS 3621, clase SB, 0,791 %, con vencimiento el 15/01/2040 *	–	–
20	Freddie Mac REMICS 3947, clase SG, 0,511 %, con vencimiento el 15/10/2041 *	2	–
11	Freddie Mac REMICS 4194, clase BI, 3,500 %, con vencimiento el 15/04/2043	2	–
1	Freddie Mac REMICS 4298, clase PI, 4,000 %, con vencimiento el 15/04/2043	–	–
27	Freddie Mac REMICS 4813, Clase CJ, 3,000 %, con vencimiento el 15/08/2048	23	0,01
448	Freddie Mac REMICS 4980, clase KI, 4,500 %, con vencimiento el 25/06/2050	103	0,06
65	Freddie Mac REMICS 5010, clase IK, 2,500 %, con vencimiento el 25/09/2050	10	0,01
231	Freddie Mac REMICS 5010, clase JI, 2,500 %, con vencimiento el 25/09/2050	37	0,02
79	Freddie Mac REMICS 5013, clase IN, 2,500 %, con vencimiento el 25/09/2050	12	0,01
162	Freddie Mac REMICS 5018, clase MI, 2,000 %, con vencimiento el 25/10/2050	22	0,01
384	Freddie Mac REMICS 5038, Clase PJ, 0,750 %, con vencimiento el 25/10/2050	268	0,14
69	Freddie Mac REMICS 5040, Clase IB, 2,500 %, con vencimiento el 25/11/2050	10	0,01
407	Freddie Mac REMICS 5059, Clase IB, 2,500 %, con vencimiento el 25/01/2051	67	0,04
73	Freddie Mac REMICS 5069, clase MI, 2,500 %, con vencimiento el 25/02/2051	11	0,01
416	Freddie Mac REMICS 5085, clase NI, 2,000 %, con vencimiento el 25/03/2051	49	0,03
77	Freddie Mac REMICS 5092, clase AP, 2,000 %, con vencimiento el 25/04/2041	66	0,04
487	Freddie Mac REMICS 5093, clase IY, 4,500 %, con vencimiento el 25/12/2050	112	0,06
173	Freddie Mac REMICS 5140, clase NI, 2,500 %, con vencimiento el 25/05/2049	24	0,01
200	Freddie Mac REMICS 5224, clase HL, 4,000 %, con vencimiento el 25/04/2052	179	0,10
420	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, Serie 2022 DNA3, Clase M1B, 144A, 8,222 %, con vencimiento el 25/04/2042 *	435	0,23
65	Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates, serie T 56, clase 2AF, 5,836 %, con vencimiento el 25/05/2043 *	63	0,03
14	Ginnie Mae I Pool '557522', 7,000 %, con vencimiento el 15/07/2031	15	0,01
9	Ginnie Mae I Pool '565347', 7,000 %, con vencimiento el 15/08/2031	9	–
3	Ginnie Mae I Pool '584344', 7,000 %, con vencimiento el 15/04/2032	3	–
59	Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, con vencimiento el 15/06/2048	55	0,03
33	Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, con vencimiento el 15/09/2042	30	0,02
50	Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, con vencimiento el 15/09/2042	45	0,02
111	Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, con vencimiento el 15/10/2042	99	0,05
6	Ginnie Mae II Pool '4837', 6,000 %, con vencimiento el 20/10/2040	7	–
6	Ginnie Mae II Pool '4923', 4,500 %, con vencimiento el 20/01/2041	6	–
4	Ginnie Mae II Pool '4961', 6,000 %, con vencimiento el 20/02/2041	4	–
14	Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500 %, con vencimiento el 20/03/2041	14	0,01
7	Ginnie Mae II Pool '5240', 6,000 %, con vencimiento el 20/11/2041	8	–
12	Ginnie Mae II Pool '784106', 3,500 %, con vencimiento el 20/01/2046	11	0,01
425	Ginnie Mae II Pool '784577', 4,000 %, con vencimiento el 20/07/2047	396	0,21
11	Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500 %, con vencimiento el 20/10/2049	10	0,01
98	Ginnie Mae II Pool '784894', 3,500 %, con vencimiento el 20/02/2048	89	0,05
118	Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000 %, con vencimiento el 20/01/2050	103	0,06
23	Ginnie Mae II Pool '784985', 3,500 %, con vencimiento el 20/09/2048	21	0,01
54	Ginnie Mae II Pool '785359', 2,000 %, con vencimiento el 20/03/2051	43	0,02
82	Ginnie Mae II Pool '785360', 2,000 %, con vencimiento el 20/03/2051	65	0,03
316	Ginnie Mae II Pool '785558', 2,500 %, con vencimiento el 20/07/2051	267	0,14
161	Ginnie Mae II Pool '785565', 2,500 %, con vencimiento el 20/06/2051	135	0,07
159	Ginnie Mae II Pool '785568', 2,500 %, con vencimiento el 20/08/2051	133	0,07
165	Ginnie Mae II Pool '785657', 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2051	138	0,07
81	Ginnie Mae II Pool '785663', 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2051	68	0,04
83	Ginnie Mae II Pool '785667', 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2051	70	0,04
170	Ginnie Mae II Pool '785762', 2,500 %, con vencimiento el 20/11/2051	143	0,08
166	Ginnie Mae II Pool '785789', 2,500 %, con vencimiento el 20/12/2051	139	0,07
333	Ginnie Mae II Pool '785791', 2,500 %, con vencimiento el 20/12/2051	280	0,15
259	Ginnie Mae II Pool '785821', 2,500 %, con vencimiento el 20/12/2051	217	0,12
86	Ginnie Mae II Pool '785944', 3,000 %, con vencimiento el 20/02/2052	76	0,04
89	Ginnie Mae II Pool '786095', 3,000 %, con vencimiento el 20/04/2052	76	0,04
92	Ginnie Mae II Pool '786108', 3,500 %, con vencimiento el 20/03/2052	82	0,04
162	Ginnie Mae II Pool '786134', 3,000 %, con vencimiento el 20/04/2052	139	0,07
93	Ginnie Mae II Pool '786474', 5,000 %, con vencimiento el 20/01/2053	92	0,05
757	Ginnie Mae II Pool '786583', 3,000 %, con vencimiento el 20/03/2052	666	0,36
96	Ginnie Mae II Pool '786709', 5,000 %, con vencimiento el 20/05/2053	94	0,05
95	Ginnie Mae II Pool '786726', 2,000 %, con vencimiento el 20/03/2051	75	0,04
98	Ginnie Mae II Pool '786835', 5,500 %, con vencimiento el 20/08/2053	98	0,05
95	Ginnie Mae II Pool '786843', 3,000 %, con vencimiento el 20/03/2052	83	0,04
395	Ginnie Mae II Pool '786916', 5,500 %, con vencimiento el 20/08/2053	396	0,21
98	Ginnie Mae II Pool '786928', 6,500 %, con vencimiento el 20/09/2053	99	0,05
390	Ginnie Mae II Pool '786963', 6,000 %, con vencimiento el 20/09/2053	395	0,21
100	Ginnie Mae II Pool '787154', 6,500 %, con vencimiento el 20/11/2053	102	0,06

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
99	Ginnie Mae II Pool '787228', 6,000 %, con vencimiento el 20/01/2054	101	0,05
100	Ginnie Mae II Pool '787236', 6,500 %, con vencimiento el 20/01/2054	102	0,06
24	Ginnie Mae II Pool 'BC4732', 3,500 %, con vencimiento el 20/10/2047	22	0,01
28	Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500 %, con vencimiento el 20/02/2050	25	0,01
68	Ginnie Mae II Pool 'BM9743', 4,000 %, con vencimiento el 20/11/2049	64	0,03
31	Ginnie Mae II Pool 'BS1742', 4,000 %, con vencimiento el 20/02/2050	30	0,02
103	Ginnie Mae II Pool 'BT0812', 3,000 %, con vencimiento el 20/03/2050	88	0,05
26	Ginnie Mae II Pool 'MA1995', 3,500 %, con vencimiento el 20/06/2044	24	0,01
9	Ginnie Mae II Pool 'MA2678', 3,500 %, con vencimiento el 20/03/2045	9	–
99	Ginnie Mae II Pool 'MA3521', 3,500 %, con vencimiento el 20/03/2046	91	0,05
53	Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500 %, con vencimiento el 20/04/2046	49	0,03
13	Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500 %, con vencimiento el 20/05/2046	12	0,01
41	Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500 %, con vencimiento el 20/06/2046	38	0,02
14	Ginnie Mae II Pool 'MA3803', 3,500 %, con vencimiento el 20/07/2046	13	0,01
79	Ginnie Mae II Pool 'MA3873', 3,000 %, con vencimiento el 20/08/2046	70	0,04
15	Ginnie Mae II Pool 'MA3937', 3,500 %, con vencimiento el 20/09/2046	14	0,01
17	Ginnie Mae II Pool 'MA4068', 3,000 %, con vencimiento el 20/11/2046	15	0,01
20	Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000 %, con vencimiento el 20/02/2047	18	0,01
140	Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, con vencimiento el 20/06/2047	132	0,07
119	Ginnie Mae II Pool 'MA4719', 3,500 %, con vencimiento el 20/09/2047	109	0,06
11	Ginnie Mae II Pool 'MA4899', 3,000 %, con vencimiento el 20/12/2047	10	0,01
10	Ginnie Mae II Pool 'MA5018', 3,000 %, con vencimiento el 20/02/2048	9	–
94	Ginnie Mae II Pool 'MA5019', 3,500 %, con vencimiento el 20/02/2048	86	0,05
90	Ginnie Mae II Pool 'MA5078', 4,000 %, con vencimiento el 20/03/2048	85	0,05
18	Ginnie Mae II Pool 'MA5194', 5,000 %, con vencimiento el 20/05/2048	18	0,01
178	Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500 %, con vencimiento el 20/06/2048	172	0,09
35	Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, con vencimiento el 20/07/2048	34	0,02
124	Ginnie Mae II Pool 'MA5465', 3,500 %, con vencimiento el 20/09/2048	114	0,06
56	Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500 %, con vencimiento el 20/10/2048	54	0,03
156	Ginnie Mae II Pool 'MA5594', 3,500 %, con vencimiento el 20/11/2048	143	0,08
15	Ginnie Mae II Pool 'MA5597', 5,000 %, con vencimiento el 20/11/2048	14	0,01
25	Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500 %, con vencimiento el 20/12/2048	24	0,01
45	Ginnie Mae II Pool 'MA5653', 5,000 %, con vencimiento el 20/12/2048	44	0,02
789	Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500 %, con vencimiento el 20/01/2049	763	0,41
14	Ginnie Mae II Pool 'MA5712', 5,000 %, con vencimiento el 20/01/2049	14	0,01
13	Ginnie Mae II Pool 'MA5762', 3,500 %, con vencimiento el 20/02/2049	12	0,01
39	Ginnie Mae II Pool 'MA5763', 4,000 %, con vencimiento el 20/02/2049	37	0,02
73	Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500 %, con vencimiento el 20/03/2049	71	0,04
18	Ginnie Mae II Pool 'MA5878', 5,000 %, con vencimiento el 20/04/2049	18	0,01
16	Ginnie Mae II Pool 'MA6287', 5,000 %, con vencimiento el 20/11/2049	15	0,01
35	Ginnie Mae II Pool 'MA6413', 5,000 %, con vencimiento el 20/01/2050	35	0,02
391	Ginnie Mae II Pool 'MA6930', 2,000 %, con vencimiento el 20/10/2050	318	0,17
82	Ginnie Mae II Pool 'MA6933', 3,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	75	0,04
544	Ginnie Mae II Pool 'MA7051', 2,000 %, con vencimiento el 20/12/2050	443	0,24
190	Ginnie Mae II Pool 'MA7056', 4,500 %, con vencimiento el 20/12/2050	184	0,10
138	Ginnie Mae II Pool 'MA7135', 2,000 %, con vencimiento el 20/01/2051	113	0,06
984	Ginnie Mae II Pool 'MA7192', 2,000 %, con vencimiento el 20/02/2051	802	0,43
155	Ginnie Mae II Pool 'MA7472', 2,500 %, con vencimiento el 20/07/2051	131	0,07
158	Ginnie Mae II Pool 'MA7534', 2,500 %, con vencimiento el 20/08/2051	134	0,07
642	Ginnie Mae II Pool 'MA7589', 2,500 %, con vencimiento el 20/09/2051	544	0,29
75	Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, con vencimiento el 20/09/2051	66	0,04
187	Ginnie Mae II Pool 'MA8428', 5,000 %, con vencimiento el 20/11/2052	183	0,10
184	Ginnie Mae II Pool 'MA8429', 5,500 %, con vencimiento el 20/11/2052	183	0,10
281	Ginnie Mae II Pool 'MA8490', 5,000 %, con vencimiento el 20/12/2052	275	0,15
284	Ginnie Mae II Pool 'MA8569', 5,000 %, con vencimiento el 20/01/2053	278	0,15
96	Ginnie Mae II Pool 'MA8725', 5,000 %, con vencimiento el 20/03/2053	94	0,05
189	Ginnie Mae II Pool 'MA8726', 5,500 %, con vencimiento el 20/03/2053	188	0,10
183	Ginnie Mae II Pool 'MA8796', 3,000 %, con vencimiento el 20/04/2053	162	0,09
382	Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2053	380	0,20
294	Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000 %, con vencimiento el 20/06/2053	287	0,16
100	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 3,000 % ±	88	0,05
200	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 4,000 % ±	186	0,10
300	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 4,500 % ±	286	0,15
2.500	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 % ±	2.442	1,32
400	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,500 % ±	397	0,21
100	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 6,000 % ±	100	0,05
4	Government National Mortgage Association, serie 2007 51, clase SG, 1,146 %, con vencimiento el 20/08/2037 *	–	–
5	Government National Mortgage Association, serie 2009 H01, clase FA, 6,584 %, con vencimiento el 20/11/2059 *	5	–
–	Government National Mortgage Association, serie 2010 85, clase HS, 1,216 %, con vencimiento el 20/01/2040 *	–	–
10	Government National Mortgage Association, serie 2010 H26, clase LF, 5,813 %, con vencimiento el 20/08/2058 *	10	0,01
18	Government National Mortgage Association, serie 2011 H01, clase AF, 5,913 %, con vencimiento el 20/11/2060 *	18	0,01
20	Government National Mortgage Association, serie 2011 H09, clase AF, 5,963 %, con vencimiento el 20/03/2061 *	20	0,01
74	Government National Mortgage Association, serie 2012 112, clase IO, 0,108 %, con vencimiento el 16/02/2053 *	–	–
37	Government National Mortgage Association, serie 2012 27, clase IO, 0,227 %, con vencimiento el 16/04/2053 *	–	–
16	Government National Mortgage Association, serie 2012 34, clase SA, 0,616 %, con vencimiento el 20/03/2042 *	2	–
20	Government National Mortgage Association, serie 2012 44, clase IO, 0,029 %, con vencimiento el 16/03/2049 *	–	–
9	Government National Mortgage Association, serie 2012 H18, clase NA, 5,983 %, con vencimiento el 20/08/2062 *	9	–
21	Government National Mortgage Association, serie 2012 H27, clase AI, 1,741 %, con vencimiento el 20/10/2062 *	1	–
9	Government National Mortgage Association, serie 2012 H30, clase GA, 5,813 %, con vencimiento el 20/12/2062 *	9	–
73	Government National Mortgage Association, serie 2013 107, clase AD, 2,834 %, con vencimiento el 16/11/2047 *	65	0,03
17	Government National Mortgage Association, Serie 2013 163, Clase IO, 1,010 %, con vencimiento el 16/02/2046 *	–	–
47	Government National Mortgage Association, serie 2013 H08, clase BF, 5,863 %, con vencimiento el 20/03/2063 *	47	0,03
30	Government National Mortgage Association, serie 2014 105, clase IO, 0,125 %, con vencimiento el 16/06/2054 *	–	–
8	Government National Mortgage Association, serie 2014 17, clase AM, 3,536 %, con vencimiento el 16/06/2048 *	7	–
9	Government National Mortgage Association, Serie 2014 47, Clase IA, 0,153 %, con vencimiento el 16/02/2048 *	–	–
49	Government National Mortgage Association, Serie 2014 50, Clase IO, 0,628 %, con vencimiento el 16/09/2055 *	1	–
243	Government National Mortgage Association, serie 2014 92, clase IX, 0,099 %, con vencimiento el 16/05/2054 *	1	–
339	Government National Mortgage Association, serie 2014 H20, clase FA, 5,893 %, con vencimiento el 20/10/2064 *	338	0,18
41	Government National Mortgage Association, serie 2015 167, clase OI, 4,000 %, con vencimiento el 16/04/2045	8	–
26	Government National Mortgage Association, serie 2015 36, clase MI, 5,500 %, con vencimiento el 20/03/2045	4	–
526	Government National Mortgage Association, serie 2015 5, clase IK, 0,273 %, con vencimiento el 16/11/2054 *	3	–
160	Government National Mortgage Association, serie 2016 128, clase IO, 0,857 %, con vencimiento el 16/09/2056 *	6	–
68	Government National Mortgage Association, serie 2020 123, clase IL, 2,500 %, con vencimiento el 20/08/2050	9	–
146	Government National Mortgage Association, serie 2020 123, clase NI, 2,500 %, con vencimiento el 20/08/2050	19	0,01
71	Government National Mortgage Association, serie 2020 127, clase IN, 2,500 %, con vencimiento el 20/08/2050	10	0,01

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
75	Government National Mortgage Association, Serie 2020 129, Clase IE, 2,500 %, con vencimiento el 20/09/2050	10	0,01
78	Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Clase IH, 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	10	0,01
74	Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Clase VI, 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	10	0,01
301	Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Clase YI, 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	39	0,02
4.336	Government National Mortgage Association, serie 2020 178, clase IO, 1,422 %, con vencimiento el 16/10/2060 *	386	0,21
3.186	Government National Mortgage Association, serie 2020 179, clase IO, 1,009 %, con vencimiento el 16/09/2062 *	202	0,11
357	Government National Mortgage Association, Serie 2020 181, Clase WI, 2,000 %, con vencimiento el 20/12/2050	40	0,02
1.636	Government National Mortgage Association, serie 2020 195, clase IO, 0,926 %, con vencimiento el 16/12/2062 *	105	0,06
239	Government National Mortgage Association, Serie 2020 47, Clase MI, 3,500 %, con vencimiento el 20/04/2050	43	0,02
136	Government National Mortgage Association, Serie 2020 47, Clase NI, 3,500 %, con vencimiento el 20/04/2050	25	0,01
159	Government National Mortgage Association, serie 2020 H04, clase FP, 5,963 %, con vencimiento el 20/06/2069 *	158	0,09
182	Government National Mortgage Association, Serie 2020 H09, Clase FL, 6,613 %, con vencimiento el 20/05/2070 *	181	0,10
100	Government National Mortgage Association, serie 2020 H09, clase NF, 6,713 %, con vencimiento el 20/04/2070 *	101	0,05
62	Government National Mortgage Association, Serie 2020 H13, Clase FA, 5,913 %, con vencimiento el 20/07/2070 *	60	0,03
5.842	Government National Mortgage Association, serie 2021 10, clase IO, 0,986 %, con vencimiento el 16/05/2063 *	392	0,21
151	Government National Mortgage Association, serie 2021 115, clase MI, 2,500 %, con vencimiento el 20/05/2051	16	0,01
417	Government National Mortgage Association, serie 2021 188, clase PA, 2,000 %, con vencimiento el 20/10/2051	342	0,18
167	Government National Mortgage Association, serie 2021 2, clase AH, 1,500 %, con vencimiento el 16/06/2063	126	0,07
83	Government National Mortgage Association, serie 2021 223, clase P, 2,000 %, con vencimiento el 20/06/2051	72	0,04
4.935	Government National Mortgage Association, Serie 2021 5, Clase IO, 1,112 %, con vencimiento el 16/01/2061 *	381	0,21
200	Government National Mortgage Association, serie 2022 3, clase B, 1,850 %, con vencimiento el 16/02/2061	100	0,05
865	Government National Mortgage Association, serie 2022 3, clase IO, 0,640 %, con vencimiento el 16/02/2061 *	42	0,02
100	Government National Mortgage Association, Serie 2022 63, Clase LM, 3,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	83	0,04
300	Government National Mortgage Association, Serie 2023 92, Clase AH, 2,000 %, con vencimiento el 16/06/2064	231	0,12
570	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-3PCK, serie 2018 3PCK, clase B, 144A, 8,182 %, con vencimiento el 15/09/2031 *	562	0,30
68	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-9, serie 2005 9, clase 2A1B, 6,174 %, con vencimiento el 20/06/2035 *	62	0,03
450	Independence Plaza Trust 2018-INDP, serie 2018 INDP, clase A, 144A, 3,763 %, con vencimiento el 10/07/2035	430	0,23
120	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23, serie 2014 C23, clase AS, 4,202 %, con vencimiento el 15/09/2047 *	118	0,06
419	Mill City Mortgage Trust 2015-2, serie 2015 2, clase M3, 144A, 3,705 %, con vencimiento el 25/09/2057 *	410	0,22
100	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C18, serie 2014 C18, clase AS, 4,110 %, con vencimiento el 15/10/2047 *	98	0,05
258	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C30, serie 2016 C30, clase A4, 2,600 %, con vencimiento el 15/09/2049	244	0,13
217	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-ASHF, serie 2017 ASHF, clase A, 144A, 6,465 %, con vencimiento el 15/11/2034 *	215	0,12
550	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, serie 2019 FAME, clase A, 144A, 3,047 %, con vencimiento el 15/08/2036	502	0,27
145	New Residential Mortgage Loan Trust 2015-2, serie 2015 2A, clase A1, 144A, 3,750 %, con vencimiento el 25/08/2055 *	135	0,07
222	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, serie 2016 3A, clase A1B, 144A, 3,250 %, con vencimiento el 25/09/2056 *	202	0,11
223	New Residential Mortgage Loan Trust 2017-2, serie 2017 2A, clase B1, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 25/03/2057 *	209	0,11
244	New Residential Mortgage Loan Trust 2018-3, Serie 2018 3A, Clase A1, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 25/05/2058 *	235	0,13
149	New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Serie 2021 NQ2R, Clase A3, 144A, 1,353 %, con vencimiento el 25/10/2058 *	135	0,07
364	OBX 2024-NQM1 Trust, serie 2024 NQM1, clase A1, 144A, 5,928 %, con vencimiento el 25/11/2063	364	0,20
4	Thornburg Mortgage Securities Trust 2007-4, serie 2007 4, clase 1A1, 3,912 %, con vencimiento el 25/09/2037 *	4	–
300	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C15, serie 2018 C15, clase C, 5,140 %, con vencimiento el 15/12/2051 *	267	0,14
289	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, serie 2016 C36, clase A3, 2,807 %, con vencimiento el 15/11/2059	271	0,15
150	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, serie 2016 C36, clase A4, 3,065 %, con vencimiento el 15/11/2059	140	0,08
1.366	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, serie 2016 C36, clase XA, 1,165 %, con vencimiento el 15/11/2059 *	31	0,02
460	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C41, serie 2017 C41, clase B, 4,188 %, con vencimiento el 15/11/2050 *	409	0,22
1.480	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C23, serie 2014 C23, clase XA, 0,543 %, con vencimiento el 15/10/2057 *	1	–
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 82.359 $)		78.783	42,48
Bonos y obligaciones corporativos: 33,45 % (28 de febrero de 2023: 37,25 %)			
Australia: 0,04 % (28 de febrero de 2023: 0,05 %)			
70	BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000 %, con vencimiento el 30/09/2043	67	0,04
Bélgica: 0,38 % (28 de febrero de 2023: 0,45 %)			
33	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,650 %, con vencimiento el 01/02/2026	32	0,02
230	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,000 %, con vencimiento el 13/04/2028	223	0,12
60	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2030	55	0,03
300	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, con vencimiento el 01/06/2040	269	0,14
100	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,439 %, con vencimiento el 06/10/2048	88	0,05
30	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, con vencimiento el 23/01/2049	31	0,02
		698	0,38
Brasil: 0,86 % (28 de febrero de 2023: 0,57 %)			
10	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, con vencimiento el 17/03/2024	10	0,01
50	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, con vencimiento el 05/06/2115	47	0,02
1.100	Suzano Austria GmbH, 6,000 %, con vencimiento el 15/01/2029	1.100	0,59
20	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, con vencimiento el 21/11/2036	21	0,01
390	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, con vencimiento el 10/11/2039	418	0,23
		1.596	0,86
Canadá: 0,47 % (28 de febrero de 2023: 0,83 %)			
130	Bank of Montreal, 1,850 %, con vencimiento el 01/05/2025	125	0,07
30	Bank of Montreal, 3,803 %, con vencimiento el 15/12/2032 *	28	0,02
80	Bank of Nova Scotia/The, 3,450 %, con vencimiento el 11/04/2025	78	0,04
240	Bank of Nova Scotia/The, 1,300 %, con vencimiento el 11/06/2025	228	0,12
70	Bank of Nova Scotia/The, 4,588 %, con vencimiento el 04/05/2037 *	63	0,03
80	Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, con vencimiento el 30/05/2041	81	0,04
40	Barrick PD Australia Finance Pty Ltd, 5,950 %, con vencimiento el 15/10/2039	41	0,02
60	Royal Bank of Canada, 1,150 %, con vencimiento el 10/06/2025	57	0,03
110	Royal Bank of Canada, 3,875 %, con vencimiento el 04/05/2032	100	0,06
80	Royal Bank of Canada, 5,150 %, con vencimiento el 01/02/2034	79	0,04
		880	0,47
China: 0,29 % (28 de febrero de 2023: 0,45 %)			
120	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2,700 %, con vencimiento el 01/05/2025	116	0,06
670	Prosus NV, 144A, 4,027 %, con vencimiento el 03/08/2050	427	0,23
		543	0,29
Colombia: 0,26 % (28 de febrero de 2023: 0,33 %)			
650	Ecopetrol SA, 5,875 %, con vencimiento el 28/05/2045	482	0,26
Francia: 0,54 % (28 de febrero de 2023: 0,73 %)			
400	BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, con vencimiento el 09/06/2026 *	383	0,21
410	BNP Paribas SA, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 13/01/2029 *	407	0,22
200	BNP Paribas SA, 144A, 5,894 %, con vencimiento el 05/12/2034 *	205	0,11
		995	0,54

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
India: 0,10 % (28 de febrero de 2023: 0,14 %)			
270	Reliance Industries Ltd, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 12/01/2052	197	0,10
Irlanda: 0,29 % (28 de febrero de 2023: 0,29 %)			
230	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 2,450 %, con vencimiento el 29/10/2026	212	0,11
360	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,000 %, con vencimiento el 29/10/2028	324	0,18
		536	0,29
Japón: 0,21 % (28 de febrero de 2023: 0,15 %)			
400	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3,837 %, con vencimiento el 17/04/2026 *	392	0,21
Kazajistán: 0,29 % (28 de febrero de 2023: 0,44 %)			
560	KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, con vencimiento el 24/04/2030	544	0,29
Macao: 0,11 % (28 de febrero de 2023: 0,15 %)			
200	Sands China Ltd, 5,125 %, con vencimiento el 08/08/2025	197	0,11
México: 0,67 % (28 de febrero de 2023: 0,62 %)			
400	Comisión Federal de Electricidad, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 26/07/2033	328	0,18
450	Orbia Advance Corp. SAB de CV, 144A, 2,875 %, con vencimiento el 11/05/2031	365	0,19
590	Southern Copper Corp, 5,250 %, con vencimiento el 08/11/2042	555	0,30
		1.248	0,67
Países Bajos: 0,66 % (28 de febrero de 2023: 0,65 %)			
500	Cooperatieve Rabobank UA, 4,375 %, con vencimiento el 04/08/2025	490	0,26
260	Cooperatieve Rabobank UA/NY, 3,375 %, con vencimiento el 21/05/2025	255	0,14
180	Shell International Finance BV, 2,750 %, con vencimiento el 06/04/2030	160	0,09
10	Shell International Finance BV, 4,550 %, con vencimiento el 12/08/2043	9	–
260	Shell International Finance BV, 4,000 %, con vencimiento el 10/05/2046	214	0,12
130	Shell International Finance BV, 3,250 %, con vencimiento el 06/04/2050	93	0,05
		1.221	0,66
Perú: 0,24 % (28 de febrero de 2023: 0,33 %)			
400	Petroleos del Peru SA, 4,750 %, con vencimiento el 19/06/2032	314	0,17
200	Petroleos del Peru SA, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 19/06/2047	137	0,07
		451	0,24
Sudáfrica: 0,26 % (28 de febrero de 2023: 0,21 %)			
490	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 10/04/2027	480	0,26
España: 0,46 % (28 de febrero de 2023: 0,52 %)			
600	Banco Santander SA, 2,746 %, con vencimiento el 28/05/2025	579	0,31
300	Telefónica Emisiones SA, 5,213 %, con vencimiento el 08/03/2047	270	0,15
		849	0,46
Suiza: 1,14 % (28 de febrero de 2023: 1,25 %)			
620	Credit Suisse AG/New York NY, 7,950 %, con vencimiento el 09/01/2025	631	0,34
250	Credit Suisse AG/New York NY, 2,950 %, con vencimiento el 09/04/2025	243	0,13
400	UBS Group AG, 144A, 3,126 %, con vencimiento el 13/08/2030 *	354	0,19
500	UBS Group AG, 144A, 4,194 %, con vencimiento el 01/04/2031 *	460	0,25
500	UBS Group AG, 144A, 3,091 %, con vencimiento el 14/05/2032 *	420	0,23
		2.108	1,14
Taiwán: 0,26 % (28 de febrero de 2023: 0,36 %)			
570	TSMC Arizona Corp, 2,500 %, con vencimiento el 25/10/2031	483	0,26
Emiratos Árabes Unidos: 0,33 % (28 de febrero de 2023: 0,54 %)			
650	DP World Ltd/United Arab Emirates, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 25/09/2048	610	0,33
Reino Unido: 1,13 % (28 de febrero de 2023: 1,57 %)			
400	HSBC Holdings Plc, 2,633 %, con vencimiento el 07/11/2025 *	391	0,21
350	HSBC Holdings Plc, 4,300 %, con vencimiento el 08/03/2026	343	0,18
600	HSBC Holdings Plc, 4,041 %, con vencimiento el 13/03/2028 *	576	0,31
200	Lloyds Banking Group Plc, 4,650 %, con vencimiento el 24/03/2026	196	0,11
400	NatWest Group Plc, 4,269 %, con vencimiento el 22/03/2025 *	400	0,22
200	NatWest Group Plc, 4,892 %, con vencimiento el 18/05/2029 *	195	0,10
		2.101	1,13
Estados Unidos: 24,46 % (28 de febrero de 2023: 25,89 %)			
10	3M Co, 2,375 %, con vencimiento el 26/08/2029	9	–
130	3M Co, 3,700 %, con vencimiento el 15/04/2050	96	0,05
10	Abbott Laboratories, 4,750 %, con vencimiento el 30/11/2036	10	0,01
90	AbbVie Inc, 3,800 %, con vencimiento el 15/03/2025	89	0,05
20	AbbVie Inc, 3,600 %, con vencimiento el 14/05/2025	20	0,01
90	AbbVie Inc, 2,950 %, con vencimiento el 21/11/2026	85	0,05
120	AbbVie Inc, 4,800 %, con vencimiento el 15/03/2029	119	0,06
1.080	AbbVie Inc, 3,200 %, con vencimiento el 21/11/2029	989	0,53
50	AbbVie Inc, 4,950 %, con vencimiento el 15/03/2031	50	0,03
70	AbbVie Inc, 5,050 %, con vencimiento el 15/03/2034	70	0,04
10	AbbVie Inc, 4,875 %, con vencimiento el 14/11/2048	9	–
70	AbbVie Inc, 4,250 %, con vencimiento el 21/11/2049	60	0,03
280	Adobe Inc, 2,300 %, con vencimiento el 01/02/2030	245	0,13
10	Aetna Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2047	8	–
150	Air Lease Corp, 3,375 %, con vencimiento el 01/07/2025	146	0,08
70	Air Lease Corp, 5,300 %, con vencimiento el 01/02/2028	70	0,04
320	Alphabet Inc, 1,100 %, con vencimiento el 15/08/2030	259	0,14
70	Alphabet Inc, 1,900 %, con vencimiento el 15/08/2040	46	0,02
450	Amazon.com Inc, 3,150 %, con vencimiento el 22/08/2027	427	0,23
60	Amazon.com Inc, 3,450 %, con vencimiento el 13/04/2029	57	0,03
50	Amazon.com Inc, 1,500 %, con vencimiento el 03/06/2030	41	0,02
80	Amazon.com Inc, 2,100 %, con vencimiento el 12/05/2031	67	0,04
250	Amazon.com Inc, 3,600 %, con vencimiento el 13/04/2032	231	0,12
80	Amazon.com Inc, 4,950 %, con vencimiento el 05/12/2044	79	0,04
610	Amazon.com Inc, 2,500 %, con vencimiento el 03/06/2050	384	0,21
30	Alphabet Inc, 4,250 %, con vencimiento el 22/08/2057	26	0,01
290	American Express Co, 2,500 %, con vencimiento el 30/07/2024	286	0,15
210	American Express Co, 4,050 %, con vencimiento el 03/05/2029	203	0,11
20	American International Group Inc, 4,750 %, con vencimiento el 01/04/2048	18	0,01
30	American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, con vencimiento el 15/01/2032	25	0,01
11	Amgen Inc, 4,663 %, con vencimiento el 15/06/2051	10	0,01
210	Aon North America Inc, 5,450 %, con vencimiento el 01/03/2034	210	0,11
270	Applied Materials Inc, 1,750 %, con vencimiento el 01/06/2030	225	0,12
70	AT&T Inc, 3,800 %, con vencimiento el 15/02/2027	68	0,04
270	AT&T Inc, 2,300 %, con vencimiento el 01/06/2027	247	0,13
40	AT&T Inc, 2,250 %, con vencimiento el 01/02/2032	32	0,02
50	AT&T Inc, 2,550 %, con vencimiento el 01/12/2033	39	0,02
10	AT&T Inc, 5,350 %, con vencimiento el 01/09/2040	10	0,01
10	AT&T Inc, 5,550 %, con vencimiento el 15/08/2041	10	0,01
37	AT&T Inc, 4,350 %, con vencimiento el 15/06/2045	31	0,02
28	AT&T Inc, 4,500 %, con vencimiento el 09/03/2048	23	0,01
160	AT&T Inc, 3,500 %, con vencimiento el 15/09/2053	110	0,06
76	AT&T Inc, 3,550 %, con vencimiento el 15/09/2055	52	0,03
10	AT&T Inc, 3,800 %, con vencimiento el 01/12/2057	7	–
63	AT&T Inc, 3,650 %, con vencimiento el 15/09/2059	43	0,02
650	Bank of America Corp, 4,000 %, con vencimiento el 22/01/2025	641	0,35
10	Bank of America Corp, 4,450 %, con vencimiento el 03/03/2026	10	0,01
260	Bank of America Corp, 1,319 %, con vencimiento el 19/06/2026 *	246	0,13
160	Bank of America Corp, 4,250 %, con vencimiento el 22/10/2026	157	0,08
90	Bank of America Corp, 3,593 %, con vencimiento el 21/07/2028 *	85	0,05
193	Bank of America Corp, 3,419 %, con vencimiento el 20/12/2028 *	180	0,10
220	Bank of America Corp, 3,970 %, con vencimiento el 05/03/2029 *	209	0,11
200	Bank of America Corp, 3,974 %, con vencimiento el 07/02/2030 *	188	0,10
210	Bank of America Corp, 2,592 %, con vencimiento el 29/04/2031 *	180	0,10
130	Bank of America Corp, 2,572 %, con vencimiento el 20/10/2032 *	107	0,06
960	Bank of America Corp, 2,972 %, con vencimiento el 04/02/2033 *	807	0,43
140	Bank of America Corp, 5,000 %, con vencimiento el 21/01/2044	134	0,07
130	Bank of America Corp, 3,946 %, con vencimiento el 23/01/2049 *	105	0,06

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
180	Bank of America Corp, 4,083 %, con vencimiento el 20/03/2051 *	145	0,08
30	Bank of New York Mellon Corp/The, 1,600 %, con vencimiento el 24/04/2025	29	0,02
113	Becton Dickinson & Co, 4,685 %, con vencimiento el 15/12/2044	101	0,05
110	Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, con vencimiento el 15/01/2049	97	0,05
480	Boston Properties LP, 3,400 %, con vencimiento el 21/06/2029	424	0,23
210	BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, con vencimiento el 06/04/2030	196	0,11
160	BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, con vencimiento el 24/02/2050	107	0,06
19	Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, con vencimiento el 26/07/2029	18	0,01
60	Bristol-Myers Squibb Co, 5,100 %, con vencimiento el 22/02/2031	60	0,03
180	Bristol-Myers Squibb Co, 5,200 %, con vencimiento el 22/02/2034	182	0,10
140	Bristol-Myers Squibb Co, 4,250 %, con vencimiento el 26/10/2049	118	0,06
30	Bristol-Myers Squibb Co, 5,550 %, con vencimiento el 22/02/2054	30	0,02
20	Bristol-Myers Squibb Co, 5,650 %, con vencimiento el 22/02/2064	20	0,01
270	Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, con vencimiento el 15/11/2035	214	0,12
540	Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, con vencimiento el 15/01/2035	447	0,24
10	Carrier Global Corp, 3,577 %, con vencimiento el 05/04/2050	7	–
240	Charles Schwab Corp/The, 5,875 %, con vencimiento el 24/08/2026	244	0,13
50	Charles Schwab Corp/The, 6,136 %, con vencimiento el 24/08/2034 *	52	0,03
180	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, con vencimiento el 23/07/2025	178	0,10
520	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, con vencimiento el 15/03/2028	488	0,26
80	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, con vencimiento el 30/03/2029	77	0,04
80	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,400 %, con vencimiento el 01/04/2033	70	0,04
90	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, con vencimiento el 01/04/2038	78	0,04
90	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, con vencimiento el 23/10/2045	82	0,04
10	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, con vencimiento el 01/05/2047	8	–
360	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, con vencimiento el 01/04/2048	300	0,16
40	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, con vencimiento el 01/07/2049	30	0,02
150	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, con vencimiento el 01/03/2050	109	0,06
60	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,500 %, con vencimiento el 01/04/2063	46	0,02
30	Chevron USA Inc, 3,850 %, con vencimiento el 15/01/2028	29	0,02
480	Cigna Group/The, 4,375 %, con vencimiento el 15/10/2028	466	0,25
20	Cigna Group/The, 4,900 %, con vencimiento el 15/12/2048	18	0,01
30	Cintas Corp. No 2, 3,700 %, con vencimiento el 01/04/2027	29	0,02
60	Cintas Corp. No 2, 4,000 %, con vencimiento el 01/05/2032	56	0,03
190	Citigroup Inc, 6,031 %, con vencimiento el 30/10/2024 *	190	0,10
300	Citigroup Inc, 4,400 %, con vencimiento el 10/06/2025	296	0,16
40	Citigroup Inc, 5,500 %, con vencimiento el 13/09/2025	40	0,02
90	Citigroup Inc, 3,106 %, con vencimiento el 08/04/2026 *	88	0,05
30	Citigroup Inc, 4,300 %, con vencimiento el 20/11/2026	29	0,02
170	Citigroup Inc, 4,450 %, con vencimiento el 29/09/2027	165	0,09
90	Citigroup Inc, 4,658 %, con vencimiento el 24/05/2028 *	88	0,05
150	Citigroup Inc, 3,520 %, con vencimiento el 27/10/2028 *	141	0,08
200	Citigroup Inc, 3,980 %, con vencimiento el 20/03/2030 *	188	0,10
220	Citigroup Inc, 4,412 %, con vencimiento el 31/03/2031 *	208	0,11
220	Citigroup Inc, 2,572 %, con vencimiento el 03/06/2031 *	186	0,10
530	Citigroup Inc, 3,785 %, con vencimiento el 17/03/2033 *	469	0,25
170	Citigroup Inc, 4,910 %, con vencimiento el 24/05/2033 *	163	0,09
90	Citigroup Inc, 8,125 %, con vencimiento el 15/07/2039	114	0,06
77	Citigroup Inc, 4,650 %, con vencimiento el 30/07/2045	69	0,04
10	Citigroup Inc, 4,750 %, con vencimiento el 18/05/2046	9	–
110	Coca-Cola Co/The, 2,500 %, con vencimiento el 01/06/2040	79	0,04
260	Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,036 %, con vencimiento el 15/11/2033	267	0,14
30	Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,544 %, con vencimiento el 15/11/2053	32	0,02
120	Comcast Corp, 3,300 %, con vencimiento el 01/04/2027	115	0,06
100	Comcast Corp, 4,150 %, con vencimiento el 15/10/2028	97	0,05
80	Comcast Corp, 3,400 %, con vencimiento el 01/04/2030	73	0,04
130	Comcast Corp, 4,250 %, con vencimiento el 15/10/2030	124	0,07
361	Comcast Corp, 7,050 %, con vencimiento el 15/03/2033	406	0,22
80	Comcast Corp, 3,900 %, con vencimiento el 01/03/2038	69	0,04
10	Comcast Corp, 3,250 %, con vencimiento el 01/11/2039	8	–
40	Comcast Corp, 3,750 %, con vencimiento el 01/04/2040	33	0,02
20	Comcast Corp, 4,000 %, con vencimiento el 15/08/2047	16	0,01
20	Comcast Corp, 3,969 %, con vencimiento el 01/11/2047	16	0,01
20	Comcast Corp, 4,000 %, con vencimiento el 01/03/2048	16	0,01
10	Comcast Corp, 3,999 %, con vencimiento el 01/11/2049	8	–
90	Comcast Corp, 2,800 %, con vencimiento el 15/01/2051	56	0,03
291	Comcast Corp, 2,887 %, con vencimiento el 01/11/2051	184	0,10
54	Comcast Corp, 2,937 %, con vencimiento el 01/11/2056	33	0,02
10	Comcast Corp, 4,950 %, con vencimiento el 15/10/2058	9	–
20	ConocoPhillips Co, 6,950 %, con vencimiento el 15/04/2029	22	0,01
90	Consolidated Edison Co of New York Inc, Serie 20A, 3,350 %, con vencimiento el 01/04/2030	82	0,04
30	Consolidated Edison Co of New York Inc, serie 20B, 3,950 %, con vencimiento el 01/04/2050	24	0,01
110	Constellation Brands Inc, 4,350 %, con vencimiento el 09/05/2027	108	0,06
170	Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, con vencimiento el 15/01/2028	164	0,09
210	Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/01/2031	206	0,11
140	Costco Wholesale Corp, 1,750 %, con vencimiento el 20/04/2032	112	0,06
170	Coterra Energy Inc, 3,900 %, con vencimiento el 15/05/2027	164	0,09
600	Coterra Energy Inc, 4,375 %, con vencimiento el 15/03/2029	578	0,31
40	CVS Health Corp, 3,625 %, con vencimiento el 01/04/2027	38	0,02
70	CVS Health Corp, 4,300 %, con vencimiento el 25/03/2028	68	0,04
220	CVS Health Corp, 3,750 %, con vencimiento el 01/04/2030	203	0,11
20	CVS Health Corp, 1,875 %, con vencimiento el 28/02/2031	16	0,01
90	CVS Health Corp, 2,125 %, con vencimiento el 15/09/2031	73	0,04
380	CVS Health Corp, 4,780 %, con vencimiento el 25/03/2038	346	0,19
40	CVS Health Corp, 4,125 %, con vencimiento el 01/04/2040	33	0,02
40	CVS Health Corp, 5,125 %, con vencimiento el 20/07/2045	36	0,02
220	CVS Health Corp, 5,050 %, con vencimiento el 25/03/2048	196	0,11
3	CVS Pass-Through Trust, 5,880 %, con vencimiento el 10/01/2028	3	–
50	Deere & Co, 3,750 %, con vencimiento el 15/04/2050	41	0,02
264	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 20/10/2025	261	0,14
190	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 20/10/2028	186	0,10
160	Devon Energy Corp, 5,850 %, con vencimiento el 15/12/2025	161	0,09
18	Devon Energy Corp, 5,250 %, con vencimiento el 15/10/2027	18	0,01
30	Devon Energy Corp, 4,500 %, con vencimiento el 15/01/2030	29	0,02
40	Devon Energy Corp, 5,600 %, con vencimiento el 15/07/2041	38	0,02
70	Devon Energy Corp, 4,750 %, con vencimiento el 15/05/2042	59	0,03
300	Devon Energy Corp, 5,000 %, con vencimiento el 15/06/2045	260	0,14
260	Diamondback Energy Inc, 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2029	239	0,13
30	Diamondback Energy Inc, 3,125 %, con vencimiento el 24/03/2031	26	0,01
70	Eaton Corp, 4,150 %, con vencimiento el 02/11/2042	61	0,03

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
60	Elevance Health Inc, 4,100 %, con vencimiento el 15/05/2032	55	0,03
160	Eli Lilly & Co, 4,700 %, con vencimiento el 09/02/2034	158	0,09
20	Eli Lilly & Co, 5,000 %, con vencimiento el 09/02/2054	20	0,01
140	Eli Lilly & Co, 5,100 %, con vencimiento el 09/02/2064	138	0,07
340	Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, con vencimiento el 16/10/2028	328	0,18
160	Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, con vencimiento el 31/01/2030	142	0,08
350	Enterprise Products Operating LLC, 4,850 %, con vencimiento el 31/01/2034	341	0,18
20	Enterprise Products Operating LLC, 7,550 %, con vencimiento el 15/04/2038	24	0,01
60	Enterprise Products Operating LLC, 5,700 %, con vencimiento el 15/02/2042	61	0,03
20	Enterprise Products Operating LLC, 4,850 %, con vencimiento el 15/03/2044	18	0,01
20	Enterprise Products Operating LLC, 3,700 %, con vencimiento el 31/01/2051	15	0,01
10	Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, con vencimiento el 31/01/2060	8	–
30	Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, con vencimiento el 15/02/2078 *	28	0,01
130	EOG Resources Inc, 4,375 %, con vencimiento el 15/04/2030	126	0,07
350	EOG Resources Inc, 3,900 %, con vencimiento el 01/04/2035	315	0,17
170	EOG Resources Inc, 4,950 %, con vencimiento el 15/04/2050	159	0,09
140	EQT Corp, 7,000 %, con vencimiento el 01/02/2030	148	0,08
50	FirstEnergy Corp, serie A, 1,600 %, con vencimiento el 15/01/2026	46	0,02
180	FirstEnergy Corp, serie B, 4,150 %, con vencimiento el 15/07/2027	171	0,09
200	FirstEnergy Corp, serie C, 5,100 %, con vencimiento el 15/07/2047	173	0,09
120	Ford Motor Co, 6,100 %, con vencimiento el 19/08/2032	120	0,06
60	Freeport-McMoRan Inc, 5,400 %, con vencimiento el 14/11/2034	58	0,03
30	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, con vencimiento el 15/03/2043	28	0,01
90	General Motors Co, 5,600 %, con vencimiento el 15/10/2032	90	0,05
10	General Motors Co, 6,600 %, con vencimiento el 01/04/2036	11	0,01
10	General Motors Co, 5,150 %, con vencimiento el 01/04/2038	9	–
30	General Motors Co, 6,250 %, con vencimiento el 02/10/2043	30	0,02
10	General Motors Co, 5,950 %, con vencimiento el 01/04/2049	10	0,01
3	Goldman Sachs Capital II, 6,370 %, Perpetuo *	3	–
150	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, con vencimiento el 01/04/2025	147	0,08
70	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250 %, con vencimiento el 21/10/2025	69	0,04
800	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, con vencimiento el 12/02/2026 *	764	0,41
90	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, con vencimiento el 16/11/2026	86	0,05
40	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,615 %, con vencimiento el 15/03/2028 *	38	0,02
130	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,814 %, con vencimiento el 23/04/2029 *	123	0,07
660	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223 %, con vencimiento el 01/05/2029 *	633	0,34
30	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, con vencimiento el 01/02/2041	32	0,02
260	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, con vencimiento el 22/05/2045	248	0,13
10	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750 %, con vencimiento el 21/10/2045	9	–
50	Guardian Life Global Funding, 144A, 1,100 %, con vencimiento el 23/06/2025	47	0,03
30	Home Depot Inc/The, 2,500 %, con vencimiento el 15/04/2027	28	0,01
80	Home Depot Inc/The, 2,700 %, con vencimiento el 15/04/2030	71	0,04
60	Home Depot Inc/The, 3,250 %, con vencimiento el 15/04/2032	53	0,03
240	Home Depot Inc/The, 3,300 %, con vencimiento el 15/04/2040	188	0,10
20	Home Depot Inc/The, 3,900 %, con vencimiento el 15/06/2047	16	0,01
60	Home Depot Inc/The, 3,350 %, con vencimiento el 15/04/2050	43	0,02
20	Humana Inc, 4,500 %, con vencimiento el 01/04/2025	20	0,01
110	Humana Inc, 3,950 %, con vencimiento el 15/03/2027	106	0,06
150	Humana Inc, 3,700 %, con vencimiento el 23/03/2029	140	0,08
30	Humana Inc, 2,150 %, con vencimiento el 03/02/2032	24	0,01
50	Intel Corp, 5,125 %, con vencimiento el 10/02/2030	50	0,03
30	Intel Corp, 5,200 %, con vencimiento el 10/02/2033	30	0,02
180	Intel Corp, 4,750 %, con vencimiento el 25/03/2050	161	0,09
20	Intel Corp, 3,050 %, con vencimiento el 12/08/2051	13	0,01
420	Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA, 1,750 %, con vencimiento el 15/09/2030	343	0,19
520	JPMorgan Chase & Co, 2,083 %, con vencimiento el 22/04/2026 *	500	0,27
70	JPMorgan Chase & Co, 4,125 %, con vencimiento el 15/12/2026	68	0,04
100	JPMorgan Chase & Co, 4,250 %, con vencimiento el 01/10/2027	98	0,05
130	JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, con vencimiento el 23/07/2029 *	125	0,07
110	JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, con vencimiento el 05/12/2029 *	106	0,06
210	JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, con vencimiento el 22/04/2031 *	180	0,10
280	JPMorgan Chase & Co, 2,580 %, con vencimiento el 22/04/2032 *	234	0,13
65	JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, con vencimiento el 01/06/2045	61	0,03
50	JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, con vencimiento el 22/04/2051 *	34	0,02
80	Kenvue Inc, 4,900 %, con vencimiento el 22/03/2033	79	0,04
30	Kimberly-Clark Corp, 3,100 %, con vencimiento el 26/03/2030	27	0,01
100	KLA Corp, 4,650 %, con vencimiento el 15/07/2032	98	0,05
340	Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, con vencimiento el 08/08/2024	336	0,18
20	Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, con vencimiento el 25/06/2025	19	0,01
70	Lowe's Cos Inc, 1,700 %, con vencimiento el 15/09/2028	61	0,03
90	Lowe's Cos Inc, 4,500 %, con vencimiento el 15/04/2030	88	0,05
340	Mars Inc, 144A, 3,200 %, con vencimiento el 01/04/2030	309	0,17
250	Mastercard Inc, 3,850 %, con vencimiento el 26/03/2050	207	0,11
50	McDonald's Corp, 3,500 %, con vencimiento el 01/07/2027	48	0,03
30	McDonald's Corp, 3,800 %, con vencimiento el 01/04/2028	29	0,02
60	McDonald's Corp, 2,125 %, con vencimiento el 01/03/2030	51	0,03
80	McDonald's Corp, 3,600 %, con vencimiento el 01/07/2030	74	0,04
220	McDonald's Corp, 4,875 %, con vencimiento el 09/12/2045	203	0,11
20	McDonald's Corp, 3,625 %, con vencimiento el 01/09/2049	15	0,01
60	McDonald's Corp, 4,200 %, con vencimiento el 01/04/2050	50	0,03
15	Medtronic Inc, 4,625 %, con vencimiento el 15/03/2045	14	0,01
130	Merck & Co Inc, 1,450 %, con vencimiento el 24/06/2030	106	0,06
305	MetLife Inc, 6,400 %, con vencimiento el 15/12/2036	310	0,17
80	Micron Technology Inc, 5,300 %, con vencimiento el 15/01/2031	79	0,04
50	Micron Technology Inc, 5,875 %, con vencimiento el 09/02/2033	51	0,03
150	Microsoft Corp, 2,921 %, con vencimiento el 17/03/2052	104	0,06
20	Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC, 144A, 4,100 %, con vencimiento el 15/05/2028	19	0,01
130	Mondelez International Inc, 1,500 %, con vencimiento el 04/05/2025	124	0,07
440	Morgan Stanley, serie I, 0,864 %, con vencimiento el 21/10/2025 *	426	0,23
110	Morgan Stanley, 2,188 %, con vencimiento el 28/04/2026 *	106	0,06
160	Morgan Stanley, 3,772 %, con vencimiento el 24/01/2029 *	151	0,08
210	Morgan Stanley, 2,699 %, con vencimiento el 22/01/2031 *	182	0,10
570	Morgan Stanley, 3,622 %, con vencimiento el 01/04/2031 *	518	0,28
110	MPLX LP, 4,000 %, con vencimiento el 15/03/2028	106	0,06
100	MPLX LP, 4,500 %, con vencimiento el 15/04/2038	87	0,05
40	MPLX LP, 5,200 %, con vencimiento el 01/03/2047	36	0,02
60	MPLX LP, 5,200 %, con vencimiento el 01/12/2047	54	0,03
50	MPLX LP, 4,700 %, con vencimiento el 15/04/2048	42	0,02
140	New York Life Global Funding, 144A, 0,950 %, con vencimiento el 24/06/2025	133	0,07
140	NIKE Inc, 2,850 %, con vencimiento el 27/03/2030	126	0,07
60	NIKE Inc, 3,250 %, con vencimiento el 27/03/2040	48	0,03
80	NVIDIA Corp, 3,700 %, con vencimiento el 01/04/2060	63	0,03
50	ONEOK Inc, 5,550 %, con vencimiento el 01/11/2026	50	0,03
60	ONEOK Inc, 5,800 %, con vencimiento el 01/11/2030	61	0,03
110	ONEOK Inc, 6,050 %, con vencimiento el 01/09/2033	113	0,06
180	ONEOK Inc, 6,625 %, con vencimiento el 01/09/2053	194	0,10
210	Oracle Corp, 1,650 %, con vencimiento el 25/03/2026	195	0,11

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
50	Oracle Corp, 4,650 %, con vencimiento el 06/05/2030	49	0,03
260	Oracle Corp, 2,875 %, con vencimiento el 25/03/2031	224	0,12
60	Otis Worldwide Corp, 2,056 %, con vencimiento el 05/04/2025	58	0,03
50	Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, con vencimiento el 01/08/2027	45	0,02
150	Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2031	123	0,07
20	Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, con vencimiento el 01/08/2040	14	0,01
30	Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, con vencimiento el 01/08/2050	20	0,01
60	PayPal Holdings Inc, 4,400 %, con vencimiento el 01/06/2032	58	0,03
40	PepsiCo Inc, 1,625 %, con vencimiento el 01/05/2030	33	0,02
250	Pfizer Inc, 2,625 %, con vencimiento el 01/04/2030	221	0,12
90	Pfizer Inc, 1,700 %, con vencimiento el 28/05/2030	75	0,04
230	Pfizer Inc, 2,550 %, con vencimiento el 28/05/2040	162	0,09
110	Pfizer Inc, 2,700 %, con vencimiento el 28/05/2050	73	0,04
30	Pioneer Natural Resources Co, 1,125 %, con vencimiento el 15/01/2026	28	0,01
100	Pioneer Natural Resources Co, 1,900 %, con vencimiento el 15/08/2030	83	0,04
230	Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, con vencimiento el 15/01/2031	193	0,10
40	PNC Financial Services Group Inc/The, 5,812 %, con vencimiento el 12/06/2026 *	40	0,02
160	PNC Financial Services Group Inc/The, 5,582 %, con vencimiento el 12/06/2029 *	161	0,09
70	Principal Life Global Funding II, 144A, 1,250 %, con vencimiento el 23/06/2025	66	0,04
90	Procter & Gamble Co/The, 3,000 %, con vencimiento el 25/03/2030	82	0,04
460	Prologis LP, 1,250 %, con vencimiento el 15/10/2030	365	0,20
130	Salesforce Inc, 3,700 %, con vencimiento el 11/04/2028	125	0,07
130	Solventum Corp, 144A, 5,400 %, con vencimiento el 01/03/2029	130	0,07
130	Solventum Corp, 144A, 5,450 %, con vencimiento el 13/03/2031	129	0,07
140	Solventum Corp, 144A, 5,600 %, con vencimiento el 23/03/2034	139	0,07
130	Solventum Corp, 144A, 5,900 %, con vencimiento el 30/04/2054	127	0,07
140	Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, con vencimiento el 01/03/2032	159	0,09
30	Targa Resources Corp, 4,950 %, con vencimiento el 15/04/2052	26	0,01
2	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, con vencimiento el 16/12/2039	2	–
230	Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, con vencimiento el 01/03/2030	200	0,11
240	Texas Instruments Inc, 2,250 %, con vencimiento el 04/09/2029	212	0,11
70	Texas Instruments Inc, 1,750 %, con vencimiento el 04/05/2030	59	0,03
70	Texas Instruments Inc, 4,150 %, con vencimiento el 15/05/2048	59	0,03
170	The Vanguard Group Inc, 3,050 %, con vencimiento el 22/08/2050 †∞	107	0,06
30	Time Warner Cable LLC, 6,550 %, con vencimiento el 01/05/2037	28	0,02
100	Time Warner Cable LLC, 5,875 %, con vencimiento el 15/11/2040	86	0,05
100	T-Mobile USA Inc, 3,500 %, con vencimiento el 15/04/2025	98	0,05
20	T-Mobile USA Inc, 3,750 %, con vencimiento el 15/04/2027	19	0,01
380	T-Mobile USA Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/04/2030	353	0,19
80	T-Mobile USA Inc, 2,550 %, con vencimiento el 15/02/2031	67	0,04
80	T-Mobile USA Inc, 2,250 %, con vencimiento el 15/11/2031	65	0,03
70	T-Mobile USA Inc, 5,150 %, con vencimiento el 15/04/2034	69	0,04
110	T-Mobile USA Inc, 3,000 %, con vencimiento el 15/02/2041	80	0,04
30	T-Mobile USA Inc, 3,300 %, con vencimiento el 15/02/2051	21	0,01
320	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, con vencimiento el 01/02/2026	333	0,18
110	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,250 %, con vencimiento el 15/05/2030	99	0,05
190	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,950 %, con vencimiento el 15/05/2050	148	0,08
100	Truist Financial Corp, 6,047 %, con vencimiento el 08/06/2027 *	101	0,05
130	Union Pacific Corp, 2,400 %, con vencimiento el 05/02/2030	113	0,06
230	Union Pacific Corp, 3,750 %, con vencimiento el 05/02/2070	168	0,09
30	UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/12/2028	29	0,02
40	UnitedHealth Group Inc, 4,000 %, con vencimiento el 15/05/2029	39	0,02
100	UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, con vencimiento el 15/05/2030	84	0,05
20	UnitedHealth Group Inc, 2,300 %, con vencimiento el 15/05/2031	17	0,01
50	UnitedHealth Group Inc, 4,200 %, con vencimiento el 15/05/2032	47	0,03
270	UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, con vencimiento el 15/05/2040	195	0,10
50	UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, con vencimiento el 15/03/2043	44	0,02
40	UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, con vencimiento el 15/06/2048	34	0,02
20	UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, con vencimiento el 15/12/2048	18	0,01
50	UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, con vencimiento el 15/08/2049	38	0,02
60	UnitedHealth Group Inc, 2,900 %, con vencimiento el 15/05/2050	40	0,02
60	UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2059	46	0,02
20	UnitedHealth Group Inc, 3,125 %, con vencimiento el 15/05/2060	13	0,01
10	US Bancorp, serie mtn, 2,215 %, con vencimiento el 27/01/2028 *	9	–
100	US Bancorp, 5,775 %, con vencimiento el 12/06/2029 *	101	0,05
90	US Bancorp, 5,836 %, con vencimiento el 12/06/2034 *	91	0,05
300	USAA Capital Corp, 144A, 2,125 %, con vencimiento el 01/05/2030	249	0,13
40	Verizon Communications Inc, 2,625 %, con vencimiento el 15/08/2026	38	0,02
40	Verizon Communications Inc, 4,125 %, con vencimiento el 16/03/2027	39	0,02
100	Verizon Communications Inc, 2,100 %, con vencimiento el 22/03/2028	89	0,05
225	Verizon Communications Inc, 4,329 %, con vencimiento el 21/09/2028	218	0,12
100	Verizon Communications Inc, 3,875 %, con vencimiento el 08/02/2029	95	0,05
100	Verizon Communications Inc, 3,150 %, con vencimiento el 22/03/2030	89	0,05
296	Verizon Communications Inc, 2,550 %, con vencimiento el 21/03/2031	250	0,13
310	Verizon Communications Inc, 4,500 %, con vencimiento el 10/08/2033	293	0,16
60	Verizon Communications Inc, 4,400 %, con vencimiento el 01/11/2034	56	0,03
20	Verizon Communications Inc, 5,250 %, con vencimiento el 16/03/2037	20	0,01
210	Verizon Communications Inc, 2,650 %, con vencimiento el 20/11/2040	145	0,08
30	Verizon Communications Inc, 3,400 %, con vencimiento el 22/03/2041	23	0,01
10	Verizon Communications Inc, 4,862 %, con vencimiento el 21/08/2046	9	–
80	Verizon Communications Inc, 4,000 %, con vencimiento el 22/03/2050	63	0,03
70	Verizon Communications Inc, 5,500 %, con vencimiento el 23/02/2054	69	0,04
70	Visa Inc, 4,300 %, con vencimiento el 14/12/2045	63	0,03
50	Visa Inc, 3,650 %, con vencimiento el 15/09/2047	40	0,02
30	Walmart Inc, 1,800 %, con vencimiento el 22/09/2031	25	0,01
20	Walt Disney Co/The, 6,650 %, con vencimiento el 15/11/2037	23	0,01
60	Warnermedia Holdings Inc, 6,412 %, con vencimiento el 15/03/2026	60	0,03
30	Warnermedia Holdings Inc, 3,755 %, con vencimiento el 15/03/2027	28	0,02
60	Warnermedia Holdings Inc, 4,054 %, con vencimiento el 15/03/2029	56	0,03
200	Warnermedia Holdings Inc, 4,279 %, con vencimiento el 15/03/2032	177	0,10
20	Warnermedia Holdings Inc, 5,050 %, con vencimiento el 15/03/2042	17	0,01
100	Waste Connections Inc, 5,000 %, con vencimiento el 01/03/2034	98	0,05
90	Wells Fargo & Co, 2,188 %, con vencimiento el 30/04/2026 *	86	0,05
50	Wells Fargo & Co, 4,100 %, con vencimiento el 03/06/2026	49	0,03
30	Wells Fargo & Co, 3,000 %, con vencimiento el 23/10/2026	28	0,02
430	Wells Fargo & Co, 4,300 %, con vencimiento el 22/07/2027	418	0,22

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
60	Wells Fargo & Co, 2,393 %, con vencimiento el 02/06/2028 *	55	0,03
10	Wells Fargo & Co, 4,150 %, con vencimiento el 24/01/2029	10	–
100	Wells Fargo & Co, 5,574 %, con vencimiento el 25/07/2029 *	101	0,05
130	Wells Fargo & Co, 2,879 %, con vencimiento el 30/10/2030 *	114	0,06
120	Wells Fargo & Co, 4,478 %, con vencimiento el 04/04/2031 *	114	0,06
220	Wells Fargo & Co, 3,350 %, con vencimiento el 02/03/2033 *	189	0,10
20	Wells Fargo & Co, 4,650 %, con vencimiento el 04/11/2044	17	0,01
50	Wells Fargo & Co, 4,900 %, con vencimiento el 17/11/2045	44	0,02
400	Wells Fargo & Co, 4,400 %, con vencimiento el 14/06/2046	330	0,18
190	Wells Fargo & Co, 4,750 %, con vencimiento el 07/12/2046	164	0,09
940	Wells Fargo & Co, 5,013 %, con vencimiento el 04/04/2051 *	870	0,47
280	Williams Cos Inc/The, 5,150 %, con vencimiento el 15/03/2034	274	0,15
30	Wyeth LLC, 5,950 %, con vencimiento el 01/04/2037	32	0,02
		45.360	24,46
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 66.913 $)		62.038	33,45
Bonos y obligaciones del Estado: 16,36 % (28 de febrero de 2023: 21,89 %)			
Chile: 0,08 % (28 de febrero de 2023: 0,12 %)			
250	Chile Government International Bond, 3,100 %, con vencimiento el 22/01/2061	157	0,08
Colombia: 0,37 % (28 de febrero de 2023: 0,48 %)			
220	Colombia Government International Bond, 3,125 %, con vencimiento el 15/04/2031	174	0,09
260	Colombia Government International Bond, 3,250 %, con vencimiento el 22/04/2032	201	0,11
400	Colombia Government International Bond, 5,625 %, con vencimiento el 26/02/2044	314	0,17
		689	0,37
India: 0,22 % (28 de febrero de 2023: 0,14 %)			
430	Export-Import Bank of India, 3,375 %, con vencimiento el 05/08/2026	411	0,22
Israel: 0,37 % (28 de febrero de 2023: 0,54 %)			
800	Israel Government International Bond, 2,750 %, con vencimiento el 03/07/2050	685	0,37
Kazajistán: 0,10 % (28 de febrero de 2023: 0,14 %)			
200	Kazakhstan Government International Bond, 4,875 %, con vencimiento el 14/10/2044	188	0,10
México: 0,88 % (28 de febrero de 2023: 0,83 %)			
1.580	Mexico Government International Bond, 4,750 %, con vencimiento el 08/03/2044	1.305	0,71
420	Mexico Government International Bond, 4,400 %, con vencimiento el 12/02/2052	317	0,17
		1.622	0,88
Perú: 0,24 % (28 de febrero de 2023: 0,13 %)			
40	Peruvian Government International Bond, 3,550 %, con vencimiento el 10/03/2051	29	0,01
640	Peruvian Government International Bond, 3,600 %, con vencimiento el 15/01/2072	420	0,23
		449	0,24
Corea del Sur: 0,27 % (28 de febrero de 2023: 0,20 %)			
510	Korea Housing Finance Corp, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 24/02/2033	493	0,27
Estados Unidos: 13,69 % (28 de febrero de 2023: 18,58 %)			
620	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 09/05/2024	614	0,33
1.000	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125 %, con vencimiento el 15/01/2033 β	964	0,52
20	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, con vencimiento el 30/04/2024	20	0,01
70	United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, con vencimiento el 31/08/2028	70	0,04
20	United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, con vencimiento el 30/11/2028	20	0,01
40	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, con vencimiento el 30/04/2030	38	0,02
2.670	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, con vencimiento el 31/01/2031	2.627	1,42
1.230	United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, con vencimiento el 28/02/2031	1.229	0,66
170	United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, con vencimiento el 15/05/2042	143	0,08
380	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, con vencimiento el 15/02/2043	348	0,19
1.990	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, con vencimiento el 15/05/2043	1.820	0,98
1.220	United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, con vencimiento el 15/08/2043	1.195	0,65
700	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, con vencimiento el 15/11/2043	721	0,39
30	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 15/02/2044	26	0,01
640	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, con vencimiento el 15/02/2048	498	0,27
460	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, con vencimiento el 15/02/2049	357	0,19
130	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, con vencimiento el 15/05/2049	98	0,05
3.200	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, con vencimiento el 15/02/2050	1.993	1,08
50	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, con vencimiento el 15/08/2050	26	0,01
700	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, con vencimiento el 15/11/2050	393	0,21
230	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, con vencimiento el 15/02/2052	151	0,08
1.590	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, con vencimiento el 15/05/2052	1.198	0,65
3.130	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, con vencimiento el 15/08/2052	2.420	1,31
60	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, con vencimiento el 15/11/2052	56	0,03
1.675	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,625 %, con vencimiento el 15/02/2053	1.465	0,79
5.810	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 15/05/2053	5.085	2,74
990	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2053	948	0,51
390	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, con vencimiento el 15/11/2053	415	0,22
450	United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, con vencimiento el 15/02/2054	442	0,24
		25.380	13,69
Paraguay: 0,14 % (28 de febrero de 2023: 0,53 %)			
220	Uruguay Government International Bond, 7,625 %, con vencimiento el 21/03/2036	265	0,14
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 34.322 $)		30.339	16,36
Organismos de inversión colectiva: 1,68 % (28 de febrero de 2023: 1,32 %)			
3.108	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – clase WA (distribución)	3.108	1,68
Total de organismos de inversión colectiva (coste 3.108 $)		3.108	1,68
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 202.925 $)		190.499	102,72

Contratos (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Opciones compradas: 0,06 % (28 de febrero de 2023: 0,05 %)			
–	CME 3 Month SOFR Futures April 2024 Put 94.75, con vencimiento el 12/04/2024 (Goldman Sachs)	3	–
–	CME 3 Month SOFR Futures December 2024 Put 96.00, con vencimiento el 13/12/2024 (Goldman Sachs)	81	0,05
–	CME 3 Month SOFR Futures March 2024 Call 94.6250, con vencimiento el 15/03/2024 (Goldman Sachs)	3	–
–	CME 3 Month SOFR Futures March 2024 Put 94.50, con vencimiento el 15/03/2024 (Goldman Sachs)	1	–
–	U.S. 10 Year April 2024 Put 109.75, con vencimiento el 22/03/2024 (Goldman Sachs)	5	–
–	U.S. 10 Year May 2024 Call 111.00, con vencimiento el 26/04/2024 (Goldman Sachs)	5	0,01
–	U.S. 2 Year June 2024 Call 103.50, con vencimiento el 24/05/2024 (Goldman Sachs)	2	–
–	U.S. 5 Year April 2024 Call 108.00, con vencimiento el 22/03/2024 (Goldman Sachs)	2	–
–	U.S. 5 Year W1 March 2024 Put 106.50, con vencimiento el 01/03/2024 (Goldman Sachs)	–	–
Total de opciones compradas (coste 107 $)		102	0,06
Swaps de incumplimiento de crédito: 0,25 % (28 febrero de 2023: 0,23 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		462	0,25
Swaps sobre índices: 0,48 % (28 de febrero de 2023: 1,66 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		884	0,48
Futuros: 0,08 % (28 de febrero de 2023: 0,23 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		156	0,08
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		192.103	103,59

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas: (0,40 %) (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
(900)	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 % ±	(740)	(0,40)
Total de valores garantizados por hipotecas (coste (739) $)		(740)	(0,40)
Total de inversiones vendidas en corto a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste (739) $)		(740)	(0,40)

Contratos (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Opciones suscritas: (0,04 %) (28 de febrero de 2023: 0,05 %)			
–	CME 3 Month SOFR Futures December 2024 Call 97.1250, con vencimiento el 13/12/2024 (Goldman Sachs)	(10)	(0,01)
–	CME 3 Month SOFR Futures December 2024 Put 95.50, con vencimiento el 13/12/2024 (Goldman Sachs)	(44)	(0,03)
–	CME 3 Month SOFR Futures March 2024 Call 95.25, con vencimiento el 15/03/2024 (Goldman Sachs)	–	–
–	CME 3 Month SOFR Futures March 2024 Call 96.1250, con vencimiento el 15/03/2024 (Goldman Sachs)	–	–
–	U.S. 10 Year April 2024 Put 108.75, con vencimiento el 22/03/2024 (Goldman Sachs)	(3)	–
–	U.S. 10 Year May 2024 Put 108.00, con vencimiento el 26/04/2024 (Goldman Sachs)	(5)	–
–	U.S. 2 Year June 2024 Call 104.50, con vencimiento el 24/05/2024 (Goldman Sachs)	(1)	–
–	U.S. 5 Year April 2024 Put 105.25, con vencimiento el 22/03/2024 (Goldman Sachs)	(2)	–
–	U.S. Bond April 2024 Call 122.00, con vencimiento el 22/03/2024 (Goldman Sachs)	(5)	–
–	U.S. Bond June 2024 Call 130.00, con vencimiento el 24/05/2024 (Goldman Sachs)	–	–
Total de opciones suscritas (coste (98) $)		(70)	(0,04)
Swaps sobre índices: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(1)	–
Futuros: (0,04 %) (28 de febrero de 2023: (0,14 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(75)	(0,04)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(886)	(0,48)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		191.217	103,11
Excedente de pasivos respecto a otros activos		(5.757)	(3,11)
Patrimonio		185.460 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 29.434.000 USD o el 15,88 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

† 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 29 de febrero de 2024.

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.

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	94,50
Organismos de inversión colectiva	1,57
Instrumentos financieros derivados	0,81
Otros activos	3,12
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)
Goldman Sachs	CDX.NA.IG, 1,000 % – Vender	20 de diciembre de 2028	21.340	$ 437
Goldman Sachs	CDX.NA.IG, 1,000 % – Vender	20 de diciembre de 2033	4.870	25
Apreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): 304 $)				$ 462
Depreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): (44) $)				–
Apreciación neta de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): 260 $)				$ 462

Listado de swaps de inflación

Contraparte	Entidad de referencia	Fecha de vencimiento	Importe teórico (en miles)	Valor (en miles)
Goldman Sachs	Pay Fixed 2,600 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15 de febrero de 2048	954	$ 173
Goldman Sachs	Pay Fixed 3,050 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15 de febrero de 2048	2.107	235
Goldman Sachs	Pay Fixed 3,150 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15 de mayo de 2048	2.725	261
Goldman Sachs	Pay Fixed 3,530 %, Receive Floating USD Sofr Compound	31 de octubre de 2030	3.588	83
Goldman Sachs	Pay Fixed 3,540 %, Receive Floating USD Sofr Compound	31 de octubre de 2030	5.844	132
Goldman Sachs	Pay Fixed 3,870 %, Receive Floating USD Sofr Compound	28 de febrero de 2031	998	(1)
Apreciación latente de swaps sobre índices (28 de febrero de 2023 (en miles): 2.192 $)				$ 884
Depreciación latente de swaps sobre índices (28 de febrero de 2023 (en miles): (2) $)				(1)
Apreciación neta de swaps sobre índices (28 de febrero de 2023 (en miles): 2.190 $)				$ 883

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

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	Goldman Sachs	(32)	$ (7.572)	$ (3)
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2024	Goldman Sachs	49	11.699	(23)
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2025	Goldman Sachs	123	29.608	38
Índice SOFR de 3 meses Marzo 2024	Goldman Sachs	(15)	(3.551)	(4)
U.S. 10 Year Note (CBT) junio de 2024	Goldman Sachs	188	20.762	46
U.S. 10 Year Ultra Note junio 2024	Goldman Sachs	(21)	(2.397)	(9)
U.S. 2 Year Note (CBT) junio de 2024	Goldman Sachs	68	13.923	(7)
U.S. 5 Year Note (CBT) junio de 2024	Goldman Sachs	48	5.131	7
U.S. Long Bond (CBT) junio 2024	Goldman Sachs	(59)	(7.036)	(29)
U.S. Ultra Bond (CBT) junio 2024	Goldman Sachs	63	8.056	65
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 303 $)				$ 156
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (180) $)				(75)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 123 $)				$ 81

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por activos: 6,14 % (28 de febrero de 2023: 6,51 %)			
1.700	37 Capital CLO II, serie 2022 1A, clase A1A, 144A, 7,314 %, con vencimiento el 15/07/2034 *	1.709	0,21
2.000	AB BSL CLO 4 Ltd, Serie 2023 4A, Clase A, 144A, 7,318 %, con vencimiento el 20/04/2036 *	2.020	0,25
107	Aegis Asset Backed Sec Corp Mort Pass Thr Certs Series 2003-3, serie 2003 3, clase M2, 7,910 %, con vencimiento el 25/01/2034 *	99	0,01
2.745	Ameriquest Mortgage Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Ctfs Ser 2005-R8, serie 2005 R8, clase M4, 6,305 %, con vencimiento el 25/10/2035 *	2.657	0,33
1.000	Apidos CLO XXXVII, serie 2021 37A, clase A, 144A, 6,709 %, con vencimiento el 22/10/2034 *	1.001	0,12
2.390	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust, serie 1996 1, clase B1, 7,875 %, con vencimiento el 10/10/2026	47	0,01
1.500	BCRED MML CLO 2021-1 LLC, serie 2021 1A, clase A, 144A, 7,056 %, con vencimiento el 15/01/2035 *	1.504	0,19
1.000	BCRED MML CLO 2022-1 LLC, serie 2022 1A, clase A1, 144A, 6,968 %, con vencimiento el 20/04/2035 *	996	0,12
1.740	Cayuga Park CLO Ltd, serie 2020 1A, clase AR, 144A, 6,698 %, con vencimiento el 17/07/2034 *	1.744	0,21
2.617	Countrywide Asset-Backed Certificates, serie 2004 3, clase 1A, 5,855 %, con vencimiento el 25/08/2034 *	2.505	0,31
841	DB Master Finance LLC, Serie 2021 1A, Clase A23, 144A, 2,791 %, con vencimiento el 20/11/2051	704	0,09
2.537	Educational Funding Co LLC/The, Serie 2006 1A, Clase A3, 144A, 5,936 %, con vencimiento el 25/04/2033 *	1.549	0,19
2.672	Encore Credit Receivables Trust 2005-3, serie 2005 3, clase M5, 6,395 %, con vencimiento el 25/10/2035 *	2.501	0,31
4.291	Fieldstone Mortgage Investment Trust Serie 2005-2, Serie 2005 2, Clase M3, 6,215 %, con vencimiento el 25/12/2035 *	3.737	0,46
182	Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates FRESR 2017-SR01, serie 2017 SR01, clase A3, 3,089 %, con vencimiento el 25/11/2027	171	0,02
3.083	Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, serie 2021 1GS, clase A, 144A, 2,290 %, con vencimiento el 20/01/2048	2.472	0,30
1.150	Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1, serie 2004 1, clase M1, 6,185 %, con vencimiento el 25/02/2034 *	1.125	0,14
1.987	Magnetite XIV-R Ltd, serie 2015 14RA, clase A2, 144A, 6,680 %, con vencimiento el 18/10/2031 *	1.990	0,24
1.738	Magnolia Finance, 8,552 %, con vencimiento el 09/08/2024	1.735	0,21
3.134	Mosaic Solar Loan Trust 2021-3, serie 2021 3A, clase B, 144A, 1,920 %, con vencimiento el 20/06/2052	2.352	0,29
3.000	National Collegiate II Commutation Trust, serie 2005 AR15, clase AR15, 0,000 %, con vencimiento el 01/06/2045	274	0,03
3.300	National Collegiate Student Loan Trust 2006-3, Serie 2006 3, Clase B, 5,795 %, con vencimiento el 26/01/2032 *	2.746	0,34
2.000	Neuberger Berman Loan Advisers Clo 42 Ltd, serie 2021 42A, clase A, 144A, 6,676 %, con vencimiento el 16/07/2035 *	2.001	0,25
635	Ocean Trails Clo XI, serie 2021 11A, clase A, 144A, 6,799 %, con vencimiento el 20/07/2034 *	637	0,08
2.650	Ocean Trails CLO XIV Ltd, serie 2023 14A, clase A1, 144A, 7,318 %, con vencimiento el 20/01/2035 *	2.670	0,33
1.086	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Serie 2007 FXD1, Clase 1A1, 5,866 %, con vencimiento el 25/01/2037	883	0,11
213	Origen Manufactured Housing Contract Trust 2006-A, serie 2006 A, clase A2, 7,064 %, con vencimiento el 15/10/2037 *	195	0,02
1.806	Renaissance Home Equity Loan Trust 2004-1, serie 2004 1, clase AV3, 6,375 %, con vencimiento el 25/05/2034 *	1.608	0,20
2.344	SLM Private Education Loan Trust 2010-C, serie 2010 C, clase A5, 144A, 10,182 %, con vencimiento el 15/10/2041 *	2.521	0,31
2	SMB Private Education Loan Trust 2015-A, serie 2015 A, clase R, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 15/10/2048	455	0,05
303	SMB Private Education Loan Trust, serie 2020 B, clase A1A, 144A, 1,290 %, con vencimiento el 15/07/2053	276	0,03
1.573	Stonepeak 2021-1 ABS, serie 2021 1A, clase A, 144A, 2,675 %, con vencimiento el 28/02/2033	1.433	0,17
1.002	Structured Asset Investment Loan Trust 2005-HE1, serie 2005 HE1, clase M2, 6,155 %, con vencimiento el 25/07/2035 *	930	0,11
800	Trinitas CLO XXV Ltd, serie 2023 25A, clase A1, 144A, 7,181 %, con vencimiento el 23/01/2037 *	807	0,10
Total de valores garantizados por activos (coste 54.809 $)		50.054	6,14
Valores garantizados por hipotecas: 43,18 % (28 de febrero de 2023: 32,48 %)			
1.000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust, serie 2017 280P, clase A, 144A, 6,502 %, con vencimiento el 15/09/2034 *	979	0,12
52	Alternative Loan Trust 2005-14, serie 2005 14, clase 2A2, 5,935 %, con vencimiento el 25/05/2035 *	38	–
185	Alternative Loan Trust 2005-56, Serie 2005 56, Clase 4A1, 6,055 %, con vencimiento el 25/11/2035 *	162	0,02
37	Alternative Loan Trust 2006-18CB, serie 2006 18CB, clase A6, 6,858 %, con vencimiento el 25/07/2036 *	32	–
3.660	AREIT 2022-CRE7 LLC, serie 2022 CRE7, clase A, 144A, 7,562 %, con vencimiento el 17/06/2039 *	3.669	0,45
991	BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Serie 2016 GG10, Clase AJA, 144A, 5,630 %, con vencimiento el 10/08/2045 *	213	0,03
1.956	Banc of America Funding 2014-R2 Trust, serie 2014 R2, clase 2A2, 144A, 5,649 %, con vencimiento el 26/05/2037 *	1.693	0,21
930	BANK 2017-BNK7, serie 2017 BNK7, clase A5, 3,435 %, con vencimiento el 15/09/2060	876	0,11
11.999	BANK 2017-BNK7, serie 2017 BNK7, clase XA, 0,714 %, con vencimiento el 15/09/2060 *	227	0,03
1.500	BANK 2018-BNK15, serie 2018 BN15, clase B, 4,661 %, con vencimiento el 15/11/2061 *	1.423	0,17
2.570	BBCCRE Trust 2015-GTP, serie 2015 GTP, clase E, 144A, 4,563 %, con vencimiento el 10/08/2033 *	1.780	0,22
240	Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR1, serie 2007 AR1, clase 1A1, 5,595 %, con vencimiento el 25/01/2037 *	202	0,03
560	Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, Serie 2018 B1, Clase A5, 3,666 %, con vencimiento el 15/01/2051 *	520	0,06
430	CD 2017-CD3 Mortgage Trust, serie 2017 CD3, clase A4, 3,631 %, con vencimiento el 10/02/2050	398	0,05
49	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-3, serie 2005 3, clase 1A2, 6,015 %, con vencimiento el 25/04/2035 *	44	0,01
300	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27, serie 2015 GC27, clase AS, 3,571 %, con vencimiento el 10/02/2048	292	0,04
530	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C1, serie 2016 C1, clase A4, 3,209 %, con vencimiento el 10/05/2049	504	0,06
71.889	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C3, Serie 2016 C3, Clase XA, 0,982 %, con vencimiento el 15/11/2049 *	1.480	0,18
8.968	Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-AR6, Serie 2006 AR6, Clase 2A4, 5,875 %, con vencimiento el 25/09/2036 *	2.621	0,32
90	COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, serie 2015 DC1, clase B, 4,035 %, con vencimiento el 10/02/2048 *	83	0,01
1.450	COMM 2015-PC1 Mortgage Trust, Serie 2015 PC1, Clase A5, 3,902 %, con vencimiento el 10/07/2050	1.418	0,17
1.620	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05, serie 2023 R05, clase 1M2, 144A, 8,421 %, con vencimiento el 25/06/2043 *	1.700	0,21
560	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R06, serie 2023 R06, clase 1M2, 144A, 8,022 %, con vencimiento el 25/07/2043 *	579	0,07
500	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, serie 2015 C1, clase AS, 3,791 %, con vencimiento el 15/04/2050 *	483	0,06
1.050	CSMC 2014-USA OA LLC, serie 2014 USA, clase A2, 144A, 3,953 %, con vencimiento el 15/09/2037	927	0,11
140	CSMC 2014-USA OA LLC, serie 2014 USA, clase E, 144A, 4,373 %, con vencimiento el 15/09/2037	75	0,01
5.170	CSMC 2014-USA OA LLC, serie 2014 USA, clase F, 144A, 4,373 %, con vencimiento el 15/09/2037	2.271	0,28
1.960	CSMC 2017-RPL1 Trust, serie 2017 RPL1, clase M2, 144A, 2,969 %, con vencimiento el 25/07/2057 *	1.474	0,18
2.230	CSMC 2021-NQM8, Serie 2021 NQM8, Clase A1, 144A, 1,841 %, con vencimiento el 25/10/2066 *	1.911	0,23
600	CSMC Trust 2017-CHOP, serie 2017 CHOP, clase G, 144A, 10,794 %, con vencimiento el 15/07/2032 *	517	0,06
1.680	DBCG 2017-BBG Mortgage Trust, Serie 2017 BBG, Clase A, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/06/2034 *	1.680	0,21
145	Deutsche Mortgage Securities Inc Mortgage Loan Trust Series 2006-PR1, serie 2006 PR1, clase 3AF1, 144A, 5,712 %, con vencimiento el 15/04/2036 *	133	0,02
301	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, serie 2014 C03, clase 1M2, 8,436 %, con vencimiento el 25/07/2024 *	303	0,04
2.554	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, serie 2018 C03, clase 1B1, 9,186 %, con vencimiento el 25/10/2030 *	2.758	0,34
178	Fannie Mae Grantor Trust 2017-T1, serie 2017 T1, clase A, 2,898 %, con vencimiento el 25/06/2027	168	0,02
10	Fannie Mae Interest Strip 390, clase C3, 6,000 %, con vencimiento el 25/07/2038	2	–
5	Fannie Mae Interest Strip 407, clase 22, 5,000 %, con vencimiento el 25/01/2039	1	–
3	Fannie Mae Interest Strip 407, clase 23, 5,000 %, con vencimiento el 25/01/2039 *	1	–
6	Fannie Mae Interest Strip 407, clase 27, 5,500 %, con vencimiento el 25/01/2039 *	1	–

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
5	Fannie Mae Interest Strip 407, clase 34, 5,000 %, con vencimiento el 25/01/2038	1	–
14	Fannie Mae Interest Strip 407, clase 41, 6,000 %, con vencimiento el 25/01/2038	3	–
45	Fannie Mae Interest Strip 409, Clase C13, 3,500 %, con vencimiento el 25/11/2041	7	–
52	Fannie Mae Interest Strip 409, clase C18, 4,000 %, con vencimiento el 25/04/2042	9	–
42	Fannie Mae Interest Strip 409, clase C2, 3,000 %, con vencimiento el 25/04/2027	1	–
50	Fannie Mae Interest Strip 409, clase C22, 4,500 %, con vencimiento el 25/11/2039	9	–
615	Fannie Mae Interest Strip 427, Clase C73, 3,000 %, con vencimiento el 25/12/2048	99	0,01
4.400	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,500 % ±	4.167	0,51
2.000	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 6,000 % ±	2.008	0,25
200	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 6,500 % ±	203	0,03
6	Fannie Mae Pool '745000', 6,000 %, con vencimiento el 01/10/2035	6	–
4	Fannie Mae Pool '843997', 6,871 %, con vencimiento el 01/11/2035 *	4	–
4	Fannie Mae Pool '865915', 7,122 %, con vencimiento el 01/03/2036 *	4	–
327	Fannie Mae Pool '890604', 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2044	317	0,04
109	Fannie Mae Pool '890827', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2037	102	0,01
13	Fannie Mae Pool '995072', 5,500 %, con vencimiento el 01/08/2038	13	–
31	Fannie Mae Pool 'AB9683', 4,000 %, con vencimiento el 01/06/2043	29	–
27	Fannie Mae Pool 'AE0758', 7,000 %, con vencimiento el 01/02/2039	28	–
26	Fannie Mae Pool 'AK8441', 4,000 %, con vencimiento el 01/04/2042	24	–
305	Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2043	278	0,03
29	Fannie Mae Pool 'AL3026', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2042	27	–
22	Fannie Mae Pool 'AL3508', 4,000 %, con vencimiento el 01/04/2043	21	–
15	Fannie Mae Pool 'AL4741', 4,500 %, con vencimiento el 01/01/2044	15	–
63	Fannie Mae Pool 'AL9397', 3,000 %, con vencimiento el 01/10/2046	55	0,01
311	Fannie Mae Pool 'AL9546', 3,500 %, con vencimiento el 01/11/2046	288	0,04
287	Fannie Mae Pool 'AL9631', 3,000 %, con vencimiento el 01/12/2046	251	0,03
79	Fannie Mae Pool 'AM3347', 3,310 %, con vencimiento el 01/05/2033	71	0,01
10	Fannie Mae Pool 'AM8674', 2,810 %, con vencimiento el 01/04/2025	10	–
10	Fannie Mae Pool 'AO2711', 4,000 %, con vencimiento el 01/05/2042	9	–
18	Fannie Mae Pool 'AO6086', 4,000 %, con vencimiento el 01/06/2042	17	–
8	Fannie Mae Pool 'AO9859', 4,000 %, con vencimiento el 01/07/2042	8	–
14	Fannie Mae Pool 'AP0692', 4,000 %, con vencimiento el 01/07/2042	13	–
15	Fannie Mae Pool 'AP2530', 4,000 %, con vencimiento el 01/08/2042	14	–
46	Fannie Mae Pool 'AP4710', 3,500 %, con vencimiento el 01/08/2042	42	0,01
213	Fannie Mae Pool 'AP4781', 3,000 %, con vencimiento el 01/09/2042	190	0,02
22	Fannie Mae Pool 'AP4903', 4,000 %, con vencimiento el 01/09/2042	21	–
53	Fannie Mae Pool 'AP7399', 4,000 %, con vencimiento el 01/09/2042	49	0,01
13	Fannie Mae Pool 'AP9229', 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2042	13	–
53	Fannie Mae Pool 'AP9766', 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2042	50	0,01
48	Fannie Mae Pool 'AP9862', 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2042	45	0,01
16	Fannie Mae Pool 'AQ0100', 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2042	15	–
52	Fannie Mae Pool 'AQ1641', 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2042	49	0,01
16	Fannie Mae Pool 'AQ3599', 4,000 %, con vencimiento el 01/11/2042	15	–
20	Fannie Mae Pool 'AQ4078', 4,000 %, con vencimiento el 01/06/2043	19	–
14	Fannie Mae Pool 'AQ4080', 4,000 %, con vencimiento el 01/06/2043	13	–
26	Fannie Mae Pool 'AQ4555', 4,000 %, con vencimiento el 01/12/2042	25	–
22	Fannie Mae Pool 'AQ5137', 4,000 %, con vencimiento el 01/11/2042	20	–
39	Fannie Mae Pool 'AQ7003', 4,000 %, con vencimiento el 01/12/2042	37	–
50	Fannie Mae Pool 'AQ7082', 4,000 %, con vencimiento el 01/01/2043	47	0,01
105	Fannie Mae Pool 'AR7399', 3,000 %, con vencimiento el 01/06/2043	93	0,01
251	Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, con vencimiento el 01/07/2043	223	0,03
19	Fannie Mae Pool 'AS0070', 4,000 %, con vencimiento el 01/08/2043	18	–
79	Fannie Mae Pool 'AS3253', 4,000 %, con vencimiento el 01/09/2044	75	0,01
21	Fannie Mae Pool 'AS4271', 4,500 %, con vencimiento el 01/01/2045	20	–
36	Fannie Mae Pool 'AS4347', 4,000 %, con vencimiento el 01/01/2045	34	–
95	Fannie Mae Pool 'AS6340', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2045	87	0,01
78	Fannie Mae Pool 'AS6541', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2046	71	0,01
63	Fannie Mae Pool 'AS6562', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2046	57	0,01
55	Fannie Mae Pool 'AS7844', 3,000 %, con vencimiento el 01/09/2046	48	0,01
183	Fannie Mae Pool 'AS8623', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2047	160	0,02
117	Fannie Mae Pool 'AS8740', 3,500 %, con vencimiento el 01/02/2037	110	0,01
697	Fannie Mae Pool 'AS8745', 3,000 %, con vencimiento el 01/02/2047	610	0,08
15	Fannie Mae Pool 'AT7208', 4,000 %, con vencimiento el 01/06/2043	14	–
23	Fannie Mae Pool 'AT8394', 4,000 %, con vencimiento el 01/06/2043	22	–
61	Fannie Mae Pool 'AT9637', 4,000 %, con vencimiento el 01/07/2043	57	0,01
47	Fannie Mae Pool 'AT9653', 4,000 %, con vencimiento el 01/07/2043	44	0,01
36	Fannie Mae Pool 'AT9657', 4,000 %, con vencimiento el 01/07/2043	34	–
240	Fannie Mae Pool 'AU6735', 3,000 %, con vencimiento el 01/10/2043	213	0,03
31	Fannie Mae Pool 'BC1509', 3,000 %, con vencimiento el 01/08/2046	27	–
87	Fannie Mae Pool 'BC2817', 3,000 %, con vencimiento el 01/09/2046	76	0,01
210	Fannie Mae Pool 'BC9077', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2046	190	0,02
553	Fannie Mae Pool 'BD2455', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2047	484	0,06
224	Fannie Mae Pool 'BD8104', 3,000 %, con vencimiento el 01/10/2046	195	0,02
752	Fannie Mae Pool 'BF0104', 4,000 %, con vencimiento el 01/02/2056	714	0,09
532	Fannie Mae Pool 'BF0163', 5,000 %, con vencimiento el 01/11/2046	525	0,06
445	Fannie Mae Pool 'BF0183', 4,000 %, con vencimiento el 01/01/2057	412	0,05
759	Fannie Mae Pool 'BF0191', 4,000 %, con vencimiento el 01/06/2057	707	0,09
653	Fannie Mae Pool 'BF0222', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2057	624	0,08
35	Fannie Mae Pool 'BF0301', 4,500 %, con vencimiento el 01/08/2058	33	–
249	Fannie Mae Pool 'BF0338', 4,500 %, con vencimiento el 01/01/2059	236	0,03
4.739	Fannie Mae Pool 'BF0646', 2,500 %, con vencimiento el 01/06/2062	3.772	0,46
68	Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000 %, con vencimiento el 01/12/2037	62	0,01
628	Fannie Mae Pool 'BK7700', 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2048	607	0,07
646	Fannie Mae Pool 'BM1565', 3,000 %, con vencimiento el 01/04/2047	566	0,07
37	Fannie Mae Pool 'BM3799', 3,000 %, con vencimiento el 01/08/2047	33	–
234	Fannie Mae Pool 'BM4751', 3,500 %, con vencimiento el 01/03/2043	215	0,03
339	Fannie Mae Pool 'BM4897', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2046	310	0,04
175	Fannie Mae Pool 'BM6623', 2,500 %, con vencimiento el 01/10/2050	141	0,02
180	Fannie Mae Pool 'BM6912', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2052	143	0,02
274	Fannie Mae Pool 'BN1623', 4,500 %, con vencimiento el 01/11/2048	264	0,03
891	Fannie Mae Pool 'BN3898', 4,500 %, con vencimiento el 01/12/2048	860	0,11

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
107	Fannie Mae Pool 'BO1858', 3,000 %, con vencimiento el 01/08/2049	94	0,01
75	Fannie Mae Pool 'BP3484', 2,500 %, con vencimiento el 01/06/2051	63	0,01
502	Fannie Mae Pool 'BQ4926', 2,000 %, con vencimiento el 01/10/2050	398	0,05
233	Fannie Mae Pool 'BQ5876', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2050	195	0,02
309	Fannie Mae Pool 'BR1001', 2,500 %, con vencimiento el 01/05/2051	260	0,03
240	Fannie Mae Pool 'BR1823', 2,000 %, con vencimiento el 01/01/2051	191	0,02
219	Fannie Mae Pool 'BR2641', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	176	0,02
339	Fannie Mae Pool 'BR2643', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	272	0,03
135	Fannie Mae Pool 'BR2644', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	108	0,01
205	Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	167	0,02
353	Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	286	0,04
221	Fannie Mae Pool 'BR3286', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	177	0,02
210	Fannie Mae Pool 'BR4722', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	169	0,02
157	Fannie Mae Pool 'BR4753', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	127	0,02
272	Fannie Mae Pool 'BR4756', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	218	0,03
156	Fannie Mae Pool 'BR5487', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	125	0,02
312	Fannie Mae Pool 'BR5587', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	250	0,03
389	Fannie Mae Pool 'BR5633', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	312	0,04
76	Fannie Mae Pool 'BR6515', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2051	62	0,01
72	Fannie Mae Pool 'BR7744', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2051	58	0,01
216	Fannie Mae Pool 'BR7745', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2051	173	0,02
78	Fannie Mae Pool 'BR8478', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2051	63	0,01
146	Fannie Mae Pool 'BR8518', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2051	117	0,01
100	Fannie Mae Pool 'BS5233', 3,520 %, con vencimiento el 01/06/2032	92	0,01
100	Fannie Mae Pool 'BS5754', 3,900 %, con vencimiento el 01/06/2032	94	0,01
100	Fannie Mae Pool 'BS5808', 3,830 %, con vencimiento el 01/07/2032	93	0,01
99	Fannie Mae Pool 'BS5955', 3,730 %, con vencimiento el 01/06/2032	92	0,01
98	Fannie Mae Pool 'BS5964', 3,670 %, con vencimiento el 01/06/2032	91	0,01
98	Fannie Mae Pool 'BS6023', 3,860 %, con vencimiento el 01/07/2032	92	0,01
99	Fannie Mae Pool 'BS6084', 4,185 %, con vencimiento el 01/07/2032	95	0,01
98	Fannie Mae Pool 'BS6103', 4,060 %, con vencimiento el 01/07/2032	93	0,01
100	Fannie Mae Pool 'BS6130', 4,130 %, con vencimiento el 01/07/2032	95	0,01
98	Fannie Mae Pool 'BS6147', 3,880 %, con vencimiento el 01/07/2032	92	0,01
100	Fannie Mae Pool 'BS6169', 4,110 %, con vencimiento el 01/07/2032	95	0,01
100	Fannie Mae Pool 'BS6188', 4,340 %, con vencimiento el 01/07/2032	97	0,01
99	Fannie Mae Pool 'BS7424', 4,940 %, con vencimiento el 01/12/2032	99	0,01
320	Fannie Mae Pool 'BS7657', 5,080 %, con vencimiento el 01/01/2033	326	0,04
100	Fannie Mae Pool 'BS8995', 4,820 %, con vencimiento el 01/07/2033	100	0,01
100	Fannie Mae Pool 'BS9106', 5,350 %, con vencimiento el 01/07/2033	103	0,01
100	Fannie Mae Pool 'BS9506', 5,490 %, con vencimiento el 01/10/2033	104	0,01
236	Fannie Mae Pool 'BT0846', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2051	197	0,02
188	Fannie Mae Pool 'BT0972', 2,500 %, con vencimiento el 01/05/2051	150	0,02
333	Fannie Mae Pool 'BT3244', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2051	278	0,03
82	Fannie Mae Pool 'BT3270', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	68	0,01
157	Fannie Mae Pool 'BT3303', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	132	0,02
788	Fannie Mae Pool 'BU1421', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2052	683	0,08
336	Fannie Mae Pool 'BU2599', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2052	281	0,03
77	Fannie Mae Pool 'BU5925', 3,000 %, con vencimiento el 01/12/2051	67	0,01
88	Fannie Mae Pool 'BU8750', 5,000 %, con vencimiento el 01/06/2052	86	0,01
332	Fannie Mae Pool 'BV3089', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2052	278	0,03
175	Fannie Mae Pool 'BV3167', 3,500 %, con vencimiento el 01/05/2052	157	0,02
160	Fannie Mae Pool 'BV4142', 3,000 %, con vencimiento el 01/03/2052	140	0,02
595	Fannie Mae Pool 'BV8546', 3,500 %, con vencimiento el 01/05/2052	536	0,07
465	Fannie Mae Pool 'BW9916', 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2052	452	0,06
90	Fannie Mae Pool 'BX0553', 5,500 %, con vencimiento el 01/10/2052	89	0,01
381	Fannie Mae Pool 'BX2186', 4,500 %, con vencimiento el 01/11/2052	361	0,04
290	Fannie Mae Pool 'BX6719', 5,500 %, con vencimiento el 01/02/2053	288	0,04
274	Fannie Mae Pool 'BX9419', 5,000 %, con vencimiento el 01/03/2053	266	0,03
328	Fannie Mae Pool 'CA2047', 4,500 %, con vencimiento el 01/07/2048	316	0,04
560	Fannie Mae Pool 'CA2199', 4,500 %, con vencimiento el 01/08/2048	540	0,07
470	Fannie Mae Pool 'CA2798', 4,500 %, con vencimiento el 01/12/2048	454	0,06
253	Fannie Mae Pool 'CA4819', 4,000 %, con vencimiento el 01/12/2049	236	0,03
430	Fannie Mae Pool 'CA7257', 2,500 %, con vencimiento el 01/10/2050	360	0,04
484	Fannie Mae Pool 'CA7422', 2,000 %, con vencimiento el 01/10/2040	407	0,05
499	Fannie Mae Pool 'CA7531', 3,000 %, con vencimiento el 01/10/2050	436	0,05
480	Fannie Mae Pool 'CA9220', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	380	0,05
75	Fannie Mae Pool 'CA9358', 2,500 %, con vencimiento el 01/03/2041	65	0,01
388	Fannie Mae Pool 'CB0100', 2,500 %, con vencimiento el 01/04/2041	336	0,04
153	Fannie Mae Pool 'CB0101', 2,500 %, con vencimiento el 01/04/2041	132	0,02
77	Fannie Mae Pool 'CB0114', 2,500 %, con vencimiento el 01/04/2041	67	0,01
1.342	Fannie Mae Pool 'CB0470', 2,500 %, con vencimiento el 01/05/2041	1.166	0,14
852	Fannie Mae Pool 'CB1273', 2,000 %, con vencimiento el 01/08/2051	677	0,08
161	Fannie Mae Pool 'CB1301', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	134	0,02
244	Fannie Mae Pool 'CB2115', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2041	212	0,03
3.639	Fannie Mae Pool 'CB2563', 2,000 %, con vencimiento el 01/01/2042	3.037	0,37
2.318	Fannie Mae Pool 'CB2664', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2052	1.989	0,24
711	Fannie Mae Pool 'CB3044', 2,500 %, con vencimiento el 01/03/2052	592	0,07
87	Fannie Mae Pool 'CB3386', 3,500 %, con vencimiento el 01/04/2042	79	0,01
168	Fannie Mae Pool 'CB3880', 5,000 %, con vencimiento el 01/06/2052	165	0,02
694	Fannie Mae Pool 'CB4103', 5,000 %, con vencimiento el 01/07/2052	687	0,08
82	Fannie Mae Pool 'CB4418', 5,500 %, con vencimiento el 01/08/2052	81	0,01
899	Fannie Mae Pool 'CB4788', 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2052	873	0,11
1.028	Fannie Mae Pool 'CB5108', 5,500 %, con vencimiento el 01/11/2052	1.020	0,13
1.340	Fannie Mae Pool 'CB5497', 6,500 %, con vencimiento el 01/01/2053	1.381	0,17
567	Fannie Mae Pool 'CB6322', 5,500 %, con vencimiento el 01/05/2053	564	0,07
2.755	Fannie Mae Pool 'CB6540', 6,000 %, con vencimiento el 01/06/2053	2.798	0,34
475	Fannie Mae Pool 'CB6753', 6,000 %, con vencimiento el 01/07/2053	479	0,06
286	Fannie Mae Pool 'CB7109', 5,500 %, con vencimiento el 01/09/2053	284	0,04
582	Fannie Mae Pool 'CB7114', 5,500 %, con vencimiento el 01/09/2053	577	0,07

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
321	Fannie Mae Pool 'FM0068', 3,500 %, con vencimiento el 01/02/2040	299	0,04
110	Fannie Mae Pool 'FM0071', 3,500 %, con vencimiento el 01/02/2040	102	0,01
116	Fannie Mae Pool 'FM1263', 4,500 %, con vencimiento el 01/07/2049	112	0,01
929	Fannie Mae Pool 'FM1727', 5,000 %, con vencimiento el 01/09/2049	918	0,11
831	Fannie Mae Pool 'FM3049', 4,000 %, con vencimiento el 01/04/2044	781	0,10
824	Fannie Mae Pool 'FM3123', 2,500 %, con vencimiento el 01/03/2038	739	0,09
164	Fannie Mae Pool 'FM3158', 4,000 %, con vencimiento el 01/11/2048	154	0,02
71	Fannie Mae Pool 'FM3542', 4,000 %, con vencimiento el 01/05/2049	67	0,01
251	Fannie Mae Pool 'FM3572', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2049	242	0,03
2.459	Fannie Mae Pool 'FM3773', 3,500 %, con vencimiento el 01/11/2048	2.229	0,27
172	Fannie Mae Pool 'FM5743', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2051	144	0,02
44	Fannie Mae Pool 'FM5754', 3,500 %, con vencimiento el 01/03/2037	42	0,01
419	Fannie Mae Pool 'FM5783', 3,000 %, con vencimiento el 01/06/2038	387	0,05
225	Fannie Mae Pool 'FM5904', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2051	189	0,02
95	Fannie Mae Pool 'FM6015', 3,500 %, con vencimiento el 01/08/2039	89	0,01
371	Fannie Mae Pool 'FM6134', 3,000 %, con vencimiento el 01/03/2040	340	0,04
293	Fannie Mae Pool 'FM6460', 2,500 %, con vencimiento el 01/03/2051	246	0,03
2.331	Fannie Mae Pool 'FM6597', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2041	1.957	0,24
219	Fannie Mae Pool 'FM7100', 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2050	199	0,02
91	Fannie Mae Pool 'FM7141', 4,000 %, con vencimiento el 01/02/2047	86	0,01
393	Fannie Mae Pool 'FM7675', 2,500 %, con vencimiento el 01/06/2051	329	0,04
161	Fannie Mae Pool 'FM7676', 2,500 %, con vencimiento el 01/06/2051	134	0,02
73	Fannie Mae Pool 'FM7727', 2,500 %, con vencimiento el 01/06/2051	62	0,01
759	Fannie Mae Pool 'FM7786', 4,000 %, con vencimiento el 01/01/2049	713	0,09
115	Fannie Mae Pool 'FM7796', 4,000 %, con vencimiento el 01/06/2048	109	0,01
76	Fannie Mae Pool 'FM7869', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2051	63	0,01
314	Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2051	262	0,03
400	Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2051	337	0,04
318	Fannie Mae Pool 'FM8025', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2051	268	0,03
214	Fannie Mae Pool 'FM8166', 3,000 %, con vencimiento el 01/06/2051	188	0,02
1.430	Fannie Mae Pool 'FM8576', 3,000 %, con vencimiento el 01/02/2050	1.250	0,15
969	Fannie Mae Pool 'FM8577', 3,000 %, con vencimiento el 01/08/2051	848	0,10
1.968	Fannie Mae Pool 'FM8786', 2,500 %, con vencimiento el 01/10/2051	1.642	0,20
190	Fannie Mae Pool 'FM8813', 3,500 %, con vencimiento el 01/09/2051	170	0,02
633	Fannie Mae Pool 'FM8864', 2,500 %, con vencimiento el 01/10/2051	529	0,07
153	Fannie Mae Pool 'FM8977', 2,500 %, con vencimiento el 01/09/2051	129	0,02
163	Fannie Mae Pool 'FM9205', 2,500 %, con vencimiento el 01/04/2051	136	0,02
238	Fannie Mae Pool 'FM9365', 3,000 %, con vencimiento el 01/11/2051	208	0,03
803	Fannie Mae Pool 'FM9464', 3,000 %, con vencimiento el 01/11/2051	699	0,09
296	Fannie Mae Pool 'FS0024', 2,500 %, con vencimiento el 01/09/2051	250	0,03
761	Fannie Mae Pool 'FS0028', 2,500 %, con vencimiento el 01/09/2051	635	0,08
412	Fannie Mae Pool 'FS0034', 3,000 %, con vencimiento el 01/12/2051	360	0,04
285	Fannie Mae Pool 'FS0037', 3,000 %, con vencimiento el 01/08/2051	250	0,03
203	Fannie Mae Pool 'FS0067', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2051	195	0,02
574	Fannie Mae Pool 'FS0240', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2052	502	0,06
1.132	Fannie Mae Pool 'FS0349', 2,000 %, con vencimiento el 01/01/2052	902	0,11
77	Fannie Mae Pool 'FS0357', 3,000 %, con vencimiento el 01/12/2051	67	0,01
252	Fannie Mae Pool 'FS0366', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2052	213	0,03
252	Fannie Mae Pool 'FS0408', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2052	221	0,03
928	Fannie Mae Pool 'FS0424', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2052	775	0,10
246	Fannie Mae Pool 'FS0434', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2051	207	0,03
259	Fannie Mae Pool 'FS0551', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2052	216	0,03
258	Fannie Mae Pool 'FS0582', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2052	216	0,03
89	Fannie Mae Pool 'FS0612', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2052	71	0,01
330	Fannie Mae Pool 'FS0697', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2042	286	0,04
426	Fannie Mae Pool 'FS1014', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2052	341	0,04
97	Fannie Mae Pool 'FS1015', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2052	77	0,01
3.242	Fannie Mae Pool 'FS1074', 3,000 %, con vencimiento el 01/03/2052	2.823	0,35
332	Fannie Mae Pool 'FS1104', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2051	278	0,03
1.295	Fannie Mae Pool 'FS1112', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2052	1.038	0,13
753	Fannie Mae Pool 'FS1289', 3,000 %, con vencimiento el 01/03/2052	660	0,08
241	Fannie Mae Pool 'FS1403', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2045	214	0,03
330	Fannie Mae Pool 'FS1539', 3,000 %, con vencimiento el 01/11/2048	293	0,04
707	Fannie Mae Pool 'FS1626', 2,500 %, con vencimiento el 01/04/2052	586	0,07
89	Fannie Mae Pool 'FS1628', 2,500 %, con vencimiento el 01/04/2052	75	0,01
85	Fannie Mae Pool 'FS1726', 2,000 %, con vencimiento el 01/09/2041	72	0,01
84	Fannie Mae Pool 'FS2296', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2052	75	0,01
372	Fannie Mae Pool 'FS2496', 4,500 %, con vencimiento el 01/08/2052	353	0,04
90	Fannie Mae Pool 'FS2768', 2,000 %, con vencimiento el 01/01/2052	72	0,01
523	Fannie Mae Pool 'FS3249', 5,000 %, con vencimiento el 01/11/2052	508	0,06
259	Fannie Mae Pool 'FS3411', 6,000 %, con vencimiento el 01/01/2053	262	0,03
382	Fannie Mae Pool 'FS3672', 5,500 %, con vencimiento el 01/02/2053	382	0,05
381	Fannie Mae Pool 'FS3836', 4,500 %, con vencimiento el 01/01/2053	361	0,04
375	Fannie Mae Pool 'FS3941', 5,000 %, con vencimiento el 01/02/2053	365	0,04
379	Fannie Mae Pool 'FS3978', 5,000 %, con vencimiento el 01/01/2053	368	0,05
259	Fannie Mae Pool 'FS4000', 6,000 %, con vencimiento el 01/07/2041	267	0,03
97	Fannie Mae Pool 'FS4136', 5,000 %, con vencimiento el 01/04/2053	94	0,01
1.322	Fannie Mae Pool 'FS4269', 2,000 %, con vencimiento el 01/10/2051	1.061	0,13
751	Fannie Mae Pool 'FS4270', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2052	599	0,07
448	Fannie Mae Pool 'FS4308', 5,000 %, con vencimiento el 01/04/2053	435	0,05
188	Fannie Mae Pool 'FS4314', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2052	150	0,02
182	Fannie Mae Pool 'FS4448', 4,000 %, con vencimiento el 01/12/2044	171	0,02
267	Fannie Mae Pool 'FS4480', 4,500 %, con vencimiento el 01/03/2050	259	0,03
383	Fannie Mae Pool 'FS4524', 5,000 %, con vencimiento el 01/05/2053	372	0,05
295	Fannie Mae Pool 'FS4805', 5,500 %, con vencimiento el 01/05/2053	295	0,04
3.654	Fannie Mae Pool 'FS5059', 3,500 %, con vencimiento el 01/11/2048	3.315	0,41
477	Fannie Mae Pool 'FS5306', 6,000 %, con vencimiento el 01/07/2053	487	0,06
289	Fannie Mae Pool 'FS5647', 5,500 %, con vencimiento el 01/07/2053	288	0,04
491	Fannie Mae Pool 'FS6129', 2,000 %, con vencimiento el 01/06/2042	409	0,05

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
1.069	Fannie Mae Pool 'FS6158', 4,000 %, con vencimiento el 01/07/2052	985	0,12
579	Fannie Mae Pool 'FS6779', 6,500 %, con vencimiento el 01/12/2053	592	0,07
200	Fannie Mae Pool 'FS7170', 2,000 %, con vencimiento el 01/08/2042	167	0,02
8	Fannie Mae Pool 'MA0706', 4,500 %, con vencimiento el 01/04/2031	8	–
33	Fannie Mae Pool 'MA0734', 4,500 %, con vencimiento el 01/05/2031	32	–
9	Fannie Mae Pool 'MA0776', 4,500 %, con vencimiento el 01/06/2031	9	–
14	Fannie Mae Pool 'MA0913', 4,500 %, con vencimiento el 01/11/2031	14	–
15	Fannie Mae Pool 'MA0939', 4,500 %, con vencimiento el 01/12/2031	14	–
60	Fannie Mae Pool 'MA1146', 4,000 %, con vencimiento el 01/08/2042	57	0,01
15	Fannie Mae Pool 'MA1177', 3,500 %, con vencimiento el 01/09/2042	14	–
434	Fannie Mae Pool 'MA1217', 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2042	410	0,05
97	Fannie Mae Pool 'MA1253', 4,000 %, con vencimiento el 01/11/2042	92	0,01
275	Fannie Mae Pool 'MA1283', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2042	251	0,03
186	Fannie Mae Pool 'MA1437', 3,500 %, con vencimiento el 01/05/2043	170	0,02
22	Fannie Mae Pool 'MA1547', 4,000 %, con vencimiento el 01/08/2043	21	–
41	Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2043	40	0,01
34	Fannie Mae Pool 'MA1629', 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2043	33	–
17	Fannie Mae Pool 'MA1664', 4,500 %, con vencimiento el 01/11/2043	16	–
38	Fannie Mae Pool 'MA1711', 4,500 %, con vencimiento el 01/12/2043	37	–
113	Fannie Mae Pool 'MA2110', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2034	107	0,01
77	Fannie Mae Pool 'MA2138', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2035	73	0,01
51	Fannie Mae Pool 'MA2320', 3,000 %, con vencimiento el 01/07/2035	47	0,01
475	Fannie Mae Pool 'MA2523', 3,000 %, con vencimiento el 01/02/2036	439	0,05
361	Fannie Mae Pool 'MA2579', 3,000 %, con vencimiento el 01/04/2036	333	0,04
730	Fannie Mae Pool 'MA2672', 3,000 %, con vencimiento el 01/07/2036	672	0,08
302	Fannie Mae Pool 'MA2707', 3,000 %, con vencimiento el 01/08/2036	278	0,03
1.586	Fannie Mae Pool 'MA2773', 3,000 %, con vencimiento el 01/10/2036	1.457	0,18
788	Fannie Mae Pool 'MA2832', 3,000 %, con vencimiento el 01/12/2036	724	0,09
1.318	Fannie Mae Pool 'MA3210', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2047	1.192	0,15
288	Fannie Mae Pool 'MA4031', 4,500 %, con vencimiento el 01/05/2050	275	0,03
287	Fannie Mae Pool 'MA4177', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2040	249	0,03
2.057	Fannie Mae Pool 'MA4208', 2,000 %, con vencimiento el 01/12/2050	1.628	0,20
991	Fannie Mae Pool 'MA4280', 1,500 %, con vencimiento el 01/03/2051	743	0,09
158	Fannie Mae Pool 'MA4364', 2,000 %, con vencimiento el 01/06/2041	133	0,02
497	Fannie Mae Pool 'MA4474', 2,000 %, con vencimiento el 01/11/2041	415	0,05
169	Fannie Mae Pool 'MA4501', 2,000 %, con vencimiento el 01/12/2041	141	0,02
513	Fannie Mae Pool 'MA4540', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2042	428	0,05
173	Fannie Mae Pool 'MA4570', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2042	144	0,02
255	Fannie Mae Pool 'MA4571', 2,500 %, con vencimiento el 01/03/2042	221	0,03
524	Fannie Mae Pool 'MA4587', 2,500 %, con vencimiento el 01/04/2042	453	0,06
178	Fannie Mae Pool 'MA4606', 2,000 %, con vencimiento el 01/05/2042	149	0,02
88	Fannie Mae Pool 'MA4607', 2,500 %, con vencimiento el 01/05/2042	76	0,01
65	Fannie Mae REMICS, serie 2005 29, clase ZA, 5,500 %, con vencimiento el 25/04/2035	67	0,01
263	Fannie Mae REMICS, serie 2011 59, clase NZ, 5,500 %, con vencimiento el 25/07/2041	268	0,03
69	Fannie Mae REMICS, serie 2012 133, clase CS, 0,714 %, con vencimiento el 25/12/2042 *	7	–
3	Fannie Mae REMICS, serie 2012 28, clase B, 6,500 %, con vencimiento el 25/06/2039	3	–
133	Fannie Mae REMICS, serie 2012 35, clase SC, 1,064 %, con vencimiento el 25/04/2042 *	15	–
35	Fannie Mae REMICS, serie 2012 46, clase BA, 6,000 %, con vencimiento el 25/05/2042	36	–
51	Fannie Mae REMICS, serie 2012 51, clase B, 7,000 %, con vencimiento el 25/05/2042	55	0,01
40	Fannie Mae REMICS, serie 2012 74, clase SA, 1,214 %, con vencimiento el 25/03/2042 *	2	–
135	Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Clase BC, 6,500 %, con vencimiento el 25/07/2042	141	0,02
164	Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Clase CB, 5,500 %, con vencimiento el 25/04/2042	166	0,02
958	Fannie Mae REMICS, serie 2016 23, clase ST, 0,564 %, con vencimiento el 25/11/2045 *	104	0,01
140	Fannie Mae REMICS, serie 2016 61, clase BS, 0,664 %, con vencimiento el 25/09/2046 *	10	–
736	Fannie Mae REMICS, serie 2017 76, clase SB, 0,664 %, con vencimiento el 25/10/2057 *	82	0,01
188	Fannie Mae REMICS, Serie 2017 85, Clase SC, 0,764 %, con vencimiento el 25/11/2047 *	17	–
607	Fannie Mae REMICS, serie 2020 37, clase IM, 4,000 %, con vencimiento el 25/06/2050	122	0,02
646	Fannie Mae REMICS, Serie 2020 47, Clase GZ, 2,000 %, con vencimiento el 25/07/2050	370	0,05
1.700	Fannie Mae REMICS, serie 2020 56, clase AQ, 2,000 %, con vencimiento el 25/08/2050	1.303	0,16
450	Fannie Mae REMICS, serie 2020 56, clase DI, 2,500 %, con vencimiento el 25/08/2050	70	0,01
3.207	Fannie Mae REMICS, serie 2020 57, clase NI, 2,500 %, con vencimiento el 25/08/2050	525	0,06
367	Fannie Mae REMICS, Serie 2020 74, Clase EI, 2,500 %, con vencimiento el 25/10/2050	60	0,01
2.040	Fannie Mae REMICS, Serie 2020 89, Clase DI, 2,500 %, con vencimiento el 25/12/2050	311	0,04
1.287	Fannie Mae REMICS, serie 2020 97, clase AI, 2,000 %, con vencimiento el 25/01/2051	175	0,02
2.214	Fannie Mae REMICS, serie 2021 3, clase QI, 2,500 %, con vencimiento el 25/02/2051	336	0,04
830	Fannie Mae REMICS, serie 2021 52, clase CI, 2,500 %, con vencimiento el 25/12/2047	114	0,01
1.954	Fannie Mae REMICS, serie 2021 69, clase IJ, 2,500 %, con vencimiento el 25/01/2049	264	0,03
666	Fannie Mae REMICS, serie 2021 77, clase WI, 3,000 %, con vencimiento el 25/08/2050	106	0,01
800	Fannie Mae-Aces, serie 2018 M15, clase 1A2, 3,700 %, con vencimiento el 25/01/2036	728	0,09
1.662	Fannie Mae-Aces, serie 2020 M36, clase X1, 1,448 %, con vencimiento el 25/09/2034 *	82	0,01
100	Fannie Mae-Aces, serie 2023 M4, clase A2, 3,768 %, con vencimiento el 25/08/2032 *	93	0,01
56	Freddie Mac Gold Pool 'C91987', 3,000 %, con vencimiento el 01/04/2038	51	0,01
107	Freddie Mac Gold Pool 'G06409', 6,000 %, con vencimiento el 01/11/2039	111	0,01
11	Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500 %, con vencimiento el 01/09/2039	11	–
–	Freddie Mac Gold Pool 'G13888', 5,000 %, con vencimiento el 01/06/2025	–	–
1.186	Freddie Mac Gold Pool 'G60985', 3,000 %, con vencimiento el 01/05/2047	1.040	0,13
748	Freddie Mac Gold Pool 'G67701', 3,000 %, con vencimiento el 01/10/2046	658	0,08
21	Freddie Mac Gold Pool 'Q19135', 4,000 %, con vencimiento el 01/06/2043	20	–
19	Freddie Mac Gold Pool 'Q19254', 4,000 %, con vencimiento el 01/06/2043	18	–
23	Freddie Mac Gold Pool 'Q19611', 4,000 %, con vencimiento el 01/07/2043	22	–
20	Freddie Mac Gold Pool 'Q19615', 4,000 %, con vencimiento el 01/07/2043	20	–
6	Freddie Mac Gold Pool 'Q27298', 4,000 %, con vencimiento el 01/07/2044	6	–
296	Freddie Mac Gold Pool 'Q45560', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2047	259	0,03
731	Freddie Mac Gold Pool 'Q45737', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2047	641	0,08
208	Freddie Mac Gold Pool 'Q45819', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2047	182	0,02
183	Freddie Mac Gold Pool 'Q45827', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2047	160	0,02
73	Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2042	69	0,01
42	Freddie Mac Gold Pool 'U91254', 4,000 %, con vencimiento el 01/04/2043	40	0,01
17	Freddie Mac Gold Pool 'U95137', 4,000 %, con vencimiento el 01/08/2043	16	–
511	Freddie Mac Gold Pool 'U99054', 4,000 %, con vencimiento el 01/06/2043	477	0,06

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
6.365	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K058, Clase X1, 0,908 %, con vencimiento el 25/08/2026 *	115	0,01
8.819	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K128, clase X1, 0,515 %, con vencimiento el 25/03/2031 *	248	0,03
34.809	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K130, clase X1, 1,037 %, con vencimiento el 25/06/2031 *	2.041	0,25
4.688	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K131, clase X1, 0,728 %, con vencimiento el 25/07/2031 *	203	0,03
7.780	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K144, clase X1, 0,325 %, con vencimiento el 25/04/2032 *	183	0,02
10.771	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, serie K 150, clase X1, 0,310 %, con vencimiento el 25/09/2032 *	260	0,03
18.599	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Serie K 157, Clase X1, 0,254 %, con vencimiento el 25/05/2033 *	419	0,05
50	Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 2,107 %, con vencimiento el 01/03/2047 *	47	0,01
1.466	Freddie Mac Non Gold Pool '841076', 3,006 %, con vencimiento el 01/11/2048 *	1.381	0,17
502	Freddie Mac Non Gold Pool '841077', 2,875 %, con vencimiento el 01/11/2047 *	486	0,06
724	Freddie Mac Non Gold Pool '841081', 3,096 %, con vencimiento el 01/02/2050 *	684	0,08
42	Freddie Mac Pool 'QA5770', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2050	37	–
386	Freddie Mac Pool 'QA7256', 3,000 %, con vencimiento el 01/02/2050	334	0,04
360	Freddie Mac Pool 'QB4985', 2,000 %, con vencimiento el 01/11/2050	287	0,04
351	Freddie Mac Pool 'QB5092', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2050	295	0,04
220	Freddie Mac Pool 'QB5093', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2050	184	0,02
216	Freddie Mac Pool 'QB8602', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	175	0,02
269	Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	216	0,03
136	Freddie Mac Pool 'QB8773', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	110	0,01
1.104	Freddie Mac Pool 'QB9087', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	886	0,11
217	Freddie Mac Pool 'QB9482', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	174	0,02
142	Freddie Mac Pool 'QB9484', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	114	0,01
73	Freddie Mac Pool 'QB9485', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	59	0,01
235	Freddie Mac Pool 'QB9961', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	188	0,02
190	Freddie Mac Pool 'QC0160', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	152	0,02
229	Freddie Mac Pool 'QC0161', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	183	0,02
76	Freddie Mac Pool 'QC0885', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2051	62	0,01
138	Freddie Mac Pool 'QC1164', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2051	111	0,01
77	Freddie Mac Pool 'QC2044', 2,500 %, con vencimiento el 01/05/2051	65	0,01
248	Freddie Mac Pool 'QC3690', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2051	208	0,03
168	Freddie Mac Pool 'QC4818', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	140	0,02
80	Freddie Mac Pool 'QC4824', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	67	0,01
1.326	Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	1.110	0,14
171	Freddie Mac Pool 'QC6303', 2,000 %, con vencimiento el 01/09/2051	137	0,02
416	Freddie Mac Pool 'QC6551', 2,500 %, con vencimiento el 01/09/2051	349	0,04
169	Freddie Mac Pool 'QC7127', 2,000 %, con vencimiento el 01/09/2051	135	0,02
258	Freddie Mac Pool 'QC7411', 2,500 %, con vencimiento el 01/09/2051	215	0,03
87	Freddie Mac Pool 'QD5620', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2052	69	0,01
87	Freddie Mac Pool 'QD6142', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2052	73	0,01
261	Freddie Mac Pool 'QD8675', 2,500 %, con vencimiento el 01/03/2052	218	0,03
530	Freddie Mac Pool 'QE0399', 3,000 %, con vencimiento el 01/04/2052	454	0,06
280	Freddie Mac Pool 'QF3213', 4,500 %, con vencimiento el 01/11/2052	265	0,03
279	Freddie Mac Pool 'QF5465', 5,000 %, con vencimiento el 01/12/2052	271	0,03
91	Freddie Mac Pool 'QG2834', 5,000 %, con vencimiento el 01/04/2053	88	0,01
196	Freddie Mac Pool 'QG7311', 5,500 %, con vencimiento el 01/07/2053	196	0,02
72	Freddie Mac Pool 'QK0701', 2,500 %, con vencimiento el 01/04/2041	62	0,01
428	Freddie Mac Pool 'QK1354', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2042	357	0,04
95	Freddie Mac Pool 'QU7914', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2051	76	0,01
680	Freddie Mac Pool 'RA3882', 2,000 %, con vencimiento el 01/11/2050	546	0,07
1.884	Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2050	1.582	0,19
488	Freddie Mac Pool 'RA4142', 2,500 %, con vencimiento el 01/12/2050	410	0,05
572	Freddie Mac Pool 'RA4537', 1,500 %, con vencimiento el 01/02/2051	429	0,05
1.230	Freddie Mac Pool 'RA4703', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	984	0,12
2.778	Freddie Mac Pool 'RA5117', 2,000 %, con vencimiento el 01/05/2051	2.218	0,27
412	Freddie Mac Pool 'RA5373', 2,000 %, con vencimiento el 01/06/2051	329	0,04
171	Freddie Mac Pool 'RA6332', 2,000 %, con vencimiento el 01/11/2051	136	0,02
494	Freddie Mac Pool 'RA6562', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2052	414	0,05
7.144	Freddie Mac Pool 'RA6694', 2,000 %, con vencimiento el 01/01/2052	5.633	0,69
945	Freddie Mac Pool 'RA7186', 4,000 %, con vencimiento el 01/04/2052	878	0,11
816	Freddie Mac Pool 'RA7928', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	774	0,10
759	Freddie Mac Pool 'RA8694', 5,000 %, con vencimiento el 01/04/2053	744	0,09
875	Freddie Mac Pool 'RA8790', 5,000 %, con vencimiento el 01/04/2053	851	0,10
189	Freddie Mac Pool 'RA9079', 6,500 %, con vencimiento el 01/05/2053	195	0,02
184	Freddie Mac Pool 'RA9080', 6,500 %, con vencimiento el 01/05/2053	190	0,02
377	Freddie Mac Pool 'RA9081', 6,500 %, con vencimiento el 01/05/2053	388	0,05
291	Freddie Mac Pool 'RA9437', 5,500 %, con vencimiento el 01/07/2053	288	0,04
60	Freddie Mac Pool 'RB5071', 2,000 %, con vencimiento el 01/09/2040	50	0,01
1.590	Freddie Mac Pool 'RB5084', 1,500 %, con vencimiento el 01/11/2040	1.279	0,16
2.324	Freddie Mac Pool 'RB5110', 1,500 %, con vencimiento el 01/05/2041	1.867	0,23
1.718	Freddie Mac Pool 'RB5117', 1,500 %, con vencimiento el 01/07/2041	1.378	0,17
1.864	Freddie Mac Pool 'RB5125', 2,000 %, con vencimiento el 01/09/2041	1.558	0,19
890	Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, con vencimiento el 01/10/2041	714	0,09
247	Freddie Mac Pool 'RB5131', 2,000 %, con vencimiento el 01/10/2041	206	0,03
119	Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, con vencimiento el 01/11/2041	95	0,01
252	Freddie Mac Pool 'RB5138', 2,000 %, con vencimiento el 01/12/2041	210	0,03
171	Freddie Mac Pool 'RB5141', 2,000 %, con vencimiento el 01/01/2042	143	0,02
517	Freddie Mac Pool 'RB5145', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2042	431	0,05
258	Freddie Mac Pool 'RB5149', 2,500 %, con vencimiento el 01/03/2042	223	0,03
351	Freddie Mac Pool 'RB5153', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2042	293	0,04
964	Freddie Mac Pool 'SC0093', 2,000 %, con vencimiento el 01/10/2040	811	0,10
927	Freddie Mac Pool 'SC0160', 2,000 %, con vencimiento el 01/07/2041	778	0,10
320	Freddie Mac Pool 'SC0188', 2,000 %, con vencimiento el 01/09/2041	268	0,03
568	Freddie Mac Pool 'SC0206', 2,000 %, con vencimiento el 01/11/2041	477	0,06
86	Freddie Mac Pool 'SC0269', 2,000 %, con vencimiento el 01/01/2042	72	0,01
90	Freddie Mac Pool 'SC0310', 2,000 %, con vencimiento el 01/08/2042	76	0,01
271	Freddie Mac Pool 'SC0313', 2,000 %, con vencimiento el 01/01/2042	226	0,03

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
93	Freddie Mac Pool 'SC0345', 2,000 %, con vencimiento el 01/05/2042	77	0,01
1.224	Freddie Mac Pool 'SC0384', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2042	1.026	0,13
1.364	Freddie Mac Pool 'SC0447', 2,000 %, con vencimiento el 01/05/2042	1.138	0,14
293	Freddie Mac Pool 'SC0448', 2,000 %, con vencimiento el 01/08/2042	244	0,03
52	Freddie Mac Pool 'SD0247', 4,000 %, con vencimiento el 01/07/2047	49	0,01
202	Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2051	164	0,02
413	Freddie Mac Pool 'SD0615', 4,500 %, con vencimiento el 01/01/2051	398	0,05
240	Freddie Mac Pool 'SD0618', 3,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	208	0,03
424	Freddie Mac Pool 'SD0745', 2,000 %, con vencimiento el 01/11/2051	339	0,04
335	Freddie Mac Pool 'SD0849', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2052	280	0,03
78	Freddie Mac Pool 'SD1143', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2050	75	0,01
1.557	Freddie Mac Pool 'SD1305', 5,000 %, con vencimiento el 01/07/2052	1.513	0,19
911	Freddie Mac Pool 'SD1749', 2,500 %, con vencimiento el 01/04/2052	758	0,09
621	Freddie Mac Pool 'SD1751', 2,500 %, con vencimiento el 01/10/2051	519	0,06
646	Freddie Mac Pool 'SD1807', 4,500 %, con vencimiento el 01/07/2052	615	0,08
192	Freddie Mac Pool 'SD2138', 5,500 %, con vencimiento el 01/01/2053	192	0,02
284	Freddie Mac Pool 'SD2245', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	282	0,03
723	Freddie Mac Pool 'SD2284', 6,000 %, con vencimiento el 01/12/2052	731	0,09
371	Freddie Mac Pool 'SD2374', 5,000 %, con vencimiento el 01/01/2053	361	0,04
448	Freddie Mac Pool 'SD2395', 5,000 %, con vencimiento el 01/01/2053	435	0,05
451	Freddie Mac Pool 'SD2452', 6,500 %, con vencimiento el 01/02/2053	461	0,06
267	Freddie Mac Pool 'SD2549', 4,000 %, con vencimiento el 01/07/2052	250	0,03
182	Freddie Mac Pool 'SD2588', 4,000 %, con vencimiento el 01/07/2050	172	0,02
652	Freddie Mac Pool 'SD2591', 5,000 %, con vencimiento el 01/03/2053	637	0,08
755	Freddie Mac Pool 'SD2688', 5,500 %, con vencimiento el 01/04/2053	750	0,09
88	Freddie Mac Pool 'SD2715', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2050	84	0,01
471	Freddie Mac Pool 'SD2723', 5,500 %, con vencimiento el 01/03/2053	469	0,06
670	Freddie Mac Pool 'SD2762', 5,500 %, con vencimiento el 01/05/2053	667	0,08
277	Freddie Mac Pool 'SD2763', 5,500 %, con vencimiento el 01/04/2053	275	0,03
177	Freddie Mac Pool 'SD2792', 4,500 %, con vencimiento el 01/03/2047	173	0,02
188	Freddie Mac Pool 'SD2856', 5,500 %, con vencimiento el 01/05/2053	186	0,02
281	Freddie Mac Pool 'SD2866', 4,000 %, con vencimiento el 01/07/2049	264	0,03
466	Freddie Mac Pool 'SD2892', 5,500 %, con vencimiento el 01/05/2053	463	0,06
1.962	Freddie Mac Pool 'SD2919', 5,500 %, con vencimiento el 01/04/2053	1.944	0,24
185	Freddie Mac Pool 'SD2961', 5,000 %, con vencimiento el 01/11/2052	180	0,02
182	Freddie Mac Pool 'SD2981', 6,500 %, con vencimiento el 01/05/2053	186	0,02
376	Freddie Mac Pool 'SD3171', 5,500 %, con vencimiento el 01/06/2053	373	0,05
384	Freddie Mac Pool 'SD3382', 5,000 %, con vencimiento el 01/06/2053	373	0,05
376	Freddie Mac Pool 'SD3432', 6,000 %, con vencimiento el 01/07/2053	382	0,05
670	Freddie Mac Pool 'SD3475', 5,500 %, con vencimiento el 01/08/2053	664	0,08
674	Freddie Mac Pool 'SD3642', 6,000 %, con vencimiento el 01/09/2053	687	0,08
446	Freddie Mac Pool 'SD7509', 3,000 %, con vencimiento el 01/11/2049	389	0,05
1.029	Freddie Mac Pool 'SD7521', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2050	863	0,11
672	Freddie Mac Pool 'SD7525', 2,500 %, con vencimiento el 01/10/2050	564	0,07
1.211	Freddie Mac Pool 'SD7534', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2051	1.017	0,13
5.265	Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2051	4.409	0,54
5.239	Freddie Mac Pool 'SD7554', 2,500 %, con vencimiento el 01/04/2052	4.379	0,54
1.299	Freddie Mac Pool 'SD7560', 4,000 %, con vencimiento el 01/02/2053	1.211	0,15
109	Freddie Mac Pool 'ZA5318', 3,500 %, con vencimiento el 01/03/2048	99	0,01
930	Freddie Mac Pool 'ZA6342', 4,500 %, con vencimiento el 01/03/2049	898	0,11
94	Freddie Mac Pool 'ZI7269', 5,000 %, con vencimiento el 01/03/2038	94	0,01
156	Freddie Mac Pool 'ZM1278', 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2046	142	0,02
44	Freddie Mac Pool 'ZN0480', 3,500 %, con vencimiento el 01/10/2042	40	0,01
3	Freddie Mac Pool 'ZS0823', 5,000 %, con vencimiento el 01/12/2034	3	–
17	Freddie Mac Pool 'ZS3059', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2038	17	–
72	Freddie Mac Pool 'ZS3204', 5,000 %, con vencimiento el 01/06/2041	71	0,01
88	Freddie Mac Pool 'ZS8669', 3,000 %, con vencimiento el 01/09/2032	83	0,01
92	Freddie Mac Pool 'ZS8673', 3,000 %, con vencimiento el 01/10/2032	87	0,01
8	Freddie Mac Pool 'ZS8779', 5,000 %, con vencimiento el 01/07/2025	8	–
508	Freddie Mac Pool 'ZS9316', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2038	478	0,06
221	Freddie Mac Pool 'ZT1107', 3,500 %, con vencimiento el 01/03/2043	202	0,03
21	Freddie Mac Pool 'ZT1159', 3,500 %, con vencimiento el 01/02/2044	19	–
303	Freddie Mac Pool 'ZT1257', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2046	270	0,03
500	Freddie Mac Pool 'ZT1970', 3,500 %, con vencimiento el 01/04/2033	481	0,06
45	Freddie Mac Reference REMIC R007, clase ZA, 6,000 %, con vencimiento el 15/05/2036	47	0,01
31	Freddie Mac REMICS 3621, clase SB, 0,791 %, con vencimiento el 15/01/2040 *	3	–
173	Freddie Mac REMICS 4813, Clase CJ, 3,000 %, con vencimiento el 15/08/2048	149	0,02
2.687	Freddie Mac REMICS 4980, clase KI, 4,500 %, con vencimiento el 25/06/2050	617	0,08
522	Freddie Mac REMICS 5010, clase IK, 2,500 %, con vencimiento el 25/09/2050	78	0,01
1.002	Freddie Mac REMICS 5010, clase JI, 2,500 %, con vencimiento el 25/09/2050	162	0,02
472	Freddie Mac REMICS 5013, clase IN, 2,500 %, con vencimiento el 25/09/2050	74	0,01
811	Freddie Mac REMICS 5018, clase MI, 2,000 %, con vencimiento el 25/10/2050	108	0,01
275	Freddie Mac REMICS 5040, Clase IB, 2,500 %, con vencimiento el 25/11/2050	39	0,01
1.465	Freddie Mac REMICS 5059, Clase IB, 2,500 %, con vencimiento el 25/01/2051	241	0,03
438	Freddie Mac REMICS 5069, clase MI, 2,500 %, con vencimiento el 25/02/2051	63	0,01
1.949	Freddie Mac REMICS 5093, clase IY, 4,500 %, con vencimiento el 25/12/2050	446	0,06
1.434	Freddie Mac REMICS 5115, clase IO, 4,500 %, con vencimiento el 25/10/2049	328	0,04
1.211	Freddie Mac REMICS 5140, clase NI, 2,500 %, con vencimiento el 25/05/2049	170	0,02
735	Freddie Mac REMICS 5159, clase IP, 3,000 %, con vencimiento el 25/11/2051	107	0,01
599	Freddie Mac REMICS 5168, clase CI, 4,000 %, con vencimiento el 25/11/2051	119	0,01
1.200	Freddie Mac REMICS 5224, clase HL, 4,000 %, con vencimiento el 25/04/2052	1.075	0,13
1.300	Freddie Mac STACR Debt Notes 2015-HQ2, serie 2015 HQ2, clase B, 13,386 %, con vencimiento el 25/05/2025 *	1.380	0,17
508	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Serie 2020 DNA3, Clase B1, 144A, 10,536 %, con vencimiento el 25/06/2050 *	561	0,07
1.164	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA6, serie 2020 DNA6, clase M2, 144A, 7,322 %, con vencimiento el 25/12/2050 *	1.179	0,14
950	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Serie 2021 DNA6, Clase B1, 144A, 8,722 %, con vencimiento el 25/10/2041 *	980	0,12
1.131	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2, serie 2022 DNA2, clase M1B, 144A, 7,722 %, con vencimiento el 25/02/2042 *	1.156	0,14
38	Freddie Mac Strips 334, clase S7, 0,661 %, con vencimiento el 15/08/2044 *	4	–
303	Freddie Mac Strips 353, clase S1, 0,561 %, con vencimiento el 15/12/2046 *	30	–
27	Ginnie Mae I Pool '733600', 5,000 %, con vencimiento el 15/04/2040	27	–

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
44	Ginnie Mae I Pool '733627', 5,000 %, con vencimiento el 15/05/2040	44	0,01
47	Ginnie Mae I Pool '783669', 3,000 %, con vencimiento el 15/09/2042	42	0,01
355	Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, con vencimiento el 15/06/2048	331	0,04
66	Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, con vencimiento el 15/09/2042	59	0,01
160	Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, con vencimiento el 15/09/2042	144	0,02
346	Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, con vencimiento el 15/10/2042	311	0,04
223	Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000 %, con vencimiento el 15/10/2042	197	0,02
1	Ginnie Mae I Pool 'AB9205', 3,000 %, con vencimiento el 15/11/2042	1	–
192	Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000 %, con vencimiento el 15/11/2042	170	0,02
15	Ginnie Mae II Pool '4040', 6,500 %, con vencimiento el 20/10/2037	15	–
18	Ginnie Mae II Pool '4617', 4,500 %, con vencimiento el 20/01/2040	18	–
21	Ginnie Mae II Pool '4696', 4,500 %, con vencimiento el 20/05/2040	21	–
71	Ginnie Mae II Pool '4747', 5,000 %, con vencimiento el 20/07/2040	71	0,01
14	Ginnie Mae II Pool '4772', 5,000 %, con vencimiento el 20/08/2040	14	–
9	Ginnie Mae II Pool '4802', 5,000 %, con vencimiento el 20/09/2040	9	–
5	Ginnie Mae II Pool '4871', 6,000 %, con vencimiento el 20/11/2040	5	–
18	Ginnie Mae II Pool '4905', 6,000 %, con vencimiento el 20/12/2040	19	–
3	Ginnie Mae II Pool '4928', 6,000 %, con vencimiento el 20/01/2041	3	–
12	Ginnie Mae II Pool '4961', 6,000 %, con vencimiento el 20/02/2041	12	–
154	Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500 %, con vencimiento el 20/03/2041	151	0,02
4	Ginnie Mae II Pool '783050', 5,000 %, con vencimiento el 20/07/2040	4	–
47	Ginnie Mae II Pool '783368', 4,500 %, con vencimiento el 20/07/2041	46	0,01
99	Ginnie Mae II Pool '784106', 3,500 %, con vencimiento el 20/01/2046	91	0,01
1.085	Ginnie Mae II Pool '784674', 3,500 %, con vencimiento el 20/04/2048	1.002	0,12
77	Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500 %, con vencimiento el 20/10/2049	70	0,01
553	Ginnie Mae II Pool '784894', 3,500 %, con vencimiento el 20/02/2048	502	0,06
412	Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000 %, con vencimiento el 20/01/2050	362	0,04
69	Ginnie Mae II Pool '784985', 3,500 %, con vencimiento el 20/09/2048	63	0,01
723	Ginnie Mae II Pool '785565', 2,500 %, con vencimiento el 20/06/2051	606	0,07
1.194	Ginnie Mae II Pool '785568', 2,500 %, con vencimiento el 20/08/2051	1.001	0,12
2.558	Ginnie Mae II Pool '785657', 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2051	2.143	0,26
896	Ginnie Mae II Pool '785663', 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2051	751	0,09
997	Ginnie Mae II Pool '785667', 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2051	835	0,10
511	Ginnie Mae II Pool '785762', 2,500 %, con vencimiento el 20/11/2051	428	0,05
580	Ginnie Mae II Pool '785789', 2,500 %, con vencimiento el 20/12/2051	486	0,06
862	Ginnie Mae II Pool '785821', 2,500 %, con vencimiento el 20/12/2051	722	0,09
1.290	Ginnie Mae II Pool '785944', 3,000 %, con vencimiento el 20/02/2052	1.135	0,14
324	Ginnie Mae II Pool '786077', 3,000 %, con vencimiento el 20/03/2052	285	0,04
423	Ginnie Mae II Pool '786082', 3,000 %, con vencimiento el 20/11/2051	372	0,05
621	Ginnie Mae II Pool '786095', 3,000 %, con vencimiento el 20/04/2052	530	0,07
251	Ginnie Mae II Pool '786107', 3,000 %, con vencimiento el 20/03/2052	221	0,03
275	Ginnie Mae II Pool '786108', 3,500 %, con vencimiento el 20/03/2052	246	0,03
889	Ginnie Mae II Pool '786134', 3,000 %, con vencimiento el 20/04/2052	762	0,09
623	Ginnie Mae II Pool '786150', 3,000 %, con vencimiento el 20/03/2052	541	0,07
538	Ginnie Mae II Pool '786216', 3,500 %, con vencimiento el 20/06/2052	480	0,06
913	Ginnie Mae II Pool '786335', 4,500 %, con vencimiento el 20/09/2052	877	0,11
374	Ginnie Mae II Pool '786340', 5,000 %, con vencimiento el 20/09/2052	370	0,05
735	Ginnie Mae II Pool '786366', 4,500 %, con vencimiento el 20/08/2052	703	0,09
278	Ginnie Mae II Pool '786429', 4,000 %, con vencimiento el 20/06/2052	260	0,03
651	Ginnie Mae II Pool '786474', 5,000 %, con vencimiento el 20/01/2053	641	0,08
1.238	Ginnie Mae II Pool '786535', 5,500 %, con vencimiento el 20/02/2053	1.242	0,15
289	Ginnie Mae II Pool '786709', 5,000 %, con vencimiento el 20/05/2053	282	0,03
1.324	Ginnie Mae II Pool '786726', 2,000 %, con vencimiento el 20/03/2051	1.052	0,13
99	Ginnie Mae II Pool '786823', 5,500 %, con vencimiento el 20/07/2053	99	0,01
492	Ginnie Mae II Pool '786835', 5,500 %, con vencimiento el 20/08/2053	491	0,06
571	Ginnie Mae II Pool '786843', 3,000 %, con vencimiento el 20/03/2052	497	0,06
1.987	Ginnie Mae II Pool '787228', 6,000 %, con vencimiento el 20/01/2054	2.014	0,25
100	Ginnie Mae II Pool '787259', 2,000 %, con vencimiento el 20/02/2051	80	0,01
745	Ginnie Mae II Pool 'AP6338', 4,000 %, con vencimiento el 20/10/2045	705	0,09
195	Ginnie Mae II Pool 'BC4732', 3,500 %, con vencimiento el 20/10/2047	178	0,02
151	Ginnie Mae II Pool 'BD0384', 3,500 %, con vencimiento el 20/10/2047	138	0,02
83	Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500 %, con vencimiento el 20/02/2050	75	0,01
87	Ginnie Mae II Pool 'BM9734', 4,000 %, con vencimiento el 20/10/2049	82	0,01
68	Ginnie Mae II Pool 'BM9743', 4,000 %, con vencimiento el 20/11/2049	64	0,01
71	Ginnie Mae II Pool 'BS1728', 4,000 %, con vencimiento el 20/01/2050	68	0,01
62	Ginnie Mae II Pool 'BS1742', 4,000 %, con vencimiento el 20/02/2050	59	0,01
310	Ginnie Mae II Pool 'BT0812', 3,000 %, con vencimiento el 20/03/2050	264	0,03
91	Ginnie Mae II Pool 'CI1513', 3,000 %, con vencimiento el 20/03/2052	79	0,01
268	Ginnie Mae II Pool 'CK9592', 4,000 %, con vencimiento el 20/06/2052	251	0,03
167	Ginnie Mae II Pool 'CL5523', 3,000 %, con vencimiento el 20/04/2052	144	0,02
140	Ginnie Mae II Pool 'MA1995', 3,500 %, con vencimiento el 20/06/2044	129	0,02
38	Ginnie Mae II Pool 'MA2678', 3,500 %, con vencimiento el 20/03/2045	35	–
59	Ginnie Mae II Pool 'MA3375', 3,000 %, con vencimiento el 20/01/2046	52	0,01
50	Ginnie Mae II Pool 'MA3521', 3,500 %, con vencimiento el 20/03/2046	45	0,01
225	Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500 %, con vencimiento el 20/04/2046	206	0,03
120	Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500 %, con vencimiento el 20/05/2046	110	0,01
205	Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500 %, con vencimiento el 20/06/2046	188	0,02
124	Ginnie Mae II Pool 'MA3803', 3,500 %, con vencimiento el 20/07/2046	114	0,01
76	Ginnie Mae II Pool 'MA3937', 3,500 %, con vencimiento el 20/09/2046	69	0,01
104	Ginnie Mae II Pool 'MA4068', 3,000 %, con vencimiento el 20/11/2046	92	0,01
79	Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000 %, con vencimiento el 20/02/2047	70	0,01
20	Ginnie Mae II Pool 'MA4381', 3,000 %, con vencimiento el 20/04/2047	17	–
1.317	Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, con vencimiento el 20/06/2047	1.243	0,15
233	Ginnie Mae II Pool 'MA4654', 4,500 %, con vencimiento el 20/08/2047	226	0,03
14	Ginnie Mae II Pool 'MA4836', 3,000 %, con vencimiento el 20/11/2047	12	–
528	Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000 %, con vencimiento el 20/11/2047	498	0,06
150	Ginnie Mae II Pool 'MA4899', 3,000 %, con vencimiento el 20/12/2047	133	0,02
228	Ginnie Mae II Pool 'MA4901', 4,000 %, con vencimiento el 20/12/2047	215	0,03
199	Ginnie Mae II Pool 'MA5020', 4,000 %, con vencimiento el 20/02/2048	188	0,02

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
1.169	Ginnie Mae II Pool 'MA5078', 4,000 %, con vencimiento el 20/03/2048	1.102	0,14
190	Ginnie Mae II Pool 'MA5137', 4,000 %, con vencimiento el 20/04/2048	179	0,02
347	Ginnie Mae II Pool 'MA5138', 4,500 %, con vencimiento el 20/04/2048	336	0,04
107	Ginnie Mae II Pool 'MA5192', 4,000 %, con vencimiento el 20/05/2048	101	0,01
532	Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500 %, con vencimiento el 20/05/2048	515	0,06
90	Ginnie Mae II Pool 'MA5194', 5,000 %, con vencimiento el 20/05/2048	90	0,01
304	Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500 %, con vencimiento el 20/06/2048	294	0,04
131	Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, con vencimiento el 20/07/2048	127	0,02
292	Ginnie Mae II Pool 'MA5399', 4,500 %, con vencimiento el 20/08/2048	283	0,03
262	Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500 %, con vencimiento el 20/10/2048	254	0,03
402	Ginnie Mae II Pool 'MA5530', 5,000 %, con vencimiento el 20/10/2048	399	0,05
156	Ginnie Mae II Pool 'MA5594', 3,500 %, con vencimiento el 20/11/2048	143	0,02
365	Ginnie Mae II Pool 'MA5597', 5,000 %, con vencimiento el 20/11/2048	362	0,04
254	Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500 %, con vencimiento el 20/12/2048	245	0,03
267	Ginnie Mae II Pool 'MA5653', 5,000 %, con vencimiento el 20/12/2048	265	0,03
1.078	Ginnie Mae II Pool 'MA5712', 5,000 %, con vencimiento el 20/01/2049	1.066	0,13
656	Ginnie Mae II Pool 'MA5763', 4,000 %, con vencimiento el 20/02/2049	620	0,08
200	Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500 %, con vencimiento el 20/03/2049	194	0,02
171	Ginnie Mae II Pool 'MA5819', 5,000 %, con vencimiento el 20/03/2049	169	0,02
86	Ginnie Mae II Pool 'MA5877', 4,500 %, con vencimiento el 20/04/2049	83	0,01
225	Ginnie Mae II Pool 'MA5878', 5,000 %, con vencimiento el 20/04/2049	222	0,03
104	Ginnie Mae II Pool 'MA6157', 5,000 %, con vencimiento el 20/09/2049	103	0,01
109	Ginnie Mae II Pool 'MA6287', 5,000 %, con vencimiento el 20/11/2049	109	0,01
270	Ginnie Mae II Pool 'MA6342', 5,000 %, con vencimiento el 20/12/2049	268	0,03
336	Ginnie Mae II Pool 'MA6413', 5,000 %, con vencimiento el 20/01/2050	333	0,04
164	Ginnie Mae II Pool 'MA6603', 5,000 %, con vencimiento el 20/04/2050	163	0,02
121	Ginnie Mae II Pool 'MA6818', 2,000 %, con vencimiento el 20/08/2050	99	0,01
1.041	Ginnie Mae II Pool 'MA6930', 2,000 %, con vencimiento el 20/10/2050	848	0,10
205	Ginnie Mae II Pool 'MA6997', 3,500 %, con vencimiento el 20/11/2050	187	0,02
405	Ginnie Mae II Pool 'MA6999', 4,500 %, con vencimiento el 20/11/2050	387	0,05
1.837	Ginnie Mae II Pool 'MA7051', 2,000 %, con vencimiento el 20/12/2050	1.497	0,18
76	Ginnie Mae II Pool 'MA7056', 4,500 %, con vencimiento el 20/12/2050	74	0,01
2.489	Ginnie Mae II Pool 'MA7135', 2,000 %, con vencimiento el 20/01/2051	2.029	0,25
298	Ginnie Mae II Pool 'MA7136', 2,500 %, con vencimiento el 20/01/2051	253	0,03
5.973	Ginnie Mae II Pool 'MA7192', 2,000 %, con vencimiento el 20/02/2051	4.868	0,60
99	Ginnie Mae II Pool 'MA7194', 3,000 %, con vencimiento el 20/02/2051	88	0,01
1.020	Ginnie Mae II Pool 'MA7368', 3,000 %, con vencimiento el 20/05/2051	895	0,11
619	Ginnie Mae II Pool 'MA7472', 2,500 %, con vencimiento el 20/07/2051	525	0,06
867	Ginnie Mae II Pool 'MA7534', 2,500 %, con vencimiento el 20/08/2051	735	0,09
1.927	Ginnie Mae II Pool 'MA7589', 2,500 %, con vencimiento el 20/09/2051	1.632	0,20
375	Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, con vencimiento el 20/09/2051	329	0,04
831	Ginnie Mae II Pool 'MA8348', 5,000 %, con vencimiento el 20/10/2052	813	0,10
1.028	Ginnie Mae II Pool 'MA8428', 5,000 %, con vencimiento el 20/11/2052	1.005	0,12
734	Ginnie Mae II Pool 'MA8429', 5,500 %, con vencimiento el 20/11/2052	731	0,09
188	Ginnie Mae II Pool 'MA8490', 5,000 %, con vencimiento el 20/12/2052	183	0,02
1.609	Ginnie Mae II Pool 'MA8569', 5,000 %, con vencimiento el 20/01/2053	1.573	0,19
378	Ginnie Mae II Pool 'MA8726', 5,500 %, con vencimiento el 20/03/2053	376	0,05
458	Ginnie Mae II Pool 'MA8796', 3,000 %, con vencimiento el 20/04/2053	404	0,05
1.623	Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2053	1.613	0,20
3.002	Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, con vencimiento el 20/05/2053	2.985	0,37
9.200	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 % ±	8.987	1,10
4.700	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,500 % ±	4.669	0,57
91	Government National Mortgage Association, serie 2009 H01, clase FA, 6,584 %, con vencimiento el 20/11/2059 *	91	0,01
4	Government National Mortgage Association, serie 2010 42, clase BS, 1,046 %, con vencimiento el 20/04/2040 *	–	–
1	Government National Mortgage Association, serie 2010 85, clase HS, 1,216 %, con vencimiento el 20/01/2040 *	–	–
343	Government National Mortgage Association, serie 2010 H11, clase FA, 6,451 %, con vencimiento el 20/06/2060 *	344	0,04
177	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H20, Clase AF, 5,793 %, con vencimiento el 20/10/2060 *	176	0,02
1	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H22, Clase FE, 5,813 %, con vencimiento el 20/05/2059 *	1	–
289	Government National Mortgage Association, serie 2010 H24, clase FA, 5,813 %, con vencimiento el 20/10/2060 *	288	0,04
10	Government National Mortgage Association, serie 2010 H26, clase LF, 5,813 %, con vencimiento el 20/08/2058 *	10	–
98	Government National Mortgage Association, serie 2011 H01, clase AF, 5,913 %, con vencimiento el 20/11/2060 *	97	0,01
20	Government National Mortgage Association, serie 2011 H09, clase AF, 5,963 %, con vencimiento el 20/03/2061 *	20	–
291	Government National Mortgage Association, serie 2013 107, clase AD, 2,834 %, con vencimiento el 16/11/2047 *	258	0,03
4.418	Government National Mortgage Association, serie 2013 50, clase IO, 0,061 %, con vencimiento el 16/10/2048 *	6	–
787	Government National Mortgage Association, serie 2014 169, clase IO, 0,618 %, con vencimiento el 16/10/2056 *	16	–
34	Government National Mortgage Association, serie 2014 17, clase AM, 3,536 %, con vencimiento el 16/06/2048 *	32	–
196	Government National Mortgage Association, serie 2014 176, clase IA, 4,000 %, con vencimiento el 20/11/2044	39	0,01
1.333	Government National Mortgage Association, serie 2014 H20, clase FA, 5,893 %, con vencimiento el 20/10/2064 *	1.327	0,16
435	Government National Mortgage Association, serie 2015 167, clase OI, 4,000 %, con vencimiento el 16/04/2045	83	0,01
666	Government National Mortgage Association, serie 2015 183, clase IO, 0,445 %, con vencimiento el 16/09/2057 *	13	–
381	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, serie 2016 135, clase SB, 0,664 %, con vencimiento el 16/10/2046 *	52	0,01
718	Government National Mortgage Association, serie 2016 21, clase ST, 0,716 %, con vencimiento el 20/02/2046 *	82	0,01
337	Government National Mortgage Association, serie 2016 84, clase IG, 4,500 %, con vencimiento el 16/11/2045	68	0,01
919	Government National Mortgage Association, Serie 2017 111, Clase IO, 0,526 %, con vencimiento el 16/02/2059 *	28	–
803	Government National Mortgage Association, serie 2017 157, clase IO, 0,504 %, con vencimiento el 16/12/2059 *	28	–
823	Government National Mortgage Association, serie 2017 28, clase IO, 0,687 %, con vencimiento el 16/02/2057 *	28	–
490	Government National Mortgage Association, serie 2017 41, clase IO, 0,584 %, con vencimiento el 16/07/2058 *	14	–
98	Government National Mortgage Association, serie 2017 H15, clase KI, 0,835 %, con vencimiento el 20/07/2067 *	5	–
3.897	Government National Mortgage Association, serie 2017 H18, clase BI, 0,048 %, con vencimiento el 20/09/2067 *	168	0,02
50	Government National Mortgage Association, serie 2017 H20, clase IB, 0,252 %, con vencimiento el 20/10/2067 *	2	–
164	Government National Mortgage Association, serie 2018 H06, clase PF, 5,763 %, con vencimiento el 20/02/2068 *	162	0,02
321	Government National Mortgage Association, serie 2018 H07, clase FD, 5,763 %, con vencimiento el 20/05/2068 *	321	0,04
261	Government National Mortgage Association, serie 2019 90, clase AB, 3,000 %, con vencimiento el 20/07/2049	228	0,03
1.448	Government National Mortgage Association, serie 2020 103, clase AD, 1,450 %, con vencimiento el 16/01/2063	1.093	0,13
274	Government National Mortgage Association, serie 2020 123, clase IL, 2,500 %, con vencimiento el 20/08/2050	34	–
876	Government National Mortgage Association, serie 2020 123, clase NI, 2,500 %, con vencimiento el 20/08/2050	116	0,01
427	Government National Mortgage Association, serie 2020 127, clase IN, 2,500 %, con vencimiento el 20/08/2050	57	0,01
375	Government National Mortgage Association, Serie 2020 129, Clase IE, 2,500 %, con vencimiento el 20/09/2050	50	0,01
15.741	Government National Mortgage Association, serie 2020 157, clase IO, 0,935 %, con vencimiento el 16/06/2062 *	972	0,12
233	Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Clase IH, 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	31	–
297	Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Clase VI, 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	42	0,01
1.279	Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Clase YI, 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	166	0,02

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
1.385	Government National Mortgage Association, serie 2020 173, clase MI, 2,500 %, con vencimiento el 20/11/2050	188	0,02
12.083	Government National Mortgage Association, serie 2020 178, clase IO, 1,422 %, con vencimiento el 16/10/2060 *	1.076	0,13
2.781	Government National Mortgage Association, Serie 2020 181, Clase WI, 2,000 %, con vencimiento el 20/12/2050	311	0,04
718	Government National Mortgage Association, Serie 2020 47, Clase MI, 3,500 %, con vencimiento el 20/04/2050	130	0,02
273	Government National Mortgage Association, Serie 2020 47, Clase NI, 3,500 %, con vencimiento el 20/04/2050	50	0,01
787	Government National Mortgage Association, Serie 2020 H09, Clase FL, 6,613 %, con vencimiento el 20/05/2070 *	786	0,10
150	Government National Mortgage Association, serie 2020 H09, clase NF, 6,713 %, con vencimiento el 20/04/2070 *	151	0,02
98	Government National Mortgage Association, Serie 2020 H12, Clase F, 5,963 %, con vencimiento el 20/07/2070 *	96	0,01
372	Government National Mortgage Association, Serie 2020 H13, Clase FA, 5,913 %, con vencimiento el 20/07/2070 *	361	0,04
93	Government National Mortgage Association, serie 2020 H13, clase FC, 5,913 %, con vencimiento el 20/07/2070 *	91	0,01
933	Government National Mortgage Association, Serie 2021 14, Clase AB, 1,340 %, con vencimiento el 16/06/2063	697	0,09
1.814	Government National Mortgage Association, Serie 2021 21, Clase AH, 1,400 %, con vencimiento el 16/06/2063	1.358	0,17
25.223	Government National Mortgage Association, Serie 2021 5, Clase IO, 1,112 %, con vencimiento el 16/01/2061 *	1.948	0,24
1.057	Government National Mortgage Association, serie 2021 77, clase LC, 1,250 %, con vencimiento el 20/07/2050	824	0,10
1.500	Government National Mortgage Association, Serie 2022 139, Clase AL, 4,000 %, con vencimiento el 20/07/2051	1.339	0,16
1.731	Government National Mortgage Association, serie 2022 3, clase IO, 0,640 %, con vencimiento el 16/02/2061 *	85	0,01
200	Government National Mortgage Association, Serie 2022 63, Clase LM, 3,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	166	0,02
8.253	Government National Mortgage Association, Serie 2023 179, Clase IO, 0,611 %, con vencimiento el 16/09/2063 *	339	0,04
3.000	Government National Mortgage Association, Serie 2023 92, Clase AH, 2,000 %, con vencimiento el 16/06/2064	2.309	0,28
2.000	Government National Mortgage Association, Serie 2023 92, Clase IA, 0,611 %, con vencimiento el 16/06/2064 *	125	0,02
2.831	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Clase A, 144A, 7,165 %, con vencimiento el 15/09/2031 *	2.024	0,25
2.145	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Clase B, 144A, 8,365 %, con vencimiento el 15/09/2031 *	730	0,09
242	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20, serie 2014 GC20, clase XA, 0,844 %, con vencimiento el 10/04/2047 *	–	–
14	HarborView Mortgage Loan Trust 2007-7, serie 2007 7, clase 2A1A, 6,435 %, con vencimiento el 25/10/2037 *	13	–
–	Impac Secured Assets Trust 2006-4, serie 2006 4, clase A2B, 5,775 %, con vencimiento el 25/01/2037 *∞	–	–
3.980	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHH, serie 2018 PHH, clase F, 144A, 8,675 %, con vencimiento el 15/06/2035 *†	241	0,03
3.730	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, serie 2020 MKST, clase F, 144A, 8,782 %, con vencimiento el 15/12/2036 *	355	0,04
1.754	JP Morgan Mortgage Trust 2017-5, serie 2017 5, clase A2, 144A, 3,951 %, con vencimiento el 26/10/2048 *	1.718	0,21
169	JP Morgan Mortgage Trust 2018-4, serie 2018 4, clase A1, 144A, 3,500 %, con vencimiento el 25/10/2048 *	147	0,02
160	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C31, serie 2015 C31, clase B, 4,623 %, con vencimiento el 15/08/2048 *	141	0,02
2.736	MF1 2021-FL6 Ltd, Serie 2021 FL6, Clase A, 144A, 6,536 %, con vencimiento el 16/07/2036 *	2.724	0,34
280	MSCG Trust 2015-ALDR, serie 2015 ALDR, clase A2, 144A, 3,462 %, con vencimiento el 07/06/2035 *	253	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	2.621	0,32
316	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, serie 2016 3A, clase A1B, 144A, 3,250 %, con vencimiento el 25/09/2056 *	288	0,04
569	New Residential Mortgage Loan Trust 2017-6, serie 2017 6A, clase A1, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 27/08/2057 *	536	0,07
794	Prime Mortgage Trust 2006-DR1, serie 2006 DR1, clase 2A1, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 25/05/2035	720	0,09
99	Residential Asset Securitization Trust 2005-A15, serie 2005 A15, clase 1A4, 5,750 %, con vencimiento el 25/02/2036	91	0,01
530	SG Commercial Mortgage Securities Trust 2016-C5, serie 2016 C5, clase A3, 2,779 %, con vencimiento el 10/10/2048	504	0,06
2.694	Towd Point Mortgage Trust 2017-5, serie 2017 5, clase B1, 144A, 5,910 %, con vencimiento el 25/02/2057 *	2.786	0,34
690	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C2, serie 2017 C2, clase A4, 3,487 %, con vencimiento el 15/08/2050	647	0,08
471	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C7, serie 2017 C7, clase A3, 3,418 %, con vencimiento el 15/12/2050	443	0,05
72.169	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C9, serie 2018 C9, clase XA, 0,912 %, con vencimiento el 15/03/2051 *	2.197	0,27
141	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA2 Trust, serie 2007 OA2, clase 2A, 5,879 %, con vencimiento el 25/03/2047 *	122	0,02
250	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-LC20, serie 2015 LC20, clase AS, 3,467 %, con vencimiento el 15/04/2050	241	0,03
160	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1, serie 2015 NXS1, clase AS, 3,406 %, con vencimiento el 15/05/2048	153	0,02
4.796	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-RB1, serie 2017 RB1, clase XA, 1,194 %, con vencimiento el 15/03/2050 *	134	0,02
2.010	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C21, serie 2014 C21, clase B, 4,213 %, con vencimiento el 15/08/2047 *	1.898	0,23
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 388.387 $)		352.010	43,18
Bonos y obligaciones corporativos: 36,66 % (28 de febrero de 2023: 36,53 %)			
Australia: 0,04 % (28 de febrero de 2023: 0,04 %)			
140	BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000 %, con vencimiento el 30/09/2043	134	0,02
200	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 3,900 %, con vencimiento el 12/07/2047	165	0,02
		299	0,04
Bélgica: 0,43 % (28 de febrero de 2023: 0,40 %)			
750	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, con vencimiento el 01/02/2046	694	0,09
680	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,000 %, con vencimiento el 13/04/2028	660	0,08
280	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2030	259	0,03
920	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, con vencimiento el 01/06/2040	824	0,10
1.060	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, con vencimiento el 23/01/2049	1.087	0,13
		3.524	0,43
Brasil: 0,65 % (28 de febrero de 2023: 0,67 %)			
2.820	Petrobras Global Finance BV, 5,299 %, con vencimiento el 27/01/2025	2.798	0,34
290	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, con vencimiento el 05/06/2115	271	0,03
190	Suzano Austria GmbH, 3,750 %, con vencimiento el 15/01/2031	166	0,02
1.870	Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125 %, con vencimiento el 15/01/2032	1.537	0,19
60	Vale Canada Ltd, 7,200 %, con vencimiento el 15/09/2032	65	0,01
410	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, con vencimiento el 21/11/2036	438	0,06
		5.275	0,65
Canadá: 0,43 % (28 de febrero de 2023: 0,34 %)			
120	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/01/2028	112	0,01
110	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2029	99	0,01
160	Bank of Montreal, 3,803 %, con vencimiento el 15/12/2032 *	147	0,02
200	Bank of Nova Scotia/The, 4,588 %, con vencimiento el 04/05/2037 *	179	0,02
290	Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, con vencimiento el 30/05/2041	295	0,04
500	Barrick North America Finance LLC, 5,750 %, con vencimiento el 01/05/2043	513	0,06
650	Canadian Pacific Railway Co, 3,100 %, con vencimiento el 02/12/2051	442	0,06
440	Rogers Communications Inc, 5,300 %, con vencimiento el 15/02/2034	432	0,05
20	Teck Resources Ltd, 6,000 %, con vencimiento el 15/08/2040	20	–
930	Toronto-Dominion Bank/The, 4,456 %, con vencimiento el 08/06/2032	887	0,11
390	Yamana Gold Inc, 4,625 %, con vencimiento el 15/12/2027	374	0,05
		3.500	0,43
China: 0,32 % (28 de febrero de 2023: 0,30 %)			
40	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2,700 %, con vencimiento el 01/05/2025	39	–
1.930	Prosus NV, 144A, 3,061 %, con vencimiento el 13/07/2031	1.559	0,19
1.660	Prosus NV, 144A, 3,832 %, con vencimiento el 08/02/2051	1.024	0,13
		2.622	0,32

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Colombia: 0,18 % (28 de febrero de 2023: 0,13 %)			
940	Ecopetrol SA, 4,625 %, con vencimiento el 02/11/2031	778	0,09
960	Ecopetrol SA, 5,875 %, con vencimiento el 28/05/2045	712	0,09
		1.490	0,18
Dinamarca: 0,27 % (28 de febrero de 2023: 0,19 %)			
280	Danske Bank A/S, 144A, 3,244 %, con vencimiento el 20/12/2025 *	274	0,03
2.040	Danske Bank A/S, 144A, 4,298 %, con vencimiento el 01/04/2028 *	1.965	0,24
		2.239	0,27
Francia: 1,49 % (28 de febrero de 2023: 1,08 %)			
1.260	BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, con vencimiento el 09/06/2026 *	1.207	0,15
620	BNP Paribas SA, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 13/03/2027	602	0,07
2.890	BNP Paribas SA, 144A, 1,675 %, con vencimiento el 30/06/2027 *	2.646	0,33
870	BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, con vencimiento el 14/08/2028	839	0,10
1.620	BNP Paribas SA, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 13/01/2029 *	1.609	0,20
360	BNP Paribas SA, 144A, 5,198 %, con vencimiento el 10/01/2030 *	356	0,04
550	BNP Paribas SA, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 01/03/2033 *	517	0,06
990	BNP Paribas SA, 144A, 5,894 %, con vencimiento el 05/12/2034 *	1.013	0,13
410	BNP Paribas SA, 144A, 8,000 %, Perpetuo *	411	0,05
710	BNP Paribas SA, 144A, 8,500 %, Perpetuo *	734	0,09
500	BPCE SA, 144A, 5,150 %, con vencimiento el 21/07/2024	498	0,06
590	Credit Agricole SA, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 10/01/2033 *	545	0,07
240	Danone SA, 144A, 2,947 %, con vencimiento el 02/11/2026	227	0,03
940	WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 3,750 %, con vencimiento el 17/09/2024	927	0,11
		12.131	1,49
India: 0,13 % (28 de febrero de 2023: 0,10 %)			
330	Reliance Industries Ltd, 144A, 2,875 %, con vencimiento el 12/01/2032	280	0,04
1.020	Reliance Industries Ltd, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 12/01/2052	743	0,09
		1.023	0,13
Irlanda: 0,33 % (28 de febrero de 2023: 0,38 %)			
1.480	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 2,450 %, con vencimiento el 29/10/2026	1.366	0,17
1.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,000 %, con vencimiento el 29/10/2028	899	0,11
480	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, con vencimiento el 30/01/2032	406	0,05
		2.671	0,33
Israel: 0,39 % (28 de febrero de 2023: 0,42 %)			
590	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125 %, con vencimiento el 31/01/2025	593	0,07
1.570	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, con vencimiento el 01/10/2026	1.456	0,18
430	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, con vencimiento el 09/05/2027	410	0,05
530	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, con vencimiento el 09/05/2029	501	0,06
240	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, con vencimiento el 15/09/2031	260	0,03
		3.220	0,39
Italia: 0,24 % (28 de febrero de 2023: 0,17 %)			
1.160	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, con vencimiento el 26/06/2024	1.153	0,14
850	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, con vencimiento el 15/01/2026	842	0,10
		1.995	0,24
Japón: 0,37 % (28 de febrero de 2023: 0,37 %)			
560	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 4,080 %, con vencimiento el 19/04/2028 *	542	0,07
1.600	Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,522 %, con vencimiento el 17/09/2025	1.539	0,19
990	Nissan Motor Co Ltd, 144A, 4,345 %, con vencimiento el 17/09/2027	941	0,11
		3.022	0,37
Kazajistán: 0,08 % (28 de febrero de 2023: 0,05 %)			
200	KazMunayGas National Co JSC, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 19/04/2047	171	0,02
520	KazMunayGas National Co JSC, 144A, 6,375 %, con vencimiento el 24/10/2048	475	0,06
		646	0,08
Kuwait: 0,04 % (28 de febrero de 2023: 0,04 %)			
320	MEGlobal BV, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 03/11/2026	308	0,04
Luxemburgo: 0,07 % (28 de febrero de 2023: 0,01 %)			
620	Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/08/2029	535	0,07
Macao: 0,43 % (28 de febrero de 2023: 0,43 %)			
2.290	Sands China Ltd, 5,125 %, con vencimiento el 08/08/2025	2.259	0,27
710	Sands China Ltd, 2,550 %, con vencimiento el 08/03/2027	640	0,08
730	Sands China Ltd, 3,100 %, con vencimiento el 08/03/2029	630	0,08
		3.529	0,43
México: 0,13 % (28 de febrero de 2023: 0,11 %)			
20	America Movil SAB de CV, 6,375 %, con vencimiento el 01/03/2035	22	–
20	America Movil SAB de CV, 6,125 %, con vencimiento el 15/11/2037	21	–
1.110	Southern Copper Corp, 5,250 %, con vencimiento el 08/11/2042	1.044	0,13
		1.087	0,13
Marruecos: 0,12 % (28 de febrero de 2023: 0,12 %)			
740	OCP SA, 144A, 3,750 %, con vencimiento el 23/06/2031	630	0,08
480	OCP SA, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 23/06/2051	355	0,04
		985	0,12
Países Bajos: 0,52 % (28 de febrero de 2023: 0,45 %)			
200	ABN AMRO Bank NV, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 28/07/2025	196	0,02
1.520	Cooperatieve Rabobank UA, 4,375 %, con vencimiento el 04/08/2025	1.491	0,18
250	Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 1,339 %, con vencimiento el 24/06/2026 *	236	0,03
600	Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 3,649 %, con vencimiento el 06/04/2028 *	569	0,07
350	Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 3,758 %, con vencimiento el 06/04/2033 *	311	0,04
160	Shell International Finance BV, 4,550 %, con vencimiento el 12/08/2043	145	0,02
480	Shell International Finance BV, 4,375 %, con vencimiento el 11/05/2045	420	0,05
270	Shell International Finance BV, 4,000 %, con vencimiento el 10/05/2046	222	0,03
940	Shell International Finance BV, 3,250 %, con vencimiento el 06/04/2050	670	0,08
		4.260	0,52
Sudáfrica: 0,09 % (28 de febrero de 2023: 0,10 %)			
270	Anglo American Capital Plc, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 11/09/2024	267	0,03
200	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 10/04/2027	196	0,03
290	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 11/09/2027	276	0,03
		739	0,09
España: 0,22 % (28 de febrero de 2023: 0,19 %)			
1.000	Banco Santander SA, 2,746 %, con vencimiento el 28/05/2025	965	0,12
200	Banco Santander SA, 4,175 %, con vencimiento el 24/03/2028 *	192	0,02
500	Telefónica Emisiones SA, 4,103 %, con vencimiento el 08/03/2027	484	0,06
210	Telefónica Emisiones SA, 5,213 %, con vencimiento el 08/03/2047	189	0,02
		1.830	0,22
Supranacional: 0,44 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
INR 290.000	Inter-American Development Bank, 7,350 %, con vencimiento el 06/10/2030	3.562	0,44
Suiza: 1,34 % (28 de febrero de 2023: 1,28 %)			
870	Credit Suisse AG/New York NY, 7,950 %, con vencimiento el 09/01/2025	886	0,11
710	Credit Suisse AG/New York NY, 2,950 %, con vencimiento el 09/04/2025	690	0,09
1.530	Credit Suisse AG/New York NY, 5,000 %, con vencimiento el 09/07/2027	1.516	0,19
1.640	Credit Suisse AG/New York NY, 7,500 %, con vencimiento el 15/02/2028	1.766	0,22
200	UBS AG/London, 4,500 %, con vencimiento el 26/06/2048	183	0,02
700	UBS Group AG, 144A, 2,593 %, con vencimiento el 11/09/2025 *	688	0,08
270	UBS Group AG, 144A, 4,488 %, con vencimiento el 12/05/2026 *	266	0,03
610	UBS Group AG, 144A, 2,193 %, con vencimiento el 05/06/2026 *	584	0,07

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Suiza (continuación)			
680	UBS Group AG, 144A, 4,751 %, con vencimiento el 12/05/2028 *	663	0,08
670	UBS Group AG, 144A, 4,194 %, con vencimiento el 01/04/2031 *	616	0,08
720	UBS Group AG, 144A, 3,091 %, con vencimiento el 14/05/2032 *	605	0,07
300	UBS Group AG, 144A, 2,746 %, con vencimiento el 11/02/2033 *	242	0,03
420	UBS Group AG, 144A, 9,016 %, con vencimiento el 15/11/2033 *	505	0,06
210	UBS Group AG, 144A, 7,750 %, Perpetuo *	211	0,03
250	UBS Group AG, 144A, 9,250 %, Perpetuo *	277	0,03
1.120	UBS Group AG, 144A, 9,250 %, Perpetuo *	1.198	0,15
		10.896	1,34
Emiratos Árabes Unidos: 0,09 % (28 de febrero de 2023: 0,08 %)			
760	DP World Ltd/United Arab Emirates, 5,625 %, con vencimiento el 25/09/2048	713	0,09
Reino Unido: 0,85 % (28 de febrero de 2023: 1,05 %)			
210	Barclays Plc, 4,972 %, con vencimiento el 16/05/2029 *	204	0,02
2.200	Barclays Plc, 5,088 %, con vencimiento el 20/06/2030 *	2.085	0,25
430	HSBC Holdings Plc, 4,250 %, con vencimiento el 18/08/2025	421	0,05
330	HSBC Holdings Plc, 4,300 %, con vencimiento el 08/03/2026	323	0,04
400	HSBC Holdings Plc, 4,041 %, con vencimiento el 13/03/2028 *	384	0,05
400	HSBC Holdings Plc, 4,583 %, con vencimiento el 19/06/2029 *	385	0,05
600	HSBC Holdings Plc, 4,762 %, con vencimiento el 29/03/2033 *	552	0,07
820	Lloyds Banking Group Plc, 4,650 %, con vencimiento el 24/03/2026	805	0,10
450	Lloyds Banking Group Plc, 4,375 %, con vencimiento el 22/03/2028	435	0,05
230	NatWest Group Plc, 4,892 %, con vencimiento el 18/05/2029 *	224	0,03
250	NatWest Group Plc, 5,076 %, con vencimiento el 27/01/2030 *	244	0,03
340	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/05/2029	319	0,04
630	Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/07/2031	545	0,07
		6.926	0,85
Estados Unidos: 26,89 % (28 de febrero de 2023: 27,97 %)			
290	3M Co, 2,375 %, con vencimiento el 26/08/2029	252	0,03
130	3M Co, 3,050 %, con vencimiento el 15/04/2030	115	0,01
440	3M Co, 3,700 %, con vencimiento el 15/04/2050	325	0,04
230	Abbott Laboratories, 4,750 %, con vencimiento el 30/11/2036	226	0,03
1.190	AbbVie Inc, 2,600 %, con vencimiento el 21/11/2024	1.166	0,14
50	AbbVie Inc, 3,800 %, con vencimiento el 15/03/2025	49	0,01
140	AbbVie Inc, 3,600 %, con vencimiento el 14/05/2025	137	0,02
520	AbbVie Inc, 2,950 %, con vencimiento el 21/11/2026	493	0,06
510	AbbVie Inc, 4,800 %, con vencimiento el 15/03/2029	508	0,06
3.520	AbbVie Inc, 3,200 %, con vencimiento el 21/11/2029	3.222	0,40
220	AbbVie Inc, 4,950 %, con vencimiento el 15/03/2031	220	0,03
310	AbbVie Inc, 5,050 %, con vencimiento el 15/03/2034	312	0,04
7	AbbVie Inc, 4,750 %, con vencimiento el 15/03/2045	6	–
90	AbbVie Inc, 4,875 %, con vencimiento el 14/11/2048	85	0,01
110	AbbVie Inc, 4,250 %, con vencimiento el 21/11/2049	94	0,01
450	Air Lease Corp, 3,375 %, con vencimiento el 01/07/2025	437	0,05
600	Air Lease Corp, 5,300 %, con vencimiento el 01/02/2028	597	0,07
430	Amazon.com Inc, 3,450 %, con vencimiento el 13/04/2029	408	0,05
510	Amazon.com Inc, 1,500 %, con vencimiento el 03/06/2030	422	0,05
260	Amazon.com Inc, 2,100 %, con vencimiento el 12/05/2031	219	0,03
520	Amazon.com Inc, 3,600 %, con vencimiento el 13/04/2032	480	0,06
1.150	Amazon.com Inc, 3,875 %, con vencimiento el 22/08/2037	1.026	0,13
340	Amazon.com Inc, 4,950 %, con vencimiento el 05/12/2044	336	0,04
650	Amazon.com Inc, 2,500 %, con vencimiento el 03/06/2050	409	0,05
140	Alphabet Inc, 4,250 %, con vencimiento el 22/08/2057	121	0,01
50	American Express Co, 3,375 %, con vencimiento el 03/05/2024	50	0,01
690	American Express Co, 4,050 %, con vencimiento el 03/05/2029	668	0,08
220	American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, con vencimiento el 15/01/2032	181	0,02
34	Amgen Inc, 4,663 %, con vencimiento el 15/06/2051	30	–
910	Aon North America Inc, 5,450 %, con vencimiento el 01/03/2034	912	0,11
270	Apache Corp, 7,750 %, con vencimiento el 15/12/2029	290	0,04
17	Apache Corp, 6,000 %, con vencimiento el 15/01/2037	17	–
830	Apache Corp, 5,100 %, con vencimiento el 01/09/2040	695	0,09
410	Apache Corp, 4,750 %, con vencimiento el 15/04/2043	315	0,04
30	Apache Corp, 4,250 %, con vencimiento el 15/01/2044	21	–
150	Apache Corp, 5,350 %, con vencimiento el 01/07/2049	122	0,02
250	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 01/09/2029	203	0,03
180	AT&T Inc, 3,800 %, con vencimiento el 15/02/2027	174	0,02
970	AT&T Inc, 2,300 %, con vencimiento el 01/06/2027	889	0,11
150	AT&T Inc, 2,250 %, con vencimiento el 01/02/2032	120	0,01
60	AT&T Inc, 2,550 %, con vencimiento el 01/12/2033	47	0,01
170	AT&T Inc, 5,350 %, con vencimiento el 01/09/2040	164	0,02
190	AT&T Inc, 5,550 %, con vencimiento el 15/08/2041	187	0,02
161	AT&T Inc, 4,350 %, con vencimiento el 15/06/2045	135	0,02
1.218	AT&T Inc, 4,500 %, con vencimiento el 09/03/2048	1.020	0,13
70	AT&T Inc, 3,800 %, con vencimiento el 01/12/2057	49	0,01
25	AT&T Inc, 3,650 %, con vencimiento el 15/09/2059	17	–
40	Bank of America Corp, 4,200 %, con vencimiento el 26/08/2024	40	–
40	Bank of America Corp, 4,000 %, con vencimiento el 22/01/2025	39	–
130	Bank of America Corp, 4,450 %, con vencimiento el 03/03/2026	128	0,02
830	Bank of America Corp, 3,500 %, con vencimiento el 19/04/2026	805	0,10
1.250	Bank of America Corp, 1,319 %, con vencimiento el 19/06/2026 *	1.184	0,15
970	Bank of America Corp, 4,250 %, con vencimiento el 22/10/2026	949	0,12
1.290	Bank of America Corp, 4,376 %, con vencimiento el 27/04/2028 *	1.254	0,15
940	Bank of America Corp, 3,593 %, con vencimiento el 21/07/2028 *	891	0,11
1.770	Bank of America Corp, 3,419 %, con vencimiento el 20/12/2028 *	1.654	0,20
2.470	Bank of America Corp, 3,970 %, con vencimiento el 05/03/2029 *	2.350	0,29
1.480	Bank of America Corp, 3,974 %, con vencimiento el 07/02/2030 *	1.392	0,17
1.500	Bank of America Corp, 2,884 %, con vencimiento el 22/10/2030 *	1.322	0,16
1.580	Bank of America Corp, 2,572 %, con vencimiento el 20/10/2032 *	1.295	0,16
840	Bank of America Corp, 2,972 %, con vencimiento el 04/02/2033 *	706	0,09
560	Bank of America Corp, 4,330 %, con vencimiento el 15/03/2050 *	477	0,06
2.070	Bank of America Corp, 4,083 %, con vencimiento el 20/03/2051 *	1.672	0,21
40	Bank of New York Mellon Corp/The, 1,600 %, con vencimiento el 24/04/2025	38	–
30	Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 01/11/2025	28	–
35	Becton Dickinson & Co, 3,363 %, con vencimiento el 06/06/2024	35	–
26	Becton Dickinson & Co, 3,734 %, con vencimiento el 15/12/2024	26	–
377	Becton Dickinson & Co, 4,685 %, con vencimiento el 15/12/2044	338	0,04
180	Becton Dickinson & Co, 4,669 %, con vencimiento el 06/06/2047	160	0,02
850	Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, con vencimiento el 15/01/2049	750	0,09
3.380	Boston Properties LP, 3,400 %, con vencimiento el 21/06/2029	2.986	0,37
370	BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, con vencimiento el 04/05/2026	356	0,04
440	BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, con vencimiento el 06/04/2030	411	0,05
900	BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, con vencimiento el 24/02/2050	601	0,07
43	Brighthouse Financial Inc, 4,700 %, con vencimiento el 22/06/2047	33	–
12	Bristol-Myers Squibb Co, 3,200 %, con vencimiento el 15/06/2026	12	–
705	Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, con vencimiento el 26/07/2029	658	0,08
280	Bristol-Myers Squibb Co, 5,100 %, con vencimiento el 22/02/2031	281	0,03
750	Bristol-Myers Squibb Co, 5,200 %, con vencimiento el 22/02/2034	756	0,09
160	Bristol-Myers Squibb Co, 5,550 %, con vencimiento el 22/02/2054	162	0,02
110	Bristol-Myers Squibb Co, 5,650 %, con vencimiento el 22/02/2064	111	0,01
1.230	Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, con vencimiento el 15/11/2035	977	0,12
110	Builders FirstSource Inc, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 01/02/2032	97	0,01
630	Cameron LNG LLC, 144A, 2,902 %, con vencimiento el 15/07/2031	543	0,07

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
850	Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, con vencimiento el 15/01/2035	704	0,09
30	Carrier Global Corp, 2,700 %, con vencimiento el 15/02/2031	26	–
50	Carrier Global Corp, 3,577 %, con vencimiento el 05/04/2050	37	–
70	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 15/08/2030	58	0,01
370	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2032	299	0,04
770	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, con vencimiento el 01/05/2032	609	0,07
360	Centene Corp, 4,250 %, con vencimiento el 15/12/2027	343	0,04
520	Centene Corp, 4,625 %, con vencimiento el 15/12/2029	493	0,06
290	Centene Corp, 3,375 %, con vencimiento el 15/02/2030	256	0,03
50	Centene Corp, 3,000 %, con vencimiento el 15/10/2030	43	0,01
60	Centene Corp, 2,625 %, con vencimiento el 01/08/2031	49	0,01
1.170	Charles Schwab Corp/The, 5,875 %, con vencimiento el 24/08/2026	1.188	0,15
230	Charles Schwab Corp/The, 6,136 %, con vencimiento el 24/08/2034 *	238	0,03
10	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, con vencimiento el 23/07/2025	10	–
1.440	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, con vencimiento el 15/03/2028	1.350	0,17
1.200	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, con vencimiento el 30/03/2029	1.149	0,14
380	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,400 %, con vencimiento el 01/04/2033	332	0,04
500	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, con vencimiento el 01/04/2038	431	0,05
270	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, con vencimiento el 01/03/2042	177	0,02
260	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, con vencimiento el 23/10/2045	238	0,03
70	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, con vencimiento el 01/05/2047	55	0,01
430	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, con vencimiento el 01/04/2048	358	0,04
240	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, con vencimiento el 01/07/2049	182	0,02
210	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, con vencimiento el 01/03/2050	152	0,02
260	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,500 %, con vencimiento el 01/04/2063	201	0,02
230	Cheniere Energy Inc, 4,625 %, con vencimiento el 15/10/2028	221	0,03
130	Cheniere Energy Partners LP, 4,000 %, con vencimiento el 01/03/2031	116	0,01
690	Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, con vencimiento el 31/01/2032	577	0,07
140	Chubb INA Holdings Inc, 3,350 %, con vencimiento el 03/05/2026	135	0,02
2.840	Cigna Group/The, 4,375 %, con vencimiento el 15/10/2028	2.758	0,34
90	Cigna Group/The, 3,400 %, con vencimiento el 15/03/2050	63	0,01
20	Cintas Corp. No 2, 3,700 %, con vencimiento el 01/04/2027	19	–
300	Cintas Corp. No 2, 4,000 %, con vencimiento el 01/05/2032	282	0,03
30	Citigroup Inc, 3,300 %, con vencimiento el 27/04/2025	29	–
440	Citigroup Inc, 4,400 %, con vencimiento el 10/06/2025	434	0,05
160	Citigroup Inc, 5,500 %, con vencimiento el 13/09/2025	160	0,02
490	Citigroup Inc, 3,106 %, con vencimiento el 08/04/2026 *	477	0,06
110	Citigroup Inc, 4,300 %, con vencimiento el 20/11/2026	107	0,01
860	Citigroup Inc, 4,450 %, con vencimiento el 29/09/2027	833	0,10
450	Citigroup Inc, 4,658 %, con vencimiento el 24/05/2028 *	442	0,05
60	Citigroup Inc, 4,125 %, con vencimiento el 25/07/2028	57	0,01
1.360	Citigroup Inc, 3,520 %, con vencimiento el 27/10/2028 *	1.278	0,16
1.180	Citigroup Inc, 4,075 %, con vencimiento el 23/04/2029 *	1.127	0,14
1.470	Citigroup Inc, 3,980 %, con vencimiento el 20/03/2030 *	1.378	0,17
1.590	Citigroup Inc, 4,412 %, con vencimiento el 31/03/2031 *	1.503	0,18
1.180	Citigroup Inc, 2,520 %, con vencimiento el 03/11/2032 *	958	0,12
180	Citigroup Inc, 3,785 %, con vencimiento el 17/03/2033 *	159	0,02
540	Citigroup Inc, 4,910 %, con vencimiento el 24/05/2033 *	517	0,06
1.456	Citigroup Inc, 8,125 %, con vencimiento el 15/07/2039	1.850	0,23
5	Citigroup Inc, 5,300 %, con vencimiento el 06/05/2044	5	–
390	Citigroup Inc, Series P, 5,950 %, Perpetuo *	387	0,05
90	Citigroup Inc, Series M, 6,300 %, Perpetuo *	90	0,01
20	Coca-Cola Co/The, 2,500 %, con vencimiento el 01/06/2040	14	–
680	Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,036 %, con vencimiento el 15/11/2033	698	0,09
20	Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,544 %, con vencimiento el 15/11/2053	21	–
10	Comcast Corp, 3,950 %, con vencimiento el 15/10/2025	10	–
60	Comcast Corp, 3,150 %, con vencimiento el 01/03/2026	58	0,01
20	Comcast Corp, 3,300 %, con vencimiento el 01/04/2027	19	–
700	Comcast Corp, 4,150 %, con vencimiento el 15/10/2028	679	0,08
390	Comcast Corp, 3,400 %, con vencimiento el 01/04/2030	357	0,04
510	Comcast Corp, 4,250 %, con vencimiento el 15/10/2030	488	0,06
60	Comcast Corp, 4,250 %, con vencimiento el 15/01/2033	56	0,01
60	Comcast Corp, 5,650 %, con vencimiento el 15/06/2035	62	0,01
13	Comcast Corp, 6,500 %, con vencimiento el 15/11/2035	14	–
1.420	Comcast Corp, 3,900 %, con vencimiento el 01/03/2038	1.219	0,15
400	Comcast Corp, 3,250 %, con vencimiento el 01/11/2039	307	0,04
300	Comcast Corp, 3,750 %, con vencimiento el 01/04/2040	246	0,03
80	Comcast Corp, 3,400 %, con vencimiento el 15/07/2046	59	0,01
120	Comcast Corp, 4,000 %, con vencimiento el 15/08/2047	96	0,01
224	Comcast Corp, 3,969 %, con vencimiento el 01/11/2047	178	0,02
110	Comcast Corp, 4,000 %, con vencimiento el 01/03/2048	87	0,01
293	Comcast Corp, 3,999 %, con vencimiento el 01/11/2049	233	0,03
200	Comcast Corp, 3,450 %, con vencimiento el 01/02/2050	144	0,02
619	Comcast Corp, 2,887 %, con vencimiento el 01/11/2051	392	0,05
66	Comcast Corp, 4,049 %, con vencimiento el 01/11/2052	52	0,01
137	Comcast Corp, 2,937 %, con vencimiento el 01/11/2056	84	0,01
100	Comcast Corp, 4,950 %, con vencimiento el 15/10/2058	93	0,01
74	Comcast Corp, 2,987 %, con vencimiento el 01/11/2063	45	0,01
20	CommonSpirit Health, 4,350 %, con vencimiento el 01/11/2042	17	–
300	CommScope Inc, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 01/03/2026	270	0,03
130	CommScope Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 01/09/2029	89	0,01
85	ConocoPhillips Co, 6,950 %, con vencimiento el 15/04/2029	93	0,01
240	Consolidated Edison Co of New York Inc, Serie 20A, 3,350 %, con vencimiento el 01/04/2030	220	0,03
190	Consolidated Edison Co of New York Inc, serie 20B, 3,950 %, con vencimiento el 01/04/2050	152	0,02
440	Constellation Brands Inc, 4,750 %, con vencimiento el 15/11/2024	438	0,05
450	Constellation Brands Inc, 4,350 %, con vencimiento el 09/05/2027	440	0,05
10	Continental Resources Inc/OK, 3,800 %, con vencimiento el 01/06/2024	10	–
290	Continental Resources Inc/OK, 144A, 2,268 %, con vencimiento el 15/11/2026	266	0,03
1.000	Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, con vencimiento el 15/01/2028	962	0,12
390	Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/01/2031	383	0,05
100	Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, con vencimiento el 01/06/2044	81	0,01
1.790	Coterra Energy Inc, 3,900 %, con vencimiento el 15/05/2027	1.722	0,21
560	Coterra Energy Inc, 4,375 %, con vencimiento el 15/03/2029	540	0,07
300	CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 01/12/2030	224	0,03
200	CSC Holdings LLC, 144A, 3,375 %, con vencimiento el 15/02/2031	141	0,02
510	CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 15/11/2031	379	0,05
171	CVS Health Corp, 3,875 %, con vencimiento el 20/07/2025	168	0,02
220	CVS Health Corp, 3,625 %, con vencimiento el 01/04/2027	211	0,03
268	CVS Health Corp, 4,300 %, con vencimiento el 25/03/2028	260	0,03
530	CVS Health Corp, 3,750 %, con vencimiento el 01/04/2030	489	0,06
410	CVS Health Corp, 2,125 %, con vencimiento el 15/09/2031	331	0,04
400	CVS Health Corp, 4,780 %, con vencimiento el 25/03/2038	364	0,04
220	CVS Health Corp, 4,125 %, con vencimiento el 01/04/2040	181	0,02
440	CVS Health Corp, 5,125 %, con vencimiento el 20/07/2045	401	0,05
2.190	CVS Health Corp, 5,050 %, con vencimiento el 25/03/2048	1.955	0,24
70	CVS Health Corp, 4,250 %, con vencimiento el 01/04/2050	56	0,01

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
13	CVS Pass-Through Trust, 6,036 %, con vencimiento el 10/12/2028	14	–
26	CVS Pass-Through Trust, 6,943 %, con vencimiento el 10/01/2030	26	–
150	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, con vencimiento el 03/11/2036	155	0,02
630	Delta Air Lines Inc, 7,375 %, con vencimiento el 15/01/2026	650	0,08
50	Devon Energy Corp, 5,850 %, con vencimiento el 15/12/2025	50	0,01
260	Devon Energy Corp, 4,500 %, con vencimiento el 15/01/2030	248	0,03
40	Devon Energy Corp, 5,600 %, con vencimiento el 15/07/2041	38	–
520	Devon Energy Corp, 4,750 %, con vencimiento el 15/05/2042	440	0,05
1.480	Devon Energy Corp, 5,000 %, con vencimiento el 15/06/2045	1.282	0,16
50	Diamondback Energy Inc, 3,250 %, con vencimiento el 01/12/2026	48	0,01
660	Diamondback Energy Inc, 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2029	606	0,07
320	Diamondback Energy Inc, 4,400 %, con vencimiento el 24/03/2051	259	0,03
450	DISH DBS Corp, 5,875 %, con vencimiento el 15/11/2024	426	0,05
410	DISH DBS Corp, 7,750 %, con vencimiento el 01/07/2026	262	0,03
230	DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 01/12/2026	184	0,02
40	DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 01/12/2028	28	–
170	DISH DBS Corp, 5,125 %, con vencimiento el 01/06/2029	73	0,01
130	Duke Energy Carolinas LLC, 5,300 %, con vencimiento el 15/02/2040	128	0,02
200	Duke Energy Ohio Inc, 3,650 %, con vencimiento el 01/02/2029	189	0,02
420	Eaton Corp, 4,150 %, con vencimiento el 02/11/2042	366	0,04
36	El Paso Natural Gas Co LLC, 8,375 %, con vencimiento el 15/06/2032	42	0,01
10	Elevance Health Inc, 3,350 %, con vencimiento el 01/12/2024	10	–
430	Elevance Health Inc, 4,100 %, con vencimiento el 15/05/2032	396	0,05
20	Elevance Health Inc, 4,550 %, con vencimiento el 15/05/2052	17	–
710	Eli Lilly & Co, 4,700 %, con vencimiento el 09/02/2034	701	0,09
80	Eli Lilly & Co, 5,000 %, con vencimiento el 09/02/2054	79	0,01
580	Eli Lilly & Co, 5,100 %, con vencimiento el 09/02/2064	570	0,07
720	Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, con vencimiento el 16/10/2028	695	0,09
510	Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, con vencimiento el 31/01/2030	453	0,06
830	Enterprise Products Operating LLC, 4,850 %, con vencimiento el 31/01/2034	809	0,10
1.080	Enterprise Products Operating LLC, 4,200 %, con vencimiento el 31/01/2050	893	0,11
280	Enterprise Products Operating LLC, 3,700 %, con vencimiento el 31/01/2051	211	0,03
90	Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, con vencimiento el 31/01/2060	69	0,01
220	Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, con vencimiento el 15/02/2078 *	204	0,03
20	EOG Resources Inc, 4,150 %, con vencimiento el 15/01/2026	20	–
190	EOG Resources Inc, 4,375 %, con vencimiento el 15/04/2030	185	0,02
690	EOG Resources Inc, 3,900 %, con vencimiento el 01/04/2035	621	0,08
180	EOG Resources Inc, 4,950 %, con vencimiento el 15/04/2050	168	0,02
28	EQT Corp, 6,125 %, con vencimiento el 01/02/2025	28	–
20	EQT Corp, 144A, 3,125 %, con vencimiento el 15/05/2026	19	–
1.340	EQT Corp, 3,900 %, con vencimiento el 01/10/2027	1.269	0,16
200	EQT Corp, 5,000 %, con vencimiento el 15/01/2029	195	0,02
420	EQT Corp, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 15/05/2031	367	0,05
10	Exxon Mobil Corp, 3,043 %, con vencimiento el 01/03/2026	10	–
440	Exxon Mobil Corp, 3,482 %, con vencimiento el 19/03/2030	411	0,05
1.010	Exxon Mobil Corp, 4,114 %, con vencimiento el 01/03/2046	857	0,11
80	Exxon Mobil Corp, 4,327 %, con vencimiento el 19/03/2050	69	0,01
2.810	FirstEnergy Corp, serie B, 4,150 %, con vencimiento el 15/07/2027	2.672	0,33
1.000	FirstEnergy Corp, serie C, 5,100 %, con vencimiento el 15/07/2047	863	0,11
770	Ford Motor Co, 3,250 %, con vencimiento el 12/02/2032	632	0,08
570	Ford Motor Co, 6,100 %, con vencimiento el 19/08/2032	569	0,07
10	Ford Motor Co, 4,750 %, con vencimiento el 15/01/2043	8	–
400	Ford Motor Credit Co LLC, 5,125 %, con vencimiento el 16/06/2025	396	0,05
850	Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, con vencimiento el 28/05/2027	827	0,10
600	Ford Motor Credit Co LLC, 4,125 %, con vencimiento el 17/08/2027	568	0,07
610	Ford Motor Credit Co LLC, 7,350 %, con vencimiento el 04/11/2027	638	0,08
260	Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, con vencimiento el 16/02/2028	233	0,03
200	Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, con vencimiento el 10/02/2029	174	0,02
810	Ford Motor Credit Co LLC, 5,113 %, con vencimiento el 03/05/2029	781	0,10
890	Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, con vencimiento el 13/11/2030	787	0,10
500	Ford Motor Credit Co LLC, 3,625 %, con vencimiento el 17/06/2031	426	0,05
30	Freeport-McMoRan Inc, 4,550 %, con vencimiento el 14/11/2024	30	–
260	Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, con vencimiento el 01/08/2030	248	0,03
240	Freeport-McMoRan Inc, 5,400 %, con vencimiento el 14/11/2034	234	0,03
490	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, con vencimiento el 15/03/2043	457	0,06
70	General Motors Co, 6,125 %, con vencimiento el 01/10/2025	71	0,01
210	General Motors Co, 5,600 %, con vencimiento el 15/10/2032	210	0,03
50	General Motors Co, 6,600 %, con vencimiento el 01/04/2036	53	0,01
50	General Motors Co, 5,150 %, con vencimiento el 01/04/2038	46	0,01
230	General Motors Co, 6,250 %, con vencimiento el 02/10/2043	231	0,03
190	General Motors Co, 5,950 %, con vencimiento el 01/04/2049	183	0,02
50	General Motors Financial Co Inc, 4,350 %, con vencimiento el 17/01/2027	49	0,01
250	Gilead Sciences Inc, 4,750 %, con vencimiento el 01/03/2046	227	0,03
10	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,250 %, con vencimiento el 01/06/2025	10	–
80	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,375 %, con vencimiento el 15/04/2026	79	0,01
3	Goldman Sachs Capital II, 6,370 %, Perpetuo *	3	–
70	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,850 %, con vencimiento el 08/07/2024	70	0,01
760	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, con vencimiento el 01/04/2025	744	0,09
350	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250 %, con vencimiento el 21/10/2025	344	0,04
1.390	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, con vencimiento el 12/02/2026 *	1.327	0,16
1.970	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, con vencimiento el 16/11/2026	1.890	0,23
270	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,615 %, con vencimiento el 15/03/2028 *	257	0,03
3.170	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,814 %, con vencimiento el 23/04/2029 *	2.994	0,37
2.240	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223 %, con vencimiento el 01/05/2029 *	2.149	0,26
740	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,650 %, con vencimiento el 21/10/2032 *	611	0,07
670	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, con vencimiento el 01/02/2041	722	0,09
160	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,210 %, con vencimiento el 22/04/2042 *	119	0,01
380	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,908 %, con vencimiento el 21/07/2042 *	270	0,03
40	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, con vencimiento el 22/05/2045	38	–
540	Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750 %, con vencimiento el 21/10/2045	494	0,06
580	Haleon US Capital LLC, 3,375 %, con vencimiento el 24/03/2027	551	0,07
410	Haleon US Capital LLC, 3,375 %, con vencimiento el 24/03/2029	379	0,05
370	Haleon US Capital LLC, 3,625 %, con vencimiento el 24/03/2032	332	0,04
60	Halliburton Co, 4,850 %, con vencimiento el 15/11/2035	58	0,01
320	Halliburton Co, 5,000 %, con vencimiento el 15/11/2045	298	0,04
100	HCA Inc, 5,000 %, con vencimiento el 15/03/2024	100	0,01
20	HCA Inc, 5,375 %, con vencimiento el 01/02/2025	20	–
10	HCA Inc, 5,250 %, con vencimiento el 15/04/2025	10	–
170	HCA Inc, 5,250 %, con vencimiento el 15/06/2026	169	0,02

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
30	HCA Inc, 5,375 %, con vencimiento el 01/09/2026	30	–
90	HCA Inc, 5,625 %, con vencimiento el 01/09/2028	91	0,01
660	HCA Inc, 5,875 %, con vencimiento el 01/02/2029	672	0,08
930	HCA Inc, 3,500 %, con vencimiento el 01/09/2030	831	0,10
110	HCA Inc, 5,500 %, con vencimiento el 15/06/2047	103	0,01
380	Home Depot Inc/The, 2,500 %, con vencimiento el 15/04/2027	354	0,04
70	Home Depot Inc/The, 3,900 %, con vencimiento el 06/12/2028	68	0,01
440	Home Depot Inc/The, 2,700 %, con vencimiento el 15/04/2030	389	0,05
360	Home Depot Inc/The, 3,300 %, con vencimiento el 15/04/2040	282	0,03
90	Home Depot Inc/The, 3,900 %, con vencimiento el 15/06/2047	73	0,01
1.120	Home Depot Inc/The, 3,350 %, con vencimiento el 15/04/2050	812	0,10
430	Humana Inc, 3,950 %, con vencimiento el 15/03/2027	415	0,05
360	Humana Inc, 3,125 %, con vencimiento el 15/08/2029	326	0,04
190	Humana Inc, 2,150 %, con vencimiento el 03/02/2032	151	0,02
70	Humana Inc, 4,625 %, con vencimiento el 01/12/2042	62	0,01
20	Humana Inc, 4,800 %, con vencimiento el 15/03/2047	17	–
50	ILFC E-Capital Trust II, 144A, 7,436 %, con vencimiento el 21/12/2065 *	40	–
350	Intel Corp, 1,600 %, con vencimiento el 12/08/2028	305	0,04
240	Intel Corp, 5,125 %, con vencimiento el 10/02/2030	242	0,03
130	Intel Corp, 3,734 %, con vencimiento el 08/12/2047	99	0,01
380	Intel Corp, 4,750 %, con vencimiento el 25/03/2050	339	0,04
10	Intel Corp, 3,050 %, con vencimiento el 12/08/2051	7	–
250	Intercontinental Exchange Inc, 4,600 %, con vencimiento el 15/03/2033	239	0,03
790	Johnson & Johnson, 3,625 %, con vencimiento el 03/03/2037	699	0,09
20	JPMorgan Chase & Co, 3,875 %, con vencimiento el 10/09/2024	20	–
370	JPMorgan Chase & Co, 2,083 %, con vencimiento el 22/04/2026 *	356	0,04
1.000	JPMorgan Chase & Co, 3,509 %, con vencimiento el 23/01/2029 *	942	0,12
610	JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, con vencimiento el 23/07/2029 *	586	0,07
780	JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, con vencimiento el 05/12/2029 *	755	0,09
640	JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, con vencimiento el 22/04/2031 *	548	0,07
790	JPMorgan Chase & Co, 2,545 %, con vencimiento el 08/11/2032 *	651	0,08
270	JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, con vencimiento el 01/06/2045	254	0,03
300	JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, con vencimiento el 22/04/2051 *	206	0,03
700	Kenvue Inc, 4,900 %, con vencimiento el 22/03/2033	692	0,08
20	Kinder Morgan Inc, 4,300 %, con vencimiento el 01/06/2025	20	–
350	Kinder Morgan Inc, 4,300 %, con vencimiento el 01/03/2028	340	0,04
270	Kinder Morgan Inc, 5,300 %, con vencimiento el 01/12/2034	263	0,03
140	Kinder Morgan Inc, 5,550 %, con vencimiento el 01/06/2045	132	0,02
10	Kinder Morgan Inc, 5,200 %, con vencimiento el 01/03/2048	9	–
30	KKR Group Finance Co II LLC, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 01/02/2043	29	–
520	Kraft Heinz Foods Co, 5,200 %, con vencimiento el 15/07/2045	486	0,06
1.750	Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, con vencimiento el 08/08/2024	1.729	0,21
1.320	Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, con vencimiento el 25/06/2025	1.263	0,16
140	Las Vegas Sands Corp, 3,900 %, con vencimiento el 08/08/2029	127	0,02
160	Lehman Brothers Escrow, serie DMTN, cupón cero, Perpetuo †∞ε	–	–
10	Lennar Corp, 4,500 %, con vencimiento el 30/04/2024	10	–
50	Lennar Corp, 4,750 %, con vencimiento el 30/05/2025	50	0,01
460	Lennar Corp, 4,750 %, con vencimiento el 29/11/2027	453	0,06
280	Lowe's Cos Inc, 4,500 %, con vencimiento el 15/04/2030	272	0,03
300	Mars Inc, 144A, 3,200 %, con vencimiento el 01/04/2030	272	0,03
110	Mastercard Inc, 3,850 %, con vencimiento el 26/03/2050	91	0,01
100	McDonald's Corp, 1,450 %, con vencimiento el 01/09/2025	95	0,01
40	McDonald's Corp, 3,700 %, con vencimiento el 30/01/2026	39	–
310	McDonald's Corp, 3,500 %, con vencimiento el 01/03/2027	299	0,04
360	McDonald's Corp, 3,500 %, con vencimiento el 01/07/2027	345	0,04
260	McDonald's Corp, 3,800 %, con vencimiento el 01/04/2028	250	0,03
130	McDonald's Corp, 3,600 %, con vencimiento el 01/07/2030	121	0,01
80	McDonald's Corp, 3,625 %, con vencimiento el 01/09/2049	60	0,01
600	McDonald's Corp, 4,200 %, con vencimiento el 01/04/2050	497	0,06
60	MDC Holdings Inc, 6,000 %, con vencimiento el 15/01/2043	60	0,01
450	Merck & Co Inc, 1,450 %, con vencimiento el 24/06/2030	368	0,05
790	Merck & Co Inc, 2,750 %, con vencimiento el 10/12/2051	510	0,06
300	MetLife Inc, 6,400 %, con vencimiento el 15/12/2036	305	0,04
320	Micron Technology Inc, 5,300 %, con vencimiento el 15/01/2031	317	0,04
230	Micron Technology Inc, 5,875 %, con vencimiento el 09/02/2033	235	0,03
10	Microsoft Corp, 2,921 %, con vencimiento el 17/03/2052	7	–
511	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 20/06/2027	512	0,06
480	Mondelez International Inc, 1,500 %, con vencimiento el 04/05/2025	459	0,06
2.060	Morgan Stanley, serie I, 0,864 %, con vencimiento el 21/10/2025 *	1.996	0,24
340	Morgan Stanley, 2,188 %, con vencimiento el 28/04/2026 *	327	0,04
1.150	Morgan Stanley, 3,772 %, con vencimiento el 24/01/2029 *	1.088	0,13
50	Morgan Stanley, 4,431 %, con vencimiento el 23/01/2030 *	48	0,01
960	Morgan Stanley, 2,699 %, con vencimiento el 22/01/2031 *	832	0,10
720	Morgan Stanley, 3,622 %, con vencimiento el 01/04/2031 *	654	0,08
460	Morgan Stanley, 2,511 %, con vencimiento el 20/10/2032 *	377	0,05
680	Morgan Stanley, 2,484 %, con vencimiento el 16/09/2036 *	533	0,07
230	MPLX LP, 4,000 %, con vencimiento el 15/03/2028	221	0,03
840	MPLX LP, 4,800 %, con vencimiento el 15/02/2029	823	0,10
410	MPLX LP, 4,500 %, con vencimiento el 15/04/2038	357	0,04
20	MPLX LP, 5,200 %, con vencimiento el 01/03/2047	18	–
620	MPLX LP, 4,700 %, con vencimiento el 15/04/2048	520	0,06
230	MPLX LP, 5,500 %, con vencimiento el 15/02/2049	216	0,03
580	NIKE Inc, 2,750 %, con vencimiento el 27/03/2027	547	0,07
290	NIKE Inc, 3,250 %, con vencimiento el 27/03/2040	231	0,03
330	NIKE Inc, 3,375 %, con vencimiento el 27/03/2050	251	0,03
320	NVIDIA Corp, 2,850 %, con vencimiento el 01/04/2030	288	0,04
620	NVIDIA Corp, 3,700 %, con vencimiento el 01/04/2060	487	0,06
14	Occidental Petroleum Corp, 6,950 %, con vencimiento el 01/07/2024	14	–
10	Occidental Petroleum Corp, 5,550 %, con vencimiento el 15/03/2026	10	–
410	Occidental Petroleum Corp, 3,400 %, con vencimiento el 15/04/2026	393	0,05
610	Occidental Petroleum Corp, 3,200 %, con vencimiento el 15/08/2026	574	0,07
260	Occidental Petroleum Corp, 3,000 %, con vencimiento el 15/02/2027	243	0,03
360	Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, con vencimiento el 15/08/2029	328	0,04
260	Occidental Petroleum Corp, 7,875 %, con vencimiento el 15/09/2031	293	0,04
730	Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, con vencimiento el 15/09/2036	769	0,09
200	Occidental Petroleum Corp, 6,200 %, con vencimiento el 15/03/2040	203	0,03
240	Occidental Petroleum Corp, 4,625 %, con vencimiento el 15/06/2045	194	0,02
240	Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, con vencimiento el 15/03/2046	255	0,03
100	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, con vencimiento el 15/04/2046	80	0,01
380	Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, con vencimiento el 15/02/2047	280	0,03
260	Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, con vencimiento el 15/03/2048	200	0,02
520	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, con vencimiento el 15/08/2049	387	0,05
220	ONEOK Inc, 5,550 %, con vencimiento el 01/11/2026	222	0,03
350	ONEOK Inc, 5,800 %, con vencimiento el 01/11/2030	358	0,04
460	ONEOK Inc, 6,050 %, con vencimiento el 01/09/2033	474	0,06
660	ONEOK Inc, 6,625 %, con vencimiento el 01/09/2053	710	0,09
820	Oracle Corp, 1,650 %, con vencimiento el 25/03/2026	762	0,09
90	Oracle Corp, 2,950 %, con vencimiento el 01/04/2030	80	0,01
430	Oracle Corp, 4,650 %, con vencimiento el 06/05/2030	419	0,05
1.020	Oracle Corp, 2,875 %, con vencimiento el 25/03/2031	880	0,11
310	Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, con vencimiento el 01/08/2027	278	0,03
390	Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2031	320	0,04
80	Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, con vencimiento el 01/08/2040	58	0,01

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
30	Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, con vencimiento el 01/08/2050	20	–
90	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 15/02/2028	87	0,01
390	PayPal Holdings Inc, 1,650 %, con vencimiento el 01/06/2025	373	0,05
620	Pfizer Inc, 2,625 %, con vencimiento el 01/04/2030	549	0,07
580	Pfizer Inc, 1,700 %, con vencimiento el 28/05/2030	483	0,06
170	Pioneer Natural Resources Co, 1,125 %, con vencimiento el 15/01/2026	158	0,02
270	Pioneer Natural Resources Co, 1,900 %, con vencimiento el 15/08/2030	225	0,03
470	Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, con vencimiento el 15/01/2031	393	0,05
310	PNC Financial Services Group Inc/The, 5,812 %, con vencimiento el 12/06/2026 *	311	0,04
830	PNC Financial Services Group Inc/The, 5,582 %, con vencimiento el 12/06/2029 *	835	0,10
240	Principal Life Global Funding II, 144A, 1,250 %, con vencimiento el 23/06/2025	228	0,03
2.660	Prologis LP, 1,250 %, con vencimiento el 15/10/2030	2.113	0,26
70	Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/02/2030	65	0,01
80	Santander Holdings USA Inc, 4,500 %, con vencimiento el 17/07/2025	78	0,01
540	Solventum Corp, 144A, 5,400 %, con vencimiento el 01/03/2029	539	0,07
530	Solventum Corp, 144A, 5,450 %, con vencimiento el 13/03/2031	526	0,06
730	Solventum Corp, 144A, 5,600 %, con vencimiento el 23/03/2034	726	0,09
560	Solventum Corp, 144A, 5,900 %, con vencimiento el 30/04/2054	548	0,07
430	Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, con vencimiento el 01/03/2032	490	0,06
20	Southwestern Energy Co, 5,375 %, con vencimiento el 01/02/2029	19	–
160	Southwestern Energy Co, 5,375 %, con vencimiento el 15/03/2030	153	0,02
250	Southwestern Energy Co, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2032	227	0,03
552	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 20/09/2025	400	0,05
20	Sprint Capital Corp, 6,875 %, con vencimiento el 15/11/2028	21	–
655	Sprint Capital Corp, 8,750 %, con vencimiento el 15/03/2032	792	0,10
220	Sprint LLC, 7,625 %, con vencimiento el 15/02/2025	223	0,03
240	Targa Resources Corp, 4,200 %, con vencimiento el 01/02/2033	216	0,03
150	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,000 %, con vencimiento el 15/01/2028	147	0,02
290	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500 %, con vencimiento el 01/03/2030	287	0,04
320	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, con vencimiento el 01/02/2031	303	0,04
200	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, con vencimiento el 15/01/2032	179	0,02
16	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, con vencimiento el 16/12/2039	18	–
180	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 4,900 %, con vencimiento el 15/09/2044	164	0,02
160	Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, con vencimiento el 01/03/2030	139	0,02
380	Texas Instruments Inc, 1,750 %, con vencimiento el 04/05/2030	318	0,04
980	The Vanguard Group Inc, 3,050 %, con vencimiento el 22/08/2050 †∞	615	0,08
85	Time Warner Cable Enterprises LLC, 8,375 %, con vencimiento el 15/07/2033	94	0,01
182	Time Warner Cable LLC, 6,550 %, con vencimiento el 01/05/2037	172	0,02
420	Time Warner Cable LLC, 7,300 %, con vencimiento el 01/07/2038	419	0,05
290	Time Warner Cable LLC, 5,875 %, con vencimiento el 15/11/2040	250	0,03
1.400	T-Mobile USA Inc, 3,500 %, con vencimiento el 15/04/2025	1.369	0,17
160	T-Mobile USA Inc, 2,250 %, con vencimiento el 15/02/2026	151	0,02
120	T-Mobile USA Inc, 3,750 %, con vencimiento el 15/04/2027	115	0,01
520	T-Mobile USA Inc, 2,625 %, con vencimiento el 15/02/2029	461	0,06
1.720	T-Mobile USA Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/04/2030	1.597	0,20
450	T-Mobile USA Inc, 2,550 %, con vencimiento el 15/02/2031	380	0,05
380	T-Mobile USA Inc, 2,875 %, con vencimiento el 15/02/2031	327	0,04
270	T-Mobile USA Inc, 3,500 %, con vencimiento el 15/04/2031	241	0,03
70	T-Mobile USA Inc, 2,250 %, con vencimiento el 15/11/2031	57	0,01
390	T-Mobile USA Inc, 2,700 %, con vencimiento el 15/03/2032	325	0,04
340	T-Mobile USA Inc, 5,150 %, con vencimiento el 15/04/2034	335	0,04
220	T-Mobile USA Inc, 3,000 %, con vencimiento el 15/02/2041	159	0,02
10	T-Mobile USA Inc, 3,300 %, con vencimiento el 15/02/2051	7	–
360	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, con vencimiento el 01/02/2026	374	0,05
560	Truist Financial Corp, 6,047 %, con vencimiento el 08/06/2027 *	566	0,07
30	Union Pacific Corp, 3,750 %, con vencimiento el 15/07/2025	29	–
500	Union Pacific Corp, 2,891 %, con vencimiento el 06/04/2036	404	0,05
1.010	Union Pacific Corp, 3,839 %, con vencimiento el 20/03/2060	768	0,09
470	Union Pacific Corp, 3,750 %, con vencimiento el 05/02/2070	344	0,04
690	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 15/04/2029	637	0,08
70	United Rentals North America Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/11/2027	66	0,01
160	United Rentals North America Inc, 4,875 %, con vencimiento el 15/01/2028	155	0,02
210	United Rentals North America Inc, 5,250 %, con vencimiento el 15/01/2030	204	0,03
1.370	United Rentals North America Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/02/2031	1.212	0,15
420	United Rentals North America Inc, 3,750 %, con vencimiento el 15/01/2032	364	0,04
660	UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/12/2028	634	0,08
430	UnitedHealth Group Inc, 4,000 %, con vencimiento el 15/05/2029	414	0,05
200	UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, con vencimiento el 15/05/2030	168	0,02
110	UnitedHealth Group Inc, 2,300 %, con vencimiento el 15/05/2031	92	0,01
400	UnitedHealth Group Inc, 4,200 %, con vencimiento el 15/05/2032	377	0,05
160	UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, con vencimiento el 15/06/2048	135	0,02
130	UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, con vencimiento el 15/12/2048	114	0,01
990	UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, con vencimiento el 15/08/2049	760	0,09
20	UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2059	15	–
80	UnitedHealth Group Inc, 3,125 %, con vencimiento el 15/05/2060	52	0,01
40	US Bancorp, 1,450 %, con vencimiento el 12/05/2025	38	–
90	US Bancorp, serie mtn, 2,215 %, con vencimiento el 27/01/2028 *	82	0,01
500	US Bancorp, 5,775 %, con vencimiento el 12/06/2029 *	505	0,06
260	US Bancorp, 5,836 %, con vencimiento el 12/06/2034 *	263	0,03
410	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 01/11/2033	344	0,04
20	Verizon Communications Inc, 2,625 %, con vencimiento el 15/08/2026	19	–
10	Verizon Communications Inc, 3,000 %, con vencimiento el 22/03/2027	9	–
580	Verizon Communications Inc, 2,100 %, con vencimiento el 22/03/2028	517	0,06
962	Verizon Communications Inc, 4,329 %, con vencimiento el 21/09/2028	934	0,11
190	Verizon Communications Inc, 3,875 %, con vencimiento el 08/02/2029	181	0,02
500	Verizon Communications Inc, 3,150 %, con vencimiento el 22/03/2030	447	0,05
630	Verizon Communications Inc, 1,750 %, con vencimiento el 20/01/2031	505	0,06
544	Verizon Communications Inc, 2,550 %, con vencimiento el 21/03/2031	459	0,06
480	Verizon Communications Inc, 4,500 %, con vencimiento el 10/08/2033	453	0,06
580	Verizon Communications Inc, 5,250 %, con vencimiento el 16/03/2037	579	0,07
670	Verizon Communications Inc, 2,650 %, con vencimiento el 20/11/2040	462	0,06
180	Verizon Communications Inc, 3,400 %, con vencimiento el 22/03/2041	138	0,02
510	Verizon Communications Inc, 3,850 %, con vencimiento el 01/11/2042	410	0,05
50	Verizon Communications Inc, 4,862 %, con vencimiento el 21/08/2046	46	0,01
50	Verizon Communications Inc, 5,500 %, con vencimiento el 16/03/2047	50	0,01

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
270	Verizon Communications Inc, 4,000 %, con vencimiento el 22/03/2050	213	0,03
690	Verizon Communications Inc, 3,550 %, con vencimiento el 22/03/2051	501	0,06
330	Verizon Communications Inc, 5,500 %, con vencimiento el 23/02/2054	326	0,04
460	Visa Inc, 4,300 %, con vencimiento el 14/12/2045	412	0,05
170	Walt Disney Co/The, 6,650 %, con vencimiento el 15/11/2037	193	0,02
80	Warnermedia Holdings Inc, 6,412 %, con vencimiento el 15/03/2026	80	0,01
300	Warnermedia Holdings Inc, 3,755 %, con vencimiento el 15/03/2027	284	0,03
370	Warnermedia Holdings Inc, 4,054 %, con vencimiento el 15/03/2029	343	0,04
450	Warnermedia Holdings Inc, 4,279 %, con vencimiento el 15/03/2032	397	0,05
130	Warnermedia Holdings Inc, 5,050 %, con vencimiento el 15/03/2042	109	0,01
190	Warnermedia Holdings Inc, 5,141 %, con vencimiento el 15/03/2052	155	0,02
420	Waste Connections Inc, 5,000 %, con vencimiento el 01/03/2034	411	0,05
610	Wells Fargo & Co, 2,188 %, con vencimiento el 30/04/2026 *	585	0,07
870	Wells Fargo & Co, 3,000 %, con vencimiento el 23/10/2026	823	0,10
880	Wells Fargo & Co, 4,300 %, con vencimiento el 22/07/2027	854	0,10
560	Wells Fargo & Co, 3,584 %, con vencimiento el 22/05/2028 *	531	0,07
750	Wells Fargo & Co, 2,393 %, con vencimiento el 02/06/2028 *	684	0,08
370	Wells Fargo & Co, 4,150 %, con vencimiento el 24/01/2029	354	0,04
320	Wells Fargo & Co, 5,574 %, con vencimiento el 25/07/2029 *	322	0,04
1.040	Wells Fargo & Co, 2,879 %, con vencimiento el 30/10/2030 *	912	0,11
620	Wells Fargo & Co, 4,478 %, con vencimiento el 04/04/2031 *	590	0,07
330	Wells Fargo & Co, 3,350 %, con vencimiento el 02/03/2033 *	283	0,03
410	Wells Fargo & Co, 5,557 %, con vencimiento el 25/07/2034 *	409	0,05
520	Wells Fargo & Co, 4,900 %, con vencimiento el 17/11/2045	461	0,06
650	Wells Fargo & Co, 4,400 %, con vencimiento el 14/06/2046	536	0,07
100	Wells Fargo & Co, 4,750 %, con vencimiento el 07/12/2046	87	0,01
4.490	Wells Fargo & Co, 5,013 %, con vencimiento el 04/04/2051 *	4.155	0,51
130	Wells Fargo & Co, Series U, 5,875 %, Perpetuo *	130	0,02
50	Western Midstream Operating LP, 3,100 %, con vencimiento el 01/02/2025	49	0,01
110	Western Midstream Operating LP, 4,500 %, con vencimiento el 01/03/2028	105	0,01
1.340	Western Midstream Operating LP, 4,050 %, con vencimiento el 01/02/2030	1.240	0,15
40	Western Midstream Operating LP, 5,300 %, con vencimiento el 01/03/2048	34	–
130	Western Midstream Operating LP, 5,500 %, con vencimiento el 15/08/2048	114	0,01
180	Western Midstream Operating LP, 5,250 %, con vencimiento el 01/02/2050	159	0,02
350	Williams Cos Inc/The, Serie A, 7,500 %, con vencimiento el 15/01/2031	390	0,05
760	Williams Cos Inc/The, 7,750 %, con vencimiento el 15/06/2031	836	0,10
718	Williams Cos Inc/The, 8,750 %, con vencimiento el 15/03/2032	857	0,11
660	Williams Cos Inc/The, 5,150 %, con vencimiento el 15/03/2034	645	0,08
110	Wyeth LLC, 5,950 %, con vencimiento el 01/04/2037	118	0,01
		219.191	26,89
Zambia: 0,08 % (28 de febrero de 2023: 0,06 %)			
680	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/10/2027	647	0,08
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 328.435 $)		298.865	36,66
Bonos y obligaciones del Estado: 10,98 % (28 de febrero de 2023: 23,40 %)			
Argentina: 0,29 % (28 de febrero de 2023: 0,18 %)			
596	Bono Internacional de la República Argentina, 0,750 %, con vencimiento el 09/07/2030	274	0,03
1.062	Argentine Republic Government International Bond, 3,625 %, con vencimiento el 09/07/2035	396	0,05
1.850	Argentine Republic Government International Bond, 3,500 %, con vencimiento el 09/07/2041	668	0,08
1.865	Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 6,375 %, con vencimiento el 01/09/2037	725	0,09
757	Bonos del Gobierno de la Provincia de Buenos Aires, 144A, 6,375 %, con vencimiento el 01/09/2037	295	0,04
		2.358	0,29
Brasil: 0,75 % (28 de febrero de 2023: 1,02 %)			
BRL 14.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2027	2.813	0,34
BRL 14.599	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2033	2.828	0,35
640	Brazilian Government International Bond, 4,750 %, con vencimiento el 14/01/2050	475	0,06
		6.116	0,75
Colombia: 0,22 % (28 de febrero de 2023: 0,17 %)			
890	Colombia Government International Bond, 3,250 %, con vencimiento el 22/04/2032	688	0,08
900	Colombia Government International Bond, 4,125 %, con vencimiento el 22/02/2042	602	0,07
670	Colombia Government International Bond, 5,625 %, con vencimiento el 26/02/2044	526	0,07
		1.816	0,22
Israel: 0,10 % (28 de febrero de 2023: 0,08 %)			
650	Israel Government International Bond, 2,750 %, con vencimiento el 03/07/2050	557	0,07
390	Estado de Israel, 3,375 %, con vencimiento el 15/01/2050	262	0,03
		819	0,10
Kenia: 0,16 % (28 de febrero de 2023: 0,15 %)			
1.640	Republic of Kenya Government International Bond, 144A, 6,300 %, con vencimiento el 23/01/2034	1.294	0,16
México: 4,04 % (28 de febrero de 2023: 3,56 %)			
MXN 25.380	Mexican Bonos, serie M, 8,500 %, con vencimiento el 31/05/2029	1.451	0,18
MXN 194.400	Mexican Bonos, serie M, 7,750 %, con vencimiento el 23/11/2034	10.339	1,27
MXN 232.457	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, con vencimiento el 13/11/2042	11.795	1,45
MXN 141.550	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, con vencimiento el 07/11/2047	7.278	0,89
2.390	Mexico Government International Bond, 4,600 %, con vencimiento el 10/02/2048	1.890	0,23
190	Mexico Government International Bond, 5,750 %, con vencimiento el 12/10/2110	164	0,02
		32.917	4,04
Nigeria: 0,04 % (28 de febrero de 2023: 0,02 %)			
300	Nigeria Government International Bond, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 28/11/2027	274	0,04
Paraguay: 0,05 % (28 de febrero de 2023: 0,04 %)			
470	Paraguay Government International Bond, 144A, 3,849 %, con vencimiento el 28/06/2033	406	0,05
Perú: 0,11 % (28 de febrero de 2023: 0,10 %)			
730	Peruvian Government International Bond, 2,783 %, con vencimiento el 23/01/2031	622	0,08
480	Peruvian Government International Bond, 2,780 %, con vencimiento el 01/12/2060	276	0,03
		898	0,11
Estados Unidos: 5,22 % (28 de febrero de 2023: 16,97 %)			
1.440	Federal National Mortgage Association, 6,625 %, con vencimiento el 15/11/2030	1.626	0,20
830	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 09/05/2024	822	0,10
7.050	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125 %, con vencimiento el 15/01/2033 β	6.797	0,83
10	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, con vencimiento el 30/09/2028	10	–
190	United States Treasury Note/Bond, 3,750 %, con vencimiento el 31/12/2028	186	0,02
11.790	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, con vencimiento el 31/01/2031	11.600	1,42
5.390	United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, con vencimiento el 28/02/2031	5.384	0,66
940	United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, con vencimiento el 15/08/2043	920	0,11
5.300	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, con vencimiento el 15/11/2043	5.456	0,67
1.260	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, con vencimiento el 15/02/2050	785	0,10
2.970	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, con vencimiento el 15/08/2050	1.560	0,19
1.270	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, con vencimiento el 15/11/2050	713	0,09
300	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, con vencimiento el 15/02/2051	180	0,02
370	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, con vencimiento el 15/05/2051	250	0,03

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones del Estado (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
2.910	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, con vencimiento el 15/08/2051	1.793	0,22
2.040	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2053	1.954	0,24
430	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, con vencimiento el 15/11/2053	457	0,06
2.120	United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, con vencimiento el 15/02/2054	2.081	0,26
		42.574	5,22
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 94.550 $)		89.472	10,98
Obligaciones de préstamo: 2,78 % (28 de febrero de 2023: 4,08 %)			
538	Ali Group S.R.L., 7,447 %, con vencimiento el 13/10/2028 *	538	0,07
442	AmWINS Group, Inc., 7,697 %, con vencimiento el 17/02/2028 *	441	0,05
401	APi Group De Inc, 7,701 %, con vencimiento el 01/10/2026 *	402	0,05
1.069	Asurion LLC, 9,683 %, con vencimiento el 19/08/2028 *	1.065	0,13
764	Asurion LLC, 8,697 %, con vencimiento el 18/12/2026 *	761	0,09
162	Avolon TLB Borrower 1 (US) LLC, 7,320 %, con vencimiento el 22/06/2028 *	162	0,02
742	Brown Group Holding LLC, 8,183 %, con vencimiento el 07/06/2028 *	740	0,09
89	Caesars Entertainment, 8,663 %, con vencimiento el 25/01/2030 *	90	0,01
105	Castlelake Aviation One Dac, 8,135 %, con vencimiento el 22/10/2026 *	105	0,01
892	Citadel Securities LP, 7,836 %, con vencimiento el 29/07/2030 *	892	0,11
347	Cloudera Inc, 9,183 %, con vencimiento el 10/08/2028 *	346	0,04
1.168	DCert Buyer, Inc., 9,333 %, con vencimiento el 16/10/2026 *	1.161	0,14
1.016	Deerfield Dakota Holding LLC, 9,098 %, con vencimiento el 05/03/2027 *	1.005	0,12
231	First Eagle Holdings Inc, 7,948 %, con vencimiento el 17/02/2027 *	230	0,03
853	Focus Financial Partners LLC, 8,083 %, con vencimiento el 30/06/2028 *	849	0,11
1.826	Gainwell Acquisition Corp, 9,448 %, con vencimiento el 01/10/2027 *	1.751	0,22
350	Garda World Security Corp, 9,625 %, con vencimiento el 01/02/2029 *	351	0,04
1.887	Genesee & Wyoming Inc, 7,448 %, con vencimiento el 30/12/2026 *	1.889	0,23
957	Grifols Worldwide Operations USA Inc, 7,538 %, con vencimiento el 15/11/2027 *	941	0,12
841	Harbor Freight Tools USA Inc, 8,197 %, con vencimiento el 19/10/2027 *	837	0,10
607	ICON Luxembourg S.a.r.l., 7,860 %, con vencimiento el 01/07/2028 *	608	0,07
151	Indigo Merger Sub, Inc., 7,860 %, con vencimiento el 01/07/2028 *	151	0,02
228	Mozart Borrower LP, 8,451 %, con vencimiento el 30/09/2028 *	228	0,03
259	PCI Gaming Authority, 7,947 %, con vencimiento el 31/05/2026 *	259	0,03
843	Phoenix Guarantor Inc, 0,000 %, con vencimiento el 13/02/2031 *	835	0,10
609	Quikrete Holdings, Inc., 8,197 %, con vencimiento el 18/03/2029 *	610	0,08
1.110	SkyMiles IP Ltd, 9,068 %, con vencimiento el 20/10/2027 *	1.143	0,14
1.400	Sotera Health, 8,197 %, con vencimiento el 13/12/2026 *	1.397	0,17
1.271	Station Casinos LLC, 7,683 %, con vencimiento el 08/02/2027 *	1.270	0,16
1.057	UFC Holdings LLC, 8,336 %, con vencimiento el 29/04/2026 *	1.059	0,13
552	Virgin Media Bristol LLC, 7,932 %, con vencimiento el 04/01/2028 *	548	0,07
Total de obligaciones de préstamo (coste 22.736 $)		22.664	2,78
Acciones ordinarias: 0,04 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Suiza: 0,04 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
2.840	Credit Suisse Group AG Escrow †∞	348	0,04
Total de acciones ordinarias (coste – $)		348	0,04
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 888.917 $)		813.413	99,78

Contratos (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Opciones compradas: 0,06 % (28 de febrero de 2023: 0,05 %)			
–	CME 3 Month SOFR Futures April 2024 Put 94.75, con vencimiento el 12/04/2024 (Morgan Stanley)	14	–
–	CME 3 Month SOFR Futures December 2024 Put 96.00, con vencimiento el 13/12/2024 (Morgan Stanley)	190	0,03
–	CME 3 Month SOFR Futures March 2024 Call 94.6250, con vencimiento el 15/03/2024 (Morgan Stanley)	14	–
–	CME 3 Month SOFR Futures March 2024 Put 94.50, con vencimiento el 15/03/2024 (Morgan Stanley)	2	–
–	U.S. 10 Year April 2024 Put 109.75, con vencimiento el 22/03/2024 (Morgan Stanley)	21	–
–	U.S. 10 Year May 2024 Call 111.00, con vencimiento el 26/04/2024 (Morgan Stanley)	24	0,01
–	U.S. 2 Year June 2024 Call 103.50, con vencimiento el 24/05/2024 (Morgan Stanley)	6	–
–	U.S. 5 Year April 2024 Call 108.00, con vencimiento el 22/03/2024 (Morgan Stanley)	11	–
–	U.S. 5 Year W1 March 2024 Put 106.50, con vencimiento el 01/03/2024 (Morgan Stanley)	2	–
6.110	USD Call/CAD Put 1,3720, con vencimiento el 22/03/2024 (BNP Paribas)	9	–
7.020	USD Call/CHF Put 0.8725, con vencimiento el 16/03/2024 (Goldman Sachs)	94	0,01
7.910	USD Call/EUR Put 1,0808, con vencimiento el 12/03/2024 (Citi)	34	0,01
6.436	USD Put/AUD Call 0,6686, con vencimiento el 18/04/2024 (BNP Paribas)	18	–
6.980	USD Put/JPY Call 143,42, con vencimiento el 19/04/2024 (BNP Paribas)	21	–
Total de opciones compradas (coste 621 $)		460	0,06
Swaps de incumplimiento de crédito: 0,39 % (28 febrero de 2023: 0,19 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		3.206	0,39
Swaps sobre índices: 0,88 % (28 de febrero de 2023: 0,53 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		7.135	0,88
Contratos de divisas a plazo: 0,05 % (28 de febrero de 2023: 0,05 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		416	0,05
Futuros: 0,19 % (28 de febrero de 2023: 0,22 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		1.495	0,19
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		826.125	101,35

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas: (0,72 %) (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
(7.100)	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 % ±	(5.842)	(0,72)
Total de valores garantizados por hipotecas (coste (5.828) $)		(5.842)	(0,72)
Total de inversiones vendidas en corto a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste (5.828) $)		(5.842)	(0,72)

Contratos (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Opciones suscritas: (0,03 %) (28 de febrero de 2023: (0,06 %))			
–	CME 3 Month SOFR Futures December 2024 Call 97.1250, con vencimiento el 13/12/2024 (Morgan Stanley)	(23)	(0,01)
–	CME 3 Month SOFR Futures December 2024 Put 95.50, con vencimiento el 13/12/2024 (Morgan Stanley)	(102)	(0,01)
–	CME 3 Month SOFR Futures March 2024 Call 95.25, con vencimiento el 15/03/2024 (Morgan Stanley)	(1)	–
–	CME 3 Month SOFR Futures March 2024 Call 96.1250, con vencimiento el 15/03/2024 (Morgan Stanley)	(1)	–
–	U.S. 10 Year April 2024 Put 108.75, con vencimiento el 22/03/2024 (Morgan Stanley)	(12)	–
–	U.S. 10 Year April 2024 Put 108.00, con vencimiento el 26/04/2024 (Morgan Stanley)	(21)	–
–	U.S. 2 Year June 2024 Call 104.50, con vencimiento el 24/05/2024 (Morgan Stanley)	(2)	–
–	U.S. 5 Year April 2024 Put 105.25, con vencimiento el 22/03/2024 (Morgan Stanley)	(7)	–
–	U.S. Bond April 2024 Call 122.00, con vencimiento el 22/03/2024 (Morgan Stanley)	(24)	(0,01)
–	U.S. Bond June 2024 Call 130.00, con vencimiento el 24/05/2024 (Morgan Stanley)	(2)	–
(7.020)	USD Call/CHF Put 0.8890, con vencimiento el 16/03/2024 (Goldman Sachs)	(20)	–
Total de opciones suscritas (coste (356) $)		(215)	(0,03)
Swaps de incumplimiento de crédito: (0,05 %) (28 febrero de 2023: (0,01 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(459)	(0,05)
Swaps sobre índices: (0,02 %) (28 de febrero de 2023: (0,04 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(146)	(0,02)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Contratos (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Swaps de tasas de interés: (0,13 %) (28 de febrero de 2023: (0,11 %))		
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(1.035)	(0,13)
Contratos de divisas a plazo: (0,17 %) (28 de febrero de 2023: (0,23 %))		
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(1.408)	(0,17)
Futuros: (0,07 %) (28 de febrero de 2023: (0,32 %))		
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(552)	(0,07)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	(9.657)	(1,19)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	816.468	100,16
Excedente de pasivos respecto a otros activos	(1.213)	(0,16)
Patrimonio	815.255 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 116.018.000 USD o el 14,25 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

† 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 al final o tras el ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024 (ya sea capital o interés).

± 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 29 de febrero de 2024.

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

INR – Rupia india

MXN – Peso mexicano

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	92,02
Otros valores mobiliarios negociables en otro mercado regulado	2,64
Instrumentos financieros derivados	1,48
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)
Morgan Stanley	CDX.HY.CDSI 5 años, 5,000 %: comprar	20 de diciembre de 2028	7.311	$ (459)
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % – Vender	20 de diciembre de 2028	155.474	3.188
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % – Vender	20 de diciembre de 2033	3.640	18
Apreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): 2.240 $)				$ 3.206
Depreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): (158) $)				(459)
Apreciación neta de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): 2.082 $)				$ 2.747

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, Receive Fixed 10,262 %	02 de enero de 2029	82.920	$ (106)
Morgan Stanley	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,450 %	18 de julio de 2029	142.060	(453)
Morgan Stanley	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,440 %	20 de julio de 2029	147.960	(476)
Apreciación latente de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 (en miles): – $)				$ –
Depreciación latente de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 (en miles): (1.287) $)				(1.035)
Depreciación neta de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 (en miles): (1.287) $)				$ (1.035)

Listado de swaps de inflación

Contraparte	Entidad de referencia	Fecha de vencimiento	Importe teórico (en miles)	Valor (en miles)
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,600 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15 de febrero de 2048	6.547	$ 1.189
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,050 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15 de febrero de 2048	44.763	4.992
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,150 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15 de mayo de 2048	86	8
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,530 %, Receive Floating USD Sofr Compound	31 de octubre de 2030	15.568	360
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,540 %, Receive Floating USD Sofr Compound	31 de octubre de 2030	26.001	586
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,870 %, Receive Floating USD Sofr Compound	28 de febrero de 2031	4.547	(4)
Morgan Stanley	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 3,500 %	30 de septiembre de 2024	13.390	(142)
Apreciación latente de swaps sobre índices (28 de febrero de 2023 (en miles): 6.036 $)				$ 7.135
Depreciación latente de swaps sobre índices (28 de febrero de 2023 (en miles): (422) $)				(146)
Apreciación neta de swaps sobre índices (28 de febrero de 2023 (en miles): 5.614 $)				$ 6.989

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(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)
13 de marzo de 2024	Citi	Compra	EUR	2.500	Venta	USD	2.712		$ (10)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	33	Venta	AUD	53		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	33	Venta	AUD	51		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	41	Venta	EUR	38		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	9	Venta	EUR	8		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	–	Venta	GBP	–		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	896	Venta	USD	584		(2)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	10	Venta	USD	11		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	27	Venta	USD	34		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	786	Venta	USD	845		5
19 de abril de 2024	BNP Paribas	Compra	NOK	66.018	Venta	EUR	5.823		(83)
19 de abril de 2024	Citi	Compra	USD	2.927	Venta	CAD	3.910		43
19 de abril de 2024	Citi	Compra	USD	938	Venta	EUR	870		(4)
19 de abril de 2024	Citi	Compra	USD	5.433	Venta	EUR	4.990		29
19 de abril de 2024	Citi	Compra	USD	7.027	Venta	GBP	5.511		68
19 de abril de 2024	Citi	Compra	USD	491	Venta	MXN	8.468		(1)
19 de abril de 2024	Citi	Compra	IDR	2.499.385	Venta	USD	160		(1)
19 de abril de 2024	Citi	Compra	EUR	3.410	Venta	USD	3.751		(57)
19 de abril de 2024	Citi	Compra	AUD	13.061	Venta	USD	8.757		(254)
19 de abril de 2024	Citi	Compra	GBP	1.024	Venta	USD	1.307		(14)
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	2.159	Venta	CHF	1.890		11
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	1.762	Venta	EUR	1.620		6
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	407	Venta	MXN	6.970		2
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	1.756	Venta	MXN	30.310		(7)
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	CHF	1.440	Venta	USD	1.635		2
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	EUR	132	Venta	USD	143		(1)
19 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	USD	13.340	Venta	CNH	94.905		127
19 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	USD	161	Venta	IDR	2.499.385		3
19 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	USD	844	Venta	MXN	14.460		3
19 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	USD	4.428	Venta	MXN	76.470		(23)
19 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	MXN	13.220	Venta	USD	769		–
19 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	3.854	Venta	JPY	556.980		108
19 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	CAD	12.027	Venta	USD	8.982		(114)
19 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	INR	156.175	Venta	USD	1.871		9
19 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	JPY	2.944.327	Venta	USD	20.640		(837)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 540 $)									$ 416
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (2.578) $)									(1.408)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (2.038) $)									$ (992)

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	(203)	$ (48.034)	$ (55)
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2024	Morgan Stanley	167	39.871	(79)
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2025	Morgan Stanley	429	103.266	68
Índice SOFR de 3 meses Marzo 2024	Morgan Stanley	(68)	(16.096)	(19)
Euro-Bund marzo 2024	Morgan Stanley	(86)	(12.330)	127
Bonos Euro-Buxl a 30 años marzo de 2024	Morgan Stanley	(25)	(3.598)	(2)
Euro-OAT marzo 2024	Morgan Stanley	91	12.559	(36)
Bono a 10 años de Japón (OSE) marzo 2024	Morgan Stanley	(17)	(16.585)	(129)
Long Gilt junio 2024	Morgan Stanley	60	7.429	(3)
U.S. 10 Year Note (CBT) junio de 2024	Morgan Stanley	754	83.270	179
U.S. 10 Year Ultra Note junio 2024	Morgan Stanley	(475)	(54.232)	(216)
U.S. 2 Year Note (CBT) junio de 2024	Morgan Stanley	125	25.594	(13)
U.S. 5 Year Note (CBT) junio de 2024	Morgan Stanley	68	7.270	10
U.S. Long Bond (CBT) junio 2024	Morgan Stanley	302	36.013	269
U.S. Ultra Bond (CBT) junio 2024	Morgan Stanley	831	106.264	842
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 2.474 $)				$ 1.495
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (3.625) $)				(552)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (1.151) $)				$ 943

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) EUR	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas: 3,79 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
USD 100	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 % ±	76	0,15
USD 75	Fannie Mae Pool 'BQ3331', 2,000 %, con vencimiento el 01/08/2050	55	0,11
USD 258	Fannie Mae Pool 'CB2664', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2052	204	0,41
USD 90	Fannie Mae Pool 'CB4788', 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2052	81	0,16
USD 95	Fannie Mae Pool 'CB6540', 6,000 %, con vencimiento el 01/06/2053	89	0,18
USD 39	Fannie Mae Pool 'FM1263', 4,500 %, con vencimiento el 01/07/2049	34	0,07
USD 79	Fannie Mae Pool 'FM3049', 4,000 %, con vencimiento el 01/04/2044	69	0,14
USD 83	Fannie Mae Pool 'FM9195', 2,500 %, con vencimiento el 01/10/2051	64	0,13
USD 177	Fannie Mae Pool 'MA3210', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2047	148	0,30
USD 72	Freddie Mac Pool 'QB4985', 2,000 %, con vencimiento el 01/11/2050	53	0,11
USD 87	Freddie Mac Pool 'QC9443', 2,500 %, con vencimiento el 01/10/2051	67	0,13
USD 86	Freddie Mac Pool 'QK1354', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2042	66	0,13
USD 82	Freddie Mac Pool 'RB5131', 2,000 %, con vencimiento el 01/10/2041	64	0,13
USD 96	Freddie Mac Pool 'SD2762', 5,500 %, con vencimiento el 01/05/2053	88	0,18
USD 89	Freddie Mac Pool 'SD2792', 4,500 %, con vencimiento el 01/03/2047	80	0,16
USD 93	Freddie Mac Pool 'SD7560', 4,000 %, con vencimiento el 01/02/2053	80	0,16
USD 83	Ginnie Mae II Pool '785657', 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2051	64	0,13
USD 70	Ginnie Mae II Pool 'MA7192', 2,000 %, con vencimiento el 20/02/2051	53	0,11
USD 100	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 4,500 % ±	88	0,18
USD 400	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 % ±	362	0,72
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 1.921 €)		1.885	3,79
Bonos y obligaciones corporativos: 41,46 % (28 de febrero de 2023: 43,18 %)			
Australia: 1,04 % (28 de febrero de 2023: 0,70 %)			
530	Glencore Finance Europe Ltd, 1,750 %, con vencimiento el 17/03/2025	519	1,04
Bélgica: 0,27 % (28 de febrero de 2023: 0,16 %)			
140	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2,125 %, con vencimiento el 02/12/2027	135	0,27
Brasil: 0,78 % (28 de febrero de 2023: 0,52 %)			
USD 510	Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125 %, con vencimiento el 15/01/2032	388	0,78
Canadá: 1,63 % (28 de febrero de 2023: 1,89 %)			
300	Bank of Montreal, 2,750 %, con vencimiento el 15/06/2027	294	0,59
USD 10	MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 01/02/2029	9	0,02
GBP 440	Royal Bank of Canada, 5,000 %, con vencimiento el 24/01/2028	511	1,02
		814	1,63
Francia: 4,78 % (28 de febrero de 2023: 3,70 %)			
170	Altice France SA/France, 3,375 %, con vencimiento el 15/01/2028	139	0,28
700	BNP Paribas SA, 0,500 %, con vencimiento el 30/05/2028 *	630	1,26
400	Credit Agricole SA, 1,875 %, con vencimiento el 22/04/2027 *	384	0,77
GBP 100	Credit Agricole SA, 4,875 %, con vencimiento el 23/10/2029	116	0,23
100	Credit Agricole SA, 4,000 %, con vencimiento el 18/01/2033	103	0,21
200	Dassault Systemes SE, 0,125 %, con vencimiento el 16/09/2026	185	0,37
360	Orange SA, 5,000 %, Perpetuo *	367	0,73
200	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR, 2,125 %, con vencimiento el 27/09/2038	167	0,34
300	Thales SA, 0,750 %, con vencimiento el 23/01/2025	292	0,59
		2.383	4,78
Alemania: 2,83 % (28 de febrero de 2023: 2,06 %)			
400	Allianz SE, 2,625 %, Perpetuo *	310	0,62
200	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250 %, con vencimiento el 26/05/2049 *	191	0,38
560	NRW Bank, 0,375 %, con vencimiento el 16/05/2029	493	0,99
380	Volkswagen Financial Services AG, 0,875 %, con vencimiento el 31/01/2028	342	0,69
100	Vonovia SE, 1,000 %, con vencimiento el 16/06/2033	74	0,15
		1.410	2,83
Israel: 0,40 % (28 de febrero de 2023: 0,28 %)			
USD 230	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, con vencimiento el 01/10/2026	197	0,40
Italia: 2,51 % (28 de febrero de 2023: 1,91 %)			
410	CA Auto Bank SPA/Ireland, 0,500 %, con vencimiento el 13/09/2024	402	0,81
520	Intesa Sanpaolo SpA, 1,000 %, con vencimiento el 04/07/2024	515	1,03
340	UniCredit SpA, 2,000 %, con vencimiento el 23/09/2029 *	335	0,67
		1.252	2,51
Japón: 0,31 % (28 de febrero de 2023: 0,21 %)			
160	Asahi Group Holdings Ltd, 1,151 %, con vencimiento el 19/09/2025	154	0,31
Luxemburgo: 2,56 % (28 de febrero de 2023: 1,71 %)			
305	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,750 %, con vencimiento el 12/03/2029	263	0,53
700	Logicor Financing Sarl, 1,625 %, con vencimiento el 15/07/2027	636	1,28
130	Prologis International Funding II SA, 2,375 %, con vencimiento el 14/11/2030	118	0,23
270	SELP Finance Sarl, 1,500 %, con vencimiento el 20/11/2025	259	0,52
		1.276	2,56
Macao: 0,32 % (28 de febrero de 2023: 0,23 %)			
USD 200	Sands China Ltd, 3,100 %, con vencimiento el 08/03/2029	160	0,32
Países Bajos: 1,27 % (28 de febrero de 2023: 1,45 %)			
100	ABN AMRO Bank NV, 4,500 %, con vencimiento el 21/11/2034	105	0,21
170	Enexis Holding NV, 0,750 %, con vencimiento el 02/07/2031	142	0,28
400	Euronext NV, 1,000 %, con vencimiento el 18/04/2025	387	0,78
		634	1,27
Singapur: 0,34 % (28 de febrero de 2023: 0,24 %)			
270	Temasek Financial I Ltd, 1,250 %, con vencimiento el 20/11/2049	170	0,34
Sudáfrica: 0,33 % (28 de febrero de 2023: 0,22 %)			
170	Anglo American Capital Plc, 1,625 %, con vencimiento el 18/09/2025	164	0,33
España: 2,38 % (28 de febrero de 2023: 1,43 %)			
700	Banco Santander SA, 2,500 %, con vencimiento el 18/03/2025	689	1,39
200	Cellnex Finance Co SA, 2,000 %, con vencimiento el 15/09/2032	171	0,34
330	Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, con vencimiento el 18/09/2027	324	0,65
		1.184	2,38
Supranacional: 1,14 % (28 de febrero de 2023: 3,10 %)			
640	African Development Bank, 0,500 %, con vencimiento el 21/03/2029	569	1,14
Suiza: 1,17 % (28 de febrero de 2023: 1,32 %)			
380	UBS Group AG, 3,250 %, con vencimiento el 02/04/2026 *	376	0,76
220	UBS Group AG, 1,000 %, con vencimiento el 24/06/2027 *	206	0,41
		582	1,17
Emiratos Árabes Unidos: 0,28 % (28 de febrero de 2023: 0,21 %)			
180	MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000 %, con vencimiento el 10/03/2034	139	0,28
Reino Unido: 6,25 % (28 de febrero de 2023: 5,38 %)			
420	Annington Funding Plc, 1,650 %, con vencimiento el 12/07/2024	414	0,83
100	Aviva Plc, 3,375 %, con vencimiento el 04/12/2045 *	98	0,20
570	Barclays Plc, 3,375 %, con vencimiento el 02/04/2025 *	570	1,14
610	Lloyds Banking Group Plc, 4,703 %, con vencimiento el 21/06/2024 *	611	1,23
GBP 130	Premier Foods Finance Plc, 3,500 %, con vencimiento el 15/10/2026	146	0,29
230	Rentokil Initial Plc, 0,950 %, con vencimiento el 22/11/2024	225	0,45
100	Segro Capital Sarl, 1,875 %, con vencimiento el 23/03/2030	89	0,18
320	Standard Chartered Plc, 3,125 %, con vencimiento el 19/11/2024	318	0,64
GBP 140	Virgin Media Secured Finance Plc, 5,250 %, con vencimiento el 15/05/2029	150	0,30
440	Vodafone Group Plc, 2,875 %, con vencimiento el 20/11/2037	399	0,80
100	Wellcome Trust Ltd/The, 1,125 %, con vencimiento el 21/01/2027	94	0,19
		3.114	6,25
Estados Unidos: 10,50 % (28 de febrero de 2023: 14,56 %)			
230	AbbVie Inc, 1,250 %, con vencimiento el 01/06/2024	229	0,46
120	AT&T Inc, 3,550 %, con vencimiento el 17/12/2032	118	0,24
USD 40	Ball Corp, 3,125 %, con vencimiento el 15/09/2031	31	0,06

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) EUR	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
USD 60	Bank of America Corp, 4,571 %, con vencimiento el 27/04/2033 *	52	0,10
230	Berkshire Hathaway Inc, 1,125 %, con vencimiento el 16/03/2027	215	0,43
USD 160	Boeing Co/The, 5,150 %, con vencimiento el 01/05/2030	146	0,29
USD 13	Bristol-Myers Squibb Co, 2,900 %, con vencimiento el 26/07/2024	12	0,02
USD 70	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, con vencimiento el 01/05/2032	51	0,10
USD 70	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 01/06/2033	50	0,10
USD 20	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, con vencimiento el 23/07/2025	18	0,04
USD 50	Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, con vencimiento el 31/01/2032	39	0,08
650	Citigroup Inc, 1,750 %, con vencimiento el 28/01/2025	638	1,28
USD 40	Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 01/05/2025	38	0,08
USD 60	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 20/10/2025	54	0,11
USD 90	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 20/10/2028	82	0,16
230	DH Europe Finance II Sarl, 1,800 %, con vencimiento el 18/09/2049	160	0,32
USD 70	Energy Transfer LP, 5,950 %, con vencimiento el 01/10/2043	63	0,13
USD 60	Ford Motor Co, 3,250 %, con vencimiento el 12/02/2032	46	0,09
USD 20	Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, con vencimiento el 01/08/2030	18	0,04
USD 190	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, con vencimiento el 15/03/2043	164	0,33
420	General Electric Co, 0,875 %, con vencimiento el 17/05/2025	405	0,81
140	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,125 %, con vencimiento el 30/09/2024	139	0,28
USD 30	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, con vencimiento el 01/04/2025	27	0,05
480	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,875 %, con vencimiento el 09/05/2029	415	0,83
USD 20	Humana Inc, 2,150 %, con vencimiento el 03/02/2032	15	0,03
USD 60	JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, con vencimiento el 22/04/2031 *	48	0,09
200	McDonald's Corp, 1,875 %, con vencimiento el 26/05/2027	191	0,38
USD 130	Morgan Stanley, 3,622 %, con vencimiento el 01/04/2031 *	109	0,22
100	Morgan Stanley, 5,148 %, con vencimiento el 25/01/2034 *	108	0,22
320	Netflix Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/11/2029	325	0,65
190	Prologis Euro Finance LLC, 1,875 %, con vencimiento el 05/01/2029	175	0,35
380	Prologis Euro Finance LLC, 1,500 %, con vencimiento el 08/02/2034	305	0,61
USD 130	Southwestern Energy Co, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2032	109	0,22
USD 42	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 20/09/2025	28	0,06
USD 70	Targa Resources Corp, 4,950 %, con vencimiento el 15/04/2052	56	0,11
USD 10	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, con vencimiento el 15/01/2032	8	0,02
USD 10	T-Mobile USA Inc, 2,250 %, con vencimiento el 15/02/2026	9	0,02
USD 40	T-Mobile USA Inc, 2,625 %, con vencimiento el 15/02/2029	33	0,07
USD 30	T-Mobile USA Inc, 2,875 %, con vencimiento el 15/02/2031	24	0,05
USD 40	T-Mobile USA Inc, 3,500 %, con vencimiento el 15/04/2031	33	0,07
USD 10	United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 15/04/2026	9	0,02
USD 100	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 15/04/2029	85	0,17
USD 110	United Rentals North America Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/02/2031	90	0,18
USD 20	UnitedHealth Group Inc, 3,750 %, con vencimiento el 15/07/2025	18	0,04
250	Wells Fargo & Co, 1,625 %, con vencimiento el 02/06/2025	243	0,49
		5.231	10,50
Zambia: 0,37 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
USD 200	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 01/03/2026	185	0,37
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 21.649 €)		20.660	41,46

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) EUR	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones del Estado: 49,13 % (28 de febrero de 2023: 51,32 %)			
Austria: 2,32 % (28 de febrero de 2023: 2,40 %)			
1.340	Bono del Estado de la República de Austria, 144A, 0,900 %, con vencimiento el 20/02/2032	1.157	2,32
Bélgica: 2,14 % (28 de febrero de 2023: 2,12 %)			
1.000	Bono del Estado del Reino de Bélgica, Serie 71, 3,750 %, con vencimiento el 22/06/2045	1.064	2,14
Francia: 10,70 % (28 de febrero de 2023: 11,80 %)			
2.120	Bono del Estado de la República Francesa OAT, 0,000 %, con vencimiento el 25/11/2030	1.769	3,55
1.030	Bono del Estado de la República Francesa OAT, 0,000 %, con vencimiento el 25/05/2032	822	1,65
1.835	Bono del Estado de la República Francesa OAT, 3,250 %, con vencimiento el 25/05/2045	1.836	3,69
320	Bono del Estado de la República Francesa OAT, 144A, 1,500 %, con vencimiento el 25/05/2050	221	0,44
220	Bono del Estado de la República Francesa OAT, 4,000 %, con vencimiento el 25/04/2060	252	0,50
500	UNEDIC ASSEO, 1,250 %, con vencimiento el 25/05/2033	432	0,87
		5.332	10,70
Alemania: 7,42 % (28 de febrero de 2023: 11,53 %)			
320	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, con vencimiento el 15/08/2030	275	0,55
2.900	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, con vencimiento el 15/08/2032	2.757	5,53
530	Bono ligado a la inflación Deutsche Bundesrepublik, Serie I/L, 0,500 %, con vencimiento el 15/04/2030 β	665	1,34
		3.697	7,42
Irlanda: 1,07 % (28 de febrero de 2023: 1,03 %)			
650	Bono del Estado de Irlanda, 0,350 %, con vencimiento el 18/10/2032	534	1,07
Italia: 5,95 % (28 de febrero de 2023: 6,17 %)			
910	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie 10Y, 2,500 %, con vencimiento el 01/12/2032	832	1,67
2.475	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie 31Y, 144A, 3,250 %, con vencimiento el 01/09/2046	2.132	4,28
		2.964	5,95
México: 1,24 % (28 de febrero de 2023: 1,91 %)			
780	Bono Internacional del Estado de México, 2,875 %, con vencimiento el 08/04/2039	616	1,24
Países Bajos: 4,33 % (28 de febrero de 2023: 4,24 %)			
2.540	Bono del Estado de los Países bajos, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 15/07/2030	2.156	4,33
Noruega: 0,96 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
NOK 940	Bono del Estado de Noruega, Serie 484, 144A, 2,125 %, con vencimiento el 18/05/2032	72	0,15
NOK 4960	Bono del Estado de Noruega, Serie 486, 144A, 3,000 %, con vencimiento el 15/08/2033	405	0,81
		477	0,96
Polonia: 1,39 % (28 de febrero de 2023: 1,27 %)			
PLN 3860	Bono del Estado de la República de Polonia, Serie 0432, 1,750 %, con vencimiento el 25/04/2032	691	1,39
Sudáfrica: 1,37 % (28 de febrero de 2023: 1,59 %)			
USD 820	Bono Internacional del Estado de la República de Sudáfrica, 4,300 %, con vencimiento el 12/10/2028	685	1,37
Corea del Sur: 2,30 % (28 de febrero de 2023: 0,84 %)			
1.150	1.150 Export-Import Bank of Korea, 0,375 %, con vencimiento el 26/03/2024	1.147	2,30
España: 3,95 % (28 de febrero de 2023: 5,75 %)			
660	Bono del Estado de España, 144A, 1,400 %, con vencimiento el 30/04/2028	621	1,24
480	Bono del Estado de España, 144A, 2,900 %, con vencimiento el 31/10/2046	419	0,84
1.120	Bono del Estado de España, Serie 30Y, 144A, 2,700 %, con vencimiento el 31/10/2048	930	1,87
		1.970	3,95
Supranacional: 2,07 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
1.130	Mecanismo Europeo de Estabilidad Financiera, Serie EUR, 0,750 %, con vencimiento el 05/09/2028	1.031	2,07
Reino Unido: 0,39 % (28 de febrero de 2023: 0,35 %)			
GBP 10	United Kingdom Gilt, 2,500 %, con vencimiento el 22/07/2065	8	0,01
GBP 160	United Kingdom Inflation-Linked Gilt, Serie 3MO, 0,125 %, con vencimiento el 22/03/2068	188	0,38
		196	0,39
Estados Unidos: 1,53 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
USD 800	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,375 %, con vencimiento el 15/07/2033 β	716	1,44
USD 60	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,625 %, con vencimiento el 15/02/2053	49	0,09
		765	1,53
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 27.838 €)		24.482	49,13

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) EUR	% del valor neto de los activos
Organismos de inversión colectiva: 1,57 % (28 de febrero de 2023: 0,50 %)			
USD 845	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	782	1,57
Total de organismos de inversión colectiva (coste 784 €)		782	1,57
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 52.192 €)		47.809	95,95
Contratos de divisas a plazo: 0,03 % (28 de febrero de 2023: 0,05 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		16	0,03
Futuros: 0,02 % (28 de febrero de 2023: 0,36 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		9	0,02
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		47.834	96,00
Contratos de divisas a plazo: (0,03 %) (28 de febrero de 2023: (0,25 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(15)	(0,03)
Futuros: (0,45 %) (28 de febrero de 2023: (0,80 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(224)	(0,45)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(239)	(0,48)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		47.595	95,52
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		2.234	4,48
Patrimonio		49.829 €	100,00

– Los importes designados como "–" son 0 EUR, menos de 1.000 EUR, 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 8.653.000 EUR o el 17,37 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

± 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 29 de febrero de 2024.

ABREVIATURAS:

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

NOK – Corona noruega

PLN – Esloti polaco

USD – Dólar estadounidense

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	92,71
Organismos de inversión colectiva	1,54
Instrumentos financieros derivados	0,05
Otros activos	5,70
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)
13 de mayo de 2024	Citi	Compra	SEK	5.740	Venta	EUR	507	€ 5
13 de mayo de 2024	Citi	Compra	EUR	115	Venta	JPY	18.072	2
13 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	EUR	72	Venta	CAD	105	1
13 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	EUR	154	Venta	GBP	132	1
13 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	EUR	3.406	Venta	USD	3.701	(8)
13 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	EUR	50	Venta	AUD	83	1
13 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	PLN	347	Venta	EUR	79	1
13 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	NOK	327	Venta	EUR	29	(1)
13 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	EUR	1.390	Venta	GBP	1.189	4
13 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	EUR	60	Venta	JPY	9.534	1
13 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	EUR	1.958	Venta	USD	2.128	(4)
13 de mayo de 2024	UBS	Compra	EUR	775	Venta	USD	842	(2)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 72 €)								€ 16
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (338) €)								(15)
Apreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (266) €)								€ 1

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 2024	Bank of America Merrill Lynch	33	€ 7.290	€ 3
Euro-Bobl marzo de 2024	Bank of America Merrill Lynch	48	5.579	(63)
Euro-BTP marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	(3)	(354)	(1)
Euro-Bund marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	39	5.173	(36)
Bonos Euro-Buxl a 30 años marzo de 2024	Bank of America Merrill Lynch	(4)	(533)	(10)
Euro-Schatz March 2024	Bank of America Merrill Lynch	75	7.886	(68)
Bono a 10 años de Japón (OSE) marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	(6)	(5.416)	(34)
Long Gilt junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	6	687	4
U.S. 10 Year Note (CBT) junio de 2024	Bank of America Merrill Lynch	(23)	(2.350)	(5)
U.S. 10 Year Ultra Note junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	(18)	(1.901)	(7)
U.S. 5 Year Note (CBT) junio de 2024	Bank of America Merrill Lynch	(1)	(99)	–
U.S. Ultra Bond (CBT) junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	2	237	2
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 476 €)				€ 9
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (1.065) €)				(224)
Depreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (589) €)				€ (215)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por activos: 1,79 % (28 de febrero de 2023: 0,24 %)			
782	Arbys Funding LLC, Serie 2020 1A, Clase A2, 144A, 3,237 %, con vencimiento el 30/07/2050	723	0,30
590	Home Equity Asset Trust 2005-6, Serie 2005 6, Clase M5, 6,380 %, con vencimiento el 25/12/2035 *	547	0,23
291	Jack in the Box Funding LLC, Serie 2019 1A, Clase A2II, 144A, 4,476 %, con vencimiento el 25/08/2049	280	0,12
480	Jack in the Box Funding LLC, Serie 2022 1A, Clase A2I, 144A, 3,445 %, con vencimiento el 26/02/2052	445	0,18
830	Mosaic Solar Loan Trust 2023-4, Serie 2023 4A, Clase C, 144A, 8,800 %, con vencimiento el 20/05/2053	844	0,35
1.030	ServiceMaster Funding LLC, Serie 2021 1, Clase A2II, 144A, 3,113 %, con vencimiento el 30/07/2051	849	0,35
698	SMB Private Education Loan Trust 2021-B, Serie 2021 B, Clase A, 144A, 1,310 %, con vencimiento el 17/07/2051	633	0,26
Total de valores garantizados por activos (coste 4.298 $)		4.321	1,79
Valores garantizados por hipotecas: 3,90 % (28 de febrero de 2023: 1,81 %)			
650	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust, Serie 2017 280P, Clase D, 144A, 7,158 %, con vencimiento el 15/09/2034 *	604	0,25
580	BANK 2018-BNK15, serie 2018 BN15, clase B, 4,661 %, con vencimiento el 15/11/2061 *	550	0,23
470	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC29, Serie 2015 GC29, Clase D, 144A, 3,110 %, con vencimiento el 10/04/2048	396	0,16
290	COMM 2018-COR3 Mortgage Trust, Serie 2018 COR3, Clase B, 4,512 %, con vencimiento el 10/05/2051 *	248	0,10
219	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Serie 2019 R05, Clase 1B1, 144A, 9,536 %, con vencimiento el 25/07/2039 *	228	0,10
260	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Serie 2020 R01, Clase 1B1, 144A, 8,686 %, con vencimiento el 25/01/2040 *	268	0,11
450	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Clase 1B1, 144A, 8,422 %, con vencimiento el 25/10/2041 *	461	0,19
390	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05, serie 2023 R05, clase 1M2, 144A, 8,421 %, con vencimiento el 25/06/2043 *	409	0,17
800	CSAIL 2015-C3 Commercial Mortgage Trust, Serie 2015 C3, Clase C, 4,350 %, con vencimiento el 15/08/2048 *	671	0,28
710	CSAIL 2016-C7 Commercial Mortgage Trust, Serie 2016 C7, Clase C, 4,375 %, con vencimiento el 15/11/2049 *	629	0,26
132	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Serie 2020 DNA3, Clase B1, 144A, 10,536 %, con vencimiento el 25/06/2050 *	146	0,06
730	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, Serie 2021 DNA3, Clase B1, 144A, 8,822 %, con vencimiento el 25/10/2033 *	803	0,33
947	Hilton USA Trust 2016-HHV, Serie 2016 HHV, Clase D, 144A, 4,194 %, con vencimiento el 05/11/2038 *	886	0,37
5.300	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, 0,000 %, con vencimiento el 15/06/2035 †ε	66	0,03
650	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C30, Serie 2015 C30, Clase AS, 4,226 %, con vencimiento el 15/07/2048 *	602	0,25
802	Neighborly Issuer 2023-1, Serie 2023 1A, Clase A2, 144A, 7,308 %, con vencimiento el 30/01/2053	814	0,34
581	OBX 2024-NQM1 Trust, Serie 2024 NQM1, Clase A1, 144A, 5,928 %, con vencimiento el 25/11/2063	580	0,24
205	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-1, Serie 2017 1, Clase M1, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 25/01/2056 *	204	0,09
1.390	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR17 Trust, Serie 2005 AR17, Clase A1C3, 6,395 %, con vencimiento el 25/12/2045 *	830	0,34
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 14.925 $)		9.395	3,90
Bonos y obligaciones corporativos: 45,46 % (28 de febrero de 2023: 55,37 %)			
Argentina: 0,20 % (28 de febrero de 2023: 0,20 %)			
500	YPF SA, 8,500 %, con vencimiento el 28/07/2025	488	0,20
Brasil: 0,92 % (28 de febrero de 2023: 1,95 %)			
1.400	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 20/09/2031	1.223	0,51
1.040	Suzano Austria GmbH, 5,000 %, con vencimiento el 15/01/2030	991	0,41
		2.214	0,92
Canadá: 0,52 % (28 de febrero de 2023: 0,99 %)			
380	MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 01/02/2029	371	0,15
260	Open Text Corp, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/02/2028	239	0,10
740	Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 15/02/2030	654	0,27
		1.264	0,52
China: 0,51 % (28 de febrero de 2023: 0,53 %)			
1.980	BRF NV, 3,832 %, con vencimiento el 08/02/2051	1.222	0,51
Colombia: 0,24 % (28 de febrero de 2023: 0,24 %)			
550	Ecopetrol SA, 8,875 %, con vencimiento el 13/01/2033	579	0,24
Finlandia: 0,28 % (28 de febrero de 2023: 0,28 %)			
EUR 650	Nordea Bank Abp, 3,500 %, Perpetuo *	685	0,28
Francia: 3,06 % (28 de febrero de 2023: 2,03 %)			
EUR 840	Altice France SA/France, 2,125 %, con vencimiento el 15/02/2025	880	0,37
530	Altice France SA/France, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 01/02/2027	487	0,20
EUR 350	Banijay Entertainment SASU, 7,000 %, con vencimiento el 01/05/2029	397	0,17
EUR 1.000	BNP Paribas SA, 2,500 %, con vencimiento el 31/03/2032 *	1.017	0,42
1.690	BNP Paribas SA, 7,375 %, Perpetuo *	1.696	0,70
EUR 560	Burger King France SAS, 8,647 %, con vencimiento el 01/11/2026 *	613	0,26
EUR 570	Goldstory SAS, 5,375 %, con vencimiento el 01/03/2026	624	0,26
EUR 780	Goldstory SAS, 6,750 %, con vencimiento el 01/02/2030	849	0,35
EUR 300	IPD 3 BV, 8,000 %, con vencimiento el 15/06/2028	345	0,14
EUR 420	Rexel SA, 5,250 %, con vencimiento el 15/09/2030	468	0,19
		7.376	3,06
Alemania: 2,36 % (28 de febrero de 2023: 2,93 %)			
2.600	Allianz SE, 3,200 %, Perpetuo *	2.066	0,86
EUR 680	APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625 %, con vencimiento el 15/01/2027	720	0,30
EUR 740	Nidda Healthcare Holding GmbH, 7,500 %, con vencimiento el 21/08/2026	829	0,35
EUR 558	TK Elevator Holdco GmbH, 6,625 %, con vencimiento el 15/07/2028	582	0,24
EUR 540	TUI Cruises GmbH, 6,500 %, con vencimiento el 15/05/2026	587	0,24
EUR 900	ZF Finance GmbH, 2,000 %, con vencimiento el 06/05/2027	901	0,37
		5.685	2,36
Paraguay: 0,49 % (28 de febrero de 2023: 1,05 %)			
1.233	Millicom International Cellular SA, 5,125 %, con vencimiento el 15/01/2028	1.176	0,49
Indonesia: 0,17 % (28 de febrero de 2023: 0,17 %)			
460	Pertamina Persero PT, 3,100 %, con vencimiento el 27/08/2030	406	0,17
Irlanda: 0,21 % (28 de febrero de 2023: 0,69 %)			
590	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, con vencimiento el 30/01/2032	499	0,21
Israel: 0,77 % (28 de febrero de 2023: 0,99 %)			
EUR 300	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 7,375 %, con vencimiento el 15/09/2029	356	0,15
1.250	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, con vencimiento el 01/10/2026	1.159	0,48
310	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, con vencimiento el 15/09/2031	336	0,14
		1.851	0,77
Italia: 1,05 % (28 de febrero de 2023: 1,51 %)			
EUR 500	International Design Group SPA, 8,151 %, con vencimiento el 15/05/2026 *	542	0,22
GBP 770	Intesa Sanpaolo SpA, 6,500 %, con vencimiento el 14/03/2029 *	982	0,41
EUR 1.010	Telecom Italia SpA/Milano, 2,375 %, con vencimiento el 12/10/2027	1.017	0,42
		2.541	1,05
Kazajistán: 1,00 % (28 de febrero de 2023: 1,01 %)			
460	KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, con vencimiento el 24/04/2030	447	0,19
660	KazMunayGas National Co JSC, 144A, 3,500 %, con vencimiento el 14/04/2033	538	0,22
1.520	QazaqGaz NC JSC, 4,375 %, con vencimiento el 26/09/2027	1.422	0,59
		2.407	1,00
Luxemburgo: 0,63 % (28 de febrero de 2023: 0,47 %)			
EUR 820	Altice Financing SA, 2,250 %, con vencimiento el 15/01/2025	861	0,36
GBP 530	Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, con vencimiento el 01/04/2028	647	0,27
		1.508	0,63
México: 1,48 % (28 de febrero de 2023: 1,97 %)			
1.250	Banco Mercantil del Norte SA/Gran Caimán, 7,500 %, Perpetuo *	1.226	0,51
1.360	BBVA Bancomer SA/Texas, 5,125 %, con vencimiento el 18/01/2033 *	1.244	0,52
1.220	Orbia Advance Corp SAB de CV, 5,875 %, con vencimiento el 17/09/2044	1.089	0,45
		3.559	1,48

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Países Bajos: 2,04 % (28 de febrero de 2023: 1,90 %)			
EUR 200	Cooperatieve Rabobank UA, 4,875 %, Perpetuo *	198	0,08
EUR 800	Cooperatieve Rabobank UA, 3,250 %, Perpetuo *	780	0,32
GBP 450	GTCR W-2 Merger Sub LLC / GTCR W Dutch Finance Sub BV, 8,500 %, con vencimiento el 15/01/2031	613	0,26
GBP 1.100	ING Groep NV, 5,000 %, con vencimiento el 30/08/2026 *	1.377	0,57
1.510	Trivium Packaging Finance BV, 5,500 %, con vencimiento el 15/08/2026	1.474	0,61
550	VZ Secured Financing BV, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 15/01/2032	470	0,20
		4.912	2,04
Perú: 0,17 % (28 de febrero de 2023: 0,63 %)			
610	Petroleos del Peru SA, 5,625 %, con vencimiento el 19/06/2047	418	0,17
Singapur: 0,06 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
EUR 139	Cromwell Ereit Lux Finco Sarl, 2,125 %, con vencimiento el 19/11/2025	143	0,06
Paraguay: 0,31 % (28 de febrero de 2023: 0,37 %)			
EUR 710	United Group BV, 5,250 %, con vencimiento el 01/02/2030	735	0,31
Sudáfrica: 0,08 % (28 de febrero de 2023: 0,09 %)			
200	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 10/04/2027	196	0,08
España: 1,70 % (28 de febrero de 2023: 0,49 %)			
EUR 1.000	Banco Santander SA, 5,750 %, con vencimiento el 23/08/2033 *	1.123	0,47
EUR 1.300	Cellnex Finance Co SA, 2,000 %, con vencimiento el 15/02/2033	1.191	0,50
EUR 600	Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, con vencimiento el 18/09/2027	637	0,26
EUR 300	Telefonica Europe BV, 3,875 %, Perpetuo *	316	0,13
EUR 770	Vía Celere Desarrollos Inmobiliarios SA, 5,250 %, con vencimiento 01/04/2026	822	0,34
		4.089	1,70
Supranacional: 0,91 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
INR 90.200	European Bank for Reconstruction & Development, 6,300 %, con vencimiento el 26/10/2027	1.070	0,44
INR 93.900	International Bank for Reconstruction & Development, 6,750 %, con vencimiento el 13/07/2029	1.122	0,47
		2.192	0,91
Suecia: 0,67 % (28 de febrero de 2023: 0,77 %)			
EUR 300	Assemblin Group AB, 8,929 %, con vencimiento el 05/07/2029 *	332	0,14
EUR 680	Heimstaden Bostad AB, 3,625 %, Perpetuo *	446	0,18
EUR 750	Verisure Holding AB, 7,125 %, con vencimiento el 01/02/2028	847	0,35
		1.625	0,67
Reino Unido: 7,96 % (28 de febrero de 2023: 7,21 %)			
GBP 180	B&M European Value Retail SA, 8,125 %, con vencimiento el 15/11/2030	243	0,10
GBP 620	Barclays Plc, 7,125 %, Perpetuo *	767	0,32
GBP 570	Bellis Acquisition Co Plc, 4,500 %, con vencimiento el 16/02/2026	695	0,29
GBP 1.160	Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, con vencimiento el 07/04/2026	1.414	0,59
GBP 1.459	Greene King Finance Plc, Serie B2, 7,386 %, con vencimiento el 15/03/2036 *	1.492	0,62
400	HSBC Holdings Plc, 4,762 %, con vencimiento el 29/03/2033 *	368	0,15
1.240	HSBC Holdings Plc, 6,375 %, Perpetuo *	1.228	0,51
EUR 1.600	Lloyds Banking Group Plc, 4,947 %, Perpetuo *	1.684	0,70
GBP 1.275	Marston's Issuer Plc, Serie B1, 7,890 %, con vencimiento el 16/07/2035 *	1.215	0,50
GBP 660	NatWest Group Plc, 3,619 %, con vencimiento el 29/03/2029 *	773	0,32
GBP 170	NatWest Markets Plc, 6,375 %, con vencimiento el 08/11/2027	222	0,09
EUR 520	PEU Fin Plc, 7,250 %, con vencimiento el 01/07/2028	579	0,24
GBP 540	Pinewood Finance Co Ltd, 3,250 %, con vencimiento el 30/09/2025	668	0,28
GBP 400	Pinnacle Bidco Plc, 10,000 %, con vencimiento el 11/10/2028	532	0,22
GBP 550	Premier Foods Finance Plc, 3,500 %, con vencimiento el 15/10/2026	666	0,28
GBP 640	Saga Plc, 5,500 %, con vencimiento el 15/07/2026	720	0,30
GBP 449	Tesco Property Finance 5 Plc, 5,661 %, con vencimiento el 13/10/2041	564	0,23
GBP 1.015	Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, con vencimiento el 13/07/2044	1.247	0,52
GBP 810	Vmed O2 UK Financing I Plc, 4,500 %, con vencimiento el 15/07/2031	852	0,35
GBP 1.020	Vodafone Group Plc, 8,000 %, con vencimiento el 30/08/2086 *	1.370	0,57
GBP 680	Wheel Bidco Ltd, 6,750 %, con vencimiento el 15/07/2026	735	0,30
GBP 1.000	Whitbread Group Plc, 2,375 %, con vencimiento el 31/05/2027	1.144	0,48
		19.178	7,96
Estados Unidos: 17,67 % (28 de febrero de 2023: 23,51 %)			
165	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2026	164	0,07
1.320	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 20/04/2029	1.292	0,54
660	American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2029	573	0,24
890	American Express Co, 3,550 %, Perpetuo *	805	0,33
1.790	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 15/08/2027	1.300	0,54
570	Bank of America Corp, 5,015 %, con vencimiento el 22/07/2033 *	556	0,23
280	Bank of America Corp, 5,288 %, con vencimiento el 25/04/2034 *	276	0,11
1.150	Bank of America Corp, 3,311 %, con vencimiento el 22/04/2042 *	871	0,36
140	Bank of America Corp, 4,083 %, con vencimiento el 20/03/2051 *	113	0,05
494	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, con vencimiento el 15/12/2025	499	0,21
650	Carnival Corp, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 01/06/2030	710	0,29
320	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 01/06/2033	246	0,10
1.020	Centene Corp, 4,625 %, con vencimiento el 15/12/2029	966	0,40
400	Charles Schwab Corp/The, Series H, 4,000 %, Perpetuo *	330	0,14
1.380	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2041	914	0,38
250	Cigna Group/The, 4,800 %, con vencimiento el 15/08/2038	232	0,10
1.030	Citigroup Inc, 8,125 %, con vencimiento el 15/07/2039	1.309	0,54
1.798	Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, con vencimiento el 01/06/2044	1.460	0,61
750	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 01/02/2029	655	0,27
680	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, con vencimiento el 03/11/2036	703	0,29
624	Devon Energy Corp, 5,250 %, con vencimiento el 15/10/2027	623	0,26
246	Devon Energy Corp, 5,875 %, con vencimiento el 15/06/2028	248	0,10
1.060	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 15/08/2027	1.001	0,42
420	DISH DBS Corp, 5,875 %, con vencimiento el 15/11/2024	397	0,17
1.160	DISH DBS Corp, 7,750 %, con vencimiento el 01/07/2026	741	0,31
670	DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 01/12/2028	465	0,19
830	Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, con vencimiento el 15/06/2025	827	0,34
380	EQT Corp, 5,000 %, con vencimiento el 15/01/2029	371	0,15
GBP 780	Ford Motor Credit Co LLC, 2,748 %, con vencimiento el 14/06/2024	977	0,41
390	Ford Motor Credit Co LLC, 3,815 %, con vencimiento el 02/11/2027	364	0,15
1.515	Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, con vencimiento el 10/02/2029	1.321	0,55
1.430	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, con vencimiento el 15/03/2043	1.333	0,55
235	Goldman Sachs Capital II, 6,370 %, Perpetuo *	199	0,08
GBP 590	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,625 %, con vencimiento el 29/10/2029 *	692	0,29
1.400	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/12/2028	1.265	0,52
330	JPMorgan Chase & Co, 3,328 %, con vencimiento el 22/04/2052 *	235	0,10
440	Legacy LifePoint Health LLC, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 15/02/2027	409	0,17
930	Morgan Stanley, 3,622 %, con vencimiento el 01/04/2031 *	845	0,35
640	Netflix Inc, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 15/06/2030	635	0,26
690	Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, con vencimiento el 15/08/2029	628	0,26
1.850	Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/02/2030	1.721	0,71
320	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/03/2032	321	0,13
205	Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, con vencimiento el 01/03/2032	233	0,10
500	Southwestern Energy Co, 8,375 %, con vencimiento el 15/09/2028	520	0,22
1.210	Southwestern Energy Co, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2032	1.100	0,46
700	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 20/09/2025	507	0,21

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
1.620	Sprint Capital Corp, 8,750 %, con vencimiento el 15/03/2032	1.958	0,81
640	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500 %, con vencimiento el 01/03/2030	634	0,26
450	T-Mobile USA Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/04/2030	418	0,17
1.130	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 15/04/2029	1.043	0,43
790	United Rentals North America Inc, 5,500 %, con vencimiento el 15/05/2027	786	0,33
1.000	United Rentals North America Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/02/2031	885	0,37
530	Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 15/02/2029	512	0,21
1.000	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 15/02/2028	961	0,40
GBP 510	Wells Fargo & Co, 3,473 %, con vencimiento el 26/04/2028 *	606	0,25
730	Wells Fargo & Co, 5,013 %, con vencimiento el 04/04/2051 *	676	0,28
880	Wells Fargo & Co, Series U, 5,875 %, Perpetuo *	882	0,37
210	Western Midstream Operating LP, 3,950 %, con vencimiento el 01/06/2025	205	0,09
480	Western Midstream Operating LP, 5,500 %, con vencimiento el 15/08/2048	422	0,18
720	Western Midstream Operating LP, 5,250 %, con vencimiento el 01/02/2050	637	0,26
		42.577	17,67
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 116.674 $)		109.525	45,46
Bonos y obligaciones del Estado: 37,64 % (28 de febrero de 2023: 26,03 %)			
Argentina: 0,53 % (28 de febrero de 2023: 0,55 %)			
3.264	Bonos del Gobierno de la Provincia de Buenos Aires, 144A, 6,375 %, con vencimiento el 01/09/2037	1.269	0,53
Brasil: 1,23 % (28 de febrero de 2023: 0,90 %)			
BRL 14.694	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2027	2.953	1,23
Colombia: 0,44 % (28 de febrero de 2023: 0,43 %)			
1.350	Colombia Government International Bond, 5,625 %, con vencimiento el 26/02/2044	1.061	0,44
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	868	0,36
República Dominicana: 0,50 % (28 de febrero de 2023: 0,50 %)			
1.360	Bono Internacional de la República Dominicana, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 23/09/2032	1.212	0,50
Paraguay: 0,96 % (28 de febrero de 2023: 0,85 %)			
1.360	Bono Internacional del Estado de Egipto, 3,875 %, con vencimiento el 16/02/2026	1.256	0,52
EUR 1.180	Bono Internacional del Estado de Egipto, 6,375 %, con vencimiento el 11/04/2031	1.052	0,44
		2.308	0,96
Alemania: 0,62 % (28 de febrero de 2023: 0,15 %)			
EUR 650	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, con vencimiento el 15/02/2029	633	0,26
EUR 940	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, con vencimiento el 15/02/2031	866	0,36
		1.499	0,62
Indonesia: 1,05 % (28 de febrero de 2023: 2,96 %)			
IDR 39.219.000	Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR59, 7,000 %, con vencimiento el 15/05/2027	2.541	1,05
Jordania: 0,16 % (28 de febrero de 2023: 0,17 %)			
430	Bono Internacional del Estado de Jordania, 5,850 %, con vencimiento el 07/07/2030	390	0,16
Kenia: 0,25 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
590	Republic of Kenya Government International Bond, 9,750 %, con vencimiento el 16/02/2031	590	0,25
México: 3,43 % (28 de febrero de 2023: 3,33 %)			
MXN 69.240	Mexican Bonos, Serie M, 8,500 %, con vencimiento el 31/05/2029	3.960	1,64
MXN 84.947	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, con vencimiento el 13/11/2042	4.310	1,79
		8.270	3,43
Nigeria: 0,45 % (28 de febrero de 2023: 0,42 %)			
1.400	Bono Internacional del Estado de Nigeria, 7,625 %, con vencimiento el 28/11/2047	1.083	0,45
Omán: 0,16 % (28 de febrero de 2023: 0,17 %)			
390	Bono Internacional del Estado de Omán, 6,000 %, con vencimiento el 01/08/2029	396	0,16
Polonia: 1,74 % (28 de febrero de 2023: 1,46 %)			
PLN 21.700	Bono del Estado de la República de Polonia, Serie 0432, 1,750 %, con vencimiento el 25/04/2032	4.200	1,74
Sudáfrica: 1,51 % (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	2.804	1,17
1.130	Bono Internacional del Estado de la República de Sudáfrica, 5,750 %, con vencimiento el 30/09/2049	825	0,34
		3.629	1,51
Estados Unidos: 24,25 % (28 de febrero de 2023: 11,09 %)			
6.240	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 2,000 %, con vencimiento el 30/04/2024	6.206	2,58
12.270	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 2,000 %, con vencimiento el 15/02/2025	11.916	4,95
4.310	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 2,000 %, con vencimiento el 15/11/2026	4.043	1,68
2.250	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 0,625 %, con vencimiento el 31/03/2027	2.008	0,83
11.820	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 4,125 %, con vencimiento el 31/10/2027	11.725	4,87
500	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,625 %, con vencimiento el 31/03/2028	487	0,20
30	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 0,625 %, con vencimiento el 15/08/2030	24	0,01
5.680	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 1,375 %, con vencimiento el 15/11/2031	4.612	1,91
290	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 2,750 %, con vencimiento el 15/08/2032	259	0,11
3.320	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 4,125 %, con vencimiento el 15/11/2032	3.286	1,36
120	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 1,750 %, con vencimiento el 15/08/2041	80	0,03
140	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 2,000 %, con vencimiento el 15/11/2041	97	0,04
600	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,375 %, con vencimiento el 15/08/2042	513	0,21
2.320	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 4,000 %, con vencimiento el 15/11/2042	2.166	0,90
1.696	United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, con vencimiento el 15/08/2043	1.661	0,69
1.650	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,000 %, con vencimiento el 15/05/2045 ≠	1.305	0,54
15	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,000 %, con vencimiento el 15/11/2045	12	–
500	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 2,250 %, con vencimiento el 15/08/2046	340	0,14
360	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,000 %, con vencimiento el 15/02/2047	281	0,12
7.240	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,125 %, con vencimiento el 15/05/2048	5.755	2,39
820	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, con vencimiento el 15/02/2049	636	0,26
430	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, con vencimiento el 15/05/2049	325	0,14
40	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 1,250 %, con vencimiento el 15/05/2050	20	0,01
200	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, con vencimiento el 15/08/2050	105	0,04
270	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, con vencimiento el 15/08/2052	209	0,09
410	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 15/05/2053	359	0,15
		58.430	24,25
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 99.919 $)		90.699	37,64
Obligaciones de préstamo: 2,09 % (28 de febrero de 2023: 3,84 %)			
576	Alterra Mountain Co, 8,947 %, con vencimiento el 30/07/2028 *	578	0,24
571	APi Group De Inc, 7,701 %, con vencimiento el 01/10/2026 *	571	0,24
670	Asurion LLC, 9,683 %, con vencimiento el 19/08/2028 *	668	0,28
622	Focus Financial Partners LLC, 8,083 %, con vencimiento el 30/06/2028 *	619	0,25
268	Fugue Finance LLC, 9,388 %, con vencimiento el 26/01/2028 *	269	0,11
432	Grifols Worldwide Operations USA Inc, 7,538 %, con vencimiento el 15/11/2027 *	424	0,18
138	Nexstar Broadcasting Inc, 7,951 %, con vencimiento el 19/09/2026 *	137	0,06
922	Sedgwick CMS Inc, 9,083 %, con vencimiento el 17/02/2028 *	924	0,38
600	Sotera Health, 8,197 %, con vencimiento el 13/12/2026 *	599	0,25
243	UFC Holdings LLC, 8,336 %, con vencimiento el 29/04/2026 *	244	0,10
Total de obligaciones de préstamo (coste 5.038 $)		5.033	2,09
Organismos de inversión colectiva: 1,30 % (28 de febrero de 2023: 1,77 %)			
22	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – LM Class US$ Accumulating	3.139	1,30
Total de organismos de inversión colectiva (coste 2.474 $)		3.139	1,30

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias: 0,22 % (28 de febrero de 2023: 0,18 %)			
Suiza: 0,09 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
1.760	Credit Suisse Group AG Escrow †∞	216	0,09
Estados Unidos: 0,13 % (28 de febrero de 2023: 0,18 %)			
44	cuerpo de bayas	309	0,13
Total de acciones ordinarias (coste 491 $)		525	0,22
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 243.819 $)		222.637	92,40
Contratos de divisas a plazo: 0,15 % (28 de febrero de 2023: 0,34 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		364	0,15
Futuros: 0,02 % (28 de febrero de 2023: 0,03 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		43	0,02
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		223.044	92,57
Contratos de divisas a plazo: (0,65 %) (28 de febrero de 2023: (1,76 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(1.576)	(0,65)
Futuros: (0,06 %) (28 de febrero de 2023: (0,01 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(139)	(0,06)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(1.715)	(0,71)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		221.329	91,86
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		19.611	8,14
Patrimonio		240.940 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 30.641.000 USD o el 12,69 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

† 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 al final o tras el ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024 (ya sea capital o interés).

≠ Garantía (total o parcial) pignorada como garantía para la negociación de derivados a 29 de febrero de 2024.

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.
BRL – Real brasileño
EUR – Euro
GBP – Libra esterlina
IDR – Rupia indonesia
INR – Rupia india
MXN – Peso mexicano
PLN – Zloty polaco
ZAR – Rand sudafricano

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	88,02
Otros valores mobiliarios negociables en otro mercado regulado	2,07
Organismos de inversión colectiva	1,29
Instrumentos financieros derivados	0,17
Otros activos	8,45
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)
13 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	3.189	Venta	TWD	99.169	$	46
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	707	Venta	CHF	625		(1)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	60	Venta	EUR	54		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	10	Venta	EUR	10		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	13	Venta	GBP	11		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	36	Venta	GBP	29		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	34	Venta	PLN	140		(1)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	3	Venta	SGD	4		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	ZAR	125.978	Venta	USD	6.649		(91)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	96.038	Venta	USD	62.627		(171)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	4.174	Venta	USD	4.490		22
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CHF	53.081	Venta	USD	61.215		(1.092)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	1.253	Venta	USD	934		(1)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	1	Venta	USD	1		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	981	Venta	USD	1.234		4
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	PLN	10.832	Venta	USD	2.676		36
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	ZAR	24.697	Venta	USD	1.278		8
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	47	Venta	USD	51		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	78	Venta	ZAR	1.483		–
13 de mayo de 2024	BNP Paribas	Compra	USD	120	Venta	EUR	111		–
13 de mayo de 2024	BNP Paribas	Compra	USD	1.896	Venta	PLN	7.583		(2)
13 de mayo de 2024	BNP Paribas	Compra	JPY	965.332	Venta	USD	6.684		(168)
13 de mayo de 2024	Citi	Compra	USD	442	Venta	EUR	409		(1)
13 de mayo de 2024	Citi	Compra	USD	8.144	Venta	GBP	6.381		87
13 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	5.908	Venta	EUR	5.445		4
13 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	1.810	Venta	GBP	1.418		19
13 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	218	Venta	MXN	3.806		(3)
13 de mayo de 2024	HSBC	Compra	USD	20.759	Venta	EUR	19.127		22
13 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	214	Venta	EUR	197		–
13 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	3.247	Venta	GBP	2.544		35
13 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	ZAR	5.000	Venta	USD	265		(6)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(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)
13 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	AUD	3.230	Venta	USD	2.135		$ (30)
13 de mayo de 2024	Morgan Stanley	Compra	CAD	1.230	Venta	USD	917		(9)
13 de mayo de 2024	UBS	Compra	USD	7.501	Venta	GBP	5.876		81
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 775 $)									$ 364
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (4.011) $)									(1.576)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (3.236) $)									$ (1.212)

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Euro-Bobl marzo de 2024	Bank of America Merrill Lynch	(5)	$ (628)	$ 7
Euro-Bund marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	89	12.760	(89)
Bonos Euro-Buxl a 30 años marzo de 2024	Bank of America Merrill Lynch	(1)	(144)	(3)
Long Gilt junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	44	5.448	36
U.S. 10 Year Note (CBT) junio de 2024	Bank of America Merrill Lynch	(39)	(4.307)	(8)
U.S. 2 Year Note (CBT) junio de 2024	Bank of America Merrill Lynch	12	2.457	(2)
U.S. Long Bond (CBT) junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	(23)	(2.743)	(11)
U.S. Ultra Bond (CBT) junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	(30)	(3.836)	(26)
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 74 $)				$ 43
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (29) $)				(139)
Depreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 45 $)				$ (96)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por activos: 5,29 % (28 de febrero de 2023: 6,50 %)			
500	522 Funding CLO 2018-3A Ltd, Serie 2018 3A, Clase DR, 144A, 8,679 %, con vencimiento el 20/10/2031 *	501	0,52
250	AB BSL CLO 2 Ltd, Serie 2021 2A, Clase D, 144A, 8,926 %, con vencimiento el 15/04/2034 *	248	0,26
310	AGL CLO 6 Ltd, Serie 2020 6A, Clase ER, 144A, 12,079 %, con vencimiento el 20/07/2034 *	312	0,32
300	Apex Credit CLO 2022-1 Ltd, Serie 2022 1A, Clase D, 144A, 9,718 %, con vencimiento el 22/04/2033 *	297	0,31
440	Ballyrock CLO 2018-1 Ltd, Serie 2018 1A, Clase C, 144A, 8,729 %, con vencimiento el 20/04/2031 *	440	0,45
420	Canyon CLO 2020-1 Ltd, Serie 2020 1A, Clase ER, 144A, 11,926 %, con vencimiento el 15/07/2034 *	411	0,43
300	GoldenTree Loan Opportunities IX Ltd, Serie 2014 9A, Clase DR2, 144A, 8,581 %, con vencimiento el 29/10/2029 *	300	0,31
250	Greenwood Park CLO Ltd, Serie 2018 1A, Clase E, 144A, 10,526 %, con vencimiento el 15/04/2031 *	236	0,24
510	Grippen Park CLO Ltd, Serie 2017 1A, Clase E, 144A, 11,279 %, con vencimiento el 20/01/2030 *	508	0,52
443	Magnetite XII Ltd, Serie 2015 12A, Clase ER, 144A, 11,256 %, con vencimiento el 15/10/2031 *	431	0,44
250	Neuberger Berman CLO XVIII Ltd, Serie 2014 18A, Clase DR2, 144A, 11,499 %, con vencimiento el 21/10/2030 *	249	0,26
250	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 28 Ltd, Serie 2018 28A, Clase D, 144A, 8,429 %, con vencimiento el 20/04/2030 *	249	0,26
300	Ocean Trails CLO V, Serie 2014 5A, Clase DRR, 144A, 9,026 %, con vencimiento el 13/10/2031 *	283	0,29
200	Ocean Trails CLO XIV Ltd, Serie 2023 14A, Clase D, 144A, 11,138 %, con vencimiento el 20/01/2035 *	200	0,21
280	Trinitas CLO X Ltd, Serie 2019 10A, Clase DR, 144A, 8,917 %, con vencimiento el 15/01/2035 *	265	0,27
190	Warwick Capital CLO 1 Ltd, Serie 2023 1A, Clase D, 144A, 11,012 %, con vencimiento el 20/10/2036 *	193	0,20
Total de valores garantizados por activos (coste 5.111 $)		5.123	5,29
Bonos y obligaciones corporativos: 85,85 % (28 de febrero de 2023: 84,70 %)			
Bermudas: 0,38 % (28 de febrero de 2023: 0,65 %)			
371	Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, con vencimiento el 15/10/2025	371	0,38
Canadá: 3,12 % (28 de febrero de 2023: 2,47 %)			
250	Bank of Nova Scotia/The, 8,000 %, con vencimiento el 27/01/2084 *	253	0,26
230	Bombardier Inc, 144A, 8,750 %, con vencimiento el 15/11/2030	241	0,25
300	Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 15/01/2028	290	0,30
350	Empire Communities Corp, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/12/2025	346	0,36
420	GFL Environmental Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/06/2029	394	0,41
850	Hudbay Minerals Inc, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 01/04/2029	835	0,86
330	Open Text Corp, 144A, 6,900 %, con vencimiento el 01/12/2027	341	0,35
310	Toronto-Dominion Bank/The, 8,125 %, con vencimiento el 31/10/2082 *	324	0,33
		3.024	3,12
Islas Caimán 0,73 % (28 de febrero de 2023: 0,91 %)			
739	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 15/09/2024	703	0,73
Francia: 2,65 % (28 de febrero de 2023: 0,28 %)			
240	Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/01/2028	196	0,20
670	Altice France SA/France, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 15/07/2029	507	0,52
210	BNP Paribas SA, 144A, 8,000 %, Perpetuo *	210	0,22
810	BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, Perpetuo *	818	0,84
820	Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Perpetuo *	838	0,87
		2.569	2,65
Alemania: 0,70 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
650	ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 14/04/2030	678	0,70
Hong Kong: 0,23 % (28 de febrero de 2023: 0,45 %)			
250	Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 04/12/2029	225	0,23
India: 0,34 % (28 de febrero de 2023: 0,25 %)			
340	CA Magnum Holdings, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 31/10/2026	328	0,34
Israel: 1,23 % (28 de febrero de 2023: 1,26 %)			
500	Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, con vencimiento el 01/02/2036	478	0,49
660	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, con vencimiento el 15/09/2031	714	0,74
		1.192	1,23
Italia: 1,81 % (28 de febrero de 2023: 0,70 %)			
700	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, con vencimiento el 15/01/2026	694	0,72
480	Telecom Italia Capital SA, 6,000 %, con vencimiento el 30/09/2034	446	0,46
660	UniCredit SpA, 144A, 5,459 %, con vencimiento el 30/06/2035 *	610	0,63
		1.750	1,81
Luxemburgo: 1,04 % (28 de febrero de 2023: 1,51 %)			
500	Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/08/2029	431	0,44
710	Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 15/05/2027	465	0,48
260	ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 30/06/2027	111	0,12
		1.007	1,04
Macao: 0,69 % (28 de febrero de 2023: 1,80 %)			
200	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/01/2026	194	0,20
510	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 26/08/2028	480	0,49
		674	0,69
Países Bajos: 0,42 % (28 de febrero de 2023: 0,30 %)			
420	Sunrise HoldCo IV BV, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/01/2028	407	0,42
Polonia: 0,33 % (28 de febrero de 2023: 0,36 %)			
370	Canpack SA / Canpack US LLC, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/11/2029	321	0,33
España: 0,44 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
400	Banco Santander SA, 9,625 %, Perpetuo *	429	0,44
Suecia: 0,24 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
230	Stena International SA, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 15/01/2031	229	0,24
Suiza: 1,45 % (28 de febrero de 2023: 2,04 %)			
300	UBS Group AG, 144A, 9,016 %, con vencimiento el 15/11/2033 *	361	0,37
220	UBS Group AG, 144A, 7,750 %, Perpetuo *	221	0,23
230	UBS Group AG, 144A, 9,250 %, Perpetuo *	246	0,26
210	VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 01/05/2027	178	0,18
130	VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 9,500 %, con vencimiento el 01/06/2028	110	0,11
390	VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 6,375 %, con vencimiento el 01/02/2030	285	0,30
		1.401	1,45
Emiratos Árabes Unidos: 0,38 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
380	Shelf Drilling Holdings Ltd, 144A, 9,625 %, con vencimiento el 15/04/2029	367	0,38
Reino Unido: 3,49 % (28 de febrero de 2023: 2,54 %)			
1.280	Barclays Plc, 8,000 %, Perpetuo *	1.280	1,32
330	Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd, 144A, 8,750 %, con vencimiento el 15/01/2032	314	0,32
800	HSBC Holdings Plc, 4,600 %, Perpetuo *	665	0,69
740	Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, Perpetuo *	730	0,76
450	Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/07/2031	390	0,40
		3.379	3,49
Estados Unidos: 65,40 % (28 de febrero de 2023: 67,88 %)			
280	AAR Escrow Issuer LLC, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 15/03/2029	283	0,29
340	Academy Ltd, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 15/11/2027	337	0,35
742	Accelerate360 Holdings LLC, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 01/03/2028	768	0,79
220	Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 01/03/2028	210	0,22
470	Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 6,375 %, con vencimiento el 15/06/2030	470	0,49
500	Akumin Inc, 144A, 9,000 %, con vencimiento el 01/08/2027	408	0,42
1.130	Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 15/02/2028	567	0,59
370	Alta Equipment Group Inc, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 15/04/2026	359	0,37
910	AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 15/02/2029	630	0,65
310	American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 15/02/2028	313	0,32

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
720	American Airlines Inc, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/05/2029	757	0,78
470	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 20/04/2029	460	0,48
450	American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2029	391	0,40
515	American News Co LLC, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 01/09/2026	573	0,59
95	Anagram Holdings LLC/Anagram International Inc, 144A, 10,000 %, con vencimiento el 15/08/2026 ε	2	–
800	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 15/06/2029	663	0,68
400	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 01/09/2029	325	0,34
160	AthenaHealth Group Inc, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 15/02/2030	143	0,15
470	Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, con vencimiento el 01/10/2030	473	0,49
110	Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 01/02/2027	71	0,07
690	Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/02/2029	317	0,33
400	Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 30/01/2030	173	0,18
170	Beacon Roofing Supply Inc, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 01/08/2030	171	0,18
450	Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2026	441	0,46
500	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,625 %, con vencimiento el 15/07/2026	497	0,51
170	Boyne USA Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/05/2029	156	0,16
330	Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/04/2030	317	0,33
350	Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 9,250 %, con vencimiento el 01/07/2031	368	0,38
1.010	Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2030	1.036	1,07
260	Caesars Entertainment Inc, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 15/02/2032	262	0,27
400	Cano Health LLC, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 01/10/2028 ε	6	0,01
100	Carnival Corp, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 01/03/2027	99	0,10
1.310	Carnival Corp, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 01/06/2030	1.430	1,48
500	Carriage Purchaser Inc, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 15/10/2029	433	0,45
1.190	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2032	961	0,99
290	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, con vencimiento el 01/05/2032	229	0,24
800	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 01/06/2033	616	0,64
220	Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 15/06/2029	222	0,23
390	Charles Schwab Corp/The, Series H, 4,000 %, Perpetuo *	322	0,33
260	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,700 %, con vencimiento el 01/04/2051	158	0,16
600	Chord Energy Corp, 144A, 6,375 %, con vencimiento el 01/06/2026	601	0,62
210	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/04/2029	134	0,14
140	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 01/04/2030	88	0,09
860	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 15/05/2030	687	0,71
300	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 10,875 %, con vencimiento el 15/01/2032	306	0,32
270	Citigroup Inc, Serie P, 7,200 %, Perpetuo *	271	0,28
165	Clean Harbors Inc, 144A, 6,375 %, con vencimiento el 01/02/2031	164	0,17
410	Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 01/06/2029	340	0,35
360	Coinbase Global Inc, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 01/10/2031	282	0,29
700	CommScope Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 01/09/2029	480	0,50
130	CommScope Technologies LLC, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 15/03/2027	47	0,05
290	Crescent Energy Finance LLC, 144A, 9,250 %, con vencimiento el 15/02/2028	304	0,31
270	CSC Holdings LLC, 144A, 11,250 %, con vencimiento el 15/05/2028	279	0,29
330	CSC Holdings LLC, 144A, 11,750 %, con vencimiento el 31/01/2029	345	0,36
810	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 01/02/2029	707	0,73
320	CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/01/2030	188	0,19
250	CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 01/12/2030	186	0,19
430	CSC Holdings LLC, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 15/11/2031	235	0,24
490	Cushman & Wakefield US Borrower LLC, 144A, 8,875 %, con vencimiento el 01/09/2031	511	0,53
230	Darling Ingredients Inc, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 15/06/2030	227	0,23
650	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 15/08/2027	614	0,63
920	DISH DBS Corp, 7,750 %, con vencimiento el 01/07/2026	587	0,61
630	DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 01/12/2028	437	0,45
1.010	DISH DBS Corp, 5,125 %, con vencimiento el 01/06/2029	432	0,45
90	Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, con vencimiento el 15/06/2025	90	0,09
170	Diversified Healthcare Trust, 4,750 %, con vencimiento el 15/02/2028	135	0,14
440	Dornoch Debt Merger Sub Inc, 144A, 6,625 %, con vencimiento el 15/10/2029	396	0,41
270	DraftKings Holdings Inc, zero coupon, con vencimiento el 15/03/2028	230	0,24
400	Elastic NV, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 15/07/2029	360	0,37
150	FirstCash Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 01/09/2028	139	0,14
250	FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 01/01/2030	237	0,24
190	FirstCash Inc, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 01/03/2032	188	0,19
311	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 15/01/2028	318	0,33
1.090	Foot Locker Inc, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2029	924	0,95
330	Ford Motor Credit Co LLC, 7,350 %, con vencimiento el 06/03/2030	350	0,36
700	Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, con vencimiento el 13/11/2030	619	0,64
430	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, con vencimiento el 15/03/2043	401	0,41
570	Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, con vencimiento el 15/02/2028	535	0,55
510	Gannett Holdings LLC, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 01/11/2026	461	0,48
370	Gen Digital Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 30/09/2030	378	0,39
510	Gray Television Inc, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 15/11/2031	330	0,34
550	GTCR W-2 Merger Sub LLC, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 15/01/2031	574	0,59
430	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/12/2028	388	0,40
207	HCA Inc, 7,500 %, con vencimiento el 15/11/2095	221	0,23
360	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/04/2032	349	0,36
150	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 8,375 %, con vencimiento el 01/11/2033	161	0,17
100	Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 15/01/2027	100	0,10
150	iHeartCommunications Inc, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 15/08/2027	111	0,12
230	iHeartCommunications Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/01/2028	166	0,17
490	IIP Operating Partnership LP, 5,500 %, con vencimiento el 25/05/2026	463	0,48
210	Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 15/11/2029	193	0,20
260	JB Poindexter & Co Inc, 144A, 8,750 %, con vencimiento el 15/12/2031	267	0,28
390	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/06/2029	350	0,36
610	LifePoint Health Inc, 144A, 9,875 %, con vencimiento el 15/08/2030	634	0,65
230	LifePoint Health Inc, 144A, 11,000 %, con vencimiento el 15/10/2030	244	0,25
300	LSF11 A5 HoldCo LLC, 144A, 6,625 %, con vencimiento el 15/10/2029	261	0,27
130	Madison IAQ LLC, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 30/06/2028	119	0,12
600	Madison IAQ LLC, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 30/06/2029	536	0,55
430	Match Group Holdings II LLC, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 01/10/2031	363	0,37
700	Medline Borrower LP, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 01/10/2029	648	0,67
480	Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 01/05/2028	373	0,39

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
280	Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 01/05/2028	257	0,27
420	Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 15/01/2030	356	0,37
230	MIWD Holdco II LLC / MIWD Finance Corp, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 01/02/2030	210	0,22
200	Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 01/02/2026	189	0,19
70	Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 13,250 %, con vencimiento el 15/12/2027	76	0,08
340	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,500 %, con vencimiento el 15/03/2031	228	0,24
500	Nabors Industries Ltd, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 15/01/2026	493	0,51
200	NCL Corp Ltd, 144A, 8,375 %, con vencimiento el 01/02/2028	210	0,22
900	NCL Corp Ltd, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 15/01/2029	948	0,98
320	NCL Corp Ltd, 144A, 7,750 %, con vencimiento el 15/02/2029	328	0,34
500	NCL Finance Ltd, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 15/03/2028	488	0,50
350	NCR Atleos Corp, 144A, 9,500 %, con vencimiento el 01/04/2029	371	0,38
140	NextEra Energy Partners LP, 144A, 2,500 %, con vencimiento el 15/06/2026	127	0,13
400	Northern Oil & Gas Inc, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 01/03/2028	405	0,42
760	Northwest Acquisitions ULC / Dominion Finco Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 01/11/2022 ∞ε	–	–
510	Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 01/04/2027 †ε	324	0,33
600	Park-Ohio Industries Inc, 6,625 %, con vencimiento el 15/04/2027	550	0,57
70	Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 15/06/2029	63	0,06
170	Permian Resources Operating LLC, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 15/04/2027	175	0,18
290	Permian Resources Operating LLC, 144A, 9,875 %, con vencimiento el 15/07/2031	321	0,33
410	Permian Resources Operating LLC, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/01/2032	421	0,43
250	PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp, 144A, 7,750 %, con vencimiento el 15/02/2029	247	0,26
800	PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500 %, con vencimiento el 01/10/2028	809	0,84
760	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/01/2028	750	0,77
340	Rackspace Technology Global Inc, 3,500 %, con vencimiento el 31/05/2028 ∞	204	0,21
400	Range Resources Corp, 8,250 %, con vencimiento el 15/01/2029	418	0,43
290	Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/02/2030	270	0,28
1.100	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 15/10/2033	914	0,94
430	Royal Caribbean Cruises Ltd, 3,700 %, con vencimiento el 15/03/2028	397	0,41
630	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/03/2032	632	0,65
220	RR Donnelley & Sons Co, 144A, 9,750 %, con vencimiento el 31/07/2028	225	0,23
160	Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 6,750 %, con vencimiento el 01/03/2032	160	0,16
2	Service Corp International/US, 7,500 %, con vencimiento el 01/04/2027	2	–
270	Service Corp International/US, 4,000 %, con vencimiento el 15/05/2031	237	0,25
400	Service Properties Trust, 144A, 8,625 %, con vencimiento el 15/11/2031	423	0,44
560	SilverBow Resources Inc, 144A, 13,135 %, con vencimiento el 15/12/2028 *	556	0,57
360	Sizzling Platter LLC / Sizzling Platter Finance Corp, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 28/11/2025	361	0,37
340	Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 01/11/2028	330	0,34
280	Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 8,875 %, con vencimiento el 15/11/2031	297	0,31
330	Southwestern Energy Co, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2032	300	0,31
100	Speedway Motorsports LLC / Speedway Funding II Inc, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 01/11/2027	95	0,10
380	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 20/09/2025	275	0,28
150	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 20/09/2025	109	0,11
360	Sprint Capital Corp, 8,750 %, con vencimiento el 15/03/2032	435	0,45
200	StoneX Group Inc, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 01/03/2031	203	0,21
870	Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 01/09/2026	708	0,73
200	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 31/12/2030	186	0,19
280	Titan International Inc, 7,000 %, con vencimiento el 30/04/2028	278	0,29
200	TopBuild Corp, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 15/03/2029	179	0,19
500	TransDigm Inc, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 15/08/2028	507	0,52
200	TransDigm Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 01/12/2031	205	0,21
320	Triton Water Holdings Inc, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 01/04/2029	280	0,29
150	Tutor Perini Corp, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 01/05/2025	148	0,15
720	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 15/04/2029	665	0,69
770	United Rentals North America Inc, 5,250 %, con vencimiento el 15/01/2030	746	0,77
240	Univision Communications Inc, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 15/08/2028	241	0,25
370	Urban One Inc, 144A, 7,375 %, con vencimiento el 01/02/2028	318	0,33
219	US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, con vencimiento el 28/06/2028	185	0,19
530	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/01/2030	530	0,55
180	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2031	158	0,16
120	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 01/11/2033	101	0,10
680	Venture Global LNG Inc, 144A, 9,875 %, con vencimiento el 01/02/2032	716	0,74
850	Vericast Corp, 144A, 11,000 %, con vencimiento el 15/09/2026	895	0,92
120	Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 15/09/2027	117	0,12
450	Viking Cruises Ltd, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2029	450	0,46
260	Viking Cruises Ltd, 144A, 9,125 %, con vencimiento el 15/07/2031	282	0,29
120	Vistra Operations Co LLC, 144A, 7,750 %, con vencimiento el 15/10/2031	124	0,13
800	WW International Inc, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 15/04/2029	372	0,38
840	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 15/02/2031	868	0,90
690	XPO CNW Inc, 6,700 %, con vencimiento el 01/05/2034	715	0,74
320	XPO Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 01/02/2032	326	0,34
440	ZipRecruiter Inc, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 15/01/2030	388	0,40
		63.358	65,40
Zambia: 0,78 % (28 de febrero de 2023: 1,27 %)			
730	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 9,375 %, con vencimiento el 01/03/2029	757	0,78
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 89.342 $)		83.169	85,85
Bonos y obligaciones del Estado: 0,28 % (28 de febrero de 2023: 0,22 %)			
Argentina: 0,28 % (28 de febrero de 2023: 0,22 %)			
640	Bonos del Gobierno de la Provincia de Buenos Aires, 144A, 6,375 %, con vencimiento el 01/09/2037	249	0,26
60	Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 6,375 %, con vencimiento el 01/09/2037	23	0,02
		272	0,28
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 272 $)		272	0,28
Obligaciones de préstamo: 6,41 % (28 de febrero de 2023: 5,28 %)			
177	19th Holdings Golf, LLC, 8,674 %, con vencimiento el 07/02/2029 *	173	0,18
271	Adtalem Global Education, 8,837 %, con vencimiento el 14/08/2028 *	272	0,28
425	Asurion LLC, 9,433 %, con vencimiento el 17/08/2028 *	422	0,44
249	Clarios Global LP, 8,333 %, con vencimiento el 06/05/2030 *	250	0,26
190	Cotiviti Inc, 0,000 %, con vencimiento el 24/02/2031 *	190	0,20
570	DCert Buyer, Inc., 12,333 %, con vencimiento el 16/02/2029 *	522	0,54
190	Deerfield Dakota Holding LLC, 12,360 %, con vencimiento el 14/04/2028 *	189	0,20
338	Equinox Holdings Inc, 14,610 %, con vencimiento el 08/03/2024 *	335	0,35
366	Eyecare Partners LLC, 9,324 %, con vencimiento el 05/02/2027 *†	199	0,20

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Obligaciones de préstamo (continuación)			
491	Focus Financial Partners LLC, 8,083 %, con vencimiento el 30/06/2028 *	489	0,50
230	Global Tel'Link Corp, 9,748 %, con vencimiento el 29/11/2025 *	224	0,23
177	Magenta Buyer LLC, 10,574 %, con vencimiento el 03/05/2028 *	107	0,11
82	MRI Software LLC, 10,948 %, con vencimiento el 10/02/2026 *	81	0,08
47	MRI Software LLC, 10,948 %, con vencimiento el 10/02/2026 *	47	0,05
159	Neptune Bidco U.S. Inc, 10,423 %, con vencimiento el 11/04/2029 *	146	0,15
458	Phoenix Guarantor Inc, 0,000 %, con vencimiento el 13/02/2031 *	454	0,47
386	R.R. Donnelley, 12,683 %, con vencimiento el 08/03/2028 *	389	0,40
183	Redstone Holdco 2 LP, 10,201 %, con vencimiento el 27/04/2028 *	153	0,16
657	Rent-A-Center Inc/TX, 9,119 %, con vencimiento el 17/02/2028 *	657	0,68
400	Spencer Spirit IH LLC, 11,430 %, con vencimiento el 14/06/2026 *	399	0,41
120	United Airlines Inc, 8,076 %, con vencimiento el 17/02/2031 *	120	0,12
390	Verscend Holding Corp., 9,447 %, con vencimiento el 27/08/2025 *	391	0,40
Total de obligaciones de préstamo (coste 6.494 $)		6.209	6,41
Organismos de inversión colectiva: 0,60 % (28 de febrero de 2023: 1,33 %)			
577	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	577	0,60
Total de organismos de inversión colectiva (coste 577 $)		577	0,60
Acciones ordinarias: 0,33 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Suiza: 0,33 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
2.640	Credit Suisse Group AG Escrow †∞	323	0,33
Total de acciones ordinarias (coste – $)		323	0,33
Acciones preferentes: 0,34 % (28 de febrero de 2023: 0,51 %)			
Estados Unidos: 0,34 % (28 de febrero de 2023: 0,51 %)			
9	MPLX LP, Serie A ∞	333	0,34
Total de acciones preferentes (coste de 286 $)		333	0,34
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 101.468 $)		96.006	99,10
Swaps de incumplimiento de crédito: 0,43 % (28 febrero de 2023: 0,08 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		421	0,43
Contratos de divisas a plazo: 0,01 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		14	0,01
Futuros: 0,01 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		8	0,01
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		96.449	99,55
Swaps de incumplimiento de crédito: (0,22 %) (28 febrero de 2023: (0,09 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(219)	(0,22)
Contratos de divisas a plazo: 0,00 % (28 de febrero de 2023: (0,03 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(1)	–
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(220)	(0,22)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		96.229	99,33
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		649	0,67
Patrimonio		96.878 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 73.653.000 USD o el 76,02 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

† 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 al final o tras el ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024 (ya sea capital 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 los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	88,94
Otros valores mobiliarios negociables en otro mercado regulado	6,19
Organismos de inversión colectiva	0,58
Instrumentos financieros derivados	0,44
Otros activos	3,85
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)
Goldman Sachs	American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 % – Vender	20 de diciembre de 2028	580	$ 25
Goldman Sachs	CDX.HY.CDSI 5 años, 5,000 % – Vender	20 de diciembre de 2028	960	60
Goldman Sachs	Delta Airlines Inc, 5,000 % – Vender	20 de diciembre de 2028	668	97
Goldman Sachs	Ford Motor Co, 5,000 % – Vender	20 de diciembre de 2028	230	34
Goldman Sachs	Ford Motor Co, 5,000 % – Vender	20 de diciembre de 2026	900	98
Goldman Sachs	General Motors Co, 5,000 % – Vender	20 de diciembre de 2028	230	(37)
Goldman Sachs	Macy's, Inc, 1,000 % – Comprar	20 de diciembre de 2028	420	39
Goldman Sachs	Nabors Industries, Inc, 1,000 % – Vender	20 de diciembre de 2028	419	(77)
Goldman Sachs	Nordstrom Inc, 1,000 % – Vender	20 de diciembre de 2028	420	(43)
Goldman Sachs	Occidental Petroleum Corporation, 1,000 % – Vender	20 de junio de 2026	700	8
Goldman Sachs	Southwest Airlines Co, 1,000 % – Comprar	20 de diciembre de 2028	668	(9)
Goldman Sachs	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5,000 % – Comprar	20 de junio de 2027	580	(53)
Goldman Sachs	Transocean Inc, 1,000 % – Comprar	20 de diciembre de 2028	419	60
Apreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): 102 $)				$ 421
Depreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): (116) $)				(219)
Apreciación neta de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): (14) $)				$ 202

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(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)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	729	Venta	GBP	576		$ 2
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	32	Venta	SGD	43		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	29	Venta	SGD	39		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	45	Venta	USD	32		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	822	Venta	USD	613		(1)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	588	Venta	USD	740		3
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	1.640	Venta	USD	1.766		9
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	USD	–		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	19	Venta	USD	20		–
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	6	Venta	CAD	8		–
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 1 $)									$ 14
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (35) $)									(1)
Apreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (34) $)									$ 13

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) junio de 2024	Goldman Sachs	76	$ 8.125	$ 8
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): – $)				$ 8
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (31) $)				–
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (31) $)				$ 8

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por activos: 0,50 % (28 de febrero de 2023: 0,40 %)			
250	Magnetite XII Ltd, Serie 2015 12A, Clase ER, 144A, 11,256 %, con vencimiento el 15/10/2031 *	243	0,50
Total de valores garantizados por activos (coste 247 $)		243	0,50
Bonos y obligaciones corporativos: 77,42 % (28 de febrero de 2023: 73,14 %)			
Brasil: 1,93 % (28 de febrero de 2023: 1,86 %)			
450	B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 20/09/2031	393	0,81
650	MercadoLibre Inc, 3,125 %, con vencimiento el 14/01/2031	545	1,12
		938	1,93
Canadá: 2,30 % (28 de febrero de 2023: 0,50 %)			
340	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2029	307	0,64
150	Bombardier Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 15/06/2026	152	0,31
400	GFL Environmental Inc, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 01/06/2025	393	0,81
250	Ritchie Bros Holdings Inc, 144A, 7,750 %, con vencimiento el 15/03/2031	263	0,54
		1.115	2,30
Islas Caimán: 1,30 % (28 de febrero de 2023: 1,78 %)			
661	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 15/09/2024	629	1,30
China: 0,04 % (28 de febrero de 2023: 0,28 %)			
400	China Aoyuan Group Ltd, 0,000 %, con vencimiento el 08/02/2025 ε	9	0,02
400	China Aoyuan Group Ltd, 0,000 %, con vencimiento el 23/01/2025 ε	8	0,02
		17	0,04
Colombia: 0,89 % (28 de febrero de 2023: 0,44 %)			
280	Ecopetrol SA, 8,375 %, con vencimiento el 19/01/2036	282	0,58
200	Ecopetrol SA, 5,875 %, con vencimiento el 28/05/2045	148	0,31
		430	0,89
Francia: 1,06 % (28 de febrero de 2023: 0,93 %)			
220	Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/10/2029	167	0,34
210	Banijay Entertainment SASU, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 01/05/2029	217	0,45
EUR 120	Burger King France SAS, 8,647 %, con vencimiento el 01/11/2026 *	131	0,27
		515	1,06
Alemania: 3,64 % (28 de febrero de 2023: 2,00 %)			
EUR 450	APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625 %, con vencimiento el 15/01/2027	477	0,98
EUR 360	APCOA Parking Holdings GmbH, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 15/01/2027	381	0,79
EUR 240	TUI Cruises GmbH, 6,500 %, con vencimiento el 15/05/2026	261	0,54
430	ZF North America Capital Inc, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 14/04/2028	439	0,90
200	ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 14/04/2030	209	0,43
		1.767	3,64
Paraguay: 1,78 % (28 de febrero de 2023: 1,14 %)			
690	Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 27/04/2029 *	648	1,33
250	Millicom International Cellular SA, 4,500 %, con vencimiento el 27/04/2031	216	0,45
		864	1,78
Hong Kong: 0,48 % (28 de febrero de 2023: 0,67 %)			
260	Melco Resorts Finance Ltd, 5,375 %, con vencimiento el 04/12/2029	234	0,48
Irlanda: 0,57 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
330	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,400 %, con vencimiento el 29/10/2033	274	0,57
Israel: 2,77 % (28 de febrero de 2023: 3,90 %)			
1.450	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, con vencimiento el 01/10/2026	1.345	2,77
Italia: 2,25 % (28 de febrero de 2023: 1,71 %)			
720	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, con vencimiento el 01/06/2032 *	591	1,22
70	Telecom Italia Capital SA, 7,200 %, con vencimiento el 18/07/2036	69	0,14
430	Telecom Italia SpA/Milano, 144A, 5,303 %, con vencimiento el 30/05/2024	429	0,89
		1.089	2,25
Luxemburgo: 3,07 % (28 de febrero de 2023: 3,83 %)			
830	Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/08/2029	716	1,48
200	Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 15/05/2027	131	0,27
410	Altice France Holding SA, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 15/02/2028	207	0,43
390	ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 30/06/2027	167	0,34
GBP 220	Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, con vencimiento el 01/04/2028	269	0,55
		1.490	3,07
Macao: 0,73 % (28 de febrero de 2023: 1,90 %)			
210	Sands China Ltd, 3,250 %, con vencimiento el 08/08/2031	175	0,36
200	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 15/12/2029	181	0,37
		356	0,73
México: 1,88 % (28 de febrero de 2023: 1,56 %)			
200	Banco Mercantil del Norte SA/Gran Caimán, 144A, 7,625 %, Perpetuo *	196	0,40
360	Banco Mercantil del Norte SA/Gran Caimán, 144A, 6,625 %, Perpetuo *	316	0,65
440	BBVA Bancomer SA/Texas, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 18/01/2033 *	402	0,83
		914	1,88
Perú: 1,21 % (28 de febrero de 2023: 1,00 %)			
750	Petroleos del Peru SA, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 19/06/2032	589	1,21
Polonia: 0,54 % (28 de febrero de 2023: 0,42 %)			
300	Canpack SA / Canpack US LLC, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/11/2029	261	0,54
Paraguay: 0,43 % (28 de febrero de 2023: 0,28 %)			
EUR 200	United Group BV, 5,250 %, con vencimiento el 01/02/2030	207	0,43
Suecia: 2,12 % (28 de febrero de 2023: 1,47 %)			
EUR 100	Assemblin Group AB, 8,929 %, con vencimiento el 05/07/2029 *	111	0,23
EUR 200	Heimstaden AB, 4,250 %, con vencimiento el 09/03/2026	121	0,25
EUR 300	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,375 %, con vencimiento el 04/09/2026	253	0,52
230	Stena International SA, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 15/01/2031	229	0,47
EUR 280	Verisure Holding AB, 7,125 %, con vencimiento el 01/02/2028	316	0,65
		1.030	2,12
Suiza: 0,26 % (28 de febrero de 2023: 2,38 %)			
150	VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 01/05/2027	127	0,26
Turquía: 1,23 % (28 de febrero de 2023: 1,19 %)			
200	Coca-Cola Icecek AS, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 20/01/2029	187	0,39
410	Turk Telekomunikasyon AS, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 28/02/2025	410	0,84
		597	1,23
Reino Unido: 7,09 % (28 de febrero de 2023: 5,97 %)			
EUR 220	888 Acquisitions Ltd, 7,558 %, con vencimiento el 15/07/2027	232	0,48
EUR 200	888 Acquisitions Ltd, 144A, 7,558 %, con vencimiento el 15/07/2027	211	0,44
200	Ashtead Capital Inc, 144A, 2,450 %, con vencimiento el 12/08/2031	161	0,33
GBP 220	Bellis Acquisition Co Plc, 4,500 %, con vencimiento el 16/02/2026	269	0,55
GBP 100	Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, con vencimiento el 07/04/2026	122	0,25
280	Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, Perpetuo *	276	0,57
GBP 100	Marks & Spencer Plc, 3,750 %, con vencimiento el 19/05/2026	121	0,25
GBP 510	Marston's Issuer Plc, Serie B1, 7,890 %, con vencimiento el 16/07/2035 *	486	1,00
GBP 140	Saga Plc, 5,500 %, con vencimiento el 15/07/2026	158	0,33
400	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/05/2029	375	0,77
560	Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/07/2031	485	1,00
400	Vodafone Group Plc, 4,125 %, con vencimiento el 30/05/2025	394	0,81
GBP 140	Wheel Bidco Ltd, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 15/07/2026	151	0,31
		3.441	7,09
Estados Unidos: 39,38 % (28 de febrero de 2023: 36,14 %)			
200	Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 01/05/2028	179	0,37
550	American Airlines Group Inc, 144A, 3,750 %, con vencimiento el 01/03/2025	538	1,11

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
150	American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 15/02/2028	151	0,31
100	American Airlines Inc, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/05/2029	105	0,22
660	American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2029	573	1,18
280	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 15/06/2027	275	0,57
200	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 15/08/2027	145	0,30
390	Ball Corp, 2,875 %, con vencimiento el 15/08/2030	331	0,68
250	Ball Corp, 3,125 %, con vencimiento el 15/09/2031	211	0,43
80	Beacon Roofing Supply Inc, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 01/08/2030	81	0,17
340	Boise Cascade Co, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 01/07/2030	314	0,65
210	Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2030	215	0,44
90	Caesars Entertainment Inc, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 15/02/2032	91	0,19
230	Carnival Holdings Bermuda Ltd, 144A, 10,375 %, con vencimiento el 01/05/2028	251	0,52
EUR 500	Carnival Plc, 1,000 %, con vencimiento el 28/10/2029	423	0,87
110	Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 15/05/2029	96	0,20
600	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 15/01/2034	449	0,93
150	Charles Schwab Corp/The, Series H, 4,000 %, Perpetuo *	124	0,25
190	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 10,875 %, con vencimiento el 15/01/2032	194	0,40
270	Comerica Bank, 2,500 %, con vencimiento el 23/07/2024	266	0,55
380	CSC Holdings LLC, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 01/12/2030	212	0,44
250	CSC Holdings LLC, 144A, 3,375 %, con vencimiento el 15/02/2031	177	0,36
200	CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 15/11/2031	149	0,31
870	CSC Holdings LLC, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 15/11/2031	475	0,98
60	Cushman & Wakefield US Borrower LLC, 144A, 8,875 %, con vencimiento el 01/09/2031	63	0,13
200	Delta Air Lines Inc, 2,900 %, con vencimiento el 28/10/2024	196	0,40
200	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 15/08/2027	189	0,39
230	DISH DBS Corp, 5,875 %, con vencimiento el 15/11/2024	218	0,45
510	DISH DBS Corp, 5,125 %, con vencimiento el 01/06/2029	218	0,45
300	DISH Network Corp, 2,375 %, con vencimiento el 15/03/2024	296	0,61
720	DISH Network Corp, 3,375 %, con vencimiento el 15/08/2026	429	0,88
100	Diversified Healthcare Trust, 4,375 %, con vencimiento el 01/03/2031	76	0,16
1.080	Ford Motor Co, 3,250 %, con vencimiento el 12/02/2032	886	1,83
180	Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, con vencimiento el 15/02/2028	169	0,35
200	GTCR W-2 Merger Sub LLC, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 15/01/2031	209	0,43
830	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/12/2028	750	1,55
140	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 8,375 %, con vencimiento el 01/11/2033	150	0,31
500	Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 01/05/2025	499	1,03
80	iHeartCommunications Inc, 6,375 %, con vencimiento el 01/05/2026	68	0,14
150	Iron Mountain Inc, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2029	152	0,31
570	JB Poindexter & Co Inc, 144A, 8,750 %, con vencimiento el 15/12/2031	585	1,20
270	Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, con vencimiento el 08/08/2024	267	0,55
540	Match Group Holdings II LLC, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 01/10/2031	455	0,94
265	NCL Corp Ltd, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 15/12/2024	261	0,54
270	NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 15/03/2026	264	0,54
60	NCL Corp Ltd, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 15/01/2029	63	0,13
270	Rackspace Technology Global Inc, 3,500 %, con vencimiento el 31/05/2028 ∞	162	0,33
280	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 2,875 %, con vencimiento el 15/10/2026	258	0,53
200	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 01/07/2026	193	0,40
930	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 01/04/2028	916	1,89
110	Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 6,750 %, con vencimiento el 01/03/2032	110	0,23
200	Service Corp International/US, 5,125 %, con vencimiento el 01/06/2029	196	0,40
520	Service Properties Trust, 5,500 %, con vencimiento el 15/12/2027	490	1,01
120	SilverBow Resources Inc, 144A, 13,135 %, con vencimiento el 15/12/2028 *	119	0,25
290	Sirius XM Radio Inc, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 01/07/2030	250	0,51
220	Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 8,875 %, con vencimiento el 15/11/2031	233	0,48
320	Southwestern Energy Co, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2032	291	0,60
250	Spirit Airlines Inc, 1,000 %, con vencimiento el 15/05/2026	117	0,24
60	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 20/09/2025	43	0,09
290	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 20/09/2025	210	0,43
40	StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/05/2029	29	0,06
150	Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp, 5,875 %, con vencimiento el 01/03/2027	148	0,30
240	Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 01/09/2026	195	0,40
190	Tenet Healthcare Corp, 6,250 %, con vencimiento el 01/02/2027	190	0,39
170	Titan International Inc, 7,000 %, con vencimiento el 30/04/2028	169	0,35
250	T-Mobile USA Inc, 2,625 %, con vencimiento el 15/04/2026	237	0,49
450	T-Mobile USA Inc, 2,625 %, con vencimiento el 15/02/2029	399	0,82
240	TransDigm Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 01/12/2031	246	0,51
200	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 15/04/2029	185	0,38
550	United Rentals North America Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/11/2027	518	1,07
50	Venture Global LNG Inc, 144A, 8,375 %, con vencimiento el 01/06/2031	51	0,10
40	Viasat Inc, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 30/05/2031	28	0,06
120	Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 15/02/2029	116	0,24
120	Vistra Operations Co LLC, 144A, 7,750 %, con vencimiento el 15/10/2031	124	0,26
230	WW International Inc, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 15/04/2029	107	0,22
190	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 15/02/2031	196	0,40
90	XPO Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 01/02/2032	92	0,19
		19.106	39,38
Zambia: 0,47 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
220	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 9,375 %, con vencimiento el 01/03/2029	228	0,47
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 41.084 $)		37.563	77,42
Bonos y obligaciones del Estado: 18,60 % (28 de febrero de 2023: 17,71 %)			
Angola: 0,60 % (28 de febrero de 2023: 0,52 %)			
330	Bono Internacional del Estado de Angola, 144A, 8,750 %, con vencimiento el 14/04/2032	290	0,60
Argentina: 2,76 % (28 de febrero de 2023: 2,30 %)			
161	Bono Internacional de la República Argentina, 1,000 %, con vencimiento el 09/07/2029	75	0,16
297	Bono Internacional de la República Argentina, 0,750 %, con vencimiento el 09/07/2030	136	0,28
944	Argentine Republic Government International Bond, 3,625 %, con vencimiento el 09/07/2035	352	0,73
1.271	Bonos del Gobierno de la Provincia de Buenos Aires, 144A, 6,375 %, con vencimiento el 01/09/2037	494	1,02
340	Provincia de Cordoba, 144A, 6,990 %, con vencimiento el 01/06/2027	279	0,57
		1.336	2,76
Baréin: 0,52 % (28 de febrero de 2023: 0,43 %)			
310	Bono Internacional del Estado de Baréin, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 19/09/2044	251	0,52
Colombia: 0,57 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
350	Colombia Government International Bond, 3,125 %, con vencimiento el 15/04/2031	277	0,57

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones del Estado (continuación)			
Costa Rica: 0,42 % (28 de febrero de 2023: 0,34 %)			
200	Bono Internacional del Estado de Costa Rica, 6,125 %, con vencimiento el 19/02/2031	203	0,42
Costa de Marfil: 0,74 % (28 de febrero de 2023: 0,62 %)			
410	Bono Internacional del Estado de Costa de Marfil, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 15/06/2033	360	0,74
República Dominicana: 1,97 % (28 de febrero de 2023: 1,60 %)			
380	Bono Internacional de la República Dominicana, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 30/01/2030	346	0,71
400	Bono Internacional de la República Dominicana, 144A, 7,050 %, con vencimiento el 03/02/2031	413	0,85
220	Bono Internacional de la República Dominicana, 4,875 %, con vencimiento el 23/09/2032	196	0,41
		955	1,97
Ecuador: 0,55 % (28 de febrero de 2023: 0,58 %)			
660	Bono Internacional del Estado de Ecuador, 144A, zero coupon, con vencimiento el 31/07/2030	269	0,55
Paraguay: 1,21 % (28 de febrero de 2023: 0,89 %)			
300	Bono Internacional del Estado de Egipto, 6,588 %, con vencimiento el 21/02/2028	271	0,56
350	Bono Internacional del Estado de Egipto, 144A, 7,600 %, con vencimiento el 01/03/2029	318	0,65
		589	1,21
Jordania: 0,92 % (28 de febrero de 2023: 0,79 %)			
440	Bono Internacional del Estado de Jordania, 144A, 7,750 %, con vencimiento el 15/01/2028	446	0,92
Kenia: 0,38 % (28 de febrero de 2023: 0,30 %)			
200	Republic of Kenya Government International Bond, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 28/02/2028	186	0,38
México: 2,24 % (28 de febrero de 2023: 1,29 %)			
MXN 550	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, con vencimiento el 29/05/2031	30	0,06
MXN 10.720	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, con vencimiento el 23/11/2034	570	1,18
MXN 4680	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, con vencimiento el 13/11/2042	237	0,49
300	Bono Internacional del Estado de México, 2,659 %, con vencimiento el 24/05/2031	249	0,51
		1.086	2,24
Nigeria: 1,20 % (28 de febrero de 2023: 0,40 %)			
360	Bono Internacional del Estado de Nigeria, 144A, 7,143 %, con vencimiento el 23/02/2030	319	0,66
300	Bono Internacional del Estado de Nigeria, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 16/02/2032	264	0,54
		583	1,20
Omán: 0,42 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
200	Bono Internacional del Estado de Omán, 6,750 %, con vencimiento el 17/01/2048	201	0,42
Panamá: 0,94 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
650	Bono Internacional del Estado de Panamá, 2,252 %, con vencimiento el 29/09/2032	457	0,94
Senegal: 0,34 % (28 de febrero de 2023: 0,28 %)			
230	Bono Internacional del Estado de Senegal, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 13/03/2048	167	0,34
Sudáfrica: 0,38 % (28 de febrero de 2023: 0,32 %)			
250	Bono Internacional del Estado de la República de Sudáfrica, 5,650 %, con vencimiento el 27/09/2047	183	0,38
Turquía: 1,14 % (28 de febrero de 2023: 1,46 %)			
360	Bono Internacional del Estado de Turquía, 4,250 %, con vencimiento el 14/04/2026	346	0,71
300	Bono Internacional del Estado de Turquía, 4,875 %, con vencimiento el 16/04/2043	208	0,43
		554	1,14
Ucrania: 0,27 % (28 de febrero de 2023: 0,15 %)			
450	Bono Internacional del Estado de Ucrania, 144A, 7,750 %, con vencimiento el 01/09/2028	129	0,27
Estados Unidos: 1,03 % (28 de febrero de 2023: 4,50 %)			
500	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 05/03/2024	500	1,03
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 10.082 $)		9.022	18,60

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Obligaciones de préstamo: 1,08 % (28 de febrero de 2023: 0,31 %)			
200	DCert Buyer, Inc., 9,333 %, con vencimiento el 16/10/2026 *	199	0,41
200	Redstone Holdco 2 LP, 10,201 %, con vencimiento el 27/04/2028 *	166	0,34
300	WW International Inc, 8,947 %, con vencimiento el 13/04/2028 *	158	0,33
Total de obligaciones de préstamo (coste 603 $)		523	1,08
Acciones ordinarias: 0,42 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Suiza: 0,42 % (28 de febrero de 2023: 1,28 %) 0,00 %)			
1.680	Credit Suisse Group AG Escrow †∞	206	0,42
Total de acciones ordinarias (coste – $)		206	0,42
Warrants: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Estados Unidos: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
4	flyExclusive Inc	2	–
Total de warrants (coste 3 $)		2	–
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 52.019 $)		47.559	98,02
Contratos de divisas a plazo: 0,07 % (28 de febrero de 2023: 0,10 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		34	0,07
Futuros: 0,02 % (28 de febrero de 2023: 0,07 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		8	0,02
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		47.601	98,11
Contratos de divisas a plazo: (0,05 %) (28 de febrero de 2023: (0,47 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(24)	(0,05)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(24)	(0,05)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		47.577	98,06
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		942	1,94
Patrimonio		48.519 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 27.219.000 USD o el 56,10 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

† 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 al final o tras el ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024 (ya sea capital o interés).

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

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	94,39
Otros valores mobiliarios negociables en otro mercado regulado	1,05
Instrumentos financieros derivados	0,08
Otros activos	4,48
Total de activos	100,00

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(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)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	–	Venta	AUD	–		$ –
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	51	Venta	AUD	77		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	29	Venta	EUR	26		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	67	Venta	GBP	52		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	21	Venta	GBP	17		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	7	Venta	SGD	10		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	27	Venta	SGD	36		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	6.542	Venta	USD	4.267		(12)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	29	Venta	USD	21		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	2.350	Venta	USD	1.751		(3)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	30	Venta	USD	39		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	2.930	Venta	USD	3.687		13
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	80	Venta	USD	87		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	1.515	Venta	USD	1.630		8
19 de abril de 2024	Citi	Compra	USD	1.289	Venta	GBP	1.011		13
19 de abril de 2024	Citi	Compra	EUR	450	Venta	USD	496		(9)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 60 $)									$ 34
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (271) $)									(24)
Apreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (211) $)									$ 10

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Euro FX Currency marzo 2024	UBS	(23)	$ (3.108)	$ 8
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 38 $)				$ 8
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): – $)				–
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 38 $)				$ 8

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos: 10,61 % (28 de febrero de 2023: 14,21 %)			
Francia: 2,33 % (28 de febrero de 2023: 1,32 %)			
SGD 8000	Credit Agricole SA, 3,800 %, con vencimiento el 30/04/2031 *	5.840	2,33
India: 1,47 % (28 de febrero de 2023: 0,80 %)			
4.000	REC Ltd, 2,250 %, con vencimiento el 01/09/2026	3.686	1,47
Indonesia: 2,80 % (28 de febrero de 2023: 2,30 %)			
3.350	Pelabuhan Indonesia Persero PT, 5,375 %, con vencimiento el 05/05/2045	3.183	1,27
4.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 4,125 %, con vencimiento el 15/05/2027	3.829	1,53
		7.012	2,80
Qatar: 3,53 % (28 de febrero de 2023: 2,05 %)			
IDR 140.000.000	QNB Finance Ltd, 6,900 %, con vencimiento el 23/01/2025	8.849	3,53
Supranacional: 0,48 % (28 de febrero de 2023: 1,46 %)			
INR 100.000	International Finance Corp, 6,300 %, con vencimiento el 25/11/2024	1.202	0,48
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 28.287 $)		26.589	10,61
Bonos y obligaciones del Estado: 86,27 % (28 de febrero de 2023: 83,94 %)			
Australia: 1,72 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
AUD 7.000	Bono del Estado de Australia, 3,750 %, con vencimiento el 21/04/2037	4.317	1,72
China: 19,09 % (28 de febrero de 2023: 17,35 %)			
CNY 110.000	Banco de Desarrollo Agrícola de China, Serie 1806, 4,650 %, con vencimiento el 11/05/2028	16.670	6,65
CNY 96.500	Bono del Estado de China, 3,600 %, con vencimiento el 21/05/2030	14.176	5,66
CNY 68.500	Bono del Estado de China, Serie INBK, 3,120 %, con vencimiento el 25/10/2052	10.499	4,19
CNY 5.000	Export-Import Bank of China/The, 4,400 %, con vencimiento el 14/05/2024	696	0,28
CNY 40.000	Export-Import Bank of China/The, Serie 2010, 3,230 %, con vencimiento el 23/03/2030	5.802	2,31
		47.843	19,09
India: 11,08 % (28 de febrero de 2023: 7,70 %)			
INR 300.000	Bono del Estado de la India, Serie SPB, 8,240 %, con vencimiento el 15/02/2027	3.729	1,49
INR 350.000	Bono del Estado de la India, 7,170 %, con vencimiento el 08/01/2028	4.232	1,69
INR 400.000	Bono del Estado de la India, 7,610 %, con vencimiento el 09/05/2030	4.942	1,97
INR 300.000	Bono del Estado de la India, 7,260 %, con vencimiento el 22/08/2032	3.653	1,46
INR 190.000	Bono del Estado de la India, 6,570 %, con vencimiento el 05/12/2033	2.205	0,88
INR 460.000	Bono del Estado de la India, 7,180 %, con vencimiento el 24/07/2037	5.575	2,22
INR 280.000	Bono del Estado de la India, 7,300 %, con vencimiento el 19/06/2053	3.438	1,37
		27.774	11,08
Indonesia: 8,48 % (28 de febrero de 2023: 10,13 %)			
IDR 71.585.000	Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR97, 7,125 %, con vencimiento el 15/06/2043	4.695	1,87
IDR 160.000.000	Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR89, 6,875 %, con vencimiento el 15/08/2051	10.156	4,05
IDR 100.000.000	Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia, Serie OB, 8,250 %, con vencimiento el 15/08/2024	6.410	2,56
		21.261	8,48
Malasia: 11,52 % (28 de febrero de 2023: 11,48 %)			
MYR 32.780	Bono del Estado de Malasia, Serie 0122, 3,582 %, con vencimiento el 15/07/2032	6.768	2,70
MYR 98.770	Bono del Estado de Malasia, Serie 0318, 4,642 %, con vencimiento el 07/11/2033	22.100	8,82
		28.868	11,52
Filipinas: 5,03 % (28 de febrero de 2023: 4,92 %)			
PHP 756.000	Bono Internacional del Estado de Filipinas, 6,250 %, con vencimiento el 14/01/2036	12.614	5,03
Singapur: 4,74 % (28 de febrero de 2023: 6,16 %)			
SGD 6.250	National Environment Agency, 2,500 %, con vencimiento el 15/09/2051	3.983	1,59
SGD 11.000	Bono del Estado de Singapur, 2,625 %, con vencimiento el 01/08/2032	7.897	3,15
		11.880	4,74
Corea del Sur: 15,28 % (28 de febrero de 2023: 18,25 %)			
IDR 50.000.000	Export-Import Bank of Korea, 144A, 6,700 %, con vencimiento el 02/12/2024	3.179	1,27
KRW 14.300.000	Bono del Tesoro de Corea, Serie 2912, 1,375 %, con vencimiento el 10/12/2029	9.596	3,83
KRW 12.800.000	Bono del Tesoro de Corea, Serie 3006, 1,375 %, con vencimiento el 10/06/2030	8.506	3,40
KRW 13.200.000	Bono del Tesoro de Corea, Serie 3206, 3,375 %, con vencimiento el 10/06/2032	9.878	3,94
KRW 13.000.000	Bono del Tesoro de Corea, Serie 3909, 1,125 %, con vencimiento el 10/09/2039	7.121	2,84
		38.280	15,28
Tailandia: 7,55 % (28 de febrero de 2023: 5,38 %)			
THB 641.030	Bono del Estado de Tailandia, 3,300 %, con vencimiento el 17/06/2038	18.911	7,55
Vietnam: 1,78 % (28 de febrero de 2023: 0,34 %)			
4.500	Bono Internacional del Estado de Vietnam, 4,800 %, con vencimiento el 19/11/2024	4.467	1,78
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 241.108 $)		216.215	86,27
Organismos de inversión colectiva: 2,18 % (28 de febrero de 2023: 0,88 %)			
5.476	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	5.476	2,18
Total de organismos de inversión colectiva (coste 5.476 $)		5.476	2,18
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 274.871 $)		248.280	99,06
Contratos de divisas a plazo: 0,01 % (28 de febrero de 2023: 0,04 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		34	0,01
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		248.314	99,07
Contratos de divisas a plazo: (0,07 %) (28 de febrero de 2023: (0,26 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(182)	(0,07)
Futuros: (0,03 %) (28 de febrero de 2023: (0,09 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(82)	(0,03)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(264)	(0,10)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		248.050	98,97
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		2.578	1,03
Patrimonio		250.628 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 3.179.000 USD o el 1,27 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

ABREVIATURAS:

AUD – Dólar australiano
CNY – Renminbi chino
IDR – Rupia indonesia
INR – Rupia india
KRW – Won surcoreano
MYR – Ringgit malasio
PHP – Peso filipino
SGD – Dólar de Singapur
THB – Baht tailandés

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	96,26
Organismos de inversión colectiva	2,17
Instrumentos financieros derivados	0,01
Otros activos	1,56
Total de activos	100,00

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(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)
08 de marzo de 2024	Citi	Compra	USD	8.487	Venta	NZD	14.000		$ (37)
08 de marzo de 2024	Citi	Compra	NZD	7.000	Venta	USD	4.302		(39)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	121	Venta	AUD	187		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	6	Venta	CNH	40		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	500	Venta	CNH	3.603		(2)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	121	Venta	EUR	112		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	237	Venta	EUR	218		1
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	205	Venta	SGD	275		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	10	Venta	SGD	14		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CHF	14	Venta	USD	16		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	–	Venta	USD	–		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	17.218	Venta	USD	11.228		(31)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CNH	158.254	Venta	USD	22.037		(54)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CNH	10.700	Venta	USD	1.486		1
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	5.739	Venta	USD	6.176		32
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	3.004	Venta	USD	2.236		(3)
27 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	SGD	18.100	Venta	USD	13.484		(16)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 162 $)									$ 34
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (1.130) $)									(182)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (968) $)									$ (148)

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 marzo 2024	UBS	57	$ 4.809	$ (82)
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): – $)				$ –
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (373) $)				(82)
Depreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (373) $)				$ (82)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)			Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos: 93,20 % (28 de febrero de 2023: 83,61 %)				
Australia: 0,14 % (28 de febrero de 2023: 0,69 %)				
EUR	720	Optus Finance Pty Ltd, 1,000 %, con vencimiento el 20/06/2029	674	0,14
Canadá: 1,88 % (28 de febrero de 2023: 2,72 %)				
GBP	3.270	Royal Bank of Canada, 5,000 %, con vencimiento el 24/01/2028	4.104	0,86
GBP	1.980	Toronto-Dominion Bank/The, 2,875 %, con vencimiento el 05/04/2027	2.333	0,49
GBP	2.000	Toronto-Dominion Bank/The, 5,288 %, con vencimiento el 11/01/2028	2.537	0,53
			8.974	1,88
Dinamarca: 0,99 % (28 de febrero de 2023: 2,09 %)				
GBP	2.890	Danske Bank A/S, 4,625 %, con vencimiento el 13/04/2027 *	3.601	0,75
	1.200	Danske Bank A/S, 144A, 4,298 %, con vencimiento el 01/04/2028 *	1.156	0,24
			4.757	0,99
Finlandia: 0,77 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
EUR	1.220	Neste Oyj, 3,875 %, con vencimiento el 16/03/2029	1.339	0,28
EUR	2.150	Neste Oyj, 3,875 %, con vencimiento el 21/05/2031	2.356	0,49
			3.695	0,77
Francia: 9,01 % (28 de febrero de 2023: 6,57 %)				
EUR	2.300	APRR SA, 0,125 %, con vencimiento el 18/01/2029	2.138	0,45
EUR	800	APRR SA, 1,500 %, con vencimiento el 25/01/2030	779	0,16
GBP	2.600	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1,500 %, con vencimiento el 07/10/2026	2.997	0,63
EUR	2.700	BNP Paribas SA, 0,375 %, con vencimiento el 14/10/2027 *	2.673	0,56
EUR	1.100	BNP Paribas SA, 1,375 %, con vencimiento el 28/05/2029	1.055	0,22
	2.470	BNP Paribas SA, 144A, 5,176 %, con vencimiento el 09/01/2030 *	2.448	0,51
GBP	2.600	BNP Paribas SA, 5,750 %, con vencimiento el 13/06/2032	3.334	0,70
EUR	1.200	Bouygues SA, 0,500 %, con vencimiento el 11/02/2030	1.101	0,23
EUR	1.800	Bouygues SA, 4,625 %, con vencimiento el 07/06/2032	2.097	0,44
GBP	2.600	BPCE SA, 1,375 %, con vencimiento el 23/12/2026	2.963	0,62
GBP	1.900	BPCE SA, 4,875 %, con vencimiento el 22/10/2030	2.354	0,49
EUR	300	Credit Agricole SA/London, 1,250 %, con vencimiento el 14/04/2026	309	0,06
	6.350	Credit Agricole SA/London, 1,907 %, con vencimiento el 16/06/2026 *	6.052	1,26
EUR	300	Credit Agricole SA/London, 1,750 %, con vencimiento el 05/03/2029	296	0,06
EUR	400	Engie SA, 1,000 %, con vencimiento el 13/03/2026	412	0,09
EUR	300	Engie SA, 2,375 %, con vencimiento el 19/05/2026	317	0,07
EUR	3.800	Engie SA, 0,500 %, con vencimiento el 24/10/2030	3.343	0,70
EUR	2.400	L'Oreal SA, 0,875 %, con vencimiento el 29/06/2026	2.459	0,51
EUR	2.100	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 3,375 %, con vencimiento el 21/10/2025	2.268	0,47
EUR	600	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR, 1,000 %, con vencimiento el 19/10/2026	611	0,13
EUR	1.100	TotalEnergies Capital International SA, 1,023 %, con vencimiento el 04/03/2027	1.111	0,23
GBP	1.700	Vinci SA, 2,250 %, con vencimiento el 15/03/2027	1.995	0,42
			43.112	9,01
Alemania: 4,83 % (28 de febrero de 2023: 5,72 %)				
EUR	3.100	Allianz Finance II BV, 1,500 %, con vencimiento el 15/01/2030	3.058	0,64
EUR	300	BASF SE, 0,875 %, con vencimiento el 15/11/2027	300	0,06
EUR	600	Clearstream Banking AG, 0,000 %, con vencimiento el 01/12/2025	612	0,13
EUR	500	Deutsche Boerse AG, 1,125 %, con vencimiento el 26/03/2028	500	0,10
EUR	3.900	Deutsche Boerse AG, 3,750 %, con vencimiento el 28/09/2029	4.301	0,90
EUR	1.500	HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH, 0,625 %, con vencimiento el 01/11/2028	1.418	0,30
EUR	2.500	Robert Bosch GmbH, 3,625 %, con vencimiento el 02/06/2027	2.718	0,57
EUR	3.600	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3,000 %, con vencimiento el 22/11/2028	3.871	0,81
EUR	4.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 1,000 %, con vencimiento el 25/02/2030	3.808	0,79
GBP	2.000	Volkswagen Financial Services NV, 5,500 %, con vencimiento el 07/12/2026	2.523	0,53
			23.109	4,83
Japón: 1,54 % (28 de febrero de 2023: 1,80 %)				
EUR	3.370	NTT Finance Corp, 0,010 %, con vencimiento el 03/03/2025	3.510	0,74
EUR	2.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 0,632 %, con vencimiento el 23/10/2029	1.834	0,38
GBP	1.600	Toyota Motor Finance Netherlands BV, 4,625 %, con vencimiento el 08/06/2026	2.004	0,42
			7.348	1,54
Luxemburgo: 0,48 % (28 de febrero de 2023: 0,41 %)				
EUR	2.275	Prologis International Funding II SA, 1,750 %, con vencimiento el 15/03/2028	2.288	0,48
Países Bajos: 6,10 % (28 de febrero de 2023: 5,25 %)				
EUR	220	ABN AMRO Bank NV, 1,000 %, con vencimiento el 16/04/2025	231	0,05
GBP	2.400	ABN AMRO Bank NV, 5,250 %, con vencimiento el 26/05/2026	3.030	0,63
GBP	4.300	ABN AMRO Bank NV, 5,125 %, con vencimiento el 22/02/2028	5.406	1,13
EUR	1.470	Alliander NV, 2,625 %, con vencimiento el 09/09/2027	1.556	0,32
EUR	2.300	Cooperatieve Rabobank UA, 0,375 %, con vencimiento el 01/12/2027 *	2.276	0,48
	2.500	Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 3,649 %, con vencimiento el 06/04/2028 *	2.369	0,49
EUR	3.310	Enexis Holding NV, 0,750 %, con vencimiento el 02/07/2031	2.982	0,62
EUR	300	ING Groep NV, 2,125 %, con vencimiento el 10/01/2026	315	0,07
EUR	1.300	ING Groep NV, 0,875 %, con vencimiento el 29/11/2030 *	1.188	0,25
	1.780	Shell International Finance BV, 3,250 %, con vencimiento el 11/05/2025	1.741	0,36
	1.700	Shell International Finance BV, 2,750 %, con vencimiento el 06/04/2030	1.514	0,32
EUR	1.910	TenneT Holding BV, 1,625 %, con vencimiento el 17/11/2026	1.991	0,42
EUR	2.220	TenneT Holding BV, 1,375 %, con vencimiento el 05/06/2028	2.246	0,47
EUR	1.000	Vesteda Finance BV, 2,000 %, con vencimiento el 10/07/2026	1.033	0,22
EUR	1.500	Vesteda Finance BV, 0,750 %, con vencimiento el 18/10/2031	1.294	0,27
			29.172	6,10
Noruega: 2,79 % (28 de febrero de 2023: 1,69 %)				
EUR	940	Avinor AS, 0,750 %, con vencimiento el 01/10/2030	859	0,18
GBP	4.050	DNB Bank ASA, 4,000 %, con vencimiento el 17/08/2027 *	4.958	1,03
EUR	3.400	DNB Bank ASA, 3,125 %, con vencimiento el 21/09/2027 *	3.625	0,76
EUR	1.000	Equinor ASA, 0,750 %, con vencimiento el 22/05/2026	1.020	0,21
EUR	540	Equinor ASA, 1,250 %, con vencimiento el 17/02/2027	550	0,11
EUR	620	Statkraft AS, 2,875 %, con vencimiento el 13/09/2029	656	0,14
EUR	1.610	Statkraft AS, 3,125 %, con vencimiento el 13/12/2031	1.708	0,36
			13.376	2,79
Singapur: 1,19 % (28 de febrero de 2023: 1,06 %)				
EUR	5.300	Temasek Financial I Ltd, 3,250 %, con vencimiento el 15/02/2027	5.712	1,19
España: 2,68 % (28 de febrero de 2023: 1,42 %)				
EUR	1.900	Aena SME SA, 4,250 %, con vencimiento el 13/10/2030	2.139	0,45
EUR	2.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Serie gmtn, 3,375 %, con vencimiento el 20/09/2027	2.152	0,45
	3.400	Banco Santander SA, 5,294 %, con vencimiento el 18/08/2027	3.379	0,70
EUR	1.700	Banco Santander SA, 0,625 %, con vencimiento el 24/06/2029 *	1.612	0,34
EUR	3.200	Banco Santander SA, 4,250 %, con vencimiento el 12/06/2030	3.563	0,74
			12.845	2,68
Supranacional: 1,54 % (28 de febrero de 2023: 2,06 %)				
GBP	4.200	Inter-American Development Bank, 0,500 %, con vencimiento el 15/09/2026	4.799	1,00
GBP	2.090	International Finance Facility for Immunisation Co, 2,750 %, con vencimiento el 07/06/2025	2.558	0,54
			7.357	1,54
Suecia: 2,00 % (28 de febrero de 2023: 2,08 %)				
EUR	2.860	Assa Abloy AB, 3,750 %, con vencimiento el 13/09/2026	3.113	0,65
EUR	2.190	Hemso Treasury Oyj, 0,000 %, con vencimiento el 19/01/2028	2.030	0,43
EUR	2.250	Swedbank AB, 0,300 %, con vencimiento el 20/05/2027 *	2.244	0,47
EUR	2.000	Vattenfall AB, 3,750 %, con vencimiento el 18/10/2026	2.172	0,45
			9.559	2,00
Suiza: 4,86 % (28 de febrero de 2023: 3,77 %)				
EUR	1.480	ABB Finance BV, 3,250 %, con vencimiento el 16/01/2027	1.596	0,33
EUR	2.420	ABB Finance BV, Serie emTN, 3,125 %, con vencimiento el 15/01/2029	2.596	0,54
EUR	800	Cloverie Plc para Zurich Insurance Co Ltd, 1,500 %, con vencimiento el 15/12/2028	796	0,17
GBP	3.530	Credit Suisse AG/London, 1,125 %, con vencimiento el 15/12/2025	4.140	0,87
EUR	6.000	Novartis Finance SA, 0,000 %, con vencimiento el 23/09/2028	5.623	1,18
EUR	1.560	Sika Capital BV, 3,750 %, con vencimiento el 03/11/2026	1.698	0,35
EUR	1.050	Sika Capital BV, 3,750 %, con vencimiento el 03/05/2030	1.155	0,24
GBP	1.050	UBS Group AG, 2,125 %, con vencimiento el 12/09/2025 *	1.302	0,27
	4.430	UBS Group AG, 4,703 %, con vencimiento el 05/08/2027 *	4.343	0,91
			23.249	4,86

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Reino Unido: 10,98 % (28 de febrero de 2023: 9,14 %)			
EUR 3.850	AstraZeneca Plc, 3,625 %, con vencimiento el 03/03/2027	4.199	0,88
GBP 1.700	British Land Co Plc/The, 2,375 %, con vencimiento el 14/09/2029	1.829	0,38
EUR 400	CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd, 1,250 %, con vencimiento el 13/04/2025	419	0,09
EUR 270	GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,250 %, con vencimiento el 21/05/2026	279	0,06
EUR 550	GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,000 %, con vencimiento el 12/09/2026	561	0,12
EUR 5.000	GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,375 %, con vencimiento el 12/09/2029	4.894	1,02
EUR 1.200	GSK Capital BV, 3,125 %, con vencimiento el 28/11/2032	1.266	0,26
390	HSBC Holdings Plc, 1,645 %, con vencimiento el 18/04/2026 *	372	0,08
1.220	HSBC Holdings Plc, 2,099 %, con vencimiento el 04/06/2026 *	1.168	0,24
EUR 1.630	HSBC Holdings Plc, Serie GEN, 0,309 %, con vencimiento el 13/11/2026 *	1.661	0,35
GBP 300	HSBC Holdings Plc, 3,000 %, con vencimiento el 22/07/2028 *	348	0,07
1.800	HSBC Holdings Plc, 6,161 %, con vencimiento el 09/03/2029 *	1.840	0,38
EUR 890	Lloyds Banking Group Plc, 3,500 %, con vencimiento el 01/04/2026 *	957	0,20
EUR 3.000	Lloyds Banking Group Plc, 3,125 %, con vencimiento el 24/08/2030 *	3.117	0,65
EUR 690	London Stock Exchange Group Plc, 1,750 %, con vencimiento el 06/12/2027	705	0,15
GBP 1.250	London Stock Exchange Group Plc, 1,625 %, con vencimiento el 06/04/2030	1.328	0,28
EUR 1.560	Motability Operations Group Plc, 0,125 %, con vencimiento el 20/07/2028	1.455	0,30
GBP 990	Nationwide Building Society, 6,178 %, con vencimiento el 07/12/2027 *	1.270	0,26
GBP 3.390	Nationwide Building Society, 6,125 %, con vencimiento el 21/08/2028	4.430	0,93
EUR 4.750	Natwest Group Plc, 1,375 %, con vencimiento el 02/03/2027	4.813	1,01
GBP 3.070	NatWest Markets Plc, 6,375 %, con vencimiento el 08/11/2027	4.009	0,84
GBP 1.640	Northern Powergrid Yorkshire Plc, 5,625 %, con vencimiento el 14/11/2033	2.146	0,45
EUR 1.340	Segro Capital Sarl, 1,250 %, con vencimiento el 23/03/2026	1.374	0,29
EUR 2.200	Segro Capital Sarl, 0,500 %, con vencimiento el 22/09/2031	1.839	0,38
580	Standard Chartered Plc, 144A, 1,214 %, con vencimiento el 23/03/2025 *	577	0,12
EUR 480	Unilever Finance Netherlands BV, 1,250 %, con vencimiento el 25/03/2025	506	0,11
EUR 550	Unilever Finance Netherlands BV, 1,125 %, con vencimiento el 12/02/2027	560	0,12
EUR 2.000	Unilever Finance Netherlands BV, 3,250 %, con vencimiento el 23/02/2031	2.164	0,45
EUR 1.500	Unilever Finance Netherlands BV, 3,250 %, con vencimiento el 15/02/2032	1.620	0,34
EUR 810	Wellcome Trust Ltd/The, 1,125 %, con vencimiento el 21/01/2027	827	0,17
		52.533	10,98
Estados Unidos: 41,42 % (28 de febrero de 2023: 37,14 %)			
EUR 2.000	Abbott Ireland Financing DAC, 0,375 %, con vencimiento el 19/11/2027	1.959	0,41
4.000	AbbVie Inc, 4,800 %, con vencimiento el 15/03/2029	3.982	0,83
1.700	Adobe Inc, 2,150 %, con vencimiento el 01/02/2027	1.583	0,33
4.500	Alphabet Inc, 0,800 %, con vencimiento el 15/08/2027	3.978	0,83
2.200	Amazon.com Inc, 1,200 %, con vencimiento el 03/06/2027	1.969	0,41
1.400	Amazon.com Inc, 1,500 %, con vencimiento el 03/06/2030	1.158	0,24
340	Apple Inc, 3,200 %, con vencimiento el 13/05/2025	333	0,07
GBP 1.500	Apple Inc, 3,050 %, con vencimiento el 31/07/2029	1.777	0,37
EUR 2.500	Bank of America Corp, 4,134 %, con vencimiento el 12/06/2028	2.751	0,57
EUR 800	Bank of America Corp, 3,648 %, con vencimiento el 31/03/2029 *	860	0,18
4.800	Bank of America Corp, 5,015 %, con vencimiento el 22/07/2033 *	4.680	0,98
4.300	Bank of New York Mellon Corp/The, 4,947 %, con vencimiento el 26/04/2027 *	4.277	0,89
EUR 3.000	Berkshire Hathaway Inc, 1,125 %, con vencimiento el 16/03/2027	3.036	0,63
EUR 530	BlackRock Inc, 1,250 %, con vencimiento el 06/05/2025	557	0,12
EUR 2.550	Blackstone Holdings Finance Co LLC, 1,000 %, con vencimiento el 05/10/2026	2.569	0,54
EUR 2.000	Booking Holdings Inc, 0,100 %, con vencimiento el 08/03/2025	2.083	0,44
3.410	Bristol-Myers Squibb Co, 4,900 %, con vencimiento el 22/02/2029	3.403	0,71
588	Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, con vencimiento el 26/07/2029	548	0,11
4.000	Cargill Inc, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 24/06/2026	3.951	0,83
EUR 1.360	Cargill Inc, 3,875 %, con vencimiento el 24/04/2030	1.502	0,31
7.140	Caterpillar Financial Services Corp, 5,050 %, con vencimiento el 27/02/2026	7.146	1,49
3.000	Caterpillar Inc, 2,600 %, con vencimiento el 09/04/2030	2.669	0,56
2.400	Chevron Corp, 1,554 %, con vencimiento el 11/05/2025	2.304	0,48
EUR 1.300	Chubb INA Holdings Inc, 0,875 %, con vencimiento el 15/06/2027	1.291	0,27
EUR 800	Chubb INA Holdings Inc, 1,550 %, con vencimiento el 15/03/2028	801	0,17
3.420	Citigroup Inc, 3,300 %, con vencimiento el 27/04/2025	3.345	0,70
2.900	Citigroup Inc, 2,572 %, con vencimiento el 03/06/2031 *	2.453	0,51
EUR 5.000	Coca-Cola Co/The, 0,125 %, con vencimiento el 15/03/2029	4.640	0,97
EUR 1.300	Colgate-Palmolive Co, 0,500 %, con vencimiento el 06/03/2026	1.331	0,28
2.890	Comcast Corp, 3,150 %, con vencimiento el 01/03/2026	2.790	0,58
1.200	Comcast Corp, 4,150 %, con vencimiento el 15/10/2028	1.165	0,24
1.800	Costco Wholesale Corp, 1,375 %, con vencimiento el 20/06/2027	1.620	0,34
2.900	Deere & Co, 3,100 %, con vencimiento el 15/04/2030	2.637	0,55
7.000	Ecolab Inc, 2,125 %, con vencimiento el 01/02/2032	5.756	1,20
2.000	Estee Lauder Cos Inc/The, 2,375 %, con vencimiento el 01/12/2029	1.750	0,37
GBP 1.440	Experian Finance Plc, 0,739 %, con vencimiento el 29/10/2025	1.694	0,35
1.830	Gilead Sciences Inc, 3,650 %, con vencimiento el 01/03/2026	1.777	0,37
4.500	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,600 %, con vencimiento el 07/02/2030	3.910	0,82
1.480	Home Depot Inc/The, 2,700 %, con vencimiento el 15/04/2030	1.310	0,27
EUR 320	JPMorgan Chase & Co, 1,500 %, con vencimiento el 29/10/2026	329	0,07
4.400	JPMorgan Chase & Co, 1,045 %, con vencimiento el 19/11/2026 *	4.093	0,86
2.500	JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, con vencimiento el 23/07/2029 *	2.401	0,50
240	Kimberly-Clark Corp, 1,050 %, con vencimiento el 15/09/2027	211	0,04
910	Kimberly-Clark Corp, 3,950 %, con vencimiento el 01/11/2028	882	0,18
EUR 2.100	Linde Plc, 1,000 %, con vencimiento el 31/03/2027	2.125	0,44
EUR 2.800	Linde Plc, 3,375 %, con vencimiento el 12/06/2029	3.043	0,64
1.150	Mars Inc, 2,700 %, con vencimiento el 01/04/2025	1.120	0,23
1.700	Mars Inc, 144A, 2,700 %, con vencimiento el 01/04/2025	1.655	0,35
280	Mastercard Inc, 3,375 %, con vencimiento el 01/04/2024	279	0,06
EUR 2.000	Mastercard Inc, 1,000 %, con vencimiento el 22/02/2029	1.952	0,41
EUR 2.550	Medtronic Global Holdings SCA, 0,000 %, con vencimiento el 15/10/2025	2.600	0,54
4.340	Merck & Co Inc, 1,900 %, con vencimiento el 10/12/2028	3.833	0,80
570	Microsoft Corp, 2,700 %, con vencimiento el 12/02/2025	557	0,12
2.400	Microsoft Corp, 2,400 %, con vencimiento el 08/08/2026	2.274	0,48
EUR 330	Morgan Stanley, 1,375 %, con vencimiento el 27/10/2026	337	0,07
EUR 2.040	Morgan Stanley, 4,813 %, con vencimiento el 25/10/2028 *	2.281	0,48
2.500	Morgan Stanley, 3,772 %, con vencimiento el 24/01/2029 *	2.365	0,49
EUR 2.790	Morgan Stanley, 0,495 %, con vencimiento el 26/10/2029 *	2.588	0,54
EUR 680	Nestle Finance International Ltd, 1,500 %, con vencimiento el 01/04/2030	670	0,14
3.000	Nestle Holdings Inc, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 13/03/2026	3.017	0,63
1.600	NVIDIA Corp, 2,850 %, con vencimiento el 01/04/2030	1.442	0,30
EUR 310	PepsiCo Inc, 0,750 %, con vencimiento el 18/03/2027	311	0,07
EUR 3.000	PepsiCo Inc, 0,500 %, con vencimiento el 06/05/2028	2.908	0,61
GBP 1.260	PepsiCo Inc, 3,200 %, con vencimiento el 22/07/2029	1.500	0,31
2.400	Pepsico Singapore Financing I PTE te Ltd, 4,550 %, con vencimiento el 16/02/2029	2.379	0,50
5.680	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,650 %, con vencimiento el 19/05/2030	5.590	1,17
EUR 350	Prologis Euro Finance LLC, 1,875 %, con vencimiento el 05/01/2029	349	0,07
EUR 2.200	Prologis Euro Finance LLC, 1,000 %, con vencimiento el 08/02/2029	2.102	0,44
EUR 2.600	Public Storage Operating Co, 0,500 %, con vencimiento el 09/09/2030	2.294	0,48
EUR 3.500	Roche Finance Europe BV, 3,204 %, con vencimiento el 27/08/2029	3.800	0,79
4.200	Roche Holdings Inc, 144A, 1,930 %, con vencimiento el 13/12/2028	3.681	0,77
EUR 400	Sanofi SA, 1,000 %, con vencimiento el 01/04/2025	421	0,09
1.040	Sanofi SA, 3,625 %, con vencimiento el 19/06/2028	1.005	0,21
EUR 4.900	Sanofi SA, 1,250 %, con vencimiento el 06/04/2029	4.826	1,01

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
EUR 2.400	Schneider Electric SE, 3,125 %, con vencimiento el 13/10/2029	2.579	0,54
EUR 2.700	Schneider Electric SE, 3,000 %, con vencimiento el 10/01/2031	2.861	0,60
560	Texas Instruments Inc, 1,375 %, con vencimiento el 12/03/2025	539	0,11
1.150	Texas Instruments Inc, 2,900 %, con vencimiento el 03/11/2027	1.081	0,23
3.850	Texas Instruments Inc, 4,600 %, con vencimiento el 15/02/2028	3.844	0,80
1.630	TJX Cos Inc/The, 1,600 %, con vencimiento el 15/05/2031	1.316	0,28
GBP 1.340	Toyota Motor Credit Corp, 0,750 %, con vencimiento el 19/11/2026	1.520	0,32
5.320	Union Pacific Corp, 4,750 %, con vencimiento el 21/02/2026	5.309	1,11
EUR 2.000	United Parcel Service Inc, 1,625 %, con vencimiento el 15/11/2025	2.096	0,44
4.000	UnitedHealth Group Inc, 5,350 %, con vencimiento el 15/02/2033	4.083	0,85
540	Visa Inc, 3,150 %, con vencimiento el 14/12/2025	524	0,11
4.000	Visa Inc, 1,900 %, con vencimiento el 15/04/2027	3.687	0,77
251	Walmart Inc, 2,375 %, con vencimiento el 24/09/2029	224	0,05
		198.228	41,42
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 469.956 $)		445.988	93,20
Bonos y obligaciones del Estado: 3,66 % (28 de febrero de 2023: 14,70 %)			
Canadá: 1,09 % (28 de febrero de 2023: 0,94 %)			
GBP 1.200	CPPIB Capital Inc, 0,875 %, con vencimiento el 17/12/2024	1.465	0,31
GBP 3.000	CPPIB Capital Inc, 4,375 %, con vencimiento el 02/03/2026	3.755	0,78
		5.220	1,09
Países Bajos: 0,96 % (28 de febrero de 2023: 2,02 %)			
GBP 3.660	Nederlandse Waterschapsbank NV, 4,500 %, con vencimiento el 18/06/2025	4.589	0,96
Corea del Sur 0,15 % (28 de febrero de 2023: 0,13 %)			
EUR 660	Korea Development Bank/The, 0,000 %, con vencimiento el 10/07/2024	703	0,15
Suecia: 0,94 % (28 de febrero de 2023: 1,40 %)			
GBP 3.600	Svensk Exportkredit AB, 4,500 %, con vencimiento el 11/03/2026	4.509	0,94
Estados Unidos: 0,52 % (28 de febrero de 2023: 10,21 %)			
2.710	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 1,500 %, con vencimiento el 31/01/2027	2.495	0,52
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 17.288 $)		17.516	3,66

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Planes de inversión colectiva: 0,23 % (28 de febrero de 2023: 3,25 %)			
1.097	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	1.097	0,23
Total de organismos de inversión colectiva (coste 1.097 $)		1.097	0,23
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 488.341 $)		464.601	97,09
Contratos de divisas a plazo: 0,60 % (28 de febrero de 2023: 0,71 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		2.849	0,60
Futuros: 0,14 % (28 de febrero de 2023: 0,92 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		638	0,14
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		468.088	97,83
Swaps de incumplimiento crediticio: (0,10 %) (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(498)	(0,10)
Contratos de divisas a plazo: (0,04 %) (28 de febrero de 2023: (0,62 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(177)	(0,04)
Futuros: (0,02 %) (28 de febrero de 2023: (0,01 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(82)	(0,02)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(757)	(0,16)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		467.331	97,67
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		11.207	2,33
Patrimonio		478.538 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 18.854.000 USD o el 3,94 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

ABREVIATURAS:

EUR – Euro

GBP – Libra esterlina

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	96,46
Organismos de inversión colectiva	0,23
Instrumentos financieros derivados	0,73
Otros activos	2,58
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)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000 % – Comprar	20 de diciembre de 2028	23.140	$ (498)
Apreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): 213 $)				$ –
Depreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): – $)				(498)
Depreciación neta de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): 213 $)				$ (498)

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 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	2.442	Venta	EUR	2.255	$ 2
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	1.261	Venta	EUR	1.171	(4)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	3.577	Venta	GBP	2.829	6
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	3.230	Venta	GBP	2.562	(7)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	153	Venta	SEK	1.581	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	352	Venta	SEK	3.709	(5)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	222.328	Venta	USD	279.707	966
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SEK	116.989	Venta	USD	11.097	197
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CHF	4.184	Venta	USD	4.824	(84)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	57.683	Venta	USD	62.093	289
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SEK	281	Venta	USD	26	–

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(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 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	1.750	Venta	USD	1.896		$ (4)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	1.020	Venta	USD	1.288		(2)
13 de mayo de 2024	BNP Paribas	Compra	USD	20.829	Venta	EUR	19.222		(10)
13 de mayo de 2024	BNP Paribas	Compra	USD	21.507	Venta	GBP	16.841		241
13 de mayo de 2024	BNP Paribas	Compra	EUR	7.560	Venta	USD	8.160		36
13 de mayo de 2024	Citi	Compra	USD	9.529	Venta	EUR	8.845		(61)
13 de mayo de 2024	Citi	Compra	USD	31.135	Venta	EUR	28.706		13
13 de mayo de 2024	Citi	Compra	USD	12.665	Venta	GBP	9.922		135
13 de mayo de 2024	Citi	Compra	USD	194	Venta	JPY	27.973		5
13 de mayo de 2024	Citi	Compra	EUR	705	Venta	USD	760		4
13 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	28.197	Venta	EUR	25.990		19
13 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	22.242	Venta	GBP	17.428		233
13 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	554	Venta	JPY	79.998		14
13 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	GBP	2.421	Venta	USD	3.040		17
13 de mayo de 2024	HSBC	Compra	USD	29.216	Venta	EUR	26.919		31
13 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	44.313	Venta	EUR	40.823		54
13 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	6.663	Venta	GBP	5.220		71
13 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	GBP	530	Venta	USD	667		3
13 de mayo de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	33.726	Venta	EUR	31.061		50
13 de mayo de 2024	Royal Bank of Canada	Compra	USD	16.734	Venta	GBP	13.106		183
13 de mayo de 2024	UBS	Compra	USD	30.601	Venta	EUR	28.183		45
13 de mayo de 2024	UBS	Compra	USD	21.351	Venta	GBP	16.724		231
13 de mayo de 2024	UBS	Compra	GBP	500	Venta	USD	627		4
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 3.707 $)									$ 2.849
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (3.219) $)									(177)
Apreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 488 $)									$ 2.672

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Euro-Bobl marzo de 2024	Bank of America Merrill Lynch	(338)	$ (42.456)	$ 489
Euro-Bund marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	(136)	(19.498)	130
Bono a 10 años de Japón (OSE) marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	(12)	(11.707)	(76)
U.S. 10 Year Note (CBT) junio de 2024	Bank of America Merrill Lynch	161	17.780	19
U.S. 5 Year Note (CBT) junio de 2024	Bank of America Merrill Lynch	(24)	(2.566)	(6)
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 4.839 $)				$ 638
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (61) $)				(82)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 4.778 $)				$ 556

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas: 17,49 % (28 de febrero de 2023: 10,40 %)			
100	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,000 % ±	92	0,07
700	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,500 % ±	663	0,51
1.500	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,000 % ±	1.179	0,91
2.300	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 % ±	1.890	1,46
1.900	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,000 % ±	1.625	1,26
100	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,500 % ±	89	0,07
100	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,500 % ±	95	0,07
1.600	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 5,000 % ±	1.552	1,20
1.100	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 5,500 % ±	1.088	0,84
300	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 6,000 % ±	301	0,23
400	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 6,000 % ±	402	0,31
100	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 6,500 % ±	102	0,08
100	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 6,500 % ±	102	0,08
2	Fannie Mae Pool '255984', 4,500 %, con vencimiento el 01/11/2025	2	–
51	Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2043	46	0,04
65	Fannie Mae Pool 'AL7093', 4,000 %, con vencimiento el 01/05/2045	62	0,05
21	Fannie Mae Pool 'AS4271', 4,500 %, con vencimiento el 01/01/2045	20	0,02
48	Fannie Mae Pool 'AS8951', 3,500 %, con vencimiento el 01/03/2047	43	0,03
16	Fannie Mae Pool 'AS9760', 4,500 %, con vencimiento el 01/06/2047	16	0,01
291	Fannie Mae Pool 'AX0756', 3,500 %, con vencimiento el 01/07/2044	268	0,21
30	Fannie Mae Pool 'BC9077', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2046	27	0,02
91	Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000 %, con vencimiento el 01/12/2037	83	0,06
93	Fannie Mae Pool 'BK7700', 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2048	90	0,07
34	Fannie Mae Pool 'BM4897', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2046	31	0,02
25	Fannie Mae Pool 'BN1623', 4,500 %, con vencimiento el 01/11/2048	24	0,02
32	Fannie Mae Pool 'BP1585', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2050	29	0,02
68	Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	56	0,04
71	Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	57	0,04
79	Fannie Mae Pool 'BT5574', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	66	0,05
247	Fannie Mae Pool 'BU1030', 2,000 %, con vencimiento el 01/11/2051	198	0,15
44	Fannie Mae Pool 'CA2047', 4,500 %, con vencimiento el 01/07/2048	42	0,03
86	Fannie Mae Pool 'CA2199', 4,500 %, con vencimiento el 01/08/2048	83	0,06
41	Fannie Mae Pool 'CA2482', 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2048	40	0,03
266	Fannie Mae Pool 'CA6672', 2,000 %, con vencimiento el 01/07/2050	211	0,16
24	Fannie Mae Pool 'FM1193', 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2049	22	0,02
116	Fannie Mae Pool 'FM1578', 3,500 %, con vencimiento el 01/09/2034	110	0,09
70	Fannie Mae Pool 'FM1579', 3,500 %, con vencimiento el 01/10/2034	67	0,05
136	Fannie Mae Pool 'FM1727', 5,000 %, con vencimiento el 01/09/2049	134	0,10
67	Fannie Mae Pool 'FM3215', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2049	60	0,05
45	Fannie Mae Pool 'FM4737', 3,500 %, con vencimiento el 01/09/2050	41	0,03
251	Fannie Mae Pool 'FM7786', 4,000 %, con vencimiento el 01/01/2049	236	0,18
78	Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2051	66	0,05
80	Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2051	67	0,05
79	Fannie Mae Pool 'FM8864', 2,500 %, con vencimiento el 01/10/2051	66	0,05
171	Fannie Mae Pool 'FS0331', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2052	147	0,11
84	Fannie Mae Pool 'FS0424', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2052	70	0,06
87	Fannie Mae Pool 'FS0520', 3,000 %, con vencimiento el 01/02/2052	75	0,06
88	Fannie Mae Pool 'FS0523', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2052	73	0,06
86	Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2049	78	0,06
93	Fannie Mae Pool 'FS3836', 4,500 %, con vencimiento el 01/01/2053	88	0,07
93	Fannie Mae Pool 'FS4454', 6,000 %, con vencimiento el 01/04/2053	93	0,07
281	Fannie Mae Pool 'FS5059', 3,500 %, con vencimiento el 01/11/2048	255	0,20
70	Fannie Mae Pool 'MA4158', 2,000 %, con vencimiento el 01/10/2050	56	0,04
162	Fannie Mae Pool 'MA4236', 1,500 %, con vencimiento el 01/01/2051	122	0,09
56	Freddie Mac Gold Pool 'C91987', 3,000 %, con vencimiento el 01/04/2038	51	0,04
20	Freddie Mac Gold Pool 'G67721', 4,500 %, con vencimiento el 01/04/2049	19	0,02
17	Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 2,107 %, con vencimiento el 01/03/2047 *	16	0,01
37	Freddie Mac Pool 'QA7238', 3,500 %, con vencimiento el 01/02/2050	33	0,03
67	Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	54	0,04
166	Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	139	0,11
77	Freddie Mac Pool 'QC6768', 3,000 %, con vencimiento el 01/09/2051	67	0,05
86	Freddie Mac Pool 'QD6079', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2052	72	0,06
190	Freddie Mac Pool 'RA8694', 5,000 %, con vencimiento el 01/04/2053	186	0,14
34	Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, con vencimiento el 01/10/2041	27	0,02
67	Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2051	55	0,04
83	Freddie Mac Pool 'SD0615', 4,500 %, con vencimiento el 01/01/2051	80	0,06
80	Freddie Mac Pool 'SD0653', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2051	66	0,05
168	Freddie Mac Pool 'SD0809', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2052	144	0,11
329	Freddie Mac Pool 'SD1218', 4,000 %, con vencimiento el 01/07/2049	309	0,24
170	Freddie Mac Pool 'SD2384', 6,500 %, con vencimiento el 01/02/2053	174	0,13
92	Freddie Mac Pool 'SD2578', 6,000 %, con vencimiento el 01/03/2053	93	0,07
167	Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2051	140	0,11
59	Freddie Mac Pool 'ZA6680', 4,000 %, con vencimiento el 01/04/2049	55	0,04
54	Freddie Mac Pool 'ZS3204', 5,000 %, con vencimiento el 01/06/2041	53	0,04
109	Freddie Mac Pool 'ZS3940', 4,500 %, con vencimiento el 01/06/2038	106	0,08
32	Freddie Mac Pool 'ZS4720', 4,500 %, con vencimiento el 01/05/2047	31	0,02
47	Ginnie Mae I Pool '783669', 3,000 %, con vencimiento el 15/09/2042	42	0,03
326	Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, con vencimiento el 15/06/2048	303	0,24
16	Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, con vencimiento el 15/09/2042	15	0,01
10	Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, con vencimiento el 15/09/2042	9	0,01
42	Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, con vencimiento el 15/10/2042	37	0,03
28	Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000 %, con vencimiento el 15/10/2042	25	0,02
24	Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000 %, con vencimiento el 15/11/2042	21	0,02
17	Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500 %, con vencimiento el 20/10/2049	15	0,01
73	Ginnie Mae II Pool '785218', 2,000 %, con vencimiento el 20/12/2050	59	0,05
141	Ginnie Mae II Pool '785219', 2,000 %, con vencimiento el 20/12/2050	113	0,09
75	Ginnie Mae II Pool '785220', 2,000 %, con vencimiento el 20/12/2050	61	0,05
147	Ginnie Mae II Pool '785221', 2,000 %, con vencimiento el 20/12/2050	118	0,09
70	Ginnie Mae II Pool 'BS8546', 2,500 %, con vencimiento el 20/12/2050	58	0,05
77	Ginnie Mae II Pool 'BT1888', 2,500 %, con vencimiento el 20/12/2050	65	0,05
91	Ginnie Mae II Pool 'BZ4350', 2,500 %, con vencimiento el 20/03/2051	76	0,06
71	Ginnie Mae II Pool 'CD8312', 2,500 %, con vencimiento el 20/05/2051	60	0,05
122	Ginnie Mae II Pool 'MA1995', 3,500 %, con vencimiento el 20/06/2044	113	0,09
13	Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500 %, con vencimiento el 20/04/2046	12	0,01
14	Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500 %, con vencimiento el 20/06/2046	13	0,01
17	Ginnie Mae II Pool 'MA4068', 3,000 %, con vencimiento el 20/11/2046	15	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 Global Core Plus Bond Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
12	Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, con vencimiento el 20/06/2047	11	0,01
3	Ginnie Mae II Pool 'MA4836', 3,000 %, con vencimiento el 20/11/2047	3	–
14	Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000 %, con vencimiento el 20/11/2047	13	0,01
47	Ginnie Mae II Pool 'MA5019', 3,500 %, con vencimiento el 20/02/2048	43	0,03
10	Ginnie Mae II Pool 'MA5137', 4,000 %, con vencimiento el 20/04/2048	9	0,01
54	Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500 %, con vencimiento el 20/05/2048	52	0,04
19	Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500 %, con vencimiento el 20/06/2048	18	0,01
26	Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, con vencimiento el 20/07/2048	25	0,02
9	Ginnie Mae II Pool 'MA5467', 4,500 %, con vencimiento el 20/09/2048	9	0,01
37	Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500 %, con vencimiento el 20/10/2048	36	0,03
23	Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500 %, con vencimiento el 20/01/2049	23	0,02
69	Ginnie Mae II Pool 'MA7312', 2,500 %, con vencimiento el 20/04/2051	58	0,05
225	Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, con vencimiento el 20/09/2051	197	0,15
83	Ginnie Mae II Pool 'MA7705', 2,500 %, con vencimiento el 20/11/2051	70	0,05
84	Ginnie Mae II Pool 'MA7828', 3,000 %, con vencimiento el 20/01/2052	74	0,06
87	Ginnie Mae II Pool 'MA8197', 2,500 %, con vencimiento el 20/08/2052	74	0,06
271	Ginnie Mae II Pool 'MA8486', 3,000 %, con vencimiento el 20/12/2052	238	0,18
184	Ginnie Mae II Pool 'MA8642', 2,500 %, con vencimiento el 20/02/2053	156	0,12
800	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,000 % ±	651	0,50
500	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,500 % ±	423	0,33
200	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 3,000 % ±	175	0,14
600	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 4,000 % ±	558	0,43
700	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 4,500 % ±	669	0,52
2.000	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 % ±	1.954	1,51
900	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,500 % ±	894	0,69
300	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 6,000 % ±	301	0,23
100	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 6,500 % ±	101	0,08
96	Government National Mortgage Association, serie 2022 3, clase IO, 0,640 %, con vencimiento el 16/02/2061 *	5	–
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 23.662 $)		22.640	17,49
Bonos y obligaciones corporativos: 24,82 % (28 de febrero de 2023: 28,56 %)			
Bélgica: 0,24 % (28 de febrero de 2023: 0,24 %)			
220	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, con vencimiento el 01/02/2046	203	0,16
110	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, con vencimiento el 01/06/2040	99	0,08
3	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, con vencimiento el 15/04/2048	3	–
		305	0,24
Brasil: 0,77 % (28 de febrero de 2023: 0,66 %)			
230	Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, con vencimiento el 01/02/2029	229	0,18
940	Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125 %, con vencimiento el 15/01/2032	773	0,59
		1.002	0,77
Canadá: 0,69 % (28 de febrero de 2023: 1,09 %)			
EUR 230	Bank of Montreal, 2,750 %, con vencimiento el 15/06/2027	243	0,19
GBP 540	Royal Bank of Canada, 3,625 %, con vencimiento el 14/06/2027	649	0,50
		892	0,69
China: 0,01 % (28 de febrero de 2023: 0,01 %)			
20	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2,700 %, con vencimiento el 01/05/2025	19	0,01
Dinamarca: 0,52 % (28 de febrero de 2023: 0,54 %)			
EUR 600	Danske Bank A/S, 4,750 %, con vencimiento el 21/06/2030 *	672	0,52
Francia: 0,89 % (28 de febrero de 2023: 0,92 %)			
200	BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, con vencimiento el 09/06/2026 *	192	0,15
GBP 300	BNP Paribas SA, 1,875 %, con vencimiento el 14/12/2027	336	0,26
EUR 500	BNP Paribas SA, 0,500 %, con vencimiento el 30/05/2028 *	486	0,37
200	WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 17/09/2044	140	0,11
		1.154	0,89
Alemania: 0,96 % (28 de febrero de 2023: 1,15 %)			
EUR 500	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250 %, con vencimiento el 26/05/2049 *	515	0,40
EUR 900	Vonovia SE, 0,750 %, con vencimiento el 01/09/2032	727	0,56
		1.242	0,96
Israel: 0,53 % (28 de febrero de 2023: 0,58 %)			
720	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, con vencimiento el 09/05/2029	681	0,53
Italia: 0,69 % (28 de febrero de 2023: 0,74 %)			
EUR 850	UniCredit SpA, 1,200 %, con vencimiento el 20/01/2026 *	896	0,69
Luxemburgo: 0,76 % (28 de febrero de 2023: 0,42 %)			
330	Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/08/2029	285	0,22
EUR 620	Logicor Financing Sarl, 1,625 %, con vencimiento el 15/07/2027	609	0,47
EUR 100	Logicor Financing Sarl, 2,000 %, con vencimiento el 17/01/2034	83	0,07
		977	0,76
Países Bajos: 0,19 % (28 de febrero de 2023: 0,97 %)			
80	Shell International Finance BV, 2,750 %, con vencimiento el 06/04/2030	71	0,06
150	Shell International Finance BV, 4,375 %, con vencimiento el 11/05/2045	131	0,10
60	Shell International Finance BV, 3,250 %, con vencimiento el 06/04/2050	43	0,03
		245	0,19
España: 0,70 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
EUR 400	Banco Santander SA, 5,750 %, con vencimiento el 23/08/2033 *	449	0,35
EUR 500	Cellnex Finance Co SA, 2,000 %, con vencimiento el 15/09/2032	462	0,35
		911	0,70
Suiza: 0,50 % (28 de febrero de 2023: 1,41 %)			
EUR 290	UBS Group AG, 3,250 %, con vencimiento el 02/04/2026 *	311	0,24
EUR 100	UBS Group AG, 1,000 %, con vencimiento el 24/06/2027 *	101	0,08
250	UBS Group AG, 144A, 4,194 %, con vencimiento el 01/04/2031 *	230	0,18
		642	0,50
Emiratos Árabes Unidos: 0,59 % (28 de febrero de 2023: 0,50 %)			
530	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd, 2,625 %, con vencimiento el 31/03/2036	431	0,33
EUR 400	MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000 %, con vencimiento el 10/03/2034	335	0,26
		766	0,59
Reino Unido: 2,88 % (28 de febrero de 2023: 2,96 %)			
GBP 670	Aviva Plc, 6,125 %, con vencimiento el 14/11/2036 *	854	0,66
GBP 100	Aviva Plc, 5,125 %, con vencimiento el 04/06/2050 *	119	0,09
365	HSBC Holdings Plc, 4,250 %, con vencimiento el 18/08/2025	357	0,28
EUR 550	HSBC Holdings Plc, 3,019 %, con vencimiento el 15/06/2027 *	583	0,45
GBP 1.000	Lloyds Bank Plc, 7,625 %, con vencimiento el 22/04/2025	1.285	0,99
EUR 140	Segro Capital Sarl, 1,875 %, con vencimiento el 23/03/2030	135	0,10
460	Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/07/2031	398	0,31
		3.731	2,88
Estados Unidos: 13,90 % (28 de febrero de 2023: 15,12 %)			
100	AbbVie Inc, 3,800 %, con vencimiento el 15/03/2025	98	0,08
120	AbbVie Inc, 4,875 %, con vencimiento el 14/11/2048	114	0,09
320	AbbVie Inc, 4,250 %, con vencimiento el 21/11/2049	275	0,21
80	Alphabet Inc, 4,250 %, con vencimiento el 22/08/2057	69	0,05
40	American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, con vencimiento el 15/01/2032	33	0,03
90	AT&T Inc, 2,250 %, con vencimiento el 01/02/2032	72	0,06
184	AT&T Inc, 4,500 %, con vencimiento el 09/03/2048	154	0,12
34	AT&T Inc, 3,650 %, con vencimiento el 15/09/2059	23	0,02
330	Ball Corp, 3,125 %, con vencimiento el 15/09/2031	278	0,21
160	Bank of America Corp, 4,250 %, con vencimiento el 22/10/2026	157	0,12
945	Bank of America Corp, 2,592 %, con vencimiento el 29/04/2031 *	808	0,62
400	Bank of America Corp, 5,015 %, con vencimiento el 22/07/2033 *	390	0,30
27	Becton Dickinson & Co, 3,734 %, con vencimiento el 15/12/2024	27	0,02
190	BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, con vencimiento el 06/04/2030	177	0,14
130	Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, con vencimiento el 15/11/2035	103	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 Global Core Plus Bond Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
130	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, con vencimiento el 23/07/2025	128	0,10
60	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, con vencimiento el 15/03/2028	56	0,04
180	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, con vencimiento el 30/03/2029	172	0,13
140	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, con vencimiento el 01/04/2048	117	0,09
110	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,250 %, con vencimiento el 01/04/2053	85	0,07
110	Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, con vencimiento el 31/01/2032	92	0,07
320	Cigna Group/The, 4,375 %, con vencimiento el 15/10/2028	311	0,24
230	Cigna Group/The, 3,200 %, con vencimiento el 15/03/2040	172	0,13
130	Cigna Group/The, 4,900 %, con vencimiento el 15/12/2048	117	0,09
EUR 290	Citigroup Inc, 1,750 %, con vencimiento el 28/01/2025	308	0,24
130	Citigroup Inc, 5,500 %, con vencimiento el 13/09/2025	130	0,10
120	Citigroup Inc, 4,600 %, con vencimiento el 09/03/2026	118	0,09
350	Citigroup Inc, 4,300 %, con vencimiento el 20/11/2026	341	0,26
260	Citigroup Inc, 4,450 %, con vencimiento el 29/09/2027	252	0,19
80	Citigroup Inc, 3,785 %, con vencimiento el 17/03/2033 *	71	0,05
93	Citigroup Inc, 5,300 %, con vencimiento el 06/05/2044	89	0,07
85	Citigroup Inc, 4,650 %, con vencimiento el 30/07/2045	76	0,06
66	Comcast Corp, 3,999 %, con vencimiento el 01/11/2049	52	0,04
300	Comcast Corp, 2,887 %, con vencimiento el 01/11/2051	190	0,15
51	Comcast Corp, 4,049 %, con vencimiento el 01/11/2052	40	0,03
57	Comcast Corp, 2,987 %, con vencimiento el 01/11/2063	34	0,03
200	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 01/02/2029	175	0,13
360	CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 15/11/2031	268	0,21
180	CVS Health Corp, 3,750 %, con vencimiento el 01/04/2030	166	0,13
200	CVS Health Corp, 2,700 %, con vencimiento el 21/08/2040	137	0,11
310	CVS Health Corp, 5,050 %, con vencimiento el 25/03/2048	277	0,21
40	Diamondback Energy Inc, 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2029	37	0,03
120	DISH DBS Corp, 5,875 %, con vencimiento el 15/11/2024	113	0,09
60	DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 01/12/2028	42	0,03
70	DISH DBS Corp, 5,125 %, con vencimiento el 01/06/2029	30	0,02
110	Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, con vencimiento el 31/01/2030	98	0,08
330	Enterprise Products Operating LLC, 5,100 %, con vencimiento el 15/02/2045	310	0,24
6	EQT Corp, 6,125 %, con vencimiento el 01/02/2025	6	–
10	Exelon Corp, 5,625 %, con vencimiento el 15/06/2035	10	0,01
310	Ford Motor Co, 3,250 %, con vencimiento el 12/02/2032	254	0,20
520	Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, con vencimiento el 13/11/2030	460	0,36
20	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, con vencimiento el 15/03/2043	19	0,01
30	General Motors Co, 6,600 %, con vencimiento el 01/04/2036	32	0,02
10	General Motors Co, 5,200 %, con vencimiento el 01/04/2045	9	0,01
70	General Motors Co, 6,750 %, con vencimiento el 01/04/2046	74	0,06
110	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, con vencimiento el 01/04/2025	108	0,08
620	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,750 %, con vencimiento el 01/10/2037	674	0,52
130	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, con vencimiento el 22/05/2045	124	0,10
EUR 140	Haleon Netherlands Capital BV, 1,750 %, con vencimiento el 29/03/2030	136	0,10
260	Haleon US Capital LLC, 3,625 %, con vencimiento el 24/03/2032	233	0,18
340	HCA Inc, 5,000 %, con vencimiento el 15/03/2024	340	0,26
380	HCA Inc, 5,250 %, con vencimiento el 15/06/2026	378	0,29
120	HCA Inc, 4,500 %, con vencimiento el 15/02/2027	117	0,09
130	Home Depot Inc/The, 3,300 %, con vencimiento el 15/04/2040	102	0,08
70	Home Depot Inc/The, 3,350 %, con vencimiento el 15/04/2050	51	0,04
190	Home Depot Inc/The, 4,950 %, con vencimiento el 15/09/2052	181	0,14
70	JPMorgan Chase & Co, 4,125 %, con vencimiento el 15/12/2026	68	0,05
1.080	JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, con vencimiento el 22/04/2031 *	924	0,71
440	JPMorgan Chase & Co, 2,956 %, con vencimiento el 13/05/2031 *	382	0,29
80	JPMorgan Chase & Co, 5,717 %, con vencimiento el 14/09/2033 *	81	0,06
30	McDonald's Corp, 3,625 %, con vencimiento el 01/09/2049	22	0,02
110	McDonald's Corp, 4,200 %, con vencimiento el 01/04/2050	91	0,07
40	MetLife Inc, 6,400 %, con vencimiento el 15/12/2036	41	0,03
10	Morgan Stanley, 4,431 %, con vencimiento el 23/01/2030 *	10	0,01
760	Morgan Stanley, 3,622 %, con vencimiento el 01/04/2031 *	691	0,53
470	Morgan Stanley, 2,511 %, con vencimiento el 20/10/2032 *	385	0,30
160	Morgan Stanley, 6,342 %, con vencimiento el 18/10/2033 *	170	0,13
EUR 500	Netflix Inc, 3,625 %, con vencimiento el 15/06/2030	540	0,42
EUR 380	Prologis Euro Finance LLC, 0,500 %, con vencimiento el 16/02/2032	318	0,25
EUR 271	Prologis Euro Finance LLC, 1,500 %, con vencimiento el 08/02/2034	235	0,18
180	Southwestern Energy Co, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2032	164	0,13
10	Sprint Capital Corp, 8,750 %, con vencimiento el 15/03/2032	12	0,01
4	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, con vencimiento el 16/12/2039	4	–
60	Texas Instruments Inc, 1,750 %, con vencimiento el 04/05/2030	50	0,04
100	Time Warner Cable LLC, 7,300 %, con vencimiento el 01/07/2038	100	0,08
40	Time Warner Cable LLC, 6,750 %, con vencimiento el 15/06/2039	38	0,03
30	T-Mobile USA Inc, 2,250 %, con vencimiento el 15/02/2026	28	0,02
90	T-Mobile USA Inc, 2,625 %, con vencimiento el 15/02/2029	80	0,06
160	T-Mobile USA Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/04/2030	149	0,11
60	T-Mobile USA Inc, 2,875 %, con vencimiento el 15/02/2031	52	0,04
100	T-Mobile USA Inc, 3,500 %, con vencimiento el 15/04/2031	89	0,07
150	T-Mobile USA Inc, 2,700 %, con vencimiento el 15/03/2032	125	0,10
140	T-Mobile USA Inc, 3,000 %, con vencimiento el 15/02/2041	101	0,08
50	United Rentals North America Inc, 5,250 %, con vencimiento el 15/01/2030	48	0,04
320	United Rentals North America Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/02/2031	283	0,22
90	Verizon Communications Inc, 2,355 %, con vencimiento el 15/03/2032	73	0,06
190	Verizon Communications Inc, 4,500 %, con vencimiento el 10/08/2033	179	0,14
50	Verizon Communications Inc, 5,250 %, con vencimiento el 16/03/2037	50	0,04
10	Verizon Communications Inc, 4,862 %, con vencimiento el 21/08/2046	9	0,01
10	Verizon Communications Inc, 5,500 %, con vencimiento el 16/03/2047	10	0,01
340	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 15/02/2028	327	0,25
650	Wells Fargo & Co, 4,897 %, con vencimiento el 25/07/2033 *	622	0,48
810	Wells Fargo & Co, 5,013 %, con vencimiento el 04/04/2051 *	750	0,58
		17.991	13,90
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 35.453 $)		32.126	24,82
Bonos y obligaciones del Estado: 55,88 % (28 de febrero de 2023: 53,61 %)			
Bélgica: 0,57 % (28 de febrero de 2023: 0,56 %)			
EUR 640	Bono del Estado del Reino de Bélgica, Serie 71, 3,750 %, con vencimiento el 22/06/2045	736	0,57
Brasil: 1,73 % (28 de febrero de 2023: 1,50 %)			
BRL 1.000	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNB, 6,000 %, con vencimiento el 15/05/2035 β	876	0,68
BRL 7.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2031	1.365	1,05
		2.241	1,73
Canadá: 1,59 % (28 de febrero de 2023: 1,63 %)			
CAD 1.190	Bono del Estado de Canadá, 2,750 %, con vencimiento el 01/06/2033	826	0,64
CAD 900	Province of Ontario Canada, 3,450 %, con vencimiento el 02/06/2045	580	0,45

^ 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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones del Estado (continuación)			
Canadá (continuación)			
CAD 1.000	Province of Quebec Canada, 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2045	647	0,50
		2.053	1,59
Francia: 1,65 % (28 de febrero de 2023: 2,99 %)			
EUR 1.670	Bono del Estado de la República Francesa OAT, 0,000 %, con vencimiento el 25/05/2032	1.440	1,11
EUR 670	Bono del Estado de la República Francesa OAT, 144A, 1,500 %, con vencimiento el 25/05/2050	500	0,39
EUR 160	Bono del Estado de la República Francesa OAT, 4,000 %, con vencimiento el 25/04/2060	198	0,15
		2.138	1,65
Alemania: 11,08 % (28 de febrero de 2023: 2,84 %)			
EUR 7.020	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, con vencimiento el 15/08/2028	6.899	5,33
EUR 670	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, con vencimiento el 15/02/2031	617	0,48
EUR 1.070	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, con vencimiento el 15/08/2032	1.099	0,85
EUR 1.670	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,600 %, con vencimiento el 15/08/2033	1.836	1,42
EUR 1.990	Bono ligado a la inflación Deutsche Bundesrepublik, Serie I/L, 0,500 %, con vencimiento el 15/04/2030 β	2.698	2,08
EUR 1.110	Bono del Tesoro alemán, zero coupon, con vencimiento el 19/06/2024	1.187	0,92
		14.336	11,08
Indonesia: 1,22 % (28 de febrero de 2023: 1,19 %)			
IDR 21.645.000	Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR79, 8,375 %, con vencimiento el 15/04/2039	1.578	1,22
Italia: 1,13 % (28 de febrero de 2023: 0,99 %)			
EUR 1.570	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie 31Y, 144A, 3,250 %, con vencimiento el 01/09/2046	1.461	1,13
Japón: 1,76 % (28 de febrero de 2023: 5,86 %)			
JPY 14.850	Bono del Estado de Japón a 30 años, Serie 59, 0,700 %, con vencimiento el 20/06/2048	82	0,06
JPY 444.950	Bono del Estado de Japón a 30 años, Serie 66, 0,400 %, con vencimiento el 20/03/2050	2.191	1,70
		2.273	1,76
México: 3,98 % (28 de febrero de 2023: 4,03 %)			
MXN 76.620	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, con vencimiento el 13/11/2042	3.888	3,00
EUR 590	Bono Internacional del Estado de México, 2,875 %, con vencimiento el 08/04/2039	503	0,39
830	Bono Internacional del Estado de México, 5,550 %, con vencimiento el 21/01/2045	766	0,59
		5.157	3,98
Países Bajos: 0,63 % (28 de febrero de 2023: 0,51 %)			
EUR 970	BNG Bank NV, 0,010 %, con vencimiento el 05/10/2032	817	0,63
Noruega: 1,02 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
NOK 2.420	Bono del Estado de Noruega, Serie 484, 144A, 2,125 %, con vencimiento el 18/05/2032	201	0,16
NOK 12.680	Bono del Estado de Noruega, Serie 486, 144A, 3,000 %, con vencimiento el 15/08/2033	1.118	0,86
		1.319	1,02
Polonia: 1,44 % (28 de febrero de 2023: 1,32 %)			
PLN 9.630	Bono del Estado de la República de Polonia, Serie 0432, 1,750 %, con vencimiento el 25/04/2032	1.864	1,44
Sudáfrica: 1,36 % (28 de febrero de 2023: 1,55 %)			
ZAR 56.582	Bono del Estado de la República de Sudáfrica, Serie R214, 6,500 %, con vencimiento el 28/02/2041	1.754	1,36
Corea del Sur: 1,42 % (28 de febrero de 2023: 1,23 %)			
KRW 2.533.840	Bono del Tesoro de Corea, Serie 2606, 1,875 %, con vencimiento el 10/06/2026	1.842	1,42
España: 0,55 % (28 de febrero de 2023: 1,44 %)			
EUR 190	Bono del Estado de España, 144A, 5,150 %, con vencimiento el 31/10/2044	247	0,19
EUR 520	Bono del Estado de España, Serie 30Y, 144A, 2,700 %, con vencimiento el 31/10/2048	467	0,36
		714	0,55
Reino Unido: 5,04 % (28 de febrero de 2023: 5,56 %)			
GBP 2.660	United Kingdom Gilt, 4,250 %, con vencimiento el 07/06/2032	3.420	2,64
GBP 1.610	United Kingdom Gilt, 4,250 %, con vencimiento el 07/12/2040	1.988	1,54
GBP 550	United Kingdom Gilt, 2,500 %, con vencimiento el 22/07/2065	444	0,34
GBP 530	United Kingdom Inflation-Linked Gilt, Serie 3MO, 0,125 %, con vencimiento el 22/03/2068 β	674	0,52
		6.526	5,04
Estados Unidos: 19,71 % (28 de febrero de 2023: 19,91 %)			
3.120	Bonos indexados a la inflación del Tesoro de los Estados Unidos, 1,375 %, con vencimiento el 15/07/2033 β	3.019	2,33
11.550	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 0,375 %, con vencimiento el 15/04/2024	11.479	8,87
5.540	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 0,250 %, con vencimiento el 31/08/2025	5.179	4,00
1.980	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 1,375 %, con vencimiento el 31/10/2028	1.739	1,34
130	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, con vencimiento el 15/05/2043	119	0,09
20	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 2,750 %, con vencimiento el 15/11/2047	15	0,01
1.990	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, con vencimiento el 15/05/2049	1.505	1,16
2.020	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, con vencimiento el 15/05/2052	1.522	1,18
20	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, con vencimiento el 15/08/2052	16	0,01
80	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,625 %, con vencimiento el 15/02/2053	70	0,06
970	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 15/05/2053	849	0,66
		25.512	19,71
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 79.108 $)		72.321	55,88
Organismos de inversión colectiva: 9,19 % (28 de febrero de 2023: 7,65 %)			
724	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Clase LM	10.594	8,19
9	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – LM Class US$ Accumulating	1.292	1,00
Total de organismos de inversión colectiva (coste 11.528 $)		11.886	9,19
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 149.751 $)		138.973	107,38

Contratos (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Opciones compradas: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,01 %)			
1.790	USD Call/MXN Put 17,60, con vencimiento el 13/03/2024 – JP Morgan	1	–
Total de opciones compradas (coste 24 $)		1	–
Contratos de divisas a plazo: 0,42 % (28 de febrero de 2023: 0,69 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		542	0,42
Futuros: 0,04 % (28 de febrero de 2023: 0,23 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		52	0,04
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		139.568	107,84

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas: (0,32 %) (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
(500)	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 % ±	(412)	(0,32)
Total de valores garantizados por hipotecas (coste (411) $)		(412)	(0,32)
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste (411) $)		(412)	(0,32)

Contratos (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Opciones suscritas: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
(1.820)	USD Put/MXN Call 16,50, con vencimiento el 13/03/2024 – JP Morgan	–	–
Total de opciones suscritas (coste (6) $)		–	–
Contratos de divisas a plazo: (0,29 %) (28 de febrero de 2023: (1,43 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(371)	(0,29)
Futuros: (0,18 %) (28 de febrero de 2023: (0,71 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(230)	(0,18)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(1.013)	(0,79)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		138.555	107,05
Excedente de pasivos respecto a otros activos		(9.135)	(7,05)
Patrimonio		129.420 $	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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

– Los importes designados como "–" son 0 EUR, 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 6.187.000 USD o el 4,79 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

± 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 29 de febrero de 2024.

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	87,23
Organismos de inversión colectiva	8,16
Instrumentos financieros derivados	0,41
Otros activos	4,20
Total de activos	100,00

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
NOK – Corona noruega
PLN – Esloti polaco
ZAR – Rand sudafricano

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 de marzo de 2024	Citi	Compra	USD	8.303	Venta	CNH	59.070	$	99
13 de marzo de 2024	Citi	Compra	USD	296	Venta	INR	24.760		(2)
13 de marzo de 2024	Citi	Compra	CNH	11.610	Venta	USD	1.629		(17)
13 de marzo de 2024	Citi	Compra	INR	24.760	Venta	USD	299		–
13 de marzo de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	1.874	Venta	CNH	13.250		33
13 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	1.571	Venta	CNH	11.110		28
13 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	1.954	Venta	KRW	2.554.455		36
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	156	Venta	EUR	145		(1)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	34	Venta	EUR	32		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	2.959	Venta	NZD	4.844		10
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	4.873	Venta	USD	2.956		11
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	2	Venta	USD	2		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	3.992	Venta	USD	2.455		(25)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CAD	99.712	Venta	USD	73.765		(276)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	20.973	Venta	USD	22.568		114
13 de mayo de 2024	BNP Paribas	Compra	USD	8.668	Venta	EUR	7.996		(2)
13 de mayo de 2024	BNP Paribas	Compra	PLN	761	Venta	USD	190		–
13 de mayo de 2024	Citi	Compra	USD	5.129	Venta	EUR	4.729		2
13 de mayo de 2024	Citi	Compra	USD	4.311	Venta	GBP	3.378		46
13 de mayo de 2024	Citi	Compra	USD	70	Venta	MXN	1.233		(1)
13 de mayo de 2024	Citi	Compra	SEK	14.650	Venta	USD	1.414		4
13 de mayo de 2024	Citi	Compra	ZAR	3.520	Venta	USD	183		(1)
13 de mayo de 2024	Citi	Compra	USD	191	Venta	ZAR	3.599		5
13 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	130	Venta	EUR	120		–
13 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	307	Venta	MXN	5.374		(4)
13 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	JPY	140.969	Venta	USD	976		(25)
13 de mayo de 2024	HSBC	Compra	USD	8.323	Venta	EUR	7.668		9
13 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	852	Venta	CAD	1.143		9
13 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	2.989	Venta	CNH	21.360		11
13 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	7.139	Venta	EUR	6.575		10
13 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	6.037	Venta	GBP	4.730		64
13 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	EUR	872	Venta	USD	942		3
13 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	GBP	98	Venta	USD	124		–
13 de mayo de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	1.991	Venta	EUR	1.834		3
13 de mayo de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	2.215	Venta	GBP	1.735		24
13 de mayo de 2024	Morgan Stanley	Compra	JPY	10.958	Venta	USD	76		(2)
13 de mayo de 2024	Morgan Stanley	Compra	AUD	1.657	Venta	USD	1.095		(15)
13 de mayo de 2024	UBS	Compra	USD	9.093	Venta	EUR	8.374		14
13 de mayo de 2024	UBS	Compra	EUR	2.573	Venta	USD	2.782		7
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 1.011 $)								$	542
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (2.097) $)									(371)
Apreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (1.086) $)								$	171

^ *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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

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 2024	Bank of America Merrill Lynch	92	$ 21.965	$ 13
Bono a 10 años de Australia marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	16	1.196	14
Euro-Bobl marzo de 2024	Bank of America Merrill Lynch	11	1.382	(7)
Euro-BTP marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	(18)	(2.292)	(6)
Euro-Bund marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	56	8.029	(57)
Euro-Schatz March 2024	Bank of America Merrill Lynch	52	5.909	(51)
Bono a 10 años de Japón (OSE) marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	(9)	(8.780)	(58)
Long Gilt junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	11	1.362	9
U.S. 10 Year Note (CBT) junio de 2024	Bank of America Merrill Lynch	18	1.988	5
U.S. 10 Year Ultra Note junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	(87)	(9.933)	(40)
U.S. 2 Year Note (CBT) junio de 2024	Bank of America Merrill Lynch	104	21.294	(11)
U.S. 5 Year Note (CBT) junio de 2024	Bank of America Merrill Lynch	32	3.421	4
U.S. Long Bond (CBT) junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	5	596	3
U.S. Ultra Bond (CBT) junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	3	384	4
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 338 $)				$ 52
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (1.043) $)				(230)
Depreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (705) $)				$ (178)

^ 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^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos: 91,86 % (28 de febrero de 2023: 80,76 %)			
Australia: 0,51 % (28 de febrero de 2023: 1,56 %)			
160	Glencore Finance Canada Ltd, 6,000 %, con vencimiento el 15/11/2041	159	0,51
Bélgica: 0,35 % (28 de febrero de 2023: 0,39 %)			
2	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, con vencimiento el 15/04/2048	2	–
EUR 100	Elia Transmission Belgium SA, 3,750 %, con vencimiento el 16/01/2036	108	0,35
		110	0,35
Brasil: 0,21 % (28 de febrero de 2023: 1,03 %)			
60	Vale Canada Ltd, 7,200 %, con vencimiento el 15/09/2032	65	0,21
Colombia: 0,41 % (28 de febrero de 2023: 0,25 %)			
170	Ecopetrol SA, 5,875 %, con vencimiento el 28/05/2045	126	0,41
Dinamarca: 1,57 % (28 de febrero de 2023: 2,07 %)			
EUR 140	Coloplast Finance BV, 2,250 %, con vencimiento el 19/05/2027	145	0,47
EUR 190	Danske Bank A/S, 4,750 %, con vencimiento el 21/06/2030 *	213	0,69
EUR 120	Danske Bank A/S, 4,625 %, con vencimiento el 14/05/2034 *	129	0,41
		487	1,57
Finlandia: 1,45 % (28 de febrero de 2023: 0,67 %)			
EUR 130	Fortum Oyj, 1,625 %, con vencimiento el 27/02/2026	135	0,43
EUR 200	Neste Oyj, 0,750 %, con vencimiento el 25/03/2028	193	0,63
EUR 110	Nordea Bank Abp, 4,875 %, con vencimiento el 23/02/2034 *	121	0,39
		449	1,45
Francia: 9,44 % (28 de febrero de 2023: 7,01 %)			
240	BNP Paribas SA, 144A, 5,176 %, con vencimiento el 09/01/2030 *	238	0,77
GBP 100	BNP Paribas SA, 2,000 %, con vencimiento el 24/05/2031 *	115	0,37
200	BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, Perpetuo *	202	0,65
EUR 200	Bouygues SA, 3,875 %, con vencimiento el 17/07/2031	222	0,72
EUR 100	Coentreprise de Transport d'Electricite SA, 3,750 %, con vencimiento el 17/01/2036	107	0,35
EUR 200	Credit Agricole SA, 4,125 %, con vencimiento el 26/02/2036	218	0,70
EUR 200	Eiffage SA, 1,625 %, con vencimiento el 14/01/2027	203	0,66
EUR 200	Electricite de France SA, 1,000 %, con vencimiento el 29/11/2033	167	0,54
EUR 100	Engie SA, 0,500 %, con vencimiento el 24/10/2030	88	0,28
EUR 100	Engie SA, 4,250 %, con vencimiento el 11/01/2043	109	0,35
EUR 310	GELF Bond Issuer I SA, 1,125 %, con vencimiento el 18/07/2029	283	0,91
EUR 190	Orange SA, 5,000 %, Perpetuo *	209	0,67
EUR 200	Suez SACA, 1,875 %, con vencimiento el 24/05/2027	205	0,66
EUR 100	Terega SA, 0,875 %, con vencimiento el 17/09/2030	90	0,29
EUR 200	Thales SA, 4,125 %, con vencimiento el 18/10/2028	222	0,72
EUR 100	Unibail-Rodamco-Westfield SE, 4,125 %, con vencimiento el 11/12/2030	109	0,35
200	WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 4,750 %, con vencimiento el 17/09/2044	140	0,45
		2.927	9,44
Alemania: 8,31 % (28 de febrero de 2023: 7,27 %)			
400	Allianz SE, 3,200 %, Perpetuo *	318	1,03
EUR 200	alstria office REIT-AG, 1,500 %, con vencimiento el 23/06/2026	186	0,60
EUR 100	Amprion GmbH, 3,971 %, con vencimiento el 22/09/2032	110	0,35
EUR 100	Deutsche Bahn Finance GMBH, 4,000 %, con vencimiento el 23/11/2043	114	0,37
140	Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750 %, con vencimiento el 15/06/2030	165	0,53
EUR 200	EnBW International Finance BV, 4,300 %, con vencimiento el 23/05/2034	223	0,72
EUR 200	Hannover Rueck SE, 1,125 %, con vencimiento el 09/10/2039 *	182	0,59
EUR 100	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen, 3,250 %, con vencimiento el 26/05/2049 *	103	0,33
EUR 100	Robert Bosch GmbH, 4,000 %, con vencimiento el 02/06/2035	111	0,36
EUR 100	Sirius Real Estate Ltd, 1,125 %, con vencimiento el 22/06/2026	100	0,32
EUR 100	Sirius Real Estate Ltd, 1,750 %, con vencimiento el 24/11/2028	92	0,30
EUR 200	Vier Gas Transport GmbH, 4,625 %, con vencimiento el 26/09/2032	230	0,74
GBP 100	Volkswagen Financial Services NV, 4,250 %, con vencimiento el 09/10/2025	124	0,40
EUR 200	Vonovia SE, 0,375 %, con vencimiento el 16/06/2027	193	0,62
GBP 100	Vonovia SE, 5,500 %, con vencimiento el 18/01/2036	123	0,40
EUR 200	ZF Finance GmbH, 2,000 %, con vencimiento el 06/05/2027	200	0,65
		2.574	8,31
Irlanda: 0,60 % (28 de febrero de 2023: 0,64 %)			
240	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,850 %, con vencimiento el 29/10/2041	187	0,60
Israel: 0,50 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
EUR 130	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 7,375 %, con vencimiento el 15/09/2029	154	0,50
Italia: 4,06 % (28 de febrero de 2023: 3,22 %)			
EUR 180	CA Auto Bank SPA/Ireland, 0,500 %, con vencimiento el 13/09/2024	191	0,61
200	Enel Finance International NV, 144A, 7,750 %, con vencimiento el 14/10/2052	240	0,77
200	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, con vencimiento el 01/06/2032 *	164	0,53
EUR 190	Snam SpA, 3,875 %, con vencimiento el 19/02/2034	204	0,66
EUR 100	Terna: Rete Elettrica Nazionale, 2,375 %, Perpetuo *	99	0,32
EUR 340	UniCredit SpA, 2,000 %, con vencimiento el 23/09/2029 *	362	1,17
		1.260	4,06
Luxemburgo: 3,80 % (28 de febrero de 2023: 2,48 %)			
110	ArcelorMittal SA, 6,550 %, con vencimiento el 29/11/2027	115	0,37
10	ArcelorMittal SA, 6,750 %, con vencimiento el 01/03/2041	10	0,03
GBP 100	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 2,625 %, con vencimiento el 20/10/2028	108	0,35
EUR 170	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,625 %, con vencimiento el 20/04/2030	152	0,49
EUR 150	Logicor Financing Sarl, 3,250 %, con vencimiento el 13/11/2028	154	0,50
EUR 190	P3 Group Sarl, 4,625 %, con vencimiento el 13/02/2030	204	0,66
EUR 125	Prologis International Funding II SA, 1,750 %, con vencimiento el 15/03/2028	126	0,40
EUR 140	SELP Finance Sarl, 1,500 %, con vencimiento el 20/11/2025	145	0,47
EUR 160	SELP Finance Sarl, 1,500 %, con vencimiento el 20/12/2026	163	0,53
		1.177	3,80
Países Bajos: 3,01 % (28 de febrero de 2023: 2,39 %)			
EUR 200	ABN AMRO Bank NV, 3,875 %, con vencimiento el 15/01/2032	215	0,69
EUR 100	Cooperatieve Rabobank UA, 3,822 %, con vencimiento el 26/07/2034	108	0,35
EUR 200	CTP NV, Serie emTN, 4,750 %, con vencimiento el 05/02/2030	218	0,70
EUR 130	Enexis Holding NV, 3,625 %, con vencimiento el 12/06/2034	144	0,47
EUR 140	Euronext NV, 1,000 %, con vencimiento el 18/04/2025	146	0,47
EUR 100	Koninklijke Ahold Delhaize NV, 1,750 %, con vencimiento el 02/04/2027	103	0,33
		934	3,01
Portugal: 1,01 % (28 de febrero de 2023: 0,40 %)			
EUR 200	EDP – Energias de Portugal SA, 1,875 %, con vencimiento el 02/08/2081 *	202	0,65
EUR 100	Floene Energias SA, 4,875 %, con vencimiento el 03/07/2028	112	0,36
		314	1,01
Singapur: 0,67 % (28 de febrero de 2023: 0,40 %)			
EUR 200	Cromwell Ereit Lux Finco Sarl, 2,125 %, con vencimiento el 19/11/2025	206	0,67
España: 2,73 % (28 de febrero de 2023: 3,53 %)			
EUR 100	Aena SME SA, 4,250 %, con vencimiento el 13/10/2030	113	0,36
200	Banco Santander SA, 5,294 %, con vencimiento el 18/08/2027	199	0,64
EUR 100	Banco Santander SA, 4,875 %, con vencimiento el 18/10/2031	113	0,37
EUR 100	Banco Santander SA, 5,750 %, con vencimiento el 23/08/2033 *	112	0,36
GBP 100	CaixaBank SA, 6,875 %, con vencimiento el 25/10/2033 *	127	0,41
EUR 200	Cellnex Finance Co SA, 2,000 %, con vencimiento el 15/02/2033	183	0,59
		847	2,73
Suecia: 2,44 % (28 de febrero de 2023: 1,88 %)			
EUR 140	H&M Finance BV, 0,250 %, con vencimiento el 25/08/2029	125	0,40
EUR 100	Heimstaden AB, 4,250 %, con vencimiento el 09/03/2026	61	0,20
EUR 130	Heimstaden Bostad AB, 3,625 %, Perpetuo *	85	0,28
EUR 160	Svenska Handelsbanken AB, 5,000 %, con vencimiento el 16/08/2034 *	177	0,57
200	Swedbank AB, 7,750 %, Perpetuo *	196	0,63

^ *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^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Suecia (continuación)			
EUR 100	Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 5,375 %, con vencimiento el 29/05/2028	112	0,36
		756	2,44
Suiza: 1,43 % (28 de febrero de 2023: 2,96 %)			
GBP 200	UBS Group AG, 2,250 %, con vencimiento el 09/06/2028 *	228	0,74
EUR 200	UBS Group AG, 4,125 %, con vencimiento el 09/06/2033 *	216	0,69
		444	1,43
Reino Unido: 14,54 % (28 de febrero de 2023: 13,41 %)			
GBP 130	Anglian Water Osprey Financing Plc, 2,000 %, con vencimiento el 31/07/2028	133	0,43
GBP 210	Barclays Plc, 6,375 %, Perpetuo *	255	0,82
EUR 170	Cadent Finance Plc, 0,750 %, con vencimiento el 11/03/2032	145	0,47
GBP 120	CPUK Finance Ltd, 3,588 %, con vencimiento el 28/08/2025	147	0,47
GBP 160	Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, con vencimiento el 07/04/2026	195	0,63
GBP 100	Gatwick Funding Ltd, 2,500 %, con vencimiento el 15/04/2030	109	0,35
GBP 180	Grainger Plc, 3,000 %, con vencimiento el 03/07/2030	191	0,62
200	HSBC Holdings Plc, 2,357 %, con vencimiento el 18/08/2031 *	165	0,53
GBP 160	Legal & General Group Plc, 4,500 %, con vencimiento el 01/11/2050 *	183	0,59
GBP 180	Lloyds Banking Group Plc, 1,985 %, con vencimiento el 15/12/2031 *	203	0,66
GBP 200	Lloyds Banking Group Plc, 5,125 %, Perpetuo *	246	0,79
GBP 200	Marston's Issuer Plc, Serie B1, 7,890 %, con vencimiento el 16/07/2035 *	191	0,62
GBP 290	NatWest Group plc, 4,500 %, Perpetuo *	307	0,99
EUR 100	RELX Finance BV, 3,750 %, con vencimiento el 12/06/2031	110	0,35
EUR 100	Rentokil Initial Finance BV, 3,875 %, con vencimiento el 27/06/2027	109	0,35
EUR 140	Smith & Nephew Plc, 4,565 %, con vencimiento el 11/10/2029	158	0,51
EUR 170	SSE Plc, 4,000 %, Perpetuo *	178	0,58
EUR 270	Standard Chartered Plc, 2,500 %, con vencimiento el 09/09/2030 *	283	0,91
EUR 150	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 0,375 %, con vencimiento el 27/07/2029	137	0,44
GBP 100	Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,750 %, con vencimiento el 27/04/2030	110	0,36
EUR 130	Tritax EuroBox Plc, 0,950 %, con vencimiento el 02/06/2026	128	0,41
GBP 190	UNITE Group Plc/The, 3,500 %, con vencimiento el 15/10/2028	223	0,72
GBP 200	Vodafone Group Plc, 8,000 %, con vencimiento el 30/08/2086 *	269	0,87
GBP 100	Whitbread Group Plc, 2,375 %, con vencimiento el 31/05/2027	114	0,37
GBP 100	Whitbread Group Plc, 3,000 %, con vencimiento el 31/05/2031	108	0,35
EUR 100	WPP Finance SA, 4,125 %, con vencimiento el 30/05/2028	110	0,35
		4.507	14,54
Estados Unidos: 34,82 % (28 de febrero de 2023: 27,84 %)			
EUR 190	Abbott Ireland Financing DAC, 0,375 %, con vencimiento el 19/11/2027	186	0,60
110	AbbVie Inc, 3,200 %, con vencimiento el 21/11/2029	101	0,32
200	AbbVie Inc, 4,875 %, con vencimiento el 14/11/2048	189	0,61
110	Air Lease Corp, 1,875 %, con vencimiento el 15/08/2026	101	0,33
60	Air Lease Corp, 5,300 %, con vencimiento el 01/02/2028	60	0,19
EUR 120	Air Products and Chemicals Inc, 4,000 %, con vencimiento el 03/03/2035	133	0,43
45	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2026	45	0,14
150	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 20/04/2029	147	0,47
50	American Express Co, 3,550 %, Perpetuo *	45	0,15
90	Amgen Inc, 5,250 %, con vencimiento el 02/03/2033	90	0,29
50	Amgen Inc, 5,650 %, con vencimiento el 02/03/2053	50	0,16
30	Antero Resources Corp, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 01/03/2030	29	0,09
50	Apple Inc, 2,650 %, con vencimiento el 11/05/2050	33	0,11
EUR 290	Bank of America Corp, 1,662 %, con vencimiento el 25/04/2028 *	294	0,95
80	Bank of America Corp, 5,288 %, con vencimiento el 25/04/2034 *	79	0,25
160	Bank of America Corp, 2,676 %, con vencimiento el 19/06/2041 *	111	0,36
90	Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,200 %, con vencimiento el 15/08/2048	78	0,25
40	Boeing Co/The, 3,950 %, con vencimiento el 01/08/2059	29	0,09
17	Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, con vencimiento el 26/07/2029	16	0,05
160	Broadcom Inc, 4,300 %, con vencimiento el 15/11/2032	148	0,48
EUR 120	Cargill Inc, 3,875 %, con vencimiento el 24/04/2030	132	0,43
100	Centene Corp, 4,625 %, con vencimiento el 15/12/2029	95	0,31
180	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2041	119	0,38
20	Chevron USA Inc, 3,850 %, con vencimiento el 15/01/2028	19	0,06
140	Cigna Group/The, 2,400 %, con vencimiento el 15/03/2030	120	0,39
220	Cigna Group/The, 3,400 %, con vencimiento el 15/03/2050	154	0,50
100	Citigroup Inc, 6,174 %, con vencimiento el 25/05/2034 *	101	0,33
180	Citigroup Inc, 8,125 %, con vencimiento el 15/07/2039	229	0,74
70	Comcast Corp, 4,950 %, con vencimiento el 15/10/2058	65	0,21
170	ConocoPhillips Co, 5,550 %, con vencimiento el 15/03/2054	172	0,56
80	Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/01/2031	78	0,25
150	Coterra Energy Inc, 3,900 %, con vencimiento el 15/05/2027	144	0,47
EUR 230	CRH SMW Finance DAC, 4,000 %, con vencimiento el 11/07/2031	254	0,82
160	CVS Health Corp, 5,050 %, con vencimiento el 25/03/2048	143	0,46
70	DCP Midstream Operating LP, 5,625 %, con vencimiento el 15/07/2027	70	0,23
38	Devon Energy Corp, 4,500 %, con vencimiento el 15/01/2030	36	0,12
130	Devon Energy Corp, 5,000 %, con vencimiento el 15/06/2045	113	0,36
40	Energy Transfer LP, 6,500 %, con vencimiento el 01/02/2042	42	0,14
30	Energy Transfer LP, 8,000 %, con vencimiento el 15/05/2054 *	31	0,10
130	Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, con vencimiento el 15/02/2078 *	120	0,39
40	Exelon Corp, 3,400 %, con vencimiento el 15/04/2026	39	0,12
50	Fidelity & Guaranty Life Holdings Inc, 5,500 %, con vencimiento el 01/05/2025	49	0,16
EUR 180	Ford Motor Credit Co LLC, 2,386 %, con vencimiento el 17/02/2026	188	0,61
EUR 100	General Electric Co, 4,125 %, con vencimiento el 19/09/2035	111	0,36
110	General Motors Co, 6,125 %, con vencimiento el 01/10/2025	111	0,36
130	General Motors Co, 6,750 %, con vencimiento el 01/04/2046	138	0,44
16	Goldman Sachs Capital II, 6,370 %, Perpetuo *	14	0,04
EUR 170	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,875 %, con vencimiento el 03/06/2026	182	0,59
110	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,800 %, con vencimiento el 15/03/2030	102	0,33
20	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, con vencimiento el 22/05/2045	19	0,06
EUR 120	Haleon Netherlands Capital BV, 1,750 %, con vencimiento el 29/03/2030	117	0,38
70	Halliburton Co, 5,000 %, con vencimiento el 15/11/2045	65	0,21
130	HCA Inc, 3,500 %, con vencimiento el 01/09/2030	116	0,37
50	HEICO Corp, 5,250 %, con vencimiento el 01/08/2028	50	0,16
20	HEICO Corp, 5,350 %, con vencimiento el 01/08/2033	20	0,06
100	Humana Inc, 3,125 %, con vencimiento el 15/08/2029	91	0,29
90	Humana Inc, 5,875 %, con vencimiento el 01/03/2033	93	0,30
20	Intercontinental Exchange Inc, 4,250 %, con vencimiento el 21/09/2048	17	0,06
EUR 500	JPMorgan Chase & Co, 0,389 %, con vencimiento el 24/02/2028 *	490	1,58
30	Lowe's Cos Inc, 3,000 %, con vencimiento el 15/10/2050	19	0,06
20	Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 3,375 %, con vencimiento el 15/04/2050	14	0,04
100	McDonald's Corp, 3,700 %, con vencimiento el 30/01/2026	98	0,32
240	McDonald's Corp, 5,450 %, con vencimiento el 14/08/2053	239	0,77
150	Microsoft Corp, 2,921 %, con vencimiento el 17/03/2052	104	0,34
EUR 340	Morgan Stanley, 4,656 %, con vencimiento el 02/03/2029 *	378	1,22
50	Morgan Stanley, 5,948 %, con vencimiento el 19/01/2038 *	50	0,16
100	MPLX LP, 4,500 %, con vencimiento el 15/04/2038	87	0,28
EUR 230	Netflix Inc, 3,625 %, con vencimiento el 15/06/2030	248	0,80
30	Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 6,950 %, con vencimiento el 15/09/2026	31	0,10
60	NRG Energy Inc, 144A, 2,450 %, con vencimiento el 02/12/2027	54	0,17
50	Nuveen LLC, 4,000 %, con vencimiento el 01/11/2028	48	0,16
55	Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, con vencimiento el 15/09/2036	58	0,19
100	Olin Corp, 5,000 %, con vencimiento el 01/02/2030	94	0,30

^ *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^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
160	Permian Resources Operating LLC, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/01/2032	164	0,53
50	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,750 %, con vencimiento el 19/05/2033	49	0,16
110	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 5,300 %, con vencimiento el 19/05/2053	108	0,35
120	Prudential Financial Inc, 3,000 %, con vencimiento el 10/03/2040	90	0,29
100	Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/02/2030	93	0,30
170	Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/04/2040	168	0,54
100	Royal Caribbean Cruises Ltd, 3,700 %, con vencimiento el 15/03/2028	92	0,30
30	RTX Corp, 6,000 %, con vencimiento el 15/03/2031	31	0,10
30	RTX Corp, 6,100 %, con vencimiento el 15/03/2034	32	0,10
120	Service Corp International/US, 3,375 %, con vencimiento el 15/08/2030	103	0,33
90	Solventum Corp, 144A, 5,600 %, con vencimiento el 23/03/2034	89	0,29
80	Solventum Corp, 144A, 5,900 %, con vencimiento el 30/04/2054	78	0,25
100	Southwestern Energy Co, 5,375 %, con vencimiento el 15/03/2030	96	0,31
110	Tapestry Inc, 7,700 %, con vencimiento el 27/11/2030	117	0,38
40	Targa Resources Corp, 4,200 %, con vencimiento el 01/02/2033	36	0,12
90	Targa Resources Corp, 6,500 %, con vencimiento el 30/03/2034	95	0,31
40	Targa Resources Corp, 4,950 %, con vencimiento el 15/04/2052	34	0,11
130	Texas Instruments Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/03/2039	115	0,37
100	Time Warner Cable LLC, 7,300 %, con vencimiento el 01/07/2038	100	0,32
50	T-Mobile USA Inc, 5,650 %, con vencimiento el 15/01/2053	50	0,16
30	Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, con vencimiento el 01/02/2026	31	0,10
17	United Airlines 2020-1 Clase B Pass Through Trust, 4,875 %, con vencimiento el 15/01/2026	16	0,05
120	United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 15/04/2026	116	0,37
130	UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, con vencimiento el 15/12/2048	114	0,37
EUR 130	Verizon Communications Inc, 4,250 %, con vencimiento el 31/10/2030	145	0,47
50	Verizon Communications Inc, 5,250 %, con vencimiento el 16/03/2037	50	0,16
120	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2030	108	0,35
EUR 210	Wells Fargo & Co, 1,000 %, con vencimiento el 02/02/2027	210	0,68
90	Wells Fargo & Co, 5,389 %, con vencimiento el 24/04/2034 *	89	0,29
GBP 100	Wells Fargo & Co, 4,875 %, con vencimiento el 29/11/2035	116	0,37
60	Western Midstream Operating LP, 5,450 %, con vencimiento el 01/04/2044	54	0,17
130	Western Midstream Operating LP, 5,250 %, con vencimiento el 01/02/2050	115	0,37
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	89	0,29
20	Williams Cos Inc/The, 3,500 %, con vencimiento el 15/10/2051	14	0,04
		10.792	34,82
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 31.090 $)		28.475	91,86
Bonos y obligaciones del Estado: 2,53 % (28 de febrero de 2023: 13,07 %)			
Indonesia: 1,03 % (28 de febrero de 2023: 0,63 %)			
EUR 350	Bono Internacional del Estado de Indonesia,1,400 %, con vencimiento el 30/10/2031	318	1,03
México: 1,12 % (28 de febrero de 2023: 1,10 %)			
420	Bono Internacional del Estado de México, 3,500 %, con vencimiento el 12/02/2034	348	1,12
Estados Unidos: 0,38 % (28 de febrero de 2023: 3,61 %)			
70	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 4,000 %, con vencimiento el 31/01/2029	69	0,22
50	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2033	49	0,16
		118	0,38
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 925 $)		784	2,53
Planes de inversión colectiva: 0,22 % (28 de febrero de 2023: 1,21 %)			
69	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	69	0,22
Total de organismos de inversión colectiva (coste 69 $)		69	0,22
Acciones ordinarias: 0,27 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Suiza: 0,27 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
680	Credit Suisse Group AG Escrow †∞	83	0,27
Total de acciones ordinarias (coste – $)		83	0,27
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 32.084 $)		29.411	94,88
Contratos de divisas a plazo: 0,29 % (28 de febrero de 2023: 0,74 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		90	0,29
Futuros: 0,27 % (28 de febrero de 2023: 0,44 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		82	0,27
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		29.583	95,44
Swaps de incumplimiento de crédito: (0,61 %) (28 febrero de 2023: (0,17 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(188)	(0,61)
Contratos de divisas a plazo: 0,00 % (28 de febrero de 2023: (0,19 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(1)	–
Futuros: (0,07 %) (28 de febrero de 2023: (0,08 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(21)	(0,07)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(210)	(0,68)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		29.373	94,76
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		1.624	5,24
Patrimonio		30.997 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 1.950.000 USD o el 6,26 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

† 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.

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

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	93,67
Organismos de inversión colectiva	0,22
Instrumentos financieros derivados	0,55
Otros activos	5,56
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 Western Asset Global Credit Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(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)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % – Comprar	20 de diciembre de 2028	4.200	$ (86)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000 % – Comprar	20 de diciembre de 2028	1.940	(42)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 5,000 % – Comprar	20 de diciembre de 2028	710	(60)
Apreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): – $)				$ –
Depreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): (76) $)				(188)
Depreciación neta de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): (76) $)				$ (188)

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 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	72	Venta	EUR	67	$ (1)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	–	Venta	GBP	–	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	16	Venta	USD	20	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	4.390	Venta	USD	4.724	24
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	27	Venta	USD	30	–
13 de mayo de 2024	BNP Paribas	Compra	USD	1.362	Venta	EUR	1.256	–
13 de mayo de 2024	BNP Paribas	Compra	USD	44	Venta	EUR	40	–
13 de mayo de 2024	BNP Paribas	Compra	EUR	350	Venta	USD	378	1
13 de mayo de 2024	Citi	Compra	USD	1.018	Venta	EUR	939	–
13 de mayo de 2024	Citi	Compra	USD	356	Venta	GBP	279	4
13 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	28	Venta	CAD	38	1
13 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	6.617	Venta	EUR	6.099	4
13 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	393	Venta	GBP	308	4
13 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	65	Venta	JPY	9.414	2
13 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	EUR	300	Venta	USD	323	2
13 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	CAD	31	Venta	USD	23	–
13 de mayo de 2024	HSBC	Compra	USD	65	Venta	EUR	60	–
13 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	1.023	Venta	EUR	942	1
13 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	1.755	Venta	GBP	1.375	19
13 de mayo de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	1.386	Venta	EUR	1.276	3
13 de mayo de 2024	Royal Bank of Canada	Compra	USD	801	Venta	EUR	738	1
13 de mayo de 2024	UBS	Compra	USD	3.870	Venta	EUR	3.564	6
13 de mayo de 2024	UBS	Compra	USD	1.669	Venta	GBP	1.307	18
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 343 $)								$ 90
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (90) $)								(1)
Apreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 253 $)								$ 89

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Mini bono del Estado de Japón a 10 años Marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	(1)	$ (98)	$ (1)
Euro-Bobl marzo de 2024	Bank of America Merrill Lynch	(24)	(3.015)	37
Euro-Bund marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	(12)	(1.720)	21
Bonos Euro-Buxl a 30 años marzo de 2024	Bank of America Merrill Lynch	2	288	(1)
Bono a 10 años de Japón (OSE) marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	(2)	(1.951)	(12)
Long Gilt junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	(5)	(619)	(3)
U.S. 10 Year Note (CBT) junio de 2024	Bank of America Merrill Lynch	23	2.540	6
U.S. 10 Year Ultra Note junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	11	1.256	4
U.S. 5 Year Note (CBT) junio de 2024	Bank of America Merrill Lynch	11	1.176	1
U.S. Long Bond (CBT) junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	(8)	(954)	(4)
U.S. Ultra Bond (CBT) junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	14	1.790	13
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 202 $)				$ 82
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (34) $)				(21)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 168 $)				$ 61

^ *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 al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por activos: 5,12 % (28 de febrero de 2023: 4,57 %)			
11.500	Apidos CLO XXXVI, Serie 2021 36A, Clase D, 144A, 8,479 %, con vencimiento el 20/07/2034 *	11.386	0,95
9.070	Apidos CLO XXXVIII, Serie 2021 38A, Clase D, 144A, 8,529 %, con vencimiento el 21/01/2034 *	8.974	0,74
7.650	Bain Capital Credit CLO 2021-4 Ltd, Serie 2021 4A, Clase D, 144A, 8,679 %, con vencimiento el 20/10/2034 *	7.401	0,61
3.000	Canyon Capital CLO 2017-1 Ltd, Serie 2017 1A, Clase DR, 144A, 8,576 %, con vencimiento el 15/07/2030 *	2.978	0,25
2.630	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Serie 2006-I, Serie 2006 I, Clase 2A, 5,572 %, con vencimiento el 15/01/2037 *	2.401	0,20
7.116	DB Master Finance LLC, Serie 2021 1A, Clase A23, 144A, 2,791 %, con vencimiento el 20/11/2051	5.956	0,49
2.040	Loanpal Solar Loan Ltd, Serie 2020 3GS, Clase B, 144A, 3,450 %, con vencimiento el 20/12/2047	1.567	0,13
5.375	Nassau 2021-I Ltd, Serie 2021 IA, Clase D, 144A, 9,326 %, con vencimiento el 26/08/2034 *	5.273	0,44
5.110	Ocean Trails Clo X, Serie 2020 10A, Clase DR, 144A, 9,296 %, con vencimiento el 15/10/2034 *	5.052	0,42
2.350	Ocean Trails CLO XIV Ltd, Serie 2023 14A, Clase D, 144A, 11,138 %, con vencimiento el 20/01/2035 *	2.356	0,20
4.772	Stonepeak 2021-1 ABS, serie 2021 1A, clase A, 144A, 2,675 %, con vencimiento el 28/02/2033	4.346	0,36
4.000	Vibrant Clo VII Ltd, Serie 2017 7A, Clase C, 144A, 9,179 %, con vencimiento el 15/09/2030 *	3.980	0,33
Total de valores garantizados por activos (coste 64.458 $)		61.670	5,12
Valores garantizados por hipotecas: 9,47 % (28 de febrero de 2023: 0,91 %)			
10.400	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Serie 2021 R03, Clase 1M2, 144A, 6,972 %, con vencimiento el 25/12/2041 *	10.452	0,87
7.700	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,500 % ±	7.289	0,61
13.600	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 5,000 % ±	13.190	1,09
5.500	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 5,500 % ±	5.441	0,45
12.000	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 6,000 % ±	12.049	1,00
32	Fannie Mae Pool 'CA0907', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2047	29	–
7.870	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Serie 2021 DNA6, Clase M2, 144A, 6,822 %, con vencimiento el 25/10/2041 *	7.858	0,65
10.700	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 4,500 % ±	10.219	0,85
34.200	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 % ±	33.409	2,77
12.900	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,500 % ±	12.816	1,06
1.088	MortgageIT Trust 2005-3, Serie 2005 3, Clase A1, 6,035 %, con vencimiento el 25/08/2035 *	1.027	0,09
343	New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Serie 2021 NQ2R, Clase A3, 144A, 1,353 %, con vencimiento el 25/10/2058 *	310	0,03
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 114.023 $)		114.089	9,47
Bonos y obligaciones corporativos: 37,74 % (28 de febrero de 2023: 40,30 %)			
Bermudas: 1,07 % (28 de febrero de 2023: 0,61 %)			
12.900	Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, con vencimiento el 15/10/2025	12.896	1,07
Brasil: 0,49 % (28 de febrero de 2023: 0,38 %)			
1.780	Petrobras Global Finance BV, 5,999 %, con vencimiento el 27/01/2028	1.792	0,15
4.380	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, con vencimiento el 05/06/2115	4.095	0,34
		5.887	0,49
Canadá: 0,36 % (28 de febrero de 2023: 0,20 %)			
2.400	Bank of Nova Scotia/The, 8,000 %, con vencimiento el 27/01/2084 *	2.429	0,20
260	Toronto-Dominion Bank/The, 8,125 %, con vencimiento el 31/10/2082 *	271	0,02
1.670	Yamana Gold Inc, 4,625 %, con vencimiento el 15/12/2027	1.602	0,14
		4.302	0,36
Colombia: 0,84 % (28 de febrero de 2023: 0,47 %)			
4.130	Ecopetrol SA, 5,375 %, con vencimiento el 26/06/2026	4.067	0,34
2.510	Ecopetrol SA, 8,875 %, con vencimiento el 13/01/2033	2.641	0,22
3.430	Ecopetrol SA, 8,375 %, con vencimiento el 19/01/2036	3.446	0,28
		10.154	0,84
Francia: 1,26 % (28 de febrero de 2023: 0,78 %)			
2.260	Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/01/2028	1.846	0,15
200	BNP Paribas SA, 144A, 9,250 %, Perpetuo *	213	0,02
1.210	BNP Paribas SA, 144A, 8,000 %, Perpetuo *	1.212	0,10
400	BNP Paribas SA, 144A, 7,000 %, Perpetuo *	388	0,03
5.420	Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Perpetuo *	5.539	0,46
GBP 4.830	Credit Agricole SA, 7,500 %, Perpetuo *	6.042	0,50
		15.240	1,26
Irlanda: 0,02 % (28 de febrero de 2023: 0,02 %)			
340	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, con vencimiento el 30/01/2032	288	0,02
Israel: 2,32 % (28 de febrero de 2023: 4,11 %)			
8.027	Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, con vencimiento el 01/02/2036	7.671	0,64
29.991	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,100 %, con vencimiento el 01/10/2046	20.321	1,68
		27.992	2,32
Italia: 0,23 % (28 de febrero de 2023: 0,13 %)			
2.750	Enel Finance International NV, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 07/10/2039	2.756	0,23
Luxemburgo: 0,02 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
220	Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/08/2029	190	0,02
Macao: 1,76 % (28 de febrero de 2023: 1,08 %)			
7.690	Sands China Ltd, 5,125 %, con vencimiento el 08/08/2025	7.585	0,63
3.462	Sands China Ltd, 2,550 %, con vencimiento el 08/03/2027	3.121	0,26
1.540	Sands China Ltd, 3,100 %, con vencimiento el 08/03/2029	1.330	0,11
3.570	Wynn Macau Ltd, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 01/10/2024	3.537	0,30
5.750	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/01/2026	5.581	0,46
		21.154	1,76
Malasia: 0,65 % (28 de febrero de 2023: 0,39 %)			
11.710	Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, con vencimiento el 19/08/2050	7.865	0,65
México: 0,29 % (28 de febrero de 2023: 0,43 %)			
3.610	Banco Mercantil del Norte SA/Gran Caimán, 144A, 7,625 %, Perpetuo *	3.531	0,29
Supranacional: 0,45 % (28 de febrero de 2023: 0,37 %)			
IDR 86.776.600	European Bank for Reconstruction & Development, 5,000 %, con vencimiento el 06/10/2026	5.375	0,45
Suecia: 0,31 % (28 de febrero de 2023: 0,18 %)			
4.400	Svenska Handelsbanken AB, 4,750 %, Perpetuo *	3.694	0,31
Suiza: 1,30 % (28 de febrero de 2023: 2,18 %)			
4.290	UBS Group AG, 144A, 9,016 %, con vencimiento el 15/11/2033 *	5.164	0,43
1.110	UBS Group AG, 144A, 7,750 %, Perpetuo *	1.113	0,09
1.000	UBS Group AG, 144A, 9,250 %, Perpetuo *	1.107	0,09
2.000	UBS Group AG, 144A, 9,250 %, Perpetuo *	2.140	0,18
6.160	UBS Group AG, 6,875 %, Perpetuo *	6.099	0,51
		15.623	1,30
Emiratos Árabes Unidos: 0,54 % (28 de febrero de 2023: 0,37 %)			
8.260	MDGH GMTN RSC Ltd, 3,950 %, con vencimiento el 21/05/2050	6.493	0,54
Reino Unido: 0,49 % (28 de febrero de 2023: 0,65 %)			
1.310	BAT Capital Corp, 4,540 %, con vencimiento el 15/08/2047	984	0,08
2.040	Lloyds Banking Group Plc, 7,500 %, Perpetuo *	2.039	0,17
270	Reynolds American Inc, 6,150 %, con vencimiento el 15/09/2043	261	0,02
700	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/05/2029	657	0,06
2.330	Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 31/01/2031	1.978	0,16
		5.919	0,49
Estados Unidos: 24,53 % (28 de febrero de 2023: 26,93 %)			
850	Altria Group Inc, 5,950 %, con vencimiento el 14/02/2049	847	0,07
2.395	Altria Group Inc, 6,200 %, con vencimiento el 14/02/2059	2.443	0,20
557	Alphabet Inc, 4,250 %, con vencimiento el 22/08/2057	480	0,04
1.830	Amazon.com Inc, 2,700 %, con vencimiento el 03/06/2060	1.130	0,09
4.440	Amazon.com Inc, 4,100 %, con vencimiento el 13/04/2062	3.684	0,31
550	American Airlines Inc, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/05/2029	579	0,05
17.736	Apache Corp, 5,100 %, con vencimiento el 01/09/2040	14.857	1,23
140	Apache Corp, 7,375 %, con vencimiento el 15/08/2047	138	0,01
1.933	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 15/08/2027	1.404	0,12
4.500	BAC Capital Trust XIV, Serie G, 6,046 %, Perpetuo *	3.718	0,31
210	Bank of America Corp, Serie X, 6,250 %, Perpetuo *	210	0,02
15.940	Bank of America Corp, Serie FF, 5,875 %, Perpetuo *	15.465	1,28
1.329	Bank of America Corp, Serie AA, 6,100 %, Perpetuo *	1.331	0,11
1.300	Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 01/11/2025	1.211	0,10
2.978	Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2026	2.920	0,24
2.510	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, con vencimiento el 15/12/2025	2.534	0,21

^ *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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
780	Boeing Co/The, 3,550 %, con vencimiento el 01/03/2038	604	0,05
992	Boeing Co/The, 5,930 %, con vencimiento el 01/05/2060	951	0,08
5.250	Carnival Corp, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 01/05/2029	5.134	0,43
6.150	Carnival Corp, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 01/06/2030	6.715	0,56
320	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2032	259	0,02
1.860	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, con vencimiento el 01/04/2038	1.604	0,13
540	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, con vencimiento el 01/03/2050	391	0,03
700	Cheniere Energy Inc, 4,625 %, con vencimiento el 15/10/2028	673	0,06
800	Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, con vencimiento el 31/01/2032	669	0,06
3.355	Citigroup Inc, 8,125 %, con vencimiento el 15/07/2039	4.263	0,35
11.765	Citigroup Inc, Series P, 5,950 %, Perpetuo *	11.679	0,97
6.900	Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,544 %, con vencimiento el 15/11/2053	7.358	0,61
1.019	CommonSpirit Health, 4,350 %, con vencimiento el 01/11/2042	871	0,07
330	CommScope Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 01/09/2029	226	0,02
340	Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/01/2031	334	0,03
3.290	Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, con vencimiento el 01/06/2044	2.672	0,22
5.110	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 01/02/2029	4.460	0,37
2.150	CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/01/2030	1.266	0,10
3.390	CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 01/12/2030	2.527	0,21
2.135	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, con vencimiento el 03/11/2036	2.208	0,18
1.160	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 15/09/2037	1.236	0,10
205	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 4,500 %, con vencimiento el 20/10/2025	202	0,02
354	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 4,750 %, con vencimiento el 20/10/2028	346	0,03
560	Devon Energy Corp, 5,875 %, con vencimiento el 15/06/2028	564	0,05
716	Devon Energy Corp, 4,500 %, con vencimiento el 15/01/2030	684	0,06
1.690	Devon Energy Corp, 7,875 %, con vencimiento el 30/09/2031	1.921	0,16
1.440	Devon Energy Corp, 7,950 %, con vencimiento el 15/04/2032	1.643	0,14
805	Devon Energy Corp, 5,000 %, con vencimiento el 15/06/2045	697	0,06
3.720	Dignity Health, 5,267 %, con vencimiento el 01/11/2064	3.459	0,29
170	DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 01/12/2026	136	0,01
90	DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 01/12/2028	62	0,01
1.220	DISH DBS Corp, 5,125 %, con vencimiento el 01/06/2029	522	0,04
1.530	Energy Transfer LP, 6,850 %, con vencimiento el 15/02/2040	1.586	0,13
1.995	Energy Transfer LP, 6,100 %, con vencimiento el 15/02/2042	1.982	0,16
412	Energy Transfer LP, 5,400 %, con vencimiento el 01/10/2047	374	0,03
410	Energy Transfer LP, 6,000 %, con vencimiento el 15/06/2048	402	0,03
730	Energy Transfer LP, 6,250 %, con vencimiento el 15/04/2049	738	0,06
11.260	Energy Transfer Operating LP, 6,750 %, Perpetuo *	11.092	0,92
8.650	Energy Transfer Operating LP, Serie G, 7,125 %, Perpetuo *	8.359	0,69
4.018	Energy Transfer Operating LP, 6,500 %, Perpetuo *	3.904	0,32
12.990	Energy Transfer Operating LP, 6,625 %, Perpetuo *	12.083	1,00
828	Enterprise Products Operating LLC, 6,125 %, con vencimiento el 15/10/2039	874	0,07
1	Enterprise Products Operating LLC, 6,450 %, con vencimiento el 01/09/2040	1	–
730	EQT Corp, 7,000 %, con vencimiento el 01/02/2030	774	0,06
360	Ford Motor Co, 3,250 %, con vencimiento el 12/02/2032	295	0,02
3.750	Ford Motor Co, 6,100 %, con vencimiento el 19/08/2032	3.746	0,31
200	Ford Motor Credit Co LLC, 3,375 %, con vencimiento el 13/11/2025	192	0,02
200	Ford Motor Credit Co LLC, 4,542 %, con vencimiento el 01/08/2026	194	0,02
200	Ford Motor Credit Co LLC, 2,700 %, con vencimiento el 10/08/2026	186	0,02
3.700	Ford Motor Credit Co LLC, 4,271 %, con vencimiento el 09/01/2027	3.546	0,29
200	Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, con vencimiento el 10/02/2029	174	0,01
760	Ford Motor Credit Co LLC, 5,113 %, con vencimiento el 03/05/2029	733	0,06
620	Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, con vencimiento el 01/08/2030	592	0,05
515	Goldman Sachs Capital II, 6,370 %, Perpetuo *	435	0,04
2.210	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,750 %, con vencimiento el 01/10/2037	2.404	0,20
300	HCA Inc, 3,500 %, con vencimiento el 01/09/2030	268	0,02
4.401	HCA Inc, 7,500 %, con vencimiento el 15/11/2095	4.703	0,39
6.290	ILFC E-Capital Trust I, 144A, 7,186 %, con vencimiento el 21/12/2065 *	4.888	0,41
539	Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,500 %, con vencimiento el 01/09/2039	556	0,05
400	Kinder Morgan Energy Partners LP, 6,550 %, con vencimiento el 15/09/2040	414	0,03
2.490	Northern Oil & Gas Inc, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 01/03/2028	2.524	0,21
2.760	Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, con vencimiento el 01/09/2030	2.907	0,24
300	Occidental Petroleum Corp, 6,125 %, con vencimiento el 01/01/2031	308	0,03
5.220	Occidental Petroleum Corp, 4,300 %, con vencimiento el 15/08/2039	4.213	0,35
11.725	Occidental Petroleum Corp, 4,500 %, con vencimiento el 15/07/2044	9.097	0,75
7.150	Occidental Petroleum Corp, 4,625 %, con vencimiento el 15/06/2045	5.777	0,48
2.050	Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, con vencimiento el 15/03/2046	2.179	0,18
4.520	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, con vencimiento el 15/04/2046	3.615	0,30
1.370	Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, con vencimiento el 15/02/2047	1.009	0,08
16.140	Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, con vencimiento el 15/03/2048	12.397	1,03
2.572	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, con vencimiento el 15/08/2049	1.914	0,16
890	Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, con vencimiento el 01/08/2040	642	0,05
2.280	Plains All American Pipeline LP, Serie B, 9,679 %, Perpetuo *	2.279	0,19
1.910	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 6,700 %, con vencimiento el 15/05/2036	1.996	0,17
4.800	Range Resources Corp, 8,250 %, con vencimiento el 15/01/2029	5.011	0,42
6.910	Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/04/2040	6.810	0,57
7.540	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 15/07/2027	7.403	0,61
470	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/03/2032	472	0,04
670	Southwestern Energy Co, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2032	609	0,05
560	Sprint Capital Corp, 8,750 %, con vencimiento el 15/03/2032	677	0,06
360	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, con vencimiento el 01/02/2031	341	0,03
280	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, con vencimiento el 15/01/2032	250	0,02
1.300	Time Warner Cable LLC, 7,300 %, con vencimiento el 01/07/2038	1.297	0,11
2.100	Toll Road Investors Partnership II LP, 144A, zero coupon, con vencimiento el 15/02/2038	715	0,06
6.990	United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 15/04/2026	6.735	0,56
340	United Rentals North America Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/02/2031	301	0,02
1.260	Warnermedia Holdings Inc, 5,391 %, con vencimiento el 15/03/2062	1.017	0,08
1.926	Wells Fargo & Co, Series U, 5,875 %, Perpetuo *	1.930	0,16
420	Western Midstream Operating LP, 4,500 %, con vencimiento el 01/03/2028	402	0,03
5.114	Western Midstream Operating LP, 5,450 %, con vencimiento el 01/04/2044	4.587	0,38
4.480	Western Midstream Operating LP, 5,500 %, con vencimiento el 15/08/2048	3.941	0,33
1.330	Western Midstream Operating LP, 5,250 %, con vencimiento el 01/02/2050	1.177	0,10
2.790	Williams Cos Inc/The, Serie A, 7,500 %, con vencimiento el 15/01/2031	3.105	0,26
3.400	Williams Cos Inc/The, 8,750 %, con vencimiento el 15/03/2032	4.059	0,34
1.500	Williams Cos Inc/The, 6,300 %, con vencimiento el 15/04/2040	1.562	0,13
7.313	XPO CNW Inc, 6,700 %, con vencimiento el 01/05/2034	7.575	0,63
		295.615	24,53

^ *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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Zambia: 0,81 % (28 de febrero de 2023: 0,01 %)			
7.690	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 01/03/2026	7.690	0,64
640	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/10/2027	609	0,05
900	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 9,375 %, con vencimiento el 01/03/2029	934	0,07
600	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, con vencimiento el 01/06/2031	574	0,05
		9.807	0,81
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 489.535 $)		454.781	37,74
Bonos y obligaciones del Estado: 43,01 % (28 de febrero de 2023: 40,57 %)			
Paraguay: 0,24 % (28 de febrero de 2023: 0,17 %)			
2.000	Bono Internacional del Estado de Angola, 8,250 %, con vencimiento el 09/05/2028	1.844	0,15
1.250	Bono Internacional del Estado de Angola, 144A, 8,750 %, con vencimiento el 14/04/2032	1.100	0,09
		2.944	0,24
Brasil: 1,63 % (28 de febrero de 2023: 1,07 %)			
BRL 21.530	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2027	4.326	0,36
BRL 78.647	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2031	15.337	1,27
		19.663	1,63
Costa de Marfil: 1,48 % (28 de febrero de 2023: 1,01 %)			
EUR 4.010	Bono Internacional del Estado de Costa de Marfil, 4,875 %, con vencimiento el 30/01/2032	3.644	0,30
EUR 4.020	Bono Internacional del Estado de Costa de Marfil, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 30/01/2032	3.653	0,30
558	Bono Internacional del Estado de Costa de Marfil, 5,750 %, con vencimiento el 31/12/2032	527	0,04
4.164	Bono Internacional del Estado de Costa de Marfil, 6,125 %, con vencimiento el 15/06/2033	3.661	0,31
7.240	Bono Internacional del Estado de Costa de Marfil, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 15/06/2033	6.365	0,53
		17.850	1,48
República Dominicana: 0,81 % (28 de febrero de 2023: 0,35 %)			
DOP 214.400	Bono Internacional de la República Dominicana, 144A, 11,250 %, con vencimiento el 15/09/2035	4.027	0,34
6.750	Bono Internacional de la República Dominicana, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 30/01/2060	5.709	0,47
		9.736	0,81
Paraguay: 0,40 % (28 de febrero de 2023: 0,24 %)			
EGP 22.000	Bono del Estado de Egipto, Serie 7YR, 18,400 %, con vencimiento el 30/05/2024	515	0,05
4.420	Bono Internacional del Estado de Egipto, 5,250 %, con vencimiento el 06/10/2025	4.247	0,35
		4.762	0,40
India: 10,29 % (28 de febrero de 2023: 5,07 %)			
INR 800.000	Bono del Estado de la India, 6,180 %, con vencimiento el 04/11/2024	9.609	0,80
INR 900.000	Bono del Estado de la India, 5,630 %, con vencimiento el 12/04/2026	10.585	0,88
INR 1.300.000	Bono del Estado de la India, 8,150 %, con vencimiento el 24/11/2026	16.091	1,34
INR 600.000	Bono del Estado de la India, 7,170 %, con vencimiento el 08/01/2028	7.255	0,60
INR 1.150.000	Bono del Estado de la India, 7,590 %, con vencimiento el 20/03/2029	14.194	1,18
INR 1.350.000	Bono del Estado de la India, 5,790 %, con vencimiento el 11/05/2030	15.239	1,26
INR 1.000.000	Bono del Estado de la India, 7,260 %, con vencimiento el 22/08/2032	12.176	1,01
INR 2.900.000	Bono del Estado de la India, 6,190 %, con vencimiento el 16/09/2034	32.594	2,70
INR 500.000	Bono del Estado de la India, 7,540 %, con vencimiento el 23/05/2036	6.235	0,52
		123.978	10,29
Indonesia: 5,95 % (28 de febrero de 2023: 7,79 %)			
IDR 371.785.000	Bono del Tesoro de Indonesia, Series FR78, 8,250 %, con vencimiento el 15/05/2029	25.511	2,12
IDR 500.248.000	Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR87, 6,500 %, con vencimiento el 15/02/2031	31.626	2,62
IDR 222.343.000	Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR96, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2033	14.593	1,21
		71.730	5,95
Paragua: 0,08 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
JMD 141.500	Bono Internacional del Estado de Jamaica, 9,625 %, con vencimiento el 03/11/2030	961	0,08
Kenia: 0,28 % (28 de febrero de 2023: 0,22 %)			
3.670	Republic of Kenya Government International Bond, 7,250 %, con vencimiento el 28/02/2028	3.408	0,28
México: 7,25 % (28 de febrero de 2023: 5,39 %)			
MXN 1.261.084	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, con vencimiento el 13/11/2042	63.988	5,31
MXN 453.610	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, con vencimiento el 07/11/2047	23.323	1,94
		87.311	7,25
Nigeria: 0,24 % (28 de febrero de 2023: 0,14 %)			
3.240	Bono Internacional del Estado de Nigeria, 6,125 %, con vencimiento el 28/09/2028	2.853	0,24
Polonia: 4,68 % (28 de febrero de 2023: 2,62 %)			
PLN 291.200	Bono del Estado de la República de Polonia, Serie 0432, 1,750 %, con vencimiento el 25/04/2032	56.366	4,68
Sudáfrica: 3,73 % (28 de febrero de 2023: 1,46 %)			
ZAR 1.082.770	Bono del Estado de la República de Sudáfrica, Serie R209, 6,250 %, con vencimiento el 31/03/2036	36.582	3,03
ZAR 271.600	Bono del Estado de la República de Sudáfrica, Serie R214, 6,500 %, con vencimiento el 28/02/2041	8.418	0,70
		45.000	3,73
Estados Unidos: 5,95 % (28 de febrero de 2023: 14,05 %)			
1.820	Morongo Band of Mission Indians/The, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 01/10/2039	1.918	0,16
2.990	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,500 %, con vencimiento el 15/02/2053 ≠β	2.698	0,22
7.070	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, con vencimiento el 15/11/2043 ≠	7.278	0,60
1.320	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, con vencimiento el 15/02/2049 ≠	1.023	0,09
7.000	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 1,250 %, con vencimiento el 15/05/2050 ≠	3.557	0,30
2.570	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 1,875 %, con vencimiento el 15/11/2051 ≠	1.532	0,13
18.446	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, con vencimiento el 15/02/2052 ≠	12.071	1,00
16.910	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, con vencimiento el 15/08/2052 ≠	13.077	1,09
1.044	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,625 %, con vencimiento el 15/02/2053 ≠	913	0,08
2.683	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 15/05/2053 ≠	2.348	0,19
16.500	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2053 ≠	15.801	1,31
8.870	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, con vencimiento el 15/11/2053 ≠	9.440	0,78
		71.656	5,95
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 538.758 $)		518.218	43,01
Obligaciones de préstamo: 1,92 % (28 de febrero de 2023: 1,98 %)			
3.991	1011778 Bc Ulc, 7,583 %, con vencimiento el 21/09/2030 *	3.980	0,33
1.414	Alterra Mountain Co, 8,947 %, con vencimiento el 30/07/2028 *	1.418	0,12
2.731	Asurion LLC, 9,683 %, con vencimiento el 19/08/2028 *	2.721	0,22
6.018	Charter Communications Operating LLC, 7,329 %, con vencimiento el 09/12/2030 *	5.927	0,49
2.320	GTCR W Merger Sub LLC, 8,333 %, con vencimiento el 20/09/2030 *	2.332	0,19
1.592	Jane Street Group LLC, 7,951 %, con vencimiento el 26/01/2028 *	1.590	0,13
2.358	LifePoint Health Inc, 11,087 %, con vencimiento el 16/11/2028 *	2.362	0,20
1.309	Phoenix Guarantor Inc, 0,000 %, con vencimiento el 13/02/2031 *	1.295	0,11
1.550	Virgin Media Bristol LLC, 7,932 %, con vencimiento el 04/01/2028 *	1.538	0,13
Total de obligaciones de préstamo (coste 23.319 $)		23.163	1,92
Bonos municipales: 0,26 % (28 de febrero de 2023: 0,61 %)			
4.240	Ciudad de Detroit MI, 4,000 %, con vencimiento el 01/04/2044	3.150	0,26
Total de bonos municipales (coste 3,653 $)		3.150	0,26
Organismos de inversión colectiva: 3,30 % (28 de febrero de 2023: 0,87 %)			
39.783	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	39.783	3,30
Total de organismos de inversión colectiva (coste 39.783 $)		39.783	3,30
Suiza: 0,42 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
41.200	Credit Suisse Group AG Escrow †∞	5.047	0,42
Total de acciones ordinarias (coste – $)		5.047	0,42
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 1.273.530 $)		1.219.901	101,24

^ *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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Contratos (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Opciones compradas: 0,43 % (28 de febrero de 2023: 0,28 %)			
1	Curva media de 1 año 3 Meses SOFR Futuros Diciembre 2024 Put 95,75, con vencimiento el 15/03/2024 – Morgan Stanley	430	0,04
–	Dólar australiano Moneda Futuro Marzo 2024 Call 65,00, con vencimiento 08/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	17	–
–	Dólar australiano Moneda Futuro Marzo 2024 Call 66,00, con vencimiento 08/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	5	–
–	Libra británica Divisa Futuro Abril 2024 Put 125,50, con vencimiento el 05/04/2024 – Bank of America Merrill Lynch	67	0,01
–	Libra británica Divisa Futuro Marzo 2024 Put 125,50, con vencimiento 08/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	23	–
–	Euro Moneda Futuro Marzo 2024 Call 1,08, con vencimiento el 08/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	24	–
–	Euro Moneda Futuro Marzo 2024 Call 1,0850, con vencimiento el 08/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	44	–
EUR –	Eurobono Abril 2024 Call 132,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	534	0,04
EUR –	Eurobono Abril 2024 Call 132,50, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	409	0,03
EUR –	Eurobono Abril 2024 Call 133,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	230	0,02
EUR –	Eurobono Abril 2024 Call 134,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	151	0,01
EUR 2	Eurobono Abril 2024 Call 137,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	114	0,01
–	Yen japonés moneda Futuro Marzo 2024 Call 67,00, fecha límite 08/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	70	0,01
–	Yen japonés moneda Futuro Marzo 2024 Call 2024 Call 68,50, fecha límite 08/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	5	–
–	U.S. 10 Años Abril 2024 Call 110,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	231	0,02
–	U.S. 10 Años Abril 2024 Call 110,50, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	308	0,03
1	U.S. 5 Años Abril 2024 Call 106,75, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	422	0,04
2	U.S. 5 Años Abril 2024 Call 107,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	976	0,08
–	U.S. 5 Años Abril 2024 Call 107,25, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	118	0,01
1	Bono estadounidense Abril 2024 Call 120,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	563	0,05
11.080	USD Call/CHF Put 0.8725, con vencimiento el 16/03/2024 (Goldman Sachs)	148	0,01
28.340	USD Call/EUR Put 1,0850, con vencimiento el 26/03/2024 – Goldman Sachs	222	0,02
14.904	USD Put/ZAR Call 18,2095, con vencimiento el 09/04/2024 – Goldman Sachs	18	–
Total de opciones compradas (coste 8.440 $)		5.129	0,43
Swaps de incumplimiento de crédito: (0,05 %) (28 febrero de 2023: 0,27 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		660	0,05
Swaps sobre índices: 5,59 % (28 de febrero de 2023: 6,92 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		67.371	5,59
Swaps de tasas de interés: (1,22 %) (28 de febrero de 2023: 0,12 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		14.619	1,22
Contratos de divisas a plazo: 0,71 % (28 de febrero de 2023: 1,01 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		8.511	0,71
Futuros: 1,51 % (28 de febrero de 2023: 0,96 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		18.244	1,51
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		1.334.435	110,75
Opciones suscritas: (0,66 %) (28 de febrero de 2023: (2,17 %))			
(1)	CME 3 Meses SOFR Futuros Diciembre 2024 Call 96,25, con vencimiento el 13/12/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(587)	(0,05)
(1)	CME 3 Meses SOFR Futuros Marzo 2024 Call 95,00, con vencimiento el 15/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(9)	–
(1)	CME 3 Meses SOFR Futuros Marzo 2024 Put 95,00, con vencimiento el 15/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(633)	(0,05)
EUR –	Eurobono Abril 2024 Call 133,50, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(165)	(0,01)
EUR –	Eurobono Abril 2024 Put 132,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(204)	(0,02)
EUR –	Eurobono Abril 2024 Put 132,50, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(243)	(0,02)
–	Japanese Yen Currency Future marzo 2024 Call 67,50, fecha límite 08/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(6)	–
–	U.S. 10 Años Abril 2024 Call 111,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(105)	(0,01)
(2)	U.S. 10 Años Abril 2024 Call 111,50, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(515)	(0,04)
–	U.S. 10 Años Abril 2024 Call 112,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(25)	–
(2)	U.S. 10 Años Abril 2024 Call 112,50, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(266)	(0,02)
(2)	U.S. 10 Años Abril 2024 Call 113,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(188)	(0,02)
(2)	U.S. 10 Años Abril 2024 Call 113,50, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(132)	(0,01)
(1)	U.S. 10 Años Abril 2024 Call 114,50, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(40)	–
(1)	U.S. 10 Años Junio 2024 Call 113,00, con vencimiento el 24/05/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(369)	(0,03)
–	U.S. 10 Años W1 Marzo 2024 Call 109,75, con vencimiento el 01/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(162)	(0,01)
–	U.S. 10 Años W1 Marzo 2024 Call 110,50, con vencimiento el 01/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(65)	(0,01)
–	U.S. 2 Años Abril 2024 Call 102,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(217)	(0,02)
(2)	U.S. 5 Años Abril 2024 Call 107,75, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(457)	(0,04)
(1)	U.S. 5 Años Abril 2024 Call 108,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(240)	(0,02)
(1)	U.S. 5 Años Abril 2024 Call 109,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(58)	(0,01)
(2)	U.S. 5 Años Abril 2024 Call 107,75, con vencimiento el 26/04/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(942)	(0,08)
–	Bono estadounidense Abril 2024 Call 118,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(199)	(0,02)
(1)	Bono estadounidense Abril 2024 Call 121,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(571)	(0,05)
(2)	Bono estadounidense Abril 2024 Call 123,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(461)	(0,04)
(1)	Bono estadounidense Abril 2024 Call 125,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(81)	(0,01)
–	Bono estadounidense Abril 2024 Put 121,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(512)	(0,04)
–	U.S. Long Bond W1 Marzo 2024 Call 119,00, con vencimiento el 01/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(163)	(0,01)
(13.972)	USD Call/BRL Put 5,0347, con vencimiento el 24/05/2024 – Goldman Sachs	(238)	(0,02)
(11.080)	USD Call/CHF Put 0,8890, con vencimiento el 16/03/2024 – Goldman Sachs	(31)	–
(28.340)	USD Put/EUR Call 1,12, con vencimiento el 26/03/2024 – Goldman Sobres	(2)	–
Total de opciones suscritas (coste (16.057) $)		(7.886)	(0,66)
Swaps sobre índices: (1,47 %) (28 de febrero de 2023: (0,92 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(17.747)	(1,47)
Swaps de tasas de interés: (0,04 %) (28 de febrero de 2023: (1,07 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(448)	(0,04)
Contratos de divisas a plazo: (0,54 %) (28 de febrero de 2023: (2,05 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(6.458)	(0,54)
Futuros: (1,63 %) (28 de febrero de 2023: (2,21 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(19.662)	(1,63)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(52.201)	(4,34)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		1.282.234	106,41
Excedente de pasivos respecto a otros activos		(77.265)	(6,41)
Patrimonio		1.204.969 $	100,00

- 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 230.432.000 USD o el 19,14 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

† 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.

≠ Garantía (total o parcial) pignorada como garantía para la negociación de derivados a 29 de febrero de 2024.

± 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 29 de febrero de 2024.

^ *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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

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
DOP	–	Peso dominicano
EGP	–	Libra egipcia
EUR	–	Euro
GBP	–	Libra esterlina
IDR	–	Rupia indonesia
INR	–	Rupia india
JMD	–	Dólar jamaicano
MXN	–	Peso mexicano
PLN	–	Zloty polaco
ZAR	–	Rand sudafricano

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	81,64
Otros valores mobiliarios negociables en otro mercado regulado	1,63
Organismos de inversión colectiva	2,81
Instrumentos financieros derivados	8,08
Otros activos	5,84
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)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.HY.CDSI 5 años, 5,000 % – Vender	20 de diciembre de 2028	7.914	$ 497
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % – Vender	20 de diciembre de 2028	5.300	109
Bank of America Merrill Lynch	Teva Pharmaceutical Industries Ltd, 1,000 % – Vender	20 de junio de 2026	12.479	54
Apreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): 5.762 $)				$ 660
Depreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): (520) $)				–
Apreciación neta de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): 5.242 $)				$ 660

Listado de swaps de tipos de interés

Contraparte	Tipo	Fecha de vencimiento	Importe teórico (en miles)	Valor (en miles)
Bank of America Merrill Lynch	Pago flotante BRL CDI, recibir fijo 12,024 %	04 de enero de 2027	496.488	$ 2.835
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 9,260 %	25 de octubre de 2032	1.009.497	2.286
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 8,450 %	01 de marzo de 2033	640.415	(448)
BNP Paribas	Pago flotante BRL CDI, recibir fijo 12,646 %	02 de enero de 2029	679.541	8.462
JP Morgan	Pago flotante BRL CDI, recibir fijo 12,930 %	02 de enero de 2029	73.048	1.036
Apreciación latente de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 (en miles): 2.585 $)				$ 14.619
Depreciación latente de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 (en miles): (22.883) $)				(448)
Apreciación neta de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 (en miles): (20.298) $)				$ 14.171

Listado de swaps de inflación

Contraparte	Entidad de referencia	Fecha de vencimiento	Importe teórico (en miles)	Valor (en miles)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15 de febrero de 2047	26.146	$ 8.987
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,600 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15 de febrero de 2048	261.696	47.548
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,220 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15 de mayo de 2032	230.335	10.836
Bank of America Merrill Lynch	Pago flotante USD SOFR compuesto, recibir fijo 1,396 %	13 de octubre de 2025	582.851	(16.199)
Bank of America Merrill Lynch	Pago flotante USD SOFR compuesto, recibir fijo 3,950 %	31 de mayo de 2028	143.734	(692)
Bank of America Merrill Lynch	Pago flotante USD SOFR compuesto, recibir fijo 4,600 %	04 de junio de 2024	354.373	(856)
Apreciación latente de swaps sobre índices (28 de febrero de 2023 (en miles): 147.520 $)				$ 67.371
Depreciación latente de swaps sobre índices (28 de febrero de 2023 (en miles): (19.599) $)				(17.747)
Apreciación neta de swaps sobre índices (28 de febrero de 2023 (en miles): 127.921 $)				$ 49.624

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)
04 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	28.002	Venta	BRL	139.220	$ 8
04 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	4.071	Venta	BRL	20.291	(10)
04 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	BRL	157.856	Venta	USD	32.051	(310)
04 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	BRL	1.655	Venta	USD	332	1
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	630	Venta	AUD	976	(3)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	224	Venta	AUD	340	1
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	376	Venta	CHF	332	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	302	Venta	CHF	266	2
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	133	Venta	CNH	959	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	10.791	Venta	EUR	10.050	(81)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	15.281	Venta	EUR	14.120	10
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	912	Venta	GBP	720	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 al 29 de febrero de 2024 *(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 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	1.478	Venta	GBP	1.174	$	(3)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	963	Venta	JPY	144.399		(3)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	87	Venta	NOK	927		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	93	Venta	NOK	995		(1)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	36	Venta	PLN	147		(1)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	16	Venta	SEK	173		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	34	Venta	SEK	353		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	1.022	Venta	SGD	1.378		(2)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	680	Venta	SGD	913		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	47.047	Venta	USD	59.188		205
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	129	Venta	USD	163		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	430	Venta	USD	319		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	761	Venta	USD	821		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CNH	208	Venta	USD	29		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	JPY	7.068.710	Venta	USD	48.005		(740)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SEK	16	Venta	USD	1		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NOK	3.587	Venta	USD	343		(1)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	PLN	7.890	Venta	USD	1.950		26
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SEK	10.883	Venta	USD	1.030		19
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	38.293	Venta	USD	28.520		(42)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	371.174	Venta	USD	399.385		2.032
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	39.643	Venta	USD	25.850		(70)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	JPY	106.441	Venta	USD	710		1
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CNH	18.883	Venta	USD	2.629		(7)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NOK	45.396	Venta	USD	4.268		8
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CHF	15.422	Venta	USD	17.783		(315)
02 de abril de 2024	BNY Mellon	Compra	BRL	138.752	Venta	USD	27.822		(7)
10 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	5.535	Venta	ZAR	103.620		152
19 de abril de 2024	Bank of America Merrill Lynch	Compra	USD	12.966	Venta	IDR	204.131.597		(10)
19 de abril de 2024	Bank of America Merrill Lynch	Compra	USD	12.941	Venta	INR	1.080.186		(62)
19 de abril de 2024	Bank of America Merrill Lynch	Compra	CNH	94.257	Venta	USD	13.153		(31)
19 de abril de 2024	BNP Paribas	Compra	USD	31.912	Venta	NOK	332.188		597
19 de abril de 2024	BNP Paribas	Compra	NOK	332.188	Venta	USD	32.524		(1.208)
19 de abril de 2024	Citi	Compra	USD	3.026	Venta	BRL	14.996		25
19 de abril de 2024	Citi	Compra	USD	31.978	Venta	EUR	29.019		548
19 de abril de 2024	Citi	Compra	USD	2.475	Venta	EUR	2.300		(16)
19 de abril de 2024	Citi	Compra	USD	24.796	Venta	GBP	19.455		231
19 de abril de 2024	Citi	Compra	USD	3.936	Venta	JPY	575.000		68
19 de abril de 2024	Citi	Compra	USD	869	Venta	JPY	130.000		(5)
19 de abril de 2024	Citi	Compra	USD	2.178	Venta	MXN	37.833		(24)
19 de abril de 2024	Citi	Compra	USD	27.823	Venta	TWD	846.706		867
19 de abril de 2024	Citi	Compra	EUR	2.400	Venta	USD	2.640		(41)
19 de abril de 2024	Citi	Compra	TWD	46.220	Venta	USD	1.478		(7)
19 de abril de 2024	Citi	Compra	EUR	8.481	Venta	USD	9.162		24
19 de abril de 2024	Citi	Compra	JPY	780.000	Venta	USD	5.378		(132)
19 de abril de 2024	Citi	Compra	JPY	460.000	Venta	USD	3.088		6
19 de abril de 2024	Citi	Compra	GBP	1.400	Venta	USD	1.786		(18)
19 de abril de 2024	Citi	Compra	AUD	91.376	Venta	USD	61.095		(1.605)
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	3.221	Venta	CHF	2.820		15
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	13.130	Venta	GBP	10.315		106
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	23.589	Venta	JPY	3.361.205		984
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	70.090	Venta	PLN	277.690		590
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	CHF	2.150	Venta	USD	2.442		4
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	ZAR	17.225	Venta	USD	914		(19)
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	21.410	Venta	ZAR	401.701		558
19 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	USD	16.269	Venta	CNH	116.055		111
19 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	USD	72.517	Venta	IDR	1.122.565.074		1.157
19 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	USD	104.001	Venta	MXN	1.788.305		(55)
19 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	KRW	30.410.325	Venta	USD	23.319		(480)
19 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	MXN	235.945	Venta	USD	13.643		86
19 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	3.500	Venta	BRL	17.268		44
19 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	1.910	Venta	CAD	2.558		24
19 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	99.837	Venta	INR	8.333.393		(475)
19 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	BRL	158.167	Venta	USD	32.001		(346)
19 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	JPY	1.453.762	Venta	USD	10.105		(328)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 21.504 $)								$	8.511
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (43.616) $)									(6.458)
Apreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (22.112) $)								$	2.053

^ *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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

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	Bank of America Merrill Lynch	(6.332)	$ (1.498.270)	$ (1.398)
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2025	Bank of America Merrill Lynch	5.563	1.339.084	(5.488)
Dólar australiano Divisa Marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	28	1.819	(16)
Libra británica Divisa Marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	(190)	(14.979)	61
Euribor 3 Meses Diciembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	(426)	(111.635)	699
Euribor 3 Meses Marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	(7.682)	(1.994.415)	5.304
Euro FX Currency marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	(425)	(57.423)	474
Euro-BTP marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	(324)	(41.258)	(169)
Eurobono Junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	(851)	(121.648)	304
Euro-Bund marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	2.358	338.062	(2.376)
Bonos Euro-Buxl a 30 años marzo de 2024	Bank of America Merrill Lynch	242	34.829	179
Bono a 10 años de Japón (OSE) marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	(573)	(559.011)	(3.684)
Euro FX Yen japonés Divisa Marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	933	77.975	(3.053)
Long Gilt junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	477	59.062	390
Peso mexicano Divisa Marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	4.233	123.794	3.243
U.S. 10 Year Note (CBT) junio de 2024	Bank of America Merrill Lynch	1.880	207.623	372
U.S. 10 Year Ultra Note junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	(7.365)	(840.876)	(3.415)
U.S. 2 Year Note (CBT) junio de 2024	Bank of America Merrill Lynch	2.859	585.380	(33)
U.S. 5 Year Note (CBT) junio de 2024	Bank of America Merrill Lynch	1.891	202.160	(30)
U.S. Long Bond (CBT) junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	5.840	696.420	5.136
U.S. Ultra Bond (CBT) junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	2.061	263.550	2.082
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 20.467 $)				$ 18.244
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (47.194) $)				(19.662)
Depreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (26.727) $)				$ (1.418)

^ *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 al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por activos: 11,37 % (28 de febrero de 2023: 14,21 %)			
500	AB BSL CLO 2 Ltd, Serie 2021 2A, Clase D, 144A, 8,926 %, con vencimiento el 15/04/2034 *	496	0,13
250	AB BSL CLO 4 Ltd, Serie 2023 4A, Clase A, 144A, 7,318 %, con vencimiento el 20/04/2036 *	253	0,07
67	ABFC 2003-OPT1 Trust, Serie 2003 OPT1, Clase A3, 6,115 %, con vencimiento el 25/04/2033 *	65	0,02
1.274	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Serie 2005-HE3, Serie 2005 HE3, Clase M4, 6,380 %, con vencimiento el 25/05/2035 *	1.112	0,30
578	Aegis Asset Backed Sec Corp Mort Pass Thr Certs Serie 2005-4, Serie 2005 4, Clase M2, 6,140 %, con vencimiento el 25/10/2035 *	537	0,14
950	AGL CLO 12 Ltd, Serie 2021 12A, Clase D, 144A, 8,429 %, con vencimiento el 20/07/2034 *	946	0,25
450	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd, Serie 2014 3RA, Clase E, 144A, 11,081 %, con vencimiento el 28/01/2031 *	430	0,12
480	Bain Capital Credit CLO 2022-2 Ltd, Serie 2022 2A, Clase D1, 144A, 8,968 %, con vencimiento el 22/04/2035 *	480	0,13
660	Bain Capital Credit CLO 2023-1 Ltd, Serie 2023 1A, Clase AN, 144A, 7,144 %, con vencimiento el 16/04/2036 *	664	0,18
1.380	Ballyrock CLO 19 Ltd, Serie 2022 19A, Clase D, 144A, 12,428 %, con vencimiento el 20/04/2035 *	1.360	0,37
1.225	Ballyrock CLO 2018-1 Ltd, Serie 2018 1A, Clase C, 144A, 8,729 %, con vencimiento el 20/04/2031 *	1.226	0,33
720	Barings CLO Ltd 2016-II, Serie 2016 2A, Clase ER2, 144A, 12,079 %, con vencimiento el 20/01/2032 *	707	0,19
376	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-CL1, Serie 2005 CL1, Clase A1, 3,586 %, con vencimiento el 25/09/2034 *	367	0,10
520	Birch Grove CLO 6 Ltd, Serie 2023 6A, Clase D, 144A, 11,148 %, con vencimiento el 20/07/2035 *	538	0,15
1.094	Black Diamond Clo 2019-2 Ltd, Serie 2019 2A, Clase A1A, 144A, 7,007 %, con vencimiento el 23/07/2032 *	1.092	0,29
940	BlueMountain CLO XXII Ltd, Serie 2018 22A, Clase A1, 144A, 6,656 %, con vencimiento el 15/07/2031 *	942	0,25
720	CarVal CLO VII-C Ltd, Serie 2023 1A, Clase A1, 144A, 7,518 %, con vencimiento el 20/01/2035 *	722	0,19
410	CarVal CLO VII-C Ltd, Serie 2023 1A, Clase D, 144A, 11,118 %, con vencimiento el 20/01/2035 *	415	0,11
850	CIFC Funding 2018-I Ltd, Serie 2018 1A, Clase C, 144A, 7,310 %, con vencimiento el 18/04/2031 *	851	0,23
915	Credit Suisse European Mortgage Capital Ltd, Serie 2019 1OTF, Clase A, 144A, 8,479 %, con vencimiento el 09/08/2024 *	913	0,24
13	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Serie 2005-D, Serie 2005 D, Clase 2A, 5,622 %, con vencimiento el 15/11/2035 *	12	–
1.268	Educational Funding Co LLC/The, Serie 2006 1A, Clase A3, 144A, 5,936 %, con vencimiento el 25/04/2033 *	774	0,21
600	Empower CLO 2023-3 Ltd, Serie 2023 3A, Clase D1, 144A, 10,485 %, con vencimiento el 20/01/2037 *	614	0,17
660	Encore Credit Receivables Trust 2005-2, Serie 2005 2, Clase M4, 6,365 %, con vencimiento el 25/11/2035 *	606	0,16
1.119	FOCUS Brands Funding LLC, Serie 2017 1A, Clase A2II, 144A, 5,093 %, con vencimiento el 30/04/2047	1.088	0,29
250	Goldentree Loan Management US Clo 2 Ltd, Serie 2017 2A, Clase C, 144A, 7,379 %, con vencimiento el 28/11/2030 *	250	0,07
850	Goldentree Loan Management US Clo 3 Ltd, Serie 2018 3A, Clase D, 144A, 8,429 %, con vencimiento el 20/04/2030 *	849	0,23
1.000	Golub Capital Partners CLO 21M Ltd, Serie 2014 21A, Clase CR, 144A, 8,036 %, con vencimiento el 25/01/2031 *	991	0,27
750	Golub Capital Partners CLO 53B Ltd, Serie 2021 53A, Clase E, 144A, 12,279 %, con vencimiento el 20/07/2034 *	749	0,20
300	Golub Capital Partners CLO 66B Ltd, Serie 2023 66A, Clase A, 144A, 7,275 %, con vencimiento el 25/04/2036 *	302	0,08
250	Greenwood Park CLO Ltd, Serie 2018 1A, Clase E, 144A, 10,526 %, con vencimiento el 15/04/2031 *	236	0,06
1.000	Grippen Park CLO Ltd, Serie 2017 1A, Clase D, 144A, 8,879 %, con vencimiento el 20/01/2030 *	1.001	0,27
1.700	Harriman Park CLO Ltd, Serie 2020 1A, Clase ER, 144A, 11,979 %, con vencimiento el 20/04/2034 *	1.705	0,46
607	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Serie INABS 2005-C, Serie 2005 C, Clase M2, 6,185 %, con vencimiento el 25/10/2035 *	593	0,16
247	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Serie INABS 2005-D, Serie 2005 D, Clase AII4, 6,135 %, con vencimiento el 25/03/2036 *	244	0,07
750	Katayma CLO I Ltd, Serie 2023 1A, Clase D, 144A, 10,568 %, con vencimiento el 20/10/2036 *	759	0,20
205	Loanpal Solar Loan Ltd, Serie 2020 3GS, Clase B, 144A, 3,450 %, con vencimiento el 20/12/2047	158	0,04
207	Long Beach Mortgage Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Clase M4, 6,710 %, con vencimiento el 25/02/2035 *	202	0,05
1.000	Magnetite XII Ltd, Serie 2015 12A, Clase ER, 144A, 11,256 %, con vencimiento el 15/10/2031 *	972	0,26
1.270	Marble Point CLO XIV Ltd, Serie 2018 2A, Clase D, 144A, 9,109 %, con vencimiento el 20/01/2032 *	1.232	0,33
507	Mastr Asset Backed Securities Trust 2007-HE2, Serie 2007 HE2, Clase A1, 6,585 %, con vencimiento el 25/08/2037 *	431	0,12
500	Midocean Credit Clo VIII, Serie 2018 8A, Clase D, 144A, 8,481 %, con vencimiento el 20/02/2031 *	493	0,13
316	Mosaic Solar Loan Trust 2018-1, Serie 2018 1A, Clase CERT, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 22/06/2043 ∞	115	0,03
1.177	Mosaic Solar Loan Trust 2022-1, Serie 2022 1A, Clase B, 144A, 3,160 %, con vencimiento el 20/01/2053	958	0,26
710	National Collegiate II Commutation Trust, Serie 2005 AR15, Clase AR15, 0,000 %, con vencimiento el 01/06/2045	65	0,02
493	National Collegiate Student Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Clase B, 5,815 %, con vencimiento el 26/03/2035 *	453	0,12
54	National Collegiate Student Loan Trust 2006-1, Serie 2006 1, Clase A5, 5,785 %, con vencimiento el 25/03/2033 *	52	0,01
790	National Collegiate Student Loan Trust 2006-3, Serie 2006 3, Clase B, 5,795 %, con vencimiento el 26/01/2032 *	657	0,18
625	National Collegiate Student Loan Trust 2007-2, Serie 2007 2, Clase A4, 5,725 %, con vencimiento el 25/01/2033 *	597	0,16
1.302	National Collegiate V Commutation Trust, Serie 2007 33A6, Clase 1O, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 25/03/2038 *	272	0,07
2.291	National Collegiate VI 2007-4 Clase A-3L Commutation Trust, Serie 2007 4VI, Clase O, 144A, 6,285 %, con vencimiento el 29/03/2038 *†	355	0,10
1.000	Ocean Trails CLO V, Serie 2014 5A, Clase DRR, 144A, 9,026 %, con vencimiento el 13/10/2031 *	943	0,25
600	Ocean Trails Clo X, Serie 2020 10A, Clase AR, 144A, 6,796 %, con vencimiento el 15/10/2034 *	600	0,16
300	Ocean Trails Clo X, Serie 2020 10A, Clase ER, 144A, 13,146 %, con vencimiento el 15/10/2034 *	289	0,08
650	OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 35 Ltd, Serie 2018 1A, Clase C, 144A, 8,179 %, con vencimiento el 20/01/2031 *	626	0,17
310	OHA Credit Funding 14 Ltd, Serie 2023 14A, Clase D, 144A, 10,068 %, con vencimiento el 20/04/2036 *	314	0,08
940	Option One Mortgage Loan Trust 2005-3, Serie 2005 3, Clase M4, 6,365 %, con vencimiento el 25/08/2035 *	759	0,20
248	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Serie 2007 FXD1, Clase 1A1, 5,866 %, con vencimiento el 25/01/2037	201	0,05
499	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Serie 2007 FXD1, Clase 2A1, 5,866 %, con vencimiento el 25/01/2037	414	0,11
578	RAMP Serie 2006-NC3 Trust, Serie 2006 NC3, Clase M1, 5,945 %, con vencimiento el 25/03/2036 *	560	0,15
320	SMB Private Education Loan Trust 2015-C, Serie 2015 C, Clase C, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 17/09/2046	301	0,08
1.140	Sunrun Athena Issuer 2018-1 LLC, Serie 2018 1, Clase A, 144A, 5,310 %, con vencimiento el 30/04/2049	1.087	0,29
500	Trinitas CLO XXV Ltd, Serie 2023 25A, Clase C1, 144A, 8,581 %, con vencimiento el 23/01/2037 *	504	0,14
990	Valley Stream Park CLO Ltd, Serie 2022 1A, Clase DR, 144A, 9,468 %, con vencimiento el 20/10/2034 *	1.001	0,27
718	Voya CLO 2016-3 Ltd, Serie 2016 3A, Clase A1R, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 18/10/2031 *	719	0,19
616	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Serie 2007-HE4 Trust, Serie 2007 HE4, Clase 1A, 5,605 %, con vencimiento el 25/07/2047 *	441	0,12
950	Warwick Capital CLO 1 Ltd, Serie 2023 1A, Clase D, 144A, 11,012 %, con vencimiento el 20/10/2036 *	965	0,26
750	Wellington Management Clo 2 Ltd, Serie 2024 2A, Clase D, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 20/04/2037 *	753	0,20
Total de valores garantizados por activos (coste 43.638 $)		42.378	11,37
Valores garantizados por hipotecas: 14,39 % (28 de febrero de 2023: 12,42 %)			
1.000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust, Serie 2017 280P, Clase D, 144A, 7,158 %, con vencimiento el 15/09/2034 *	930	0,25
261	Alternative Loan Trust 2007-4CB, Serie 2007 4CB, Clase 1A5, 5,750 %, con vencimiento el 25/04/2037	213	0,06
167	BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Serie 2016 GG10, Clase AJA, 144A, 5,630 %, con vencimiento el 10/08/2045 *	36	0,01
525	Banc of America Funding Corp, Serie 2015 R3, Clase 1A2, 144A, 3,465 %, con vencimiento el 27/03/2036 *	434	0,12
1.430	BANK 2017-BNK7, Serie 2017 BNK7, Clase A4, 3,175 %, con vencimiento el 15/09/2060	1.345	0,36
140	BBCCRE Trust 2015-GTP, Serie 2015 GTP, Clase D, 144A, 4,563 %, con vencimiento el 10/08/2033 *	116	0,03
752	BHMS 2018-ATLS, Serie 2018 ATLS, Clase C, 144A, 7,515 %, con vencimiento el 15/07/2035 *	736	0,20
760	BX Trust 2021-VIEW, Serie 2021 VIEW, Clase C, 144A, 7,782 %, con vencimiento el 15/06/2036 *	731	0,20
266	BXMT 2020-FL2 Ltd, Serie 2020 FL2, Clase A, 144A, 6,336 %, con vencimiento el 15/02/2038 *	255	0,07

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

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
714	Chase Mortgage Finance Trust Serie 2007-A1, Serie 2007 A1, Clase 11M1, 4,321 %, con vencimiento el 25/03/2037 *	653	0,18
430	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, Serie 2014 GC23, Clase C, 4,420 %, con vencimiento el 10/07/2047 *	407	0,11
790	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC29, Serie 2015 GC29, Clase B, 3,758 %, con vencimiento el 10/04/2048 *	760	0,20
409	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-P1, Serie 2015 P1, Clase D, 144A, 3,225 %, con vencimiento el 15/09/2048	351	0,09
20.047	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C3, Serie 2016 C3, Clase XA, 0,982 %, con vencimiento el 15/11/2049 *	413	0,11
1.400	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Serie 2017 P8, Clase A3, 3,203 %, con vencimiento el 15/09/2050	1.307	0,35
31.587	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Serie 2017 P8, Clase XA, 0,866 %, con vencimiento el 15/09/2050 *	730	0,20
586	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2018-C5, Serie 2018 C5, Clase A3, 3,963 %, con vencimiento el 10/06/2051	557	0,15
710	COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Serie 2015 DC1, Clase C, 4,274 %, con vencimiento el 10/02/2048 *	613	0,16
490	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R03, Serie 2019 R03, Clase 1B1, 144A, 9,536 %, con vencimiento el 25/09/2031 *	521	0,14
356	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Serie 2019 R07, Clase 1B1, 144A, 8,836 %, con vencimiento el 25/10/2039 *	368	0,10
260	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Serie 2020 R01, Clase 1B1, 144A, 8,686 %, con vencimiento el 25/01/2040 *	268	0,07
723	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Clase 1B1, 144A, 8,422 %, con vencimiento el 25/10/2041 *	740	0,20
670	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Clase 1M2, 144A, 6,872 %, con vencimiento el 25/10/2041 *	673	0,18
190	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Serie 2021 R03, Clase 1B1, 144A, 8,072 %, con vencimiento el 25/12/2041 *	193	0,05
700	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, Serie 2022 R04, Clase 1M2, 144A, 8,422 %, con vencimiento el 25/03/2042 *	729	0,20
250	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05, serie 2023 R05, clase 1M2, 144A, 8,421 %, con vencimiento el 25/06/2043 *	262	0,07
940	Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01, Serie 2024 R01, Clase 1B1, 144A, 8,022 %, con vencimiento el 25/01/2044 *	946	0,25
420	Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01, Serie 2024 R01, Clase 1M2, 144A, 7,122 %, con vencimiento el 25/01/2044 *	422	0,11
1.160	CSAIL 2015-C3 Commercial Mortgage Trust, Serie 2015 C3, Clase C, 4,350 %, con vencimiento el 15/08/2048 *	974	0,26
940	CSAIL 2016-C5 Commercial Mortgage Trust, Serie 2016 C5, Clase A5, 3,757 %, con vencimiento el 15/11/2048	909	0,24
360	CSAIL 2017-C8 Commercial Mortgage Trust, Serie 2017 C8, Clase C, 4,265 %, con vencimiento el 15/06/2050 *	300	0,08
350	CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust, Serie 2018 CX12, Clase C, 4,720 %, con vencimiento el 15/08/2051 *	306	0,08
1.480	CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Clase F, 144A, 4,373 %, con vencimiento el 15/09/2037	650	0,17
630	CSMC Trust 2017-CHOP, Serie 2017 CHOP, Clase F, 144A, 9,794 %, con vencimiento el 15/07/2032 *	563	0,15
420	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust, Serie 2018 BIOD, Clase D, 144A, 6,914 %, con vencimiento el 15/05/2035 *	416	0,11
571	DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Serie 2007 AR1, Clase 1A1B, 5,574 %, con vencimiento el 19/04/2047 *	473	0,13
630	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C07, Clase 1B1, 9,436 %, con vencimiento el 25/05/2030 *	681	0,18
950	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Clase 1B1, 8,986 %, con vencimiento el 25/07/2030 *	1.015	0,27
84	Fannie Mae Pool 'CB3880', 5,000 %, con vencimiento el 01/06/2052	82	0,02
68	First Franklin Mortgage Loan Trust 2003-FF4, Serie 2003 FF4, Clase M1, 7,243 %, con vencimiento el 25/10/2033 *	65	0,02
520	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA1, Serie 2020 DNA1, Clase B1, 144A, 7,736 %, con vencimiento el 25/01/2050 *	541	0,15
326	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA2, Serie 2021 DNA2, Clase M2, 144A, 7,622 %, con vencimiento el 25/08/2033 *	333	0,09
125	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Serie 2020 DNA3, Clase B1, 144A, 10,536 %, con vencimiento el 25/06/2050 *	138	0,04
500	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA5, Serie 2020 DNA5, Clase B1, 144A, 10,122 %, con vencimiento el 25/10/2050 *	564	0,15
680	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA6, Serie 2020 DNA6, Clase B1, 144A, 8,322 %, con vencimiento el 25/12/2050 *	714	0,19
580	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, Serie 2021 DNA3, Clase B1, 144A, 8,822 %, con vencimiento el 25/10/2033 *	638	0,17
600	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Serie 2021 DNA5, Clase B1, 144A, 8,372 %, con vencimiento el 25/01/2034 *	633	0,17
680	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Serie 2021 DNA6, Clase B1, 144A, 8,722 %, con vencimiento el 25/10/2041 *	701	0,19
710	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2, Serie 2022 DNA2, Clase B1, 144A, 10,072 %, con vencimiento el 25/02/2042 *	745	0,20
710	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2, Serie 2022 DNA2, Clase M2, 144A, 9,072 %, con vencimiento el 25/02/2042 *	742	0,20
230	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA6, Serie 2022 DNA6, Clase M2, 144A, 11,072 %, con vencimiento el 25/09/2042 *	258	0,07
492	Freddie Mac STACR Securitized Participation Interests Trust 2017-SPI1, Serie 2017 SPI1, Clase B, 144A, 4,115 %, con vencimiento el 25/09/2047 *	341	0,09
1.000	FS Rialto 2022-FL6 Issuer LLC, Serie 2022 FL6, Clase A, 144A, 7,896 %, con vencimiento el 17/08/2037 *	1.005	0,27
590	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-375H, Serie 2017 375H, Clase A, 144A, 3,475 %, con vencimiento el 10/09/2037 *	535	0,14
454	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Clase C, 144A, 9,615 %, con vencimiento el 15/09/2031 *	107	0,03
1.000	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC30, Serie 2015 GC30, Clase D, 3,384 %, con vencimiento el 10/05/2050	777	0,21
240	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC32, Serie 2015 GC32, Clase D, 3,345 %, con vencimiento el 10/07/2048	209	0,06
52	GSMPS Mortgage Loan Trust 2006-RP1, Serie 2006 RP1, Clase 1A2, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 25/01/2036	45	0,01
565	HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Serie 2021 FL1, Clase C, 144A, 7,136 %, con vencimiento el 16/06/2036 *	543	0,15
170	HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Serie 2021 FL1, Clase D, 144A, 7,786 %, con vencimiento el 16/06/2036 *	160	0,04
700	Hilton USA Trust 2016-HHV, Serie 2016 HHV, Clase D, 144A, 4,194 %, con vencimiento el 05/11/2038 *	655	0,18
1.183	Impac Secured Assets Trust 2006-3, Serie 2006 3, Clase A7, 5,975 %, con vencimiento el 25/11/2036 *	972	0,26
725	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR10, Serie 2005 AR10, Clase A2, 6,015 %, con vencimiento el 25/06/2035 *	534	0,14
1.010	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, 0,000 %, con vencimiento el 15/06/2035 †ε	13	–
340	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-NINE, Serie 2016 NINE, Clase A, 144A, 2,854 %, con vencimiento el 06/09/2038 *	316	0,08
100	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1, Serie 2015 JP1, Clase C, 4,723 %, con vencimiento el 15/01/2049 *	89	0,02
900	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Serie 2018 WPT, Clase FFL, 144A, 8,463 %, con vencimiento el 05/07/2033 *	603	0,16
280	JP Morgan Resecuritization Trust Serie 2009-10, Serie 2009 10, Clase 7A2, 144A, 5,829 %, con vencimiento el 26/02/2037 *	116	0,03
500	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C27, Serie 2015 C27, Clase A4, 3,753 %, con vencimiento el 15/12/2047	483	0,13
1.120	Morgan Stanley Capital I Trust 2015-UBS8, Serie 2015 UBS8, Clase C, 4,559 %, con vencimiento el 15/12/2048 *	953	0,26
381	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP, Serie 2018 MP, Clase A, 144A, 4,276 %, con vencimiento el 11/07/2040 *	339	0,09
1.367	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2005-2AR, Serie 2005 2AR, Clase B1, 5,935 %, con vencimiento el 25/04/2035 *	1.025	0,27
880	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Clase D, 144A, 4,398 %, con vencimiento el 15/08/2036 *	554	0,15
361	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Clase E, 144A, 4,398 %, con vencimiento el 15/08/2036 *	191	0,05
1.170	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Serie 2016 3A, Clase B2, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 25/09/2056 *	1.091	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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
370	New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Serie 2021 NQ2R, Clase A3, 144A, 1,353 %, con vencimiento el 25/10/2058 *	334	0,09
387	Nomura Resecuritization Trust 2015-4R, Serie 2015 4R, Clase 2A2, 144A, 2,694 %, con vencimiento el 26/10/2036 *	336	0,09
905	OBX 2024-NQM1 Trust, Serie 2024 NQM1, Clase A3, 144A, 6,455 %, con vencimiento el 25/11/2063	905	0,24
441	PMT Credit Risk Transfer Trust 2019-3R, Serie 2019 3R, Clase A, 144A, 9,135 %, con vencimiento el 27/11/2031 *	440	0,12
227	PMT Credit Risk Transfer Trust, 144A, 9,135 %, con vencimiento el 29/10/2024 *	226	0,06
535	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2016-1, Serie 2016 1, Clase M2, 144A, 3,750 %, con vencimiento el 25/09/2055 *	480	0,13
188	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-1, Serie 2017 1, Clase M1, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 25/01/2056 *	187	0,05
1.042	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-1, Serie 2018 1, Clase M, 4,750 %, con vencimiento el 25/05/2057 *	1.000	0,27
909	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-2, Serie 2018 2, Clase BX, 4,127 %, con vencimiento el 25/11/2057 *	320	0,09
244	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-3, Serie 2018 3, Clase M, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 25/08/2057 *	225	0,06
790	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-4, Serie 2018 4, Clase M, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 25/03/2058	725	0,19
370	Sequoia Mortgage Trust 2007-2, Serie 2007 2, Clase 1A3, 6,074 %, con vencimiento el 20/06/2036 *	339	0,09
250	Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Clase C, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/11/2027 *	26	0,01
1.410	Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Clase D, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/11/2027 *	56	0,02
1.450	Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Clase E, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/11/2027 *†	7	–
850	Towd Point Mortgage Trust 2015-5, Serie 2015 5, Clase B3, 144A, 4,009 %, con vencimiento el 25/05/2055 *	773	0,21
322	Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Clase A3, 144A, 6,319 %, con vencimiento el 25/05/2068	321	0,09
847	Verus Securitization Trust 2023-8, Serie 2023 8, Clase A3, 144A, 6,968 %, con vencimiento el 25/12/2068	852	0,23
870	Verus Securitization Trust 2023-8, Serie 2023 8, Clase M1, 144A, 7,454 %, con vencimiento el 25/12/2068 *	876	0,24
854	Verus Securitization Trust 2023-INV3, Serie 2023 INV3, Clase A3, 144A, 7,732 %, con vencimiento el 25/11/2068 *	870	0,23
96	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR17 Trust, Serie 2005 AR17, Clase A1C3, 6,395 %, con vencimiento el 25/12/2045 *	58	0,02
2.195	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR2 Trust, Serie 2005 AR2, Clase B1, 6,230 %, con vencimiento el 25/01/2045 *	1.839	0,49
296	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2006-AR13 Trust, Serie 2006 AR13, Clase 2A, 6,581 %, con vencimiento el 25/10/2046 *	263	0,07
774	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2006-AR16 Trust, Serie 2006 AR16, Clase 2A2, 4,335 %, con vencimiento el 25/12/2036 *	665	0,18
122	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2006-AR3 Trust, Serie 2006 AR3, Clase A1B, 6,081 %, con vencimiento el 25/02/2046 *	105	0,03
651	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28, Serie 2015 C28, Clase D, 4,080 %, con vencimiento el 15/05/2048 *	546	0,15
707	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C38, Serie 2017 C38, Clase A4, 3,190 %, con vencimiento el 15/07/2050	667	0,18
417	Wells Fargo Mortgage Backed Securities 2006-AR5 Trust, Serie 2006 AR5, Clase 2A1, 5,099 %, con vencimiento el 25/04/2036 *	385	0,10
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 57,103 $)		53.632	14,39
Bonos y obligaciones corporativos: 58,98 % (28 de febrero de 2023: 59,17 %)			
Argentina: 0,17 % (28 de febrero de 2023: 0,35 %)			
290	YPF SA, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 28/07/2025	283	0,07
420	YPF SA, 144A, 6,950 %, con vencimiento el 21/07/2027	370	0,10
		653	0,17
Bélgica: 0,29 % (28 de febrero de 2023: 0,37 %)			
EUR 1.000	KBC Group NV, 4,750 %, Perpetuo *	1.081	0,29
Paraguay: 0,44 % (28 de febrero de 2023: 0,38 %)			
1.630	Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, con vencimiento el 15/10/2025	1.629	0,44
Brasil: 0,70 % (28 de febrero de 2023: 1,03 %)			
460	B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 20/09/2031	402	0,11
370	MercadoLibre Inc, 3,125 %, con vencimiento el 14/01/2031	310	0,09
490	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, con vencimiento el 05/06/2115	458	0,12
870	Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125 %, con vencimiento el 15/01/2032	715	0,19
670	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, con vencimiento el 10/11/2039	718	0,19
		2.603	0,70
Canadá: 2,96 % (28 de febrero de 2023: 2,18 %)			
870	Air Canada, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2026	825	0,22
900	Bank of Nova Scotia/The, 8,000 %, con vencimiento el 27/01/2084 *	911	0,25
860	Bombardier Inc, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 15/04/2027	862	0,23
250	Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 15/01/2028	242	0,07
CAD 420	Doman Building Materials Group Ltd, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 15/05/2026	297	0,08
370	GFL Environmental Inc, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 15/12/2026	362	0,10
1.640	GFL Environmental Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/06/2029	1.537	0,41
730	GFL Environmental Inc, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 15/01/2031	747	0,20
280	Hudbay Minerals Inc, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 01/04/2026	270	0,07
460	Hudbay Minerals Inc, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 01/04/2029	452	0,12
440	MEG Energy Corp, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 01/02/2027	447	0,12
1.130	MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 01/02/2029	1.103	0,30
500	Open Text Corp, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/02/2028	460	0,12
270	Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 15/02/2030	239	0,06
250	Superior Plus LP / Superior General Partner Inc, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 15/03/2029	226	0,06
600	Toronto-Dominion Bank/The, 8,125 %, con vencimiento el 31/10/2082 *	626	0,17
250	TransAlta Corp, 7,750 %, con vencimiento el 15/11/2029	260	0,07
1.160	TransAlta Corp, 6,500 %, con vencimiento el 15/03/2040	1.151	0,31
		11.017	2,96
Islas Caimán: 0,36 % (28 de febrero de 2023: 0,42 %)			
1.416	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 15/09/2024	1.347	0,36
China: 0,14 % (28 de febrero de 2023: 0,30 %)			
600	Country Garden Holdings Company Limited, 0,000 %, con vencimiento el 27/01/2025 †ε	52	0,02
570	Prosus NV, 144A, 3,061 %, con vencimiento el 13/07/2031	460	0,12
		512	0,14
Colombia: 0,25 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
940	Ecopetrol SA, 8,375 %, con vencimiento el 19/01/2036	944	0,25
Dinamarca: 0,21 % (28 de febrero de 2023: 0,29 %)			
800	Danske Bank A/S, 144A, 6,466 %, con vencimiento el 09/01/2026 *	803	0,21
Francia: 1,09 % (28 de febrero de 2023: 0,74 %)			
200	Altice France SA/France, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 01/02/2027	184	0,05
1.090	Altice France SA/France, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 15/07/2029	825	0,22
600	Banijay Entertainment SASU, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 01/05/2029	621	0,17
550	BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, Perpetuo *	555	0,15
1.830	Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Perpetuo *	1.870	0,50
		4.055	1,09
Alemania: 0,53 % (28 de febrero de 2023: 0,78 %)			
320	Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/01/2028	301	0,08
EUR 100	Nidda BondCo GmbH, 5,000 %, con vencimiento el 30/09/2025	107	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 Multi-Asset Credit Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Alemania (continuación)			
330	TK Elevator US Newco Inc, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 15/07/2027	318	0,08
950	ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 29/04/2025	937	0,25
310	ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 14/04/2030	323	0,09
		1.986	0,53
Paraguay: 0,17 % (28 de febrero de 2023: 0,11 %)			
315	Millicom International Cellular SA, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 25/03/2029	306	0,08
363	Millicom International Cellular SA, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 27/04/2031	314	0,09
		620	0,17
Hong Kong: 0,24 % (28 de febrero de 2023: 0,29 %)			
230	Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 06/06/2025	225	0,06
730	Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 04/12/2029	657	0,18
		882	0,24
Irlanda: 0,25 % (28 de febrero de 2023: 0,33 %)			
630	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, con vencimiento el 30/01/2032	533	0,14
420	Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 15/04/2026	405	0,11
		938	0,25
Israel: 0,70 % (28 de febrero de 2023: 0,50 %)			
650	Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, con vencimiento el 01/02/2036	621	0,17
520	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, con vencimiento el 01/10/2026	482	0,13
500	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, con vencimiento el 09/05/2027	476	0,13
590	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, con vencimiento el 09/05/2029	558	0,15
680	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,100 %, con vencimiento el 01/10/2046	461	0,12
		2.598	0,70
Italia: 0,80 % (28 de febrero de 2023: 0,46 %)			
475	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, con vencimiento el 15/01/2026	471	0,13
1.280	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 7,800 %, con vencimiento el 28/11/2053	1.385	0,37
530	UniCredit SpA, 144A, 7,296 %, con vencimiento el 02/04/2034 *	541	0,14
640	UniCredit SpA, 144A, 5,459 %, con vencimiento el 30/06/2035 *	592	0,16
		2.989	0,80
Kazajistán: 0,24 % (28 de febrero de 2023: 0,20 %)			
690	KazMunayGas National Co JSC, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 19/04/2027	668	0,18
230	QazaqGaz NC JSC, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 26/09/2027	215	0,06
		883	0,24
Kuwait: 0,14 % (28 de febrero de 2023: 0,27 %)			
530	MEGlobal Canada ULC, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 18/05/2030	535	0,14
Luxemburgo: 0,73 % (28 de febrero de 2023: 0,94 %)			
620	Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/08/2029	535	0,14
1.650	Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 15/05/2027	1.079	0,29
500	ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 30/06/2027	214	0,06
GBP 740	Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, con vencimiento el 01/04/2028	904	0,24
		2.732	0,73
Macao: 0,82 % (28 de febrero de 2023: 0,82 %)			
270	Sands China Ltd, 5,125 %, con vencimiento el 08/08/2025	266	0,07
270	Sands China Ltd, 2,550 %, con vencimiento el 08/03/2027	243	0,06
480	Sands China Ltd, 5,400 %, con vencimiento el 08/08/2028	469	0,13
200	Sands China Ltd, 3,100 %, con vencimiento el 08/03/2029	173	0,05
200	Sands China Ltd, 3,250 %, con vencimiento el 08/08/2031	167	0,04
1.770	Wynn Macau Ltd, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 01/10/2024	1.754	0,47
		3.072	0,82
Malasia: 0,14 % (28 de febrero de 2023: 0,12 %)			
790	Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, con vencimiento el 19/08/2050	531	0,14
México: 0,27 % (28 de febrero de 2023: 0,35 %)			
1.020	Banco Mercantil del Norte SA/Gran Caimán, 144A, 7,500 %, Perpetuo *	1.000	0,27
Países Bajos: 0,55 % (28 de febrero de 2023: 0,48 %)			
EUR 400	Cooperatieve Rabobank UA, 4,875 %, Perpetuo *	397	0,11
EUR 1.400	Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, Perpetuo *	1.466	0,39
GBP 130	GTCR W-2 Merger Sub LLC / GTCR W Dutch Finance Sub BV, 8,500 %, con vencimiento el 15/01/2031	177	0,05
		2.040	0,55
Perú: 0,04 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
200	Petroleos del Peru SA, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 19/06/2047	137	0,04
Singapur: 0,06 % (28 de febrero de 2023: 0,08 %)			
220	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4,250 %, con vencimiento el 19/06/2024	219	0,06
Sudáfrica: 0,07 % (28 de febrero de 2023: 0,09 %)			
310	Sasol Financing USA LLC, 5,500 %, con vencimiento el 18/03/2031	258	0,07
Supranacional: 0,38 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
INR 115.000	Inter-American Development Bank, 7,350 %, con vencimiento el 06/10/2030	1.412	0,38
Suecia: 0,12 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
470	Stena International SA, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 15/01/2031	468	0,12
Suiza: 1,00 % (28 de febrero de 2023: 1,75 %)			
720	Credit Suisse AG/New York NY, 4,750 %, con vencimiento el 09/08/2024	717	0,19
250	Credit Suisse AG/New York NY, 3,625 %, con vencimiento el 09/09/2024	248	0,07
860	UBS Group AG, 144A, 7,750 %, Perpetuo *	862	0,23
890	UBS Group AG, 144A, 9,250 %, Perpetuo *	952	0,25
750	VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 01/05/2027	636	0,17
390	VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 9,500 %, con vencimiento el 01/06/2028	329	0,09
		3.744	1,00
Turquía: 0,19 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
700	Turk Telekomunikasyon AS, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 28/02/2025	700	0,19
Emiratos Árabes Unidos: 0,26 % (28 de febrero de 2023: 0,23 %)			
260	DP World Ltd/United Arab Emirates, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 25/09/2048	244	0,07
740	Shelf Drilling Holdings Ltd, 144A, 9,625 %, con vencimiento el 15/04/2029	715	0,19
		959	0,26
Reino Unido: 2,79 % (28 de febrero de 2023: 1,64 %)			
GBP 810	Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, con vencimiento el 07/04/2026	988	0,26
500	Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd, 144A, 8,375 %, con vencimiento el 15/01/2029	477	0,13
1.300	Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd, 144A, 8,750 %, con vencimiento el 15/01/2032	1.236	0,33
EUR 320	Lloyds Banking Group Plc, 4,947 %, Perpetuo *	337	0,09
600	Lloyds Banking Group Plc, 7,500 %, Perpetuo *	600	0,16
480	Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, Perpetuo *	474	0,13
1.812	Mclaren Finance Plc, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 01/08/2026	1.588	0,43
GBP 1.270	NatWest Group plc, 4,500 %, Perpetuo *	1.343	0,36
960	Neptune Energy Bondco Plc, 144A, 6,625 %, con vencimiento el 15/05/2025	959	0,26
GBP 980	Saga Plc, 5,500 %, con vencimiento el 15/07/2026	1.103	0,29
750	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/05/2029	703	0,19
200	Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 31/01/2031	170	0,04
330	Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/07/2031	286	0,08
GBP 130	Wheel Bidco Ltd, 6,750 %, con vencimiento el 15/07/2026	140	0,04
		10.404	2,79
Estados Unidos: 41,27 % (28 de febrero de 2023: 42,60 %)			
2.927	Accelerate360 Holdings LLC, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 01/03/2028	3.028	0,81
330	Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 01/05/2028	296	0,08
286	Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 01/03/2028	273	0,07
400	Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 30/09/2027	387	0,10

^ 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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
560	Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 6,375 %, con vencimiento el 15/06/2030	561	0,15
1.130	Akumin Inc, 144A, 9,000 %, con vencimiento el 01/08/2027	922	0,25
1.500	Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 15/02/2028	752	0,20
300	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,625 %, con vencimiento el 15/07/2026	299	0,08
340	Altria Group Inc, 5,950 %, con vencimiento el 14/02/2049	339	0,09
340	AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 15/02/2029	235	0,06
384	American Airlines 2017-1 Clase B Pass Through Trust, Serie B, 4,950 %, con vencimiento el 15/02/2025	378	0,10
610	American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 15/02/2028	616	0,17
480	American Airlines Inc, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/05/2029	505	0,14
23	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2026	22	0,01
1.300	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 20/04/2029	1.273	0,34
2.576	American News Co LLC, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 01/09/2026	2.869	0,77
190	Antero Resources Corp, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 01/03/2030	181	0,05
610	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 15/06/2027	600	0,16
450	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 15/08/2027	327	0,09
760	AthenaHealth Group Inc, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 15/02/2030	681	0,18
90	Aviation Capital Group LLC, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/12/2024	90	0,02
350	Ball Corp, 2,875 %, con vencimiento el 15/08/2030	297	0,08
340	Ball Corp, 3,125 %, con vencimiento el 15/09/2031	287	0,08
120	Bath & Body Works Inc, 5,250 %, con vencimiento el 01/02/2028	117	0,03
800	Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, con vencimiento el 01/10/2030	805	0,22
410	Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 01/11/2025	382	0,10
280	Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 01/02/2027	180	0,05
140	Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/01/2028	65	0,02
1.650	Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2026	1.618	0,43
320	Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 01/09/2028	303	0,08
1.190	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,625 %, con vencimiento el 15/12/2025	1.201	0,32
600	Boeing Co/The, 5,805 %, con vencimiento el 01/05/2050	579	0,16
400	Boyne USA Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/05/2029	368	0,10
1.030	Builders FirstSource Inc, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 01/02/2032	906	0,24
480	Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/04/2028	462	0,12
610	Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 9,250 %, con vencimiento el 01/07/2031	641	0,17
420	Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2030	431	0,12
1.480	Caesars Entertainment Inc, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 15/02/2032	1.492	0,40
1.000	Carnival Corp, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 01/03/2027	988	0,27
420	Carnival Corp, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 01/08/2028	388	0,10
150	Carnival Corp, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 01/06/2030	164	0,04
620	Carnival Holdings Bermuda Ltd, 144A, 10,375 %, con vencimiento el 01/05/2028	677	0,18
530	Carriage Purchaser Inc, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 15/10/2029	459	0,12
520	Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 15/05/2029	453	0,12
2.330	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 01/02/2031	1.876	0,50
380	CDW LLC / CDW Finance Corp, 4,125 %, con vencimiento el 01/05/2025	372	0,10
170	CDW LLC / CDW Finance Corp, 3,250 %, con vencimiento el 15/02/2029	152	0,04
1.410	Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 15/06/2029	1.421	0,38
80	Charles Schwab Corp/The, 2,900 %, con vencimiento el 03/03/2032	68	0,02
390	Charles Schwab Corp/The, 5,853 %, con vencimiento el 19/05/2034 *	396	0,11
320	Charter Communications Operating LLC / Charter	280	0,08
210	Communications Operating Capital, 4,400 %, con vencimiento el 01/04/2033 Charter Communications Operating LLC / Charter	181	0,05
520	Communications Operating Capital, 5,375 %, con vencimiento el 01/04/2038 Charter Communications Operating LLC / Charter	395	0,11
1.080	Capital Operativo de Comunicaciones, 5,125 %, con vencimiento 01/07/2049 Chord Energy Corp, 144A, 6,375 %, con vencimiento 01/06/2026	1.082	0,29
830	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 15/03/2027	760	0,20
1.100	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 15/01/2029	947	0,25
1.460	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 01/04/2030	915	0,25
220	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 15/05/2030	176	0,05
500	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 10,875 %, con vencimiento el 15/01/2032	510	0,14
760	Citigroup Inc, Serie P, 4,000 %, Perpetuo *	721	0,19
610	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/05/2027	614	0,17
330	Clean Harbors Inc, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 15/07/2029	318	0,09
1.110	Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 15/08/2027	1.039	0,28
570	CommScope Inc, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 01/03/2026	514	0,14
620	CommScope Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 01/09/2029	425	0,11
910	Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/01/2031	893	0,24
670	CoreCivic Inc, 8,250 %, con vencimiento el 15/04/2026 †	685	0,18
80	CoreCivic Inc, 4,750 %, con vencimiento el 15/10/2027 †	75	0,02
400	Crescent Energy Finance LLC, 144A, 9,250 %, con vencimiento el 15/02/2028	419	0,11
380	Crowdstrike Holdings Inc, 3,000 %, con vencimiento el 15/02/2029	336	0,09
1.480	CSC Holdings LLC, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 01/04/2028	1.054	0,28
840	CSC Holdings LLC, 144A, 11,250 %, con vencimiento el 15/05/2028	868	0,23
1.370	CSC Holdings LLC, 144A, 11,750 %, con vencimiento el 31/01/2029	1.433	0,38
1.160	CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 01/12/2030	865	0,23
690	Cushman & Wakefield US Borrower LLC, 144A, 8,875 %, con vencimiento el 01/09/2031	719	0,19
1.000	Darling Ingredients Inc, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 15/06/2030	986	0,26
770	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 15/08/2027	727	0,20
1.280	DISH DBS Corp, 5,875 %, con vencimiento el 15/11/2024	1.211	0,33
210	DISH DBS Corp, 7,750 %, con vencimiento el 01/07/2026	134	0,04
570	DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 01/12/2026	456	0,12
400	DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 01/12/2028	278	0,07
1.400	DISH Network Corp, zero coupon, con vencimiento el 15/12/2025	1.021	0,27
730	DISH Network Corp, 144A, 11,750 %, con vencimiento el 15/11/2027	762	0,20
1.030	DraftKings Holdings Inc, zero coupon, con vencimiento el 15/03/2028	879	0,24
210	Edison International, Serie A, 5,375 %, Perpetuo *	203	0,05
623	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 30/01/2028	629	0,17
220	Energy Transfer LP, 5,350 %, con vencimiento el 15/05/2045	200	0,05
260	Energy Transfer LP, 6,250 %, con vencimiento el 15/04/2049	263	0,07
500	Energy Transfer Operating LP, Serie G, 7,125 %, Perpetuo *	483	0,13
30	Energy Transfer LP, Serie A, 9,597 %, Perpetuo *	30	0,01
260	Entegris Inc, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 15/04/2028	243	0,07
420	Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, con vencimiento el 15/02/2078 *	389	0,10
170	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 01/07/2025	170	0,05
190	EQM Midstream Partners LP, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 01/07/2027	192	0,05
850	EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 01/06/2030	904	0,24
360	EQT Corp, 6,125 %, con vencimiento el 01/02/2025	361	0,10
80	EQT Corp, 7,000 %, con vencimiento el 01/02/2030	85	0,02
810	FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 01/01/2030	768	0,21

^ *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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
250	FirstEnergy Corp, Serie B, 4,150 %, con vencimiento el 15/07/2027	238	0,06
220	FirstEnergy Corp, 2,650 %, con vencimiento el 01/03/2030	188	0,05
915	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 15/01/2028	936	0,25
940	Foot Locker Inc, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2029	797	0,21
2.380	Ford Motor Co, 3,250 %, con vencimiento el 12/02/2032	1.953	0,52
1.250	Ford Motor Credit Co LLC, 3,625 %, con vencimiento el 17/06/2031	1.066	0,29
2.130	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, con vencimiento el 15/03/2043	1.985	0,53
1.500	Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, con vencimiento el 15/02/2028	1.408	0,38
90	Gannett Co Inc, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 01/12/2027	71	0,02
480	Gannett Holdings LLC, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 01/11/2026	434	0,12
1.540	Gen Digital Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 30/09/2030	1.575	0,42
580	GEO Group Inc/The, 10,500 %, con vencimiento el 30/06/2028	593	0,16
930	GTCR W-2 Merger Sub LLC, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 15/01/2031	971	0,26
520	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/12/2028	470	0,13
370	HCA Inc, 7,500 %, con vencimiento el 06/11/2033	412	0,11
650	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/04/2032	629	0,17
340	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 8,375 %, con vencimiento el 01/11/2033	365	0,10
580	Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 15/01/2027	578	0,16
400	Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 8,875 %, con vencimiento el 15/07/2028	422	0,11
150	iHeartCommunications Inc, 6,375 %, con vencimiento el 01/05/2026	128	0,03
1.380	Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 15/11/2029	1.271	0,34
270	Jazz Securities DAC, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 15/01/2029	249	0,07
530	JB Poindexter & Co Inc, 144A, 8,750 %, con vencimiento el 15/12/2031	544	0,15
60	Ladder Capital Finance Holdings LLLP/Ladder Capital Finance Corp,144A, 4,250 %, con vencimiento el 01/02/2027	55	0,02
370	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/06/2029	333	0,09
570	Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, con vencimiento el 08/08/2024	563	0,15
300	Legacy LifePoint Health LLC, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 15/02/2027	279	0,08
620	Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 01/02/2026	617	0,17
900	LifePoint Health Inc, 144A, 9,875 %, con vencimiento el 15/08/2030	935	0,25
490	LPL Holdings Inc, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 15/03/2029	450	0,12
290	Match Group Holdings II LLC, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 01/06/2028	273	0,07
526	McClatchy Co LLC/The, 144A, 11,000 %, con vencimiento el 15/07/2027	576	0,15
870	Medline Borrower LP, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 01/10/2029	806	0,22
710	Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 01/05/2028	552	0,15
260	Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 01/05/2028	239	0,06
370	Minerals Technologies Inc, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 01/07/2028	351	0,09
1.176	Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 01/02/2026	1.110	0,30
70	Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 13,250 %, con vencimiento el 15/12/2027	76	0,02
150	MPH Acquisition Holdings LLC, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 01/11/2028	120	0,03
450	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp, pagaré preferente, 4,00 %, 08/01/26	401	0,11
740	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5,000 %, con vencimiento el 15/10/2027	606	0,16
580	Multiplan Corp, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 15/10/2027	412	0,11
200	Nabors Industries Ltd, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 15/01/2026	197	0,05
970	NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 15/03/2026	948	0,25
290	NCL Corp Ltd, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 15/01/2029	305	0,08
1.120	Newell Brands Inc, 5,200 %, con vencimiento el 01/04/2026	1.089	0,29
130	Newell Brands Inc, 6,375 %, con vencimiento el 15/09/2027	126	0,03
1.040	Nexstar Media Inc, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 15/07/2027	987	0,27
570	NMI Holdings Inc, 144A, 7,375 %, con vencimiento el 01/06/2025	575	0,15
340	Noble Finance II LLC, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 15/04/2030	350	0,09
1.020	Northern Oil & Gas Inc, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 01/03/2028	1.034	0,28
2.790	Northwest Acquisitions ULC / Dominion Finco Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 01/11/2022 ∞ε	–	–
1.000	Occidental Petroleum Corp, 2,900 %, con vencimiento el 15/08/2024	986	0,26
1.050	Occidental Petroleum Corp, 7,150 %, con vencimiento el 15/05/2028	1.102	0,30
810	Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, con vencimiento el 15/09/2036	853	0,23
1.660	Occidental Petroleum Corp, 7,950 %, con vencimiento el 15/06/2039	1.930	0,52
310	Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, con vencimiento el 15/08/2049	231	0,06
120	Olin Corp, 5,000 %, con vencimiento el 01/02/2030	112	0,03
1.190	Option Care Health Inc, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 31/10/2029	1.088	0,29
1.214	Park-Ohio Industries Inc, 6,625 %, con vencimiento el 15/04/2027	1.112	0,30
470	Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 15/06/2029	421	0,11
910	PECF USS Intermediate Holding III Corp, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 15/11/2029	398	0,11
1.230	Permian Resources Operating LLC, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 01/07/2029	1.203	0,32
980	Permian Resources Operating LLC, 144A, 9,875 %, con vencimiento el 15/07/2031	1.086	0,29
290	Permian Resources Operating LLC, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/01/2032	298	0,08
680	Plains All American Pipeline LP, Serie B, 9,679 %, Perpetuo *	680	0,18
2.025	PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500 %, con vencimiento el 01/10/2028	2.047	0,55
370	PNC Financial Services Group Inc/The, 6,037 %, con vencimiento el 28/10/2033 *	380	0,10
400	PNC Financial Services Group Inc/The, 5,068 %, con vencimiento el 24/01/2034 *	385	0,10
880	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 3,375 %, con vencimiento el 31/08/2027	807	0,22
918	QVC Inc, 4,450 %, con vencimiento el 15/02/2025	892	0,24
120	Rackspace Technology Global Inc, 3,500 %, con vencimiento el 31/05/2028 ∞	72	0,02
1.140	Range Resources Corp, 8,250 %, con vencimiento el 15/01/2029	1.190	0,32
770	Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/02/2030	716	0,19
1.670	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 01/03/2029	1.483	0,40
230	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 15/10/2033	191	0,05
630	Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 15/07/2038	640	0,17
800	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 01/07/2026	771	0,21
230	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 31/08/2026	228	0,06
180	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 8,250 %, con vencimiento el 15/01/2029	191	0,05
360	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 9,250 %, con vencimiento el 15/01/2029	387	0,10
950	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 15/01/2030	988	0,27
260	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/03/2032	261	0,07
240	RR Donnelley & Sons Co, 144A, 9,750 %, con vencimiento el 31/07/2028	246	0,07
600	RXO Inc, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 15/11/2027	620	0,17
320	Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 6,750 %, con vencimiento el 01/03/2032	319	0,09
200	Sealed Air Corp/Sealed Air Corp US, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 01/02/2028	200	0,05
390	Service Properties Trust, 5,500 %, con vencimiento el 15/12/2027	368	0,10
120	Service Properties Trust, 144A, 8,625 %, con vencimiento el 15/11/2031	127	0,03
1.480	SilverBow Resources Inc, 144A, 13,135 %, con vencimiento el 15/12/2028 *	1.469	0,39

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

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
300	Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 01/11/2028	291	0,08
1.110	Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 8,875 %, con vencimiento el 15/11/2031	1.177	0,32
1.240	Southwestern Energy Co, 8,375 %, con vencimiento el 15/09/2028	1.291	0,35
1.060	Southwestern Energy Co, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2032	964	0,26
508	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 20/09/2025	368	0,10
1.550	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 20/09/2025	1.122	0,30
500	Sprint Capital Corp, 8,750 %, con vencimiento el 15/03/2032	604	0,16
390	State Street Corp, Serie I, 6,700 %, Perpetuo *	390	0,10
720	StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/05/2029	523	0,14
540	StoneX Group Inc, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 01/03/2031	547	0,15
320	Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp, 144A, 9,000 %, con vencimiento el 15/10/2026	317	0,09
1.050	Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 01/09/2026	855	0,23
260	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 31/12/2030	242	0,07
550	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, con vencimiento el 01/02/2031	522	0,14
190	Tenet Healthcare Corp, 4,625 %, con vencimiento el 15/06/2028	181	0,05
310	Time Warner Cable LLC, 6,750 %, con vencimiento el 15/06/2039	293	0,08
1.390	Titan International Inc, 7,000 %, con vencimiento el 30/04/2028	1.381	0,37
660	TKC Holdings Inc, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/05/2028	619	0,17
1.030	TopBuild Corp, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 15/03/2029	924	0,25
40	TopBuild Corp, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 15/02/2032	35	0,01
200	TransDigm Inc, 144A, 6,375 %, con vencimiento el 01/03/2029	201	0,05
430	TransDigm Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 01/12/2031	442	0,12
1.180	TransDigm Inc, 144A, 6,625 %, con vencimiento el 01/03/2032	1.189	0,32
970	Triumph Group Inc, 144A, 9,000 %, con vencimiento el 15/03/2028	1.015	0,27
300	Truist Financial Corp, 5,122 %, con vencimiento el 26/01/2034 *	285	0,08
410	Truist Financial Corp, 5,867 %, con vencimiento el 08/06/2034 *	410	0,11
1.000	Tutor Perini Corp, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 01/05/2025	990	0,27
139	United Airlines 2020-1 Clase B Pass Through Trust, 4,875 %, con vencimiento el 15/01/2026	137	0,04
80	United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 15/04/2026	77	0,02
1.610	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 15/04/2029	1.487	0,40
280	United Rentals North America Inc, 5,500 %, con vencimiento el 15/05/2027	278	0,07
100	United Rentals North America Inc, 4,875 %, con vencimiento el 15/01/2028	97	0,03
1.330	United Rentals North America Inc, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 15/12/2029	1.332	0,36
930	United Rentals North America Inc, 5,250 %, con vencimiento el 15/01/2030	901	0,24
99	US Airways 2013-1 Clase A Pass Through Trust, 3,950 %, con vencimiento el 15/11/2025	96	0,03
310	US Bancorp, 4,839 %, con vencimiento el 01/02/2034 *	292	0,08
440	US Bancorp, 5,836 %, con vencimiento el 12/06/2034 *	445	0,12
396	US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, con vencimiento el 28/06/2028	334	0,09
180	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2029	162	0,04
1.090	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/01/2030	1.089	0,29
200	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2031	176	0,05
290	Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 01/11/2033	243	0,07
480	Venture Global LNG Inc, 144A, 8,375 %, con vencimiento el 01/06/2031	486	0,13
840	Venture Global LNG Inc, 144A, 9,875 %, con vencimiento el 01/02/2032	885	0,24
290	Vericast Corp, 144A, 11,000 %, con vencimiento el 15/09/2026	305	0,08
200	Vericast Corp, 144A, 12,500 %, con vencimiento el 15/12/2027	227	0,06
1.060	Vertiv Group Corp, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 15/11/2028	979	0,26
160	Viavi Solutions Inc, 144A, 3,750 %, con vencimiento el 01/10/2029	139	0,04
460	Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 15/09/2027	450	0,12
870	Viking Cruises Ltd, 144A, 9,125 %, con vencimiento el 15/07/2031	942	0,25
980	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 15/02/2028	942	0,25
30	Western Midstream Operating LP, 3,100 %, con vencimiento el 01/02/2025	29	0,01
1.270	Western Midstream Operating LP, 5,450 %, con vencimiento el 01/04/2044	1.139	0,31
1.000	Western Midstream Operating LP, 5,300 %, con vencimiento el 01/03/2048	863	0,23
220	Williams Cos Inc/The, 8,750 %, con vencimiento el 15/03/2032	263	0,07
960	Winnebago Industries Inc, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/07/2028	948	0,25
550	WW International Inc, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 15/04/2029	255	0,07
1.050	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 15/02/2031	1.085	0,29
620	XPO Inc, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 01/06/2028	623	0,17
310	XPO Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 01/02/2032	315	0,08
770	Ziff Davis Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 15/10/2030	691	0,19
		153.796	41,27
Zambia: 0,61 % (28 de febrero de 2023: 0,83 %)			
1.150	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/10/2027	1.095	0,30
1.120	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 9,375 %, con vencimiento el 01/03/2029	1.162	0,31
		2.257	0,61
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 225.022 $)		219.804	58,98
Bonos y obligaciones del Estado: 4,55 % (28 de febrero de 2023: 5,45 %)			
Angola: 0,16 % (28 de febrero de 2023: 0,07 %)			
460	Bono Internacional del Estado de Angola, 144A, 8,750 %, con vencimiento el 14/04/2032	405	0,11
230	Bono Internacional del Estado de Angola, 9,125 %, con vencimiento el 26/11/2049	185	0,05
		590	0,16
Argentina: 0,59 % (28 de febrero de 2023: 0,68 %)			
8	Bono Internacional de la República Argentina, 1,000 %, con vencimiento el 09/07/2029	3	–
47	Bono Internacional de la República Argentina, 0,750 %, con vencimiento el 09/07/2030	22	0,01
2.904	Bonos del Gobierno de la Provincia de Buenos Aires, 144A, 6,375 %, con vencimiento el 01/09/2037	1.129	0,30
385	Provincia de Buenos Aires/Government Bonds, 6,375 %, con vencimiento el 01/09/2037	150	0,04
1.074	Provincia de Cordoba, 144A, 6,990 %, con vencimiento el 01/06/2027	881	0,24
		2.185	0,59
Bahamas: 0,06 % (28 de febrero de 2023: 0,19 %)			
220	Bono Internacional del Estado de Bahamas, 8,950 %, con vencimiento el 15/10/2032	207	0,06
Costa de Marfil: 0,36 % (28 de febrero de 2023: 0,26 %)			
1.400	Bono Internacional del Estado de Costa de Marfil, 144A, 7,625 %, con vencimiento el 30/01/2033	1.357	0,36
República Dominicana: 0,26 % (28 de febrero de 2023: 0,23 %)			
160	Bono Internacional de la República Dominicana, 4,500 %, con vencimiento el 30/01/2030	145	0,04
940	Bono Internacional de la República Dominicana, 4,875 %, con vencimiento el 23/09/2032	838	0,22
		983	0,26
Paraguay: 0,06 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
260	Bono Internacional del Estado de Egipto, 7,053 %, con vencimiento el 15/01/2032	216	0,06
El Salvador: 0,02 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
70	Bono Internacional del Estado de El Salvador, 6,375 %, con vencimiento el 18/01/2027	61	0,02
Ghana: 0,04 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
220	Bono Internacional del Estado de Ghana, 10,750 %, con vencimiento el 14/10/2030	138	0,04
Jamaica: 0,05 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
JMD 30.000	Bono Internacional del Estado de Jamaica, 9,625 %, con vencimiento el 03/11/2030	204	0,05

^ 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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones del Estado (continuación)			
Jordania: 0,20 % (28 de febrero de 2023: 0,21 %)			
560	Bono Internacional del Estado de Jordania, 144A, 7,750 %, con vencimiento el 15/01/2028	567	0,15
200	Bono Internacional del Estado de Jordania, 7,500 %, con vencimiento el 13/01/2029	198	0,05
		765	0,20
Kenia: 0,35 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
1.150	Republic of Kenya Government International Bond, 144A, 9,750 %, con vencimiento el 16/02/2031	1.150	0,31
200	Republic of Kenya Government International Bond, 6,300 %, con vencimiento el 23/01/2034	158	0,04
		1.308	0,35
México: 1,45 % (28 de febrero de 2023: 0,65 %)			
MXN 13.270	Mexican Bonos, Serie M, 5,750 %, con vencimiento el 05/03/2026	719	0,19
MXN 58.110	Mexican Bonos, Serie M, 8,500 %, con vencimiento el 31/05/2029	3.324	0,89
710	Bono Internacional del Estado de México, 6,000 %, con vencimiento el 07/05/2036	708	0,19
790	Mexico Government International Bond, 4,750 %, con vencimiento el 08/03/2044	653	0,18
		5.404	1,45
Nigeria: 0,13 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
340	Bono Internacional del Estado de Nigeria, 7,143 %, con vencimiento el 23/02/2030	301	0,08
260	Bono Internacional del Estado de Nigeria, 144A, 7,625 %, con vencimiento el 28/11/2047	201	0,05
		502	0,13
Senegal: 0,04 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
200	Bono Internacional del Estado de Senegal, 6,250 %, con vencimiento el 23/05/2033	167	0,04
Sri Lanka: 0,03 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
210	Bono Internacional del Estado de Sri Lanka, 6,200 %, con vencimiento el 11/05/2027	113	0,03
Ucrania: 0,06 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
830	Bono Internacional del Estado de Ucrania, 7,375 %, con vencimiento el 25/09/2034	218	0,06
Estados Unidos: 0,56 % (28 de febrero de 2023: 0,57 %)			
2.070	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 5,000 %, con vencimiento el 31/10/2025	2.078	0,56
Uruguay: 0,08 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
UYU 8.130	Bono Internacional del Estado de Uruguay, 3,875 %, con vencimiento el 02/07/2040 β	282	0,08
Uzbekistán: 0,05 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
220	Bono Internacional de la República de Uzbekistán, 3,900 %, con vencimiento el 19/10/2031	181	0,05
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 17.070 $)		16.959	4,55
Obligaciones de préstamo: 7,01 % (28 de febrero de 2023: 5,09 %)			
430	8Th Avenue Food & Provisions Inc, 13,197 %, con vencimiento el 01/10/2026 *†	394	0,11
457	Acrisure LLC, 9,888 %, con vencimiento el 20/10/2030 *	460	0,12
439	Agiliti Health Inc, 8,330 %, con vencimiento el 01/05/2030 *	438	0,12
279	A-L Parent LLC, 10,833 %, con vencimiento el 30/06/2028 *	279	0,07
87	Allen Media LLC, 10,998 %, con vencimiento el 10/02/2027 *	77	0,02
3	Allied Universal Holdco LLC, 9,183 %, con vencimiento el 14/05/2028 *	3	–
319	Allied Universal Holdco LLC, 10,083 %, con vencimiento el 04/05/2028 *	320	0,09
34	APi Group De Inc, 7,701 %, con vencimiento el 01/10/2026 *	34	0,01
67	Apollo Group CMR, 8,197 %, con vencimiento el 15/05/2026 *	66	0,02
240	Ascensus Holdings Inc, 8,947 %, con vencimiento el 02/08/2028 *	239	0,06
191	Asurion LLC, 8,697 %, con vencimiento el 18/12/2026 *	190	0,05
567	Asurion LLC, 9,683 %, con vencimiento el 19/08/2028 *	565	0,15
193	Asurion LLC, 9,433 %, con vencimiento el 17/08/2028 *	192	0,05
316	Autokinition U.S. Holdings, 9,450 %, con vencimiento el 06/04/2028 *	317	0,08
89	Brown Group Holding LLC, 8,388 %, con vencimiento el 02/07/2029 *	90	0,02
247	Brown Group Holding LLC, 8,183 %, con vencimiento el 07/06/2028 *	246	0,07
218	Caesars Entertainment, 8,663 %, con vencimiento el 25/01/2030 *	219	0,06
710	Caesars Entertainment, 8,040 %, con vencimiento el 24/01/2031 *	710	0,19
259	Cardinal Parent Inc, 9,998 %, con vencimiento el 12/11/2027 *	241	0,06
873	Cinemark USA Inc, 9,098 %, con vencimiento el 24/05/2030 *	876	0,23
628	Clarios Global LP, 8,333 %, con vencimiento el 06/05/2030 *	630	0,17
559	Cloudera Inc, 9,183 %, con vencimiento el 10/10/2028 *	557	0,15
444	Columbus McKinnon Corp, 8,389 %, con vencimiento el 14/05/2028 *	445	0,12
247	DCert Buyer, Inc., 9,333 %, con vencimiento el 16/10/2026 *	245	0,07
1.700	DCert Buyer, Inc., 12,333 %, con vencimiento el 16/02/2029 *	1.556	0,42
790	DS Parent Inc, 10,813 %, con vencimiento el 16/12/2030 *	782	0,21
597	Emrld Borrower LP, 7,790 %, con vencimiento el 31/05/2030 *	596	0,16
637	Equinox Holdings Inc, 14,610 %, con vencimiento el 08/03/2024 *	632	0,17
252	Evertec Group LLC, 8,833 %, con vencimiento el 12/10/2030 *	252	0,07
103	Eyecare Partners LLC, 9,324 %, con vencimiento el 05/02/2027 *†	56	0,02
397	First Brands Group LLC, 10,574 %, con vencimiento el 30/03/2027 *	398	0,11
529	First Brands Group LLC, 10,574 %, con vencimiento el 24/03/2027 *	531	0,14
4	Focus Financial Partners LLC, 8,083 %, con vencimiento el 30/06/2028 *	4	–
EUR 790	Froneri Lux FinCo SARL, 5,991 %, con vencimiento el 30/01/2027 *	855	0,23
247	Gainwell Acquisition Corp, 9,448 %, con vencimiento el 01/10/2027 *	237	0,06
208	Garda World Security Corp, 9,625 %, con vencimiento el 01/02/2029 *	209	0,05
412	Geo Group Inc/The, 12,208 %, con vencimiento el 23/03/2027 *	423	0,11
620	Greystone Select Financial, 10,571 %, con vencimiento el 06/05/2028 *	620	0,17
868	Harbor Freight Tools USA Inc, 8,197 %, con vencimiento el 19/10/2027 *	863	0,23
227	Hayward Industries Inc., 8,683 %, con vencimiento el 28/05/2028 *	227	0,06
194	Hayward Industries Inc., 8,197 %, con vencimiento el 14/05/2028 *	194	0,05
109	Hyperion Refinance S.a.r.l, 9,333 %, con vencimiento el 24/03/2030 *	109	0,03
253	Jazz Financing Lux S.a.r.l., 8,447 %, con vencimiento el 05/05/2028 *	253	0,07
384	LifePoint Health Inc, 11,087 %, con vencimiento el 16/11/2028 *	385	0,10
800	MH Sub I LLC, 9,583 %, con vencimiento el 03/05/2028 *	788	0,21
691	MRI Software LLC, 10,948 %, con vencimiento el 10/02/2026 *	690	0,18
192	MRI Software LLC, 10,948 %, con vencimiento el 10/02/2026 *	191	0,05
516	Neptune Bidco U.S. Inc, 10,173 %, con vencimiento el 11/10/2028 *	474	0,13
1.120	Nexus Buyer LLC, 9,828 %, con vencimiento el 13/12/2028 *	1.109	0,30
789	PECF USS Intermediate Holding Corp, 9,824 %, con vencimiento el 04/11/2028 *	617	0,17
407	Peraton Corporation, 9,183 %, con vencimiento el 22/02/2028 *	408	0,11
506	Planview Parent Inc, 9,610 %, con vencimiento el 18/12/2027 *	505	0,14
731	Polyconcept North America Holdings Inc, 10,848 %, con vencimiento el 12/05/2029 *	727	0,20
130	Project Sky Merger Sub, Inc., 11,433 %, con vencimiento el 10/08/2029 *	128	0,03
247	Quikrete Holdings, Inc., 8,197 %, con vencimiento el 18/03/2029 *	247	0,07
973	R.R. Donnelley, 12,683 %, con vencimiento el 08/03/2028 *	980	0,26
196	Redstone Holdco 2 LP, 10,201 %, con vencimiento el 27/04/2028 *	163	0,04
438	Scotera Health Holdings LLC, 9,071 %, con vencimiento el 13/12/2026 *	439	0,12
367	Sedgwick CMS Inc, 9,083 %, con vencimiento el 17/02/2028 *	368	0,10
417	Topgolf Callaway Brands, 8,933 %, con vencimiento el 09/03/2030 *	418	0,11
242	UFC Holdings LLC, 8,336 %, con vencimiento el 29/04/2026 *	243	0,07
247	Vertex Aerospace Services Corp, 8,683 %, con vencimiento el 06/12/2028 *	247	0,07
260	Virgin Media Bristol LLC, 7,932 %, con vencimiento el 04/01/2028 *	258	0,07
200	WW International Inc, 8,947 %, con vencimiento el 13/04/2028 *	105	0,03
Total de obligaciones de préstamo (coste 26.162 $)		26.120	7,01

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

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias: 0,04 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Suiza: 0,04 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
1.310	Credit Suisse Group AG Escrow †∞	161	0,04
Total de acciones ordinarias (coste – $)		161	0,04
Acciones preferentes: 0,67 % (28 de febrero de 2023: 0,88 %)			
Estados Unidos: 0,67 % (28 de febrero de 2023: 0,88 %)			
66	MPLX LP, Serie A ∞	2.482	0,67
Total de acciones preferentes (coste de 2,233 $)		2.482	0,67
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 371.228 $)		361.536	97,01

Contratos (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Opciones compradas: 0,02 % (28 de febrero de 2023: 0,20 %)			
–	S&P 500 E-mini Marzo 2024 Put 4.600,00, con vencimiento el 15/03/2024 – Bank of America Merrill Lynch	2	–
–	S&P 500 E-mini W3 Abril 2024 Put 4.850,00, con vencimiento el 19/04/2024 – Bank of America Merrill Lynch	25	0,01
2.530	USD Call/CAD Put 1,3720, con vencimiento el 22/03/2024 (BNP Paribas)	4	–
2.890	USD Call/CHF Put 0.8725, con vencimiento el 16/03/2024 (Goldman Sachs)	39	0,01
3.604	USD Call/EUR Put 1,0808, con vencimiento el 12/03/2024 (Citi)	15	–
2.932	USD Put/AUD Call 0,6686, con vencimiento el 18/04/2024 (BNP Paribas)	8	–
Total de opciones compradas (coste 162 $)		93	0,02
Swaps de incumplimiento de crédito: 0,06 % (28 de febrero de 2023: 0,06 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		232	0,06
Contratos de divisas a plazo: 0,40 % (28 de febrero de 2023: 0,20 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		1.501	0,40
Futuros: 0,17 % (28 de febrero de 2023: 0,02 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		620	0,17
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		363.982	97,66

Contratos (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Opciones suscritas: 0,00 % (28 de febrero de 2023: (0,01 %))			
–	S&P 500 E-mini W3 Abril 2024 Put 4.500.00, con vencimiento el 19/04/2024 – Bank of America Merrill Lynch	(9)	–
(2.890)	USD Call/CHF Put 0,8890, con vencimiento el 16/03/2024 – Goldman Sachs	(8)	–
Total de opciones suscritas (coste (25) $)		(17)	–

Contratos (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Swaps de tasas de interés: (0,07 %) (28 de febrero de 2023: (0,28 %))		
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(286)	(0,07)
Contratos de divisas a plazo: (0,11 %) (28 de febrero de 2023: (1,08 %))		
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(403)	(0,11)
Futuros: (0,07 %) (28 de febrero de 2023: (0,32 %))		
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(253)	(0,07)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	(959)	(0,25)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	363.023	97,41
Excedente de otros activos respecto a los pasivos	9.658	2,59
Patrimonio	372.681 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 225.257.000 USD o el 60,43 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

† 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 al final o tras el ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024 (ya sea capital o interés).

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 29 de febrero de 2024.

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.

CAD – Dólar canadiense

EUR – Euro

GBP – Libra esterlina

INR – Rupia india

JMD – Dólar jamaicano

MXN – Peso mexicano

UYU – Peso uruguayo

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	88,56
Otros valores mobiliarios negociables en otro mercado regulado	6,90
Instrumentos financieros derivados	0,65
Otros activos	3,89
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)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.HY.CDSI 5 años, 5,000 % – Vender	20 de diciembre de 2028	1.609	$ 101
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % – Vender	20 de diciembre de 2028	6.375	131
Apreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): 155 $)				$ 232
Depreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): – $)				–
Apreciación neta de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): 155 $)				$ 232

Listado de swaps de tipos de interés

Contraparte	Tipo	Fecha de vencimiento	Importe teórico (en miles)	Valor (en miles)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,450 %	18 de julio de 2029	80.214	$ (256)
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 10,262 %	02 de enero de 2029	23.600	(30)
Apreciación latente de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 (en miles): – $)				$ –
Depreciación latente de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 (en miles): (756) $)				(286)
Depreciación neta de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 (en miles): (756) $)				$ (286)

^ *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 al 29 de febrero de 2024 *(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)
13 de marzo de 2024	Citi	Compra	EUR	1.139	Venta	USD	1.236	$	(4)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	177	Venta	CAD	240		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	2.858	Venta	EUR	2.640		3
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	2.821	Venta	GBP	2.240		(7)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	183	Venta	GBP	144		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	45	Venta	USD	48		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CAD	23.213	Venta	USD	17.173		(64)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CHF	3.928	Venta	USD	4.530		(81)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	58.180	Venta	USD	62.603		318
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	214.126	Venta	USD	269.384		933
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	445	Venta	USD	564		(2)
19 de abril de 2024	BNP Paribas	Compra	USD	504	Venta	CNH	3.620		–
19 de abril de 2024	BNP Paribas	Compra	USD	–	Venta	NOK	2		–
19 de abril de 2024	Citi	Compra	USD	7.346	Venta	EUR	6.666		126
19 de abril de 2024	Citi	Compra	USD	1.688	Venta	EUR	1.564		(6)
19 de abril de 2024	Citi	Compra	USD	6.505	Venta	GBP	5.101		63
19 de abril de 2024	Citi	Compra	AUD	10.832	Venta	USD	7.263		(211)
19 de abril de 2024	Citi	Compra	EUR	760	Venta	USD	820		3
19 de abril de 2024	Citi	Compra	IDR	20.541.920	Venta	USD	1.310		(4)
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	1.232	Venta	CHF	1.070		15
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	793	Venta	EUR	730		3
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	CHF	660	Venta	USD	750		1
19 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	USD	1.378	Venta	CNH	9.800		13
19 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	USD	1.356	Venta	IDR	20.995.354		22
19 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	MXN	1.590	Venta	USD	93		–
19 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	MXN	3.230	Venta	USD	188		–
19 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	74	Venta	CAD	100		–
19 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	1.414	Venta	MXN	24.288		1
19 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	BRL	8.355	Venta	USD	1.690		(18)
19 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	CAD	50	Venta	USD	37		(1)
19 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	JPY	16.589	Venta	USD	116		(5)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 536 $)								$	1.501
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (2.965) $)									(403)
Apreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (2.429) $)								$	1.098

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	Bank of America Merrill Lynch	(91)	$	(21.532)	$ 118
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	49		11.699	(142)
Índice SOFR de 3 meses Marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	(22)		(5.208)	(6)
Bono a 10 años de Australia marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	20		1.495	17
Euro-Bund marzo 2024	Bank of America Merrill Lynch	81		11.613	(81)
Bonos Euro-Buxl a 30 años marzo de 2024	Bank of America Merrill Lynch	(1)		(144)	(3)
ICE 3 Month SONIA Diciembre 2023	Bank of America Merrill Lynch	37		11.067	107
ICE 3 Month SONIA Diciembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	1		301	2
ICE 3 Month SONIA Junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	38		11.390	71
Long Gilt junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	26		3.219	21
U.S. 10 Year Note (CBT) junio de 2024	Bank of America Merrill Lynch	358		39.537	92
U.S. 10 Year Ultra Note junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	23		2.626	10
U.S. 2 Year Note (CBT) junio de 2024	Bank of America Merrill Lynch	246		50.369	(21)
U.S. 5 Year Note (CBT) junio de 2024	Bank of America Merrill Lynch	130		13.898	14
U.S. Long Bond (CBT) junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	26		3.100	23
U.S. Ultra Bond (CBT) junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	142		18.158	145
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 53 $)					$ 620
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (890) $)					(253)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (837) $)					$ 367

^ *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 al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por activos: 15,66 % (28 de febrero de 2023: 12,60 %)			
1.190	Accredited Mortgage Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Clase M5, 5,423 %, con vencimiento el 25/04/2035 *	1.213	0,23
2.390	BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust, Serie 1996 1, Clase B1, 7,875 %, con vencimiento el 10/10/2026	47	0,01
601	Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Serie 2007 B, Clase 1A2, 7,331 %, con vencimiento el 28/08/2047	509	0,10
1.244	Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Serie 2007 B, Clase 1A3, 7,719 %, con vencimiento el 28/08/2047	347	0,07
62	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-CL1, Serie 2005 CL1, Clase A1, 3,586 %, con vencimiento el 25/09/2034 *	60	0,01
2.801	Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd 2016-1, Serie 2016 1A, Clase B, 144A, 5,682 %, con vencimiento el 16/12/2041	2.461	0,47
5.526	Conseco Finance Securitizations Corp, Serie 2000 3, Clase A, 144A, 8,260 %, con vencimiento el 01/12/2030 *	1.283	0,24
793	Countrywide Asset-Backed Certificates, Serie 2007 SD1, Clase A1, 144A, 6,335 %, con vencimiento el 25/03/2047 *	601	0,12
599	Credit-Based Asset Servicing and Securitization LLC, Serie 2007 MX1, Clase A4, 144A, 6,231 %, con vencimiento el 25/12/2036	595	0,11
1.888	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2004-9, Serie 2004 9, Clase MF2, 5,572 %, con vencimiento el 25/11/2034 *	1.767	0,34
1.401	Dividend Solar Loans 2018-1 LLC, Serie 2018 1, Clase D, 144A, 6,390 %, con vencimiento el 20/07/2038	1.153	0,22
2.897	Dividend Solar Loans 2018-2 LLC, Serie 2018 2, Clase D, 144A, 5,910 %, con vencimiento el 20/12/2038	2.113	0,40
2.780	Eagle RE 2023-1 Ltd, Serie 2023 1, Clase M2, 144A, 10,522 %, con vencimiento el 26/09/2033 *	2.898	0,55
4.869	Fieldstone Mortgage Investment Trust Serie 2005-2, Serie 2005 2, Clase M3, 6,215 %, con vencimiento el 25/12/2035 *	4.241	0,81
1.995	FOCUS Brands Funding, Serie 2023 2, Clase A2, 144A, 8,241 %, con vencimiento el 30/10/2053	2.115	0,40
6.435	Fremont Home Loan Trust 2006-B, Serie 2006 B, Clase 1A, 5,735 %, con vencimiento el 25/08/2036 *	2.553	0,49
2.281	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, Serie 2021 4GS, Clase C, 144A, 3,500 %, con vencimiento el 20/07/2048	1.656	0,32
2.868	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2022-1, Serie 2022 1GS, Clase C, 144A, 3,500 %, con vencimiento el 20/01/2049	1.890	0,36
2.483	HERO Funding Trust 2016-1, Serie 2016 1A, Clase R, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 20/09/2041	323	0,06
3.318	Home Partners of America 2021-2 Trust, Serie 2021 2, Clase F, 144A, 3,799 %, con vencimiento el 17/12/2026	2.955	0,56
1.770	Home RE 2023-1 Ltd, Serie 2023 1, Clase M2, 144A, 11,322 %, con vencimiento el 25/10/2033 *	1.885	0,36
1.440	Jack in the Box Funding LLC, Serie 2022 1A, Clase A2I, 144A, 3,445 %, con vencimiento el 26/02/2052	1.335	0,25
1.312	Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, Serie 2021 1GS, Clase C, 144A, 3,500 %, con vencimiento el 20/01/2048	823	0,16
2.231	Loanpal Solar Loan 2021-2 Ltd, Serie 2021 2GS, Clase C, 144A, 3,500 %, con vencimiento el 20/03/2048	1.378	0,26
1.130	Loanpal Solar Loan Ltd, Serie 2020 3GS, Clase C, 144A, 3,500 %, con vencimiento el 20/12/2047	684	0,13
30	Long Beach Mortgage Loan Trust 2002-2, Serie 2002 2, Clase M2, 5,897 %, con vencimiento el 25/07/2032 *	28	0,01
4.598	Magnolia Finance, 8,552 %, con vencimiento el 09/08/2024	4.589	0,87
68	Mastr Specialized Loan Trust, Serie 2006 2, Clase A, 144A, 5,955 %, con vencimiento el 25/02/2036 *	65	0,01
3	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust Serie 2003-SD1, Serie 2003 SD1, Clase A1, 6,435 %, con vencimiento el 25/03/2033 *	3	–
1.221	Mosaic Solar Loan Trust 2018-1, Serie 2018 1A, Clase CERT, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 22/06/2043 ∞	446	0,09
1.500	Mosaic Solar Loan Trust 2024-1, Serie 2024 1, Clase B, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 20/09/2049	1.483	0,28
3.000	National Collegiate II Commutation Trust, Serie 2005 AR15, Clase AR15, 0,000 %, con vencimiento el 01/06/2045	275	0,05
7.796	National Collegiate Student Loan Trust 2005-3, Serie 2005 3, Clase B, 5,935 %, con vencimiento el 27/07/2037 *	5.843	1,11
5.987	National Collegiate V Commutation Trust, Serie 2007 33A5, Clase 1O, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 25/03/2038 *	1.331	0,25
6.140	National Collegiate V Commutation Trust, Serie 2007 33A6, Clase 1O, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 25/03/2038 *	1.283	0,24
2.209	NRZ Excess Spread-Collateralized Notes, Serie 2021 FHT1, Clase A, 144A, 3,104 %, con vencimiento el 25/07/2026	2.058	0,39
2.549	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-2, Serie 2005 2, Clase M2, 6,217 %, con vencimiento el 25/04/2035	2.012	0,38
2.213	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-5, Serie 2005 5, Clase MV2, 3,237 %, con vencimiento el 25/11/2035 *	1.954	0,37
12.260	Redwood Funding Trust 2019-1, Serie 2019 1, Clase PT, 144A, 4,968 %, con vencimiento el 27/09/2024	11.957	2,27
1.800	Sesac Finance LLC, Serie 2024 1, Clase A2, 144A, 6,421 %, con vencimiento el 25/01/2054	1.807	0,34
120	SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM 2017-F LLC, Serie 2017 F, Clase R1, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 25/01/2041	1.146	0,22
–	Southern Pacific Secured Assets Corp, Serie 1998 1, Clase A7, 6,510 %, con vencimiento el 25/12/2027 *	–	–
513	Stonepeak 2021-1 ABS, serie 2021 1A, clase A, 144A, 2,675 %, con vencimiento el 28/02/2033	467	0,09
2.722	Stonepeak 2021-1 ABS, Serie 2021 1A, Clase B, 144A, 3,821 %, con vencimiento el 28/02/2033	2.470	0,47
3.365	Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2005-9XS, Serie 2005 9XS, Clase M2, 6,410 %, con vencimiento el 25/06/2035 *	3.374	0,64
1.304	Structured Asset Securities Corp Trust 2005-SC1, Serie 2005 SC1, Clase 1A1, 144A, 5,705 %, con vencimiento el 25/05/2031 *	962	0,18
2.289	Sunnova Sol Issuer LLC, Serie 2020 1A, Clase B, 144A, 5,540 %, con vencimiento el 01/02/2055	1.956	0,37
Total de valores garantizados por activos (coste 104.532 $)		82.394	15,66
Valores garantizados por hipotecas: 74,61 % (28 de febrero de 2023: 80,10 %)			
5.919	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust, Serie 2017 280P, Clase F, 144A, 8,449 %, con vencimiento el 15/09/2034 *	5.375	1,02
436	Alternative Loan Trust 2005-56, Serie 2005 56, Clase 4A1, 6,055 %, con vencimiento el 25/11/2035 *	382	0,07
1.085	Alternative Loan Trust 2005-80CB, Serie 2005 80CB, Clase 2A1, 6,000 %, con vencimiento el 25/02/2036	1.011	0,19
2.068	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Clase A14, 6,000 %, con vencimiento el 25/08/2036	1.194	0,23
526	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Clase A15, 6,000 %, con vencimiento el 25/08/2036	304	0,06
539	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Clase A16, 6,000 %, con vencimiento el 25/08/2036	311	0,06
610	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Clase A20, 4,588 %, con vencimiento el 25/08/2036 *	417	0,08
590	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Clase A24, 6,000 %, con vencimiento el 25/08/2036	340	0,06
750	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Clase A3, 6,000 %, con vencimiento el 25/08/2036 *	436	0,08
80	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Clase A7, 6,000 %, con vencimiento el 25/08/2036	46	0,01
357	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Serie 2006 19CB, Clase A8, 6,000 %, con vencimiento el 25/08/2036	206	0,04
4.608	Alternative Loan Trust 2006-28CB, Serie 2006 28CB, Clase A12, 0,465 %, con vencimiento el 25/10/2036 *†	465	0,09
926	Alternative Loan Trust 2007-23CB, Serie 2007 23CB, Clase A8, 6,658 %, con vencimiento el 25/09/2037 *	740	0,14
6.235	Alternative Loan Trust 2007-5CB, Serie 2007 5CB, Clase 1A20, 0,025 %, con vencimiento el 25/04/2037 *†	541	0,10
2.475	BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Serie 2016 GG10, Clase AJA, 144A, 5,630 %, con vencimiento el 10/08/2045 *	531	0,10
4.208	Banc of America Funding 2015-R4 Trust, Serie 2015 R4, Clase 4A3, 144A, 7,231 %, con vencimiento el 27/01/2030 *	1.460	0,28
6.000	BBCCRE Trust 2015-GTP, Serie 2015 GTP, Clase F, 144A, 4,563 %, con vencimiento el 10/08/2033 *	3.889	0,74
5.279	BCAP LLC 2014-RR2, Serie 2014 RR2, Clase 10A2, 144A, 4,095 %, con vencimiento el 26/07/2046 *	4.278	0,81
765	BCAP LLC Trust 2007-AA3, Serie 2007 AA3, Clase 1A2, 5,975 %, con vencimiento el 25/04/2037 *	1.042	0,20
1.207	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2004-AC6, Serie 2004 AC6, Clase A1, 5,750 %, con vencimiento el 25/11/2034	1.017	0,19
10.010	BHMS 2018-MZB, Serie 2018 MZB, Clase MZB, 144A, 12,251 %, con vencimiento el 15/07/2025 *	9.172	1,74
3.500	BRAVO Residential Funding Trust 2024-NQM2, Serie 2024 NQM2, Clase M1, 144A, 6,819 %, con vencimiento el 25/02/2064	3.517	0,67
3.500	BX Trust 2018-GW MZ, Serie 2018 GWMZ, Clase MC, 144A, 11,103 %, con vencimiento el 15/05/2037 *	3.478	0,66
1.750	BX Trust 2018-GW, Serie 2018 GW, Clase G, 144A, 8,535 %, con vencimiento el 15/05/2035 *	1.725	0,33
870	BX Trust 2021-VIEW, Serie 2021 VIEW, Clase E, 144A, 9,032 %, con vencimiento el 15/06/2036 *	808	0,15
3.327	Chase Mortgage Finance Trust Serie 2007-A1, Serie 2007 A1, Clase 11M1, 4,321 %, con vencimiento el 25/03/2037 *	3.041	0,58
832	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Serie 2004-4, Serie 2004 4A, Clase B1, 144A, 4,628 %, con vencimiento el 25/10/2035 *	630	0,12

^ 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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
252	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Serie 2005-1, Serie 2005 1A, Clase A2, 144A, 5,635 %, con vencimiento el 25/01/2036 *	223	0,04
383	Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates Serie 2005-B, Serie 2005 BA, Clase B1, 144A, 5,835 %, con vencimiento el 25/06/2036 *	313	0,06
391	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2004-25, Serie 2004 25, Clase 2A1, 6,115 %, con vencimiento el 25/02/2035 *	325	0,06
338	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-11, Serie 2005 11, Clase 3A3, 3,738 %, con vencimiento el 25/04/2035 *	224	0,04
214	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-25, Serie 2005 25, Clase A15, 2,685 %, con vencimiento el 25/11/2035 *	125	0,02
750	Citicorp Mortgage Securities Trust Serie 2007-3, Serie 2007 3, Clase 1A4, 6,000 %, con vencimiento el 25/04/2037	684	0,13
2.990	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, Serie 2014 GC23, Clase C, 4,420 %, con vencimiento el 10/07/2047 *	2.833	0,54
3.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC29, Serie 2015 GC29, Clase D, 144A, 3,110 %, con vencimiento el 10/04/2048	2.530	0,48
3.125	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-P1, Serie 2015 P1, Clase D, 144A, 3,225 %, con vencimiento el 15/09/2048	2.685	0,51
9.200	Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-AR6, Serie 2006 AR6, Clase 2A4, 5,875 %, con vencimiento el 25/09/2036 *	2.688	0,51
766	Citigroup Mortgage Loan Trust 2008-3, Serie 2008 3, Clase A3, 144A, 6,100 %, con vencimiento el 25/04/2037	345	0,07
3.529	Citigroup Mortgage Loan Trust 2014-J2, Serie 2014 J2, Clase B5, 144A, 3,818 %, con vencimiento el 25/11/2044 *	2.224	0,42
3.250	COLT 2021-RPL1 Trust, Serie 2021 RPL1, Clase B1, 144A, 4,692 %, con vencimiento el 25/09/2061 *	2.560	0,49
4.745	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Serie 2019 R05, Clase 1B1, 144A, 9,536 %, con vencimiento el 25/07/2039 *	4.941	0,94
8.245	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Serie 2019 R07, Clase 1B1, 144A, 8,836 %, con vencimiento el 25/10/2039 *	8.516	1,62
5.760	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Clase 1B1, 144A, 8,422 %, con vencimiento el 25/10/2041 *	5.896	1,12
1.500	CSAIL 2015-C3 Commercial Mortgage Trust, Serie 2015 C3, Clase C, 4,350 %, con vencimiento el 15/08/2048 *	1.259	0,24
259	CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Serie 2004-AR5, Serie 2004 AR5, Clase CB2, 4,857 %, con vencimiento el 25/06/2034 *	204	0,04
9.700	CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Clase E, 144A, 4,373 %, con vencimiento el 15/09/2037	5.176	0,98
9.200	CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Clase F, 144A, 4,373 %, con vencimiento el 15/09/2037	4.040	0,77
4.373	CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Clase B1, 144A, 2,969 %, con vencimiento el 25/07/2057 *	2.935	0,56
5.017	CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Clase B2, 144A, 2,969 %, con vencimiento el 25/07/2057 *	2.972	0,56
4.266	CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Clase B3, 144A, 2,969 %, con vencimiento el 25/07/2057 *	1.885	0,36
4.296	CSMC 2017-RPL1 Trust, Serie 2017 RPL1, Clase B4, 144A, 2,969 %, con vencimiento el 25/07/2057 *	820	0,16
2.060	CSMC 2017-RPL3 Trust, Serie 2017 RPL3, Clase B3, 144A, 4,535 %, con vencimiento el 01/08/2057 *	1.947	0,37
5.559	CSMC 2017-RPL3 Trust, Serie 2017 RPL3, Clase B4, 144A, 4,535 %, con vencimiento el 01/08/2057 *	5.117	0,97
7.854	CSMC Mortgage-Backed Trust 2006-7, Serie 2006 7, Clase 11A2, 1,065 %, con vencimiento el 25/08/2036 *†	1.025	0,19
96	CSMC Resecuritization Trust 2006-1R, Serie 2006 1R, Clase 1A2, 144A, 4,569 %, con vencimiento el 27/07/2036 *	88	0,02
4.362	CSMC Serie 2015-2R, Serie 2015 2R, Clase 7A2, 144A, 4,493 %, con vencimiento el 27/08/2036 *	3.296	0,63
4.307	CSMC Trust 2013-IVR5, Serie 2013 IVR5, Clase B5, 144A, 3,622 %, con vencimiento el 25/10/2043 *	2.866	0,54
2.000	CSMC Trust 2017-CHOP, Serie 2017 CHOP, Clase H, 144A, 12,794 %, con vencimiento el 15/07/2032 *	1.707	0,32
1.941	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Clase AX1, 144A, 0,083 %, con vencimiento el 25/02/2048 *	7	–
–	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Clase SA, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 25/02/2048	–	–
4.000	CSWF 2018-TOP, Serie 2018 TOP, Clase H, 144A, 8,977 %, con vencimiento el 15/08/2035 *	3.651	0,69
2.325	DBCG 2017-BBG Mortgage Trust, Serie 2017 BBG, Clase A, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/06/2034 *	2.325	0,44
572	DSLA Mortgage Loan Trust 2004-AR4, Serie 2004 AR4, Clase 2A2B, 6,274 %, con vencimiento el 19/01/2045 *	383	0,07
1.267	DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR3, Serie 2005 AR3, Clase 2A1B, 5,914 %, con vencimiento el 19/07/2045 *	1.169	0,22
2.313	DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR5, Serie 2005 AR5, Clase 2A1B, 6,114 %, con vencimiento el 19/09/2045 *	1.517	0,29
460	DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Serie 2007 AR1, Clase 2A1B, 5,614 %, con vencimiento el 19/04/2047 *	492	0,09
5.320	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C01, Clase 1B, 17,186 %, con vencimiento el 25/08/2028 *	6.122	1,16
3.660	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C02, Clase 1B, 17,686 %, con vencimiento el 25/09/2028 *	4.284	0,81
2.929	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C03, Clase 1B, 17,186 %, con vencimiento el 25/10/2028 *	3.412	0,65
4.873	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C04, Clase 1B, 15,686 %, con vencimiento el 25/01/2029 *	5.559	1,06
7.158	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C06, Clase 1B, 14,686 %, con vencimiento el 25/04/2029 *	8.086	1,54
3.875	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C06, Clase 1B1, 9,186 %, con vencimiento el 25/03/2031 *	4.166	0,79
1.504	Fannie Mae REMICS, Serie 2017 85, Clase SC, 0,764 %, con vencimiento el 25/11/2047 *	135	0,03
3	First Franklin Mortgage Loan Trust 2002-FF1, Serie 2002 FF1, Clase 1A2, 6,568 %, con vencimiento el 25/04/2032 *	3	–
3.590	Freddie Mac Multifamily Structured Credit Risk, Serie 2021 MN2, Clase M2, 144A, 8,672 %, con vencimiento el 25/07/2041 *	3.172	0,60
6.605	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K038, Clase X3, 2,411 %, con vencimiento el 25/06/2042 *	16	–
19.370	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K052, Clase X3, 1,616 %, con vencimiento el 25/01/2044 *	514	0,10
12.600	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Serie K 162, Clase X1, 0,370 %, con vencimiento el 25/12/2033 *	406	0,08
3.484	Freddie Mac REMICS 5152, Clase IO, 2,500 %, con vencimiento el 25/10/2051	557	0,11
4.914	Freddie Mac STACR Debt Notes 2016-DNA1, Serie 2016 DNA1, Clase B, 15,436 %, con vencimiento el 25/07/2028 *	5.487	1,04
2.498	Freddie Mac STACR Debt Notes 2016-DNA2, Serie 2016 DNA2, Clase B, 15,936 %, con vencimiento el 25/10/2028 *	2.834	0,54
2.533	Freddie Mac STACR Debt Notes 2016-DNA3, Serie 2016 DNA3, Clase B, 16,686 %, con vencimiento el 25/12/2028 *	2.931	0,56
5.453	Freddie Mac STACR Debt Notes 2016-DNA4, Serie 2016 DNA4, Clase B, 14,036 %, con vencimiento el 25/03/2029 *	6.065	1,15
3.925	Freddie Mac STACR Debt Notes 2017-DNA2, Serie 2017 DNA2, Clase B2, 16,686 %, con vencimiento el 25/10/2029 *	4.711	0,90
6.215	Freddie Mac STACR Debt Notes 2017-HRP1, Serie 2017 HRP1, Clase B2D, 8,436 %, con vencimiento el 25/12/2042 *	4.896	0,93
6.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA1, Serie 2020 DNA1, Clase B2, 144A, 10,686 %, con vencimiento el 25/01/2050 *	6.416	1,22
8.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA2, Serie 2020 DNA2, Clase B2, 144A, 10,236 %, con vencimiento el 25/02/2050 *	8.513	1,62
1.640	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA2, Serie 2021 DNA2, Clase B2, 144A, 11,322 %, con vencimiento el 25/08/2033 *	1.861	0,35
530	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Serie 2021 DNA5, Clase B2, 144A, 10,822 %, con vencimiento el 25/01/2034 *	574	0,11
5.020	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Serie 2021 DNA6, Clase B2, 144A, 12,822 %, con vencimiento el 25/10/2041 *	5.377	1,02
3.995	Freddie Mac STACR Securitized Participation Interests Trust 2018-SPI1, Serie 2018 SPI1, Clase B, 144A, 3,785 %, con vencimiento el 25/02/2048 *	2.545	0,48
5.874	Freddie Mac STACR Securitized Participation Interests Trust 2018-SPI2, Serie 2018 SPI2, Clase B, 144A, 3,845 %, con vencimiento el 25/05/2048 *	4.053	0,77
6.841	Freddie Mac STACR Securitized Participation Interests Trust 2018-SPI3, Serie 2018 SPI3, Clase B, 144A, 4,157 %, con vencimiento el 25/08/2048 *	5.019	0,95
3.000	Freddie Mac STACR Trust 2018-DNA3, Serie 2018 DNA3, Clase B2, 144A, 13,186 %, con vencimiento el 25/09/2048 *	3.504	0,67

^ *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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
4.620	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA1, Serie 2019 DNA1, Clase B2, 144A, 16,186 %, con vencimiento el 25/01/2049 *	5.805	1,10
3.100	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Serie 2019 DNA3, Clase B2, 144A, 13,586 %, con vencimiento el 25/07/2049 *	3.580	0,68
5.550	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA4, Serie 2019 DNA4, Clase B2, 144A, 11,686 %, con vencimiento el 25/10/2049 *	6.141	1,17
4.000	Freddie Mac STACR Trust 2019-FTR4, Serie 2019 FTR4, Clase B2, 144A, 10,436 %, con vencimiento el 25/11/2047 *	4.218	0,80
24.919	FRESB 2018-SB48 Mortgage Trust, Serie 2018 SB48, Clase B, 144A, 4,358 %, con vencimiento el 25/02/2038 *	11.833	2,25
707	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2010 102, Clase IO, 0,010 %, con vencimiento el 16/06/2052 *	–	–
1.777	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2010 13, Clase IO, 0,000 %, con vencimiento el 16/11/2051 *	–	–
147	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2011 127, Clase IO, 0,164 %, con vencimiento el 16/03/2047 *	–	–
12.430	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2011 95, Clase IO, 0,006 %, con vencimiento el 16/04/2051 *	1	–
7.899	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2012 114, Clase IO, 0,623 %, con vencimiento el 16/01/2053 *	123	0,02
2.903	Government National Mortgage Association, Serie 2013 163, Clase IO, 1,010 %, con vencimiento el 16/02/2046 *	41	0,01
5.181	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2014 16, Clase IO, 0,426 %, con vencimiento el 16/06/2055 *	65	0,01
7.112	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2014 171, Clase IO, 0,405 %, con vencimiento el 16/11/2055 *	58	0,01
657	Government National Mortgage Association, Serie 2014 47, Clase IA, 0,153 %, con vencimiento el 16/02/2048 *	2	–
3.496	Government National Mortgage Association, Serie 2014 50, Clase IO, 0,628 %, con vencimiento el 16/09/2055 *	86	0,02
666	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, serie 2016 135, clase SB, 0,664 %, con vencimiento el 16/10/2046 *	90	0,02
631	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2016 51, Clase NS, 0,616 %, con vencimiento el 20/04/2046 *	68	0,01
3.140	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2018 125, Clase HS, 0,816 %, con vencimiento el 20/09/2048 *	294	0,06
4.524	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2022 202, Clase Z, 3,000 %, con vencimiento el 16/10/2063 *	2.588	0,49
2.666	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2023 16, Clase Z, 3,500 %, con vencimiento el 16/07/2063 *	1.545	0,29
25.528	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Clase D, 144A, 11,865 %, con vencimiento el 15/09/2031 *	3.312	0,63
1.250	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC26, Serie 2014 GC26, Clase D, 144A, 4,509 %, con vencimiento el 10/11/2047 *	888	0,17
3.200	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC28, Serie 2015 GC28, Clase D, 144A, 4,306 %, con vencimiento el 10/02/2048 *	2.891	0,55
2.500	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC30, Serie 2015 GC30, Clase D, 3,384 %, con vencimiento el 10/05/2050	1.943	0,37
1.500	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC32, Serie 2015 GC32, Clase D, 3,345 %, con vencimiento el 10/07/2048	1.308	0,25
4.846	GSR Mortgage Loan Trust 2006-1F, Serie 2006 1F, Clase 6A1, 5,835 %, con vencimiento el 25/02/2036 *	500	0,10
72	HarborView Mortgage Loan Trust 2004-11, Serie 2004 11, Clase 3A3, 6,194 %, con vencimiento el 19/01/2035 *	68	0,01
44	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Clase 2A1A, 5,974 %, con vencimiento el 19/03/2035 *	43	0,01
119	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-10, Serie 2005 10, Clase 2A1A, 6,054 %, con vencimiento el 19/11/2035 *	79	0,02
403	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-2, Serie 2005 2, Clase 2A1A, 5,874 %, con vencimiento el 19/05/2035 *	362	0,07
172	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-3, Serie 2005 3, Clase 2A1A, 5,914 %, con vencimiento el 19/06/2035 *	162	0,03
1.686	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-8, Serie 2005 8, Clase 2A2, 6,581 %, con vencimiento el 19/09/2035 *	1.429	0,27
413	HarborView Mortgage Loan Trust 2006-10, Serie 2006 10, Clase 2A1A, 5,809 %, con vencimiento el 19/11/2036 *	355	0,07
500	HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Serie 2021 FL1, Clase E, 144A, 8,386 %, con vencimiento el 16/06/2036 *	466	0,09
686	Impac CMB Trust Serie 2005-1, Serie 2005 1, Clase M1, 6,125 %, con vencimiento el 25/04/2035 *	625	0,12
1.500	Impac CMB Trust Serie 2005-3, Serie 2005 3, Clase A2, 6,035 %, con vencimiento el 25/08/2035 *	1.332	0,25
567	Impac CMB Trust Serie 2005-4, Serie 2005 4, Clase 1M1, 6,080 %, con vencimiento el 25/05/2035 *	511	0,10
922	Impac CMB Trust Serie 2005-7, Serie 2005 7, Clase A1, 5,955 %, con vencimiento el 25/11/2035 *	808	0,15
1.268	Impac Secured Assets Trust 2006-2, Serie 2006 2, Clase 2B, 6,535 %, con vencimiento el 25/08/2036 *	1.256	0,24
15	Impac Secured Assets Trust 2006-2, Serie 2006 2, Clase 2M3, 6,535 %, con vencimiento el 25/08/2036 *	15	–
618	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR13, Serie 2005 AR13, Clase 1A1, 4,065 %, con vencimiento el 25/08/2035 *	303	0,06
553	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR2, Serie 2005 AR2, Clase 2A1B, 6,215 %, con vencimiento el 25/02/2035 *	389	0,07
1.782	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR6, Serie 2005 AR6, Clase 2A2, 6,095 %, con vencimiento el 25/04/2035 *	1.302	0,25
28.545	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, 0,000 %, con vencimiento el 15/06/2035 †ε	358	0,07
2.282	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, Serie 2017 FL11, Clase E, 144A, 9,464 %, con vencimiento el 15/10/2032 *	2.265	0,43
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 *	2.195	0,42
4.022	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-FL7, Serie 2015 FL7, Clase D, 144A, 9,193 %, con vencimiento el 15/05/2028 *	3.506	0,67
3.600	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1, Serie 2015 JP1, Clase C, 4,723 %, con vencimiento el 15/01/2049 *	3.197	0,61
1.800	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Serie 2018 WPT, Clase GFL, 144A, 8,963 %, con vencimiento el 05/07/2033 *	1.118	0,21
6.574	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Serie 2020 MKST, Clase G, 144A, 10,182 %, con vencimiento el 15/12/2036 *	497	0,09
6.867	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Serie 2020 MKST, Clase H, 144A, 12,682 %, con vencimiento el 15/12/2036 *	376	0,07
4.000	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2021-NYMZ, Serie 2021 NYMZ, Clase M, 144A, 12,682 %, con vencimiento el 15/06/2026 *	3.141	0,60
9.110	JP Morgan Mortgage Trust 2018-4, Serie 2018 4, Clase AX1, 144A, 0,214 %, con vencimiento el 25/10/2048 *†	60	0,01
5.420	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C25, Serie 2014 C25, Clase D, 144A, 3,932 %, con vencimiento el 15/11/2047 *	3.344	0,64
11	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-15, Serie 2004 15, Clase 6A1, 5,765 %, con vencimiento el 25/12/2034 *	10	–
1.464	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-6, Serie 2004 6, Clase B1, 5,495 %, con vencimiento el 25/07/2034 *	1.339	0,25
1.179	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-8, Serie 2004 8, Clase B1, 5,451 %, con vencimiento el 25/09/2034 *	1.040	0,20
661	MASTR Reperforming Loan Trust 2005-1, Serie 2005 1, Clase 1A1, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 25/08/2034	416	0,08
808	MASTR Reperforming Loan Trust 2005-2, Serie 2005 2, Clase 1A1F, 144A, 5,785 %, con vencimiento el 25/05/2035 *	420	0,08
5.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32, Serie 2016 C32, Clase D, 144A, 3,396 %, con vencimiento el 15/12/2049 *	3.187	0,61
3.742	Morgan Stanley Capital I Trust 2016-BNK2, Serie 2016 BNK2, Clase B, 3,485 %, con vencimiento el 15/11/2049	3.042	0,58
1.361	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2004-11AR, Serie 2004 11AR, Clase 1B1, 6,035 %, con vencimiento el 25/01/2035 *	1.090	0,21
3.304	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2006-8AR, Serie 2006 8AR, Clase 1A3, 5,755 %, con vencimiento el 25/06/2036 *	671	0,13
508	Multifamily Trust 2016-1, Serie 2016 1, Clase B, 144A, 4,323 %, con vencimiento el 25/04/2046 *	506	0,10
5.308	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Clase D, 144A, 4,398 %, con vencimiento el 15/08/2036 *	3.339	0,63
4.870	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Clase E, 144A, 4,398 %, con vencimiento el 15/08/2036 *	2.576	0,49

^ 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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
3.000	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2022-JERI, Serie 2022 JERI, Clase G, 144A, 12,775 %, con vencimiento el 15/01/2039 *	2.419	0,46
3.355	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-4, Serie 2016 4A, Clase B5, 144A, 4,861 %, con vencimiento el 25/11/2056 *	3.019	0,57
3.000	New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM3, Serie 2021 NQM3, Clase B2, 144A, 4,051 %, con vencimiento el 27/11/2056 *	2.254	0,43
487	Opteum Mortgage Acceptance Corp Trust 2006-1, Serie 2006 1, Clase M1, 5,990 %, con vencimiento el 25/04/2036 *	1.114	0,21
2.728	PMT Credit Risk Transfer Trust, 144A, 9,135 %, con vencimiento el 29/10/2024 *	2.725	0,52
3.000	PMT Credit Risk Transfer Trust, 144A, 8,875 %, con vencimiento el 27/02/2025 *	2.981	0,57
579	RALI Serie 2006-QA2 Trust, Serie 2006 QA2, Clase 1A1, 5,685 %, con vencimiento el 25/02/2036 *	365	0,07
927	Reperforming Loan REMIC Trust 2006-R2, Serie 2006 R2, Clase AF1, 144A, 5,855 %, con vencimiento el 25/07/2036 *	851	0,16
3.289	Residential Asset Securitization Trust 2006-A7CB, Serie 2006 A7CB, Clase 1A3, 6,250 %, con vencimiento el 25/07/2036	2.579	0,49
12.867	Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, Serie 2017 4, Clase B, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 25/06/2057 †	2.368	0,45
18.836	Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, Serie 2017 4, Clase BIO, 144A, 1,243 %, con vencimiento el 25/06/2057 *†	3.312	0,63
4.393	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2016-1, Serie 2016 1, Clase B, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 25/09/2055 †	463	0,09
7.637	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2016-1, Serie 2016 1, Clase BIO, 144A, 1,365 %, con vencimiento el 25/09/2055 *†	876	0,17
3.222	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2016-1, Serie 2016 1, Clase M2, 144A, 3,750 %, con vencimiento el 25/09/2055 *	2.894	0,55
49.006	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2016-1, Serie 2016 1, Clase XSIO, 144A, 0,075 %, con vencimiento el 25/09/2055 *†	198	0,04
2.319	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-1, Serie 2018 1, Clase M, 4,750 %, con vencimiento el 25/05/2057 *	2.226	0,42
11.418	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-2, Serie 2018 2, Clase BX, 4,127 %, con vencimiento el 25/11/2057 *	4.014	0,76
15.971	Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2018-3, Serie 2018 3, Clase BX, 144A, 0,797 %, con vencimiento el 25/08/2057 *	5.598	1,06
650	Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Clase D, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/11/2027 *	26	0,01
14.332	Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Serie 2014 STAR, Clase E, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/11/2027 *†	66	0,01
295	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust, Serie 2004 2, Clase 1A1, 5,763 %, con vencimiento el 25/03/2034 *	265	0,05
48	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR6, Serie 2006 AR6, Clase 1A1, 5,795 %, con vencimiento el 25/07/2046 *	40	0,01
3.900	Towd Point Mortgage Trust 2018-2, Serie 2018 2, Clase B2, 144A, 3,711 %, con vencimiento el 25/03/2058 *	3.139	0,60
7.118	Towd Point Mortgage Trust 2018-4, Serie 2018 4, Clase B2, 144A, 3,296 %, con vencimiento el 25/06/2058 *	4.896	0,93
4.000	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-NYCH, Serie 2018 NYCH, Clase F, 144A, 9,186 %, con vencimiento el 15/02/2032 *	3.816	0,73
3.069	Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Clase A3, 144A, 6,319 %, con vencimiento el 25/05/2068	3.055	0,58
2.770	Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Clase B1, 144A, 8,195 %, con vencimiento el 25/05/2068 *	2.759	0,52
2.750	Verus Securitization Trust 2024-1, Serie 2024 1, Clase B1, 144A, 7,909 %, con vencimiento el 25/01/2069 *	2.757	0,52
3.289	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR11 Trust, Serie 2005 AR11, Clase B1, 6,350 %, con vencimiento el 25/08/2045 *	2.666	0,51
957	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Serie 2005-AR9 Trust, Serie 2005 AR9, Clase B1, 6,380 %, con vencimiento el 25/07/2045 *	799	0,15
1.343	Waterfall Commercial Mortgage Trust 2015-SBC5, Serie 2015 SBC5, Clase B, 144A, 6,379 %, con vencimiento el 14/09/2022 *	1.161	0,22
2.500	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28, Serie 2015 C28, Clase D, 4,080 %, con vencimiento el 15/05/2048 *	2.096	0,40
1.252	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C22, Serie 2014 C22, Clase D, 144A, 3,895 %, con vencimiento el 15/09/2057 *	645	0,12
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 533.126 $)		392.587	74,61
Bonos y obligaciones corporativos: 1,23 % (28 de febrero de 2023: 0,48 %)			
Estados Unidos: 1,23 % (28 de febrero de 2023: 0,48 %)			
1.200	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 15/01/2028	1.228	0,23
1.550	Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, con vencimiento el 15/02/2028	1.455	0,28
4.000	Two Harbors Investment Corp, 6,250 %, con vencimiento el 15/01/2026	3.780	0,72
		6.463	1,23
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 6.311 $)		6.463	1,23
Obligaciones de préstamo: 3,13 % (28 de febrero de 2023: 3,29 %)			
30.000	American Dream, 0,000 %, con vencimiento el 29/06/2024 *†∞	1.102	0,21
1.613	Freehand Hotel, 9,523 %, con vencimiento el 17/12/2024 *∞	1.589	0,30
2.935	Freehand Hotel, 9,523 %, con vencimiento el 17/12/2024 *∞	2.891	0,55
5.452	Freehand Hotel, 9,523 %, con vencimiento el 17/12/2024 *∞	5.372	1,02
5.551	Sono Retail Loan, 8,702 %, con vencimiento el 06/06/2024 *∞	5.524	1,05
Total de obligaciones de préstamo (coste 45.457 $)		16.478	3,13
Organismos de inversión colectiva: 4,09 % (28 de febrero de 2023: 3,08 %)			
21.501	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	21.501	4,09
Total de organismos de inversión colectiva (coste 21.501 $)		21.501	4,09
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 710.927 $)		519.423	98,72
Contratos de divisas a plazo: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		12	–
Futuros: 0,03 % (28 de febrero de 2023: 0,05 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		166	0,03
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		519.601	98,75
Contratos de divisas a plazo: 0,00 % (28 de febrero de 2023: (0,30 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(6)	–
Futuros: (0,06 %) (28 de febrero de 2023: (0,01 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(306)	(0,06)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(312)	(0,06)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		519.289	98,69
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		6.867	1,31
Patrimonio		526.156 $	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 Structured Opportunities Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 319.582.000 USD o el 60,72 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

† 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 al final o tras el ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024 (ya sea capital o interés).

ABREVIATURAS:

REMIC – Conducto de inversiones hipotecarias inmobiliarias.

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	91,27
Otros valores mobiliarios negociables en otro mercado regulado	3,12
Organismos de inversión colectiva	4,08
Instrumentos financieros derivados	0,03
Otros activos	1,50
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)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	260	Venta	CHF	228	$ 2
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	121	Venta	EUR	110	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	77	Venta	EUR	71	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	1.825	Venta	USD	1.965	10
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CHF	291	Venta	USD	337	(6)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 8 $)								$ 12
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (1.683) $)								(6)
Apreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (1.675) $)								$ 6

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 2024	Bank of America Merrill Lynch	(206)	$ (49.183)	$ 80
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2025	Bank of America Merrill Lynch	213	51.272	(203)
Índice SOFR de 3 meses Septiembre 2024	Bank of America Merrill Lynch	(204)	(48.544)	86
U.S. 10 Year Note (CBT) junio de 2024	Bank of America Merrill Lynch	(42)	(4.638)	(9)
U.S. 10 Year Ultra Note junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	(84)	(9.591)	(39)
U.S. 5 Year Note (CBT) junio de 2024	Bank of America Merrill Lynch	(4)	(428)	(1)
U.S. Long Bond (CBT) junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	(112)	(13.356)	(54)
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 317 $)				$ 166
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (73) $)				(306)
Depreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 244 $)				$ (140)

^ *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 al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por activos: 1,44 % (28 de febrero de 2023: 1,53 %)			
1.202	DB Master Finance LLC, Serie 2021 1A, Clase A23, 144A, 2,791 %, con vencimiento el 20/11/2051	1.006	0,09
1.357	FOCUS Brands Funding, Serie 2023 2, Clase A2, 144A, 8,241 %, con vencimiento el 30/10/2053	1.438	0,13
4.764	Goodleap Sustainable Home Solutions Trust 2023-3, Serie 2023 3C, Clase A, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 20/07/2055	4.895	0,43
2.658	Home Partners of America 2021-3 Trust, Serie 2021 3, Clase A, 144A, 2,200 %, con vencimiento el 17/01/2041	2.319	0,20
2.129	Loanpal Solar Loan 2021-2 Ltd, Serie 2021 2GS, Clase B, 144A, 2,790 %, con vencimiento el 20/03/2048	1.564	0,14
525	SBA Small Business Investment Cos, Serie 2018 10B, Clase 1, 3,548 %, con vencimiento el 10/09/2028	495	0,04
1.981	SBA Small Business Investment Cos, Serie 2023 10A, Clase 1, 5,168 %, con vencimiento el 10/03/2033	1.965	0,17
2.310	SBA Small Business Investment Cos, Serie 2023 10B, Clase 1, 5,688 %, con vencimiento el 10/09/2033	2.348	0,20
500	SMB Private Education Loan Trust 2023-C, Serie 2023 C, Clase B, 144A, 6,360 %, con vencimiento el 15/11/2052	502	0,04
Total de valores garantizados por activos (coste 17.407 $)		16.532	1,44
Valores garantizados por hipotecas: 98,31 % (28 de febrero de 2023: 98,53 %)			
53.715	BANK 2017-BNK8, Serie 2017 BNK8, Clase XA, 0,710 %, con vencimiento el 15/11/2050 *	1.133	0,10
2.400	BANK 2018-BNK10, Serie 2018 BN10, Clase A5, 3,688 %, con vencimiento el 15/02/2061	2.266	0,20
2.210	Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, Serie 2018 B1, Clase A5, 3,666 %, con vencimiento el 15/01/2051 *	2.053	0,18
4.050	BHMS 2018-ATLS, Serie 2018 ATLS, Clase A, 144A, 6,865 %, con vencimiento el 15/07/2035 *	4.039	0,35
995	BXMT 2020-FL2 Ltd, Serie 2020 FL2, Clase A, 144A, 6,336 %, con vencimiento el 15/02/2038 *	953	0,08
1.000	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Serie 2017 P8, Clase A3, 3,203 %, con vencimiento el 15/09/2050	933	0,08
1.470	COMM 2015-PC1 Mortgage Trust, Serie 2015 PC1, Clase A5, 3,902 %, con vencimiento el 10/07/2050	1.437	0,13
1.950	CSMC 2021-NQM8, Serie 2021 NQM8, Clase A1, 144A, 1,841 %, con vencimiento el 25/10/2066 *	1.671	0,15
2.325	DBCG 2017-BBG Mortgage Trust, Serie 2017 BBG, Clase A, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/06/2034 *	2.325	0,20
1.082	Fannie Mae Interest Strip 406, Clase 2, 4,000 %, con vencimiento el 25/02/2041	180	0,02
256	Fannie Mae Interest Strip 407, Clase 9, 5,000 %, con vencimiento el 25/02/2041 *	41	–
540	Fannie Mae Interest Strip 407, Clase C10, 5,000 %, con vencimiento el 25/01/2038	87	0,01
359	Fannie Mae Interest Strip 409, Clase C13, 3,500 %, con vencimiento el 25/11/2041	54	–
2.015	Fannie Mae Interest Strip 417, Clase C5, 3,500 %, con vencimiento el 25/02/2043	337	0,03
4.726	Fannie Mae Interest Strip 418, Clase C15, 3,500 %, con vencimiento el 25/08/2043	786	0,07
1.645	Fannie Mae Interest Strip 427, Clase C21, 2,000 %, con vencimiento el 25/03/2050	214	0,02
16.173	Fannie Mae Interest Strip 427, Clase C73, 3,000 %, con vencimiento el 25/12/2048	2.592	0,23
906	Fannie Mae Interest Strip 428, Clase C14, 2,500 %, con vencimiento el 25/01/2048	105	0,01
1.796	Fannie Mae Interest Strip 429, Clase C10, 1,500 %, con vencimiento el 25/04/2037	101	0,01
3.747	Fannie Mae Interest Strip 435, Clase C28, 3,500 %, con vencimiento el 25/09/2052	687	0,06
2.000	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,000 % ±	1.711	0,15
3.900	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,500 % ±	3.693	0,32
2.000	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,500 % ±	1.893	0,16
3.800	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 6,000 % ±	3.816	0,33
–	Fannie Mae Pool '252875', 8,000 %, con vencimiento el 01/11/2029	–	–
–	Fannie Mae Pool '253184', 8,000 %, con vencimiento el 01/04/2030	–	–
–	Fannie Mae Pool '253399', 8,500 %, con vencimiento el 01/08/2030	–	–
–	Fannie Mae Pool '253438', 8,500 %, con vencimiento el 01/09/2030	–	–
–	Fannie Mae Pool '253598', 8,500 %, con vencimiento el 01/12/2030	–	–
–	Fannie Mae Pool '535270', 8,500 %, con vencimiento el 01/04/2030	–	–
6	Fannie Mae Pool '535299', 7,500 %, con vencimiento el 01/05/2030	6	–
1	Fannie Mae Pool '535332', 8,500 %, con vencimiento el 01/04/2030	1	–
–	Fannie Mae Pool '535351', 8,000 %, con vencimiento el 01/06/2030	–	–
–	Fannie Mae Pool '535435', 8,500 %, con vencimiento el 01/08/2030	–	–
–	Fannie Mae Pool '535608', 9,500 %, con vencimiento el 01/04/2030	–	–
3	Fannie Mae Pool '535996', 7,500 %, con vencimiento el 01/06/2031	3	–
–	Fannie Mae Pool '537715', 8,500 %, con vencimiento el 01/09/2030	–	–
17	Fannie Mae Pool '545189', 7,500 %, con vencimiento el 01/08/2031	17	–
14	Fannie Mae Pool '545190', 7,500 %, con vencimiento el 01/08/2031	14	–
1	Fannie Mae Pool '545612', 8,000 %, con vencimiento el 01/04/2032	1	–
1	Fannie Mae Pool '545990', 7,500 %, con vencimiento el 01/04/2031	1	–
–	Fannie Mae Pool '546591', 8,500 %, con vencimiento el 01/06/2030	–	–
1	Fannie Mae Pool '548965', 8,500 %, con vencimiento el 01/07/2030	1	–
8	Fannie Mae Pool '555676', 7,500 %, con vencimiento el 01/12/2032	8	–
11	Fannie Mae Pool '745248', 7,500 %, con vencimiento el 01/08/2034	11	–
100	Fannie Mae Pool '745802', 6,000 %, con vencimiento el 01/07/2036	103	0,01
406	Fannie Mae Pool '836398', 6,915 %, con vencimiento el 01/10/2035 *	414	0,04
6	Fannie Mae Pool '836852', 6,847 %, con vencimiento el 01/10/2035 *	6	–
7	Fannie Mae Pool '843823', 6,977 %, con vencimiento el 01/11/2035 *	7	–
75	Fannie Mae Pool '843997', 6,871 %, con vencimiento el 01/11/2035 *	76	0,01
19	Fannie Mae Pool '865915', 7,122 %, con vencimiento el 01/03/2036 *	19	–
513	Fannie Mae Pool '890604', 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2044	498	0,04
14	Fannie Mae Pool '902663', 6,000 %, con vencimiento el 01/11/2036	15	–
3	Fannie Mae Pool '909856', 6,000 %, con vencimiento el 01/03/2037	3	–
1	Fannie Mae Pool '974763', 4,500 %, con vencimiento el 01/04/2038	1	–
14	Fannie Mae Pool '981766', 4,500 %, con vencimiento el 01/04/2038	14	–
4	Fannie Mae Pool '995072', 5,500 %, con vencimiento el 01/08/2038	4	–
56	Fannie Mae Pool 'AA8438', 4,500 %, con vencimiento el 01/06/2039	54	–
941	Fannie Mae Pool 'AB3882', 4,500 %, con vencimiento el 01/11/2041	918	0,08
351	Fannie Mae Pool 'AB5692', 4,000 %, con vencimiento el 01/06/2042	332	0,03
29	Fannie Mae Pool 'AB7668', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2043	26	–
186	Fannie Mae Pool 'AB9107', 3,500 %, con vencimiento el 01/04/2033	176	0,02
10	Fannie Mae Pool 'AD3336', 5,500 %, con vencimiento el 01/04/2040	11	–
3	Fannie Mae Pool 'AD4567', 5,500 %, con vencimiento el 01/04/2040	3	–
5	Fannie Mae Pool 'AD4598', 5,500 %, con vencimiento el 01/05/2040	5	–
10	Fannie Mae Pool 'AD4614', 5,500 %, con vencimiento el 01/06/2040	10	–
6	Fannie Mae Pool 'AD8281', 5,500 %, con vencimiento el 01/07/2040	6	–
20	Fannie Mae Pool 'AD8326', 5,500 %, con vencimiento el 01/07/2040	20	–
10	Fannie Mae Pool 'AE0758', 7,000 %, con vencimiento el 01/02/2039	10	–
32	Fannie Mae Pool 'AH5036', 5,500 %, con vencimiento el 01/02/2041	32	–
15	Fannie Mae Pool 'AH9785', 5,500 %, con vencimiento el 01/04/2041	15	–
25	Fannie Mae Pool 'AI9532', 5,500 %, con vencimiento el 01/09/2041	25	–
15	Fannie Mae Pool 'AJ2033', 5,500 %, con vencimiento el 01/10/2041	15	–
26	Fannie Mae Pool 'AJ4713', 4,500 %, con vencimiento el 01/11/2041	26	–
80	Fannie Mae Pool 'AL1051', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2041	78	0,01
445	Fannie Mae Pool 'AL1469', 7,000 %, con vencimiento el 01/02/2039	470	0,04
203	Fannie Mae Pool 'AL1470', 7,000 %, con vencimiento el 01/04/2037	211	0,02
3.359	Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2043	3.061	0,27
29	Fannie Mae Pool 'AL3026', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2042	27	–
1.160	Fannie Mae Pool 'AL4324', 6,500 %, con vencimiento el 01/05/2040	1.206	0,10

^ *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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
106	Fannie Mae Pool 'AL4741', 4,500 %, con vencimiento el 01/01/2044	102	0,01
4.395	Fannie Mae Pool 'AL7093', 4,000 %, con vencimiento el 01/05/2045	4.184	0,36
794	Fannie Mae Pool 'AL7877', 4,000 %, con vencimiento el 01/12/2045	748	0,07
787	Fannie Mae Pool 'AL8991', 3,000 %, con vencimiento el 01/08/2035	728	0,06
92	Fannie Mae Pool 'AL9546', 3,500 %, con vencimiento el 01/11/2046	85	0,01
93	Fannie Mae Pool 'AO4102', 4,000 %, con vencimiento el 01/06/2042	88	0,01
318	Fannie Mae Pool 'AP9766', 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2042	300	0,03
892	Fannie Mae Pool 'AQ6295', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2032	849	0,07
58	Fannie Mae Pool 'AQ7130', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2032	55	–
223	Fannie Mae Pool 'AQ7270', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2032	212	0,02
276	Fannie Mae Pool 'AQ7306', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2043	244	0,02
272	Fannie Mae Pool 'AQ7864', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2032	258	0,02
41	Fannie Mae Pool 'AQ7869', 3,500 %, con vencimiento el 01/11/2032	39	–
120	Fannie Mae Pool 'AQ7913', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2032	114	0,01
124	Fannie Mae Pool 'AQ8677', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2032	118	0,01
83	Fannie Mae Pool 'AR1198', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2043	73	0,01
275	Fannie Mae Pool 'AR1202', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2043	244	0,02
140	Fannie Mae Pool 'AR7399', 3,000 %, con vencimiento el 01/06/2043	124	0,01
328	Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, con vencimiento el 01/07/2043	291	0,03
491	Fannie Mae Pool 'AS0462', 3,500 %, con vencimiento el 01/09/2033	467	0,04
171	Fannie Mae Pool 'AS0469', 4,000 %, con vencimiento el 01/09/2033	165	0,01
97	Fannie Mae Pool 'AS1281', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2033	92	0,01
3.146	Fannie Mae Pool 'AS4347', 4,000 %, con vencimiento el 01/01/2045	2.965	0,26
1.338	Fannie Mae Pool 'AS4363', 4,500 %, con vencimiento el 01/02/2045	1.307	0,11
380	Fannie Mae Pool 'AS6340', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2045	346	0,03
260	Fannie Mae Pool 'AS6541', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2046	237	0,02
211	Fannie Mae Pool 'AS6562', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2046	191	0,02
229	Fannie Mae Pool 'AS9453', 4,000 %, con vencimiento el 01/04/2047	216	0,02
148	Fannie Mae Pool 'AS9760', 4,500 %, con vencimiento el 01/06/2047	143	0,01
197	Fannie Mae Pool 'AT2486', 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2033	187	0,02
2.956	Fannie Mae Pool 'AT3070', 3,500 %, con vencimiento el 01/04/2043	2.707	0,24
66	Fannie Mae Pool 'AU4395', 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2033	63	0,01
25	Fannie Mae Pool 'AU4397', 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2033	24	–
312	Fannie Mae Pool 'AU6735', 3,000 %, con vencimiento el 01/10/2043	277	0,02
69	Fannie Mae Pool 'AU7248', 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2033	67	0,01
76	Fannie Mae Pool 'AU9562', 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2033	73	0,01
102	Fannie Mae Pool 'AU9567', 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2033	99	0,01
78	Fannie Mae Pool 'AU9570', 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2033	75	0,01
21	Fannie Mae Pool 'AV7116', 4,500 %, con vencimiento el 01/03/2044	20	–
70	Fannie Mae Pool 'AV7681', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2034	66	0,01
158	Fannie Mae Pool 'AV7683', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2034	149	0,01
197	Fannie Mae Pool 'AV7694', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2034	186	0,02
269	Fannie Mae Pool 'AV7696', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2034	254	0,02
2.082	Fannie Mae Pool 'AZ9645', 4,000 %, con vencimiento el 01/09/2035	2.008	0,17
2.383	Fannie Mae Pool 'BF0144', 3,500 %, con vencimiento el 01/10/2056	2.129	0,19
650	Fannie Mae Pool 'BF0145', 3,500 %, con vencimiento el 01/03/2057	573	0,05
1.812	Fannie Mae Pool 'BF0161', 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2046	1.812	0,16
3.567	Fannie Mae Pool 'BF0162', 5,000 %, con vencimiento el 01/11/2045	3.568	0,31
862	Fannie Mae Pool 'BF0191', 4,000 %, con vencimiento el 01/06/2057	803	0,07
1.616	Fannie Mae Pool 'BF0222', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2057	1.544	0,13
1.064	Fannie Mae Pool 'BF0263', 3,500 %, con vencimiento el 01/05/2058	953	0,08
1.935	Fannie Mae Pool 'BF0301', 4,500 %, con vencimiento el 01/08/2058	1.849	0,16
664	Fannie Mae Pool 'BF0338', 4,500 %, con vencimiento el 01/01/2059	630	0,05
1.941	Fannie Mae Pool 'BF0531', 2,500 %, con vencimiento el 01/05/2055	1.612	0,14
175	Fannie Mae Pool 'BH6684', 4,000 %, con vencimiento el 01/08/2047	164	0,01
82	Fannie Mae Pool 'BJ0685', 4,000 %, con vencimiento el 01/04/2048	77	0,01
1.050	Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000 %, con vencimiento el 01/12/2037	954	0,08
279	Fannie Mae Pool 'BJ2763', 4,500 %, con vencimiento el 01/05/2048	269	0,02
27	Fannie Mae Pool 'BK0751', 3,500 %, con vencimiento el 01/03/2048	25	–
713	Fannie Mae Pool 'BK4770', 4,500 %, con vencimiento el 01/08/2048	685	0,06
360	Fannie Mae Pool 'BM1660', 4,000 %, con vencimiento el 01/08/2047	339	0,03
1.188	Fannie Mae Pool 'BM3929', 3,500 %, con vencimiento el 01/07/2032	1.135	0,10
976	Fannie Mae Pool 'BM4696', 3,000 %, con vencimiento el 01/03/2047	867	0,08
167	Fannie Mae Pool 'BM4751', 3,500 %, con vencimiento el 01/03/2043	153	0,01
91	Fannie Mae Pool 'BM4781', 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2048	88	0,01
237	Fannie Mae Pool 'BM4897', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2046	217	0,02
1.802	Fannie Mae Pool 'BM4951', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2048	1.758	0,15
751	Fannie Mae Pool 'BM5073', 3,000 %, con vencimiento el 01/04/2048	657	0,06
112	Fannie Mae Pool 'BM5119', 4,500 %, con vencimiento el 01/12/2048	108	0,01
628	Fannie Mae Pool 'BM6912', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2052	500	0,04
101	Fannie Mae Pool 'BO2878', 3,000 %, con vencimiento el 01/11/2049	87	0,01
137	Fannie Mae Pool 'BO8932', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2050	119	0,01
794	Fannie Mae Pool 'BP2319', 3,000 %, con vencimiento el 01/02/2050	689	0,06
604	Fannie Mae Pool 'BP3484', 2,500 %, con vencimiento el 01/06/2051	504	0,04
941	Fannie Mae Pool 'BP6171', 3,500 %, con vencimiento el 01/04/2050	856	0,07
3.595	Fannie Mae Pool 'BP7395', 1,500 %, con vencimiento el 01/10/2040	2.893	0,25
616	Fannie Mae Pool 'BP8713', 3,000 %, con vencimiento el 01/08/2050	533	0,05
311	Fannie Mae Pool 'BQ5876', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2050	260	0,02
69	Fannie Mae Pool 'BR0001', 2,500 %, con vencimiento el 01/12/2050	58	0,01
695	Fannie Mae Pool 'BR1001', 2,500 %, con vencimiento el 01/05/2051	586	0,05
80	Fannie Mae Pool 'BR1823', 2,000 %, con vencimiento el 01/01/2051	64	0,01
81	Fannie Mae Pool 'BR2303', 3,000 %, con vencimiento el 01/08/2051	71	0,01
146	Fannie Mae Pool 'BR2641', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	117	0,01
135	Fannie Mae Pool 'BR2643', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	109	0,01
67	Fannie Mae Pool 'BR2644', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	54	–
68	Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	56	–
212	Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	172	0,01
368	Fannie Mae Pool 'BR3286', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	296	0,03
156	Fannie Mae Pool 'BR4035', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	124	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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
4.167	Fannie Mae Pool 'BR4393', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	3.298	0,29
351	Fannie Mae Pool 'BR4722', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	281	0,02
315	Fannie Mae Pool 'BR4753', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	253	0,02
611	Fannie Mae Pool 'BR4756', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	490	0,04
311	Fannie Mae Pool 'BR5487', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	249	0,02
546	Fannie Mae Pool 'BR5587', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	438	0,04
856	Fannie Mae Pool 'BR5633', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	686	0,06
152	Fannie Mae Pool 'BR6515', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2051	123	0,01
72	Fannie Mae Pool 'BR7744', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2051	58	0,01
72	Fannie Mae Pool 'BR7745', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2051	58	0,01
200	Fannie Mae Pool 'BR8276', 2,500 %, con vencimiento el 01/04/2051	167	0,01
78	Fannie Mae Pool 'BR8478', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2051	63	0,01
73	Fannie Mae Pool 'BR8518', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2051	58	0,01
279	Fannie Mae Pool 'BR9104', 2,500 %, con vencimiento el 01/05/2051	234	0,02
100	Fannie Mae Pool 'BS8995', 4,820 %, con vencimiento el 01/07/2033	100	0,01
100	Fannie Mae Pool 'BS9506', 5,490 %, con vencimiento el 01/10/2033	104	0,01
471	Fannie Mae Pool 'BT0846', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2051	393	0,03
665	Fannie Mae Pool 'BT3244', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2051	555	0,05
571	Fannie Mae Pool 'BT3270', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	477	0,04
348	Fannie Mae Pool 'BT3290', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	290	0,03
236	Fannie Mae Pool 'BT3303', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	198	0,02
2.916	Fannie Mae Pool 'BT9482', 2,500 %, con vencimiento el 01/12/2051	2.423	0,21
15.327	Fannie Mae Pool 'BU0971', 2,000 %, con vencimiento el 01/11/2051	12.266	1,07
841	Fannie Mae Pool 'BU2599', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2052	703	0,06
2.998	Fannie Mae Pool 'BU2838', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2051	2.500	0,22
77	Fannie Mae Pool 'BU5925', 3,000 %, con vencimiento el 01/12/2051	67	0,01
1.489	Fannie Mae Pool 'BU8670', 4,500 %, con vencimiento el 01/05/2052	1.410	0,12
3.762	Fannie Mae Pool 'BW5810', 5,000 %, con vencimiento el 01/08/2052	3.654	0,32
78	Fannie Mae Pool 'BX6441', 6,500 %, con vencimiento el 01/02/2053	80	0,01
935	Fannie Mae Pool 'BX7702', 6,500 %, con vencimiento el 01/02/2053	956	0,08
129	Fannie Mae Pool 'CA0907', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2047	118	0,01
4.876	Fannie Mae Pool 'CA0917', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2047	4.421	0,38
1.137	Fannie Mae Pool 'CA1902', 4,500 %, con vencimiento el 01/06/2048	1.096	0,10
881	Fannie Mae Pool 'CA6000', 3,000 %, con vencimiento el 01/06/2050	762	0,07
461	Fannie Mae Pool 'CA6053', 3,000 %, con vencimiento el 01/06/2050	399	0,03
3.510	Fannie Mae Pool 'CA7257', 2,500 %, con vencimiento el 01/10/2050	2.938	0,26
66	Fannie Mae Pool 'CA8955', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2051	55	–
1.697	Fannie Mae Pool 'CB1878', 3,000 %, con vencimiento el 01/10/2051	1.463	0,13
4.516	Fannie Mae Pool 'CB2164', 3,000 %, con vencimiento el 01/11/2051	3.907	0,34
2.860	Fannie Mae Pool 'CB2292', 3,000 %, con vencimiento el 01/11/2051	2.486	0,22
2.132	Fannie Mae Pool 'CB3044', 2,500 %, con vencimiento el 01/03/2052	1.777	0,15
1.168	Fannie Mae Pool 'CB4788', 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2052	1.135	0,10
7.023	Fannie Mae Pool 'CB4898', 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2052	6.820	0,59
7.083	Fannie Mae Pool 'CB5104', 4,500 %, con vencimiento el 01/11/2052	6.712	0,58
878	Fannie Mae Pool 'CB5156', 6,500 %, con vencimiento el 01/11/2052	904	0,08
1.251	Fannie Mae Pool 'CB5497', 6,500 %, con vencimiento el 01/01/2053	1.289	0,11
1.147	Fannie Mae Pool 'CB5500', 6,500 %, con vencimiento el 01/01/2053	1.171	0,10
1.642	Fannie Mae Pool 'FM1002', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2048	1.486	0,13
65	Fannie Mae Pool 'FM1159', 4,500 %, con vencimiento el 01/02/2048	63	0,01
818	Fannie Mae Pool 'FM1349', 3,500 %, con vencimiento el 01/03/2047	745	0,06
60	Fannie Mae Pool 'FM1458', 4,500 %, con vencimiento el 01/04/2049	58	0,01
985	Fannie Mae Pool 'FM1637', 4,500 %, con vencimiento el 01/05/2049	950	0,08
188	Fannie Mae Pool 'FM2173', 4,000 %, con vencimiento el 01/09/2048	176	0,02
1.850	Fannie Mae Pool 'FM2256', 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2044	1.797	0,16
385	Fannie Mae Pool 'FM2745', 4,500 %, con vencimiento el 01/03/2050	368	0,03
66	Fannie Mae Pool 'FM3083', 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2049	63	0,01
245	Fannie Mae Pool 'FM3158', 4,000 %, con vencimiento el 01/11/2048	230	0,02
1.838	Fannie Mae Pool 'FM3445', 4,000 %, con vencimiento el 01/09/2048	1.724	0,15
71	Fannie Mae Pool 'FM3542', 4,000 %, con vencimiento el 01/05/2049	67	0,01
183	Fannie Mae Pool 'FM3830', 3,000 %, con vencimiento el 01/04/2050	159	0,01
93	Fannie Mae Pool 'FM4532', 3,000 %, con vencimiento el 01/09/2050	80	0,01
627	Fannie Mae Pool 'FM4577', 2,500 %, con vencimiento el 01/10/2050	523	0,05
352	Fannie Mae Pool 'FM5018', 2,500 %, con vencimiento el 01/12/2050	290	0,03
1.160	Fannie Mae Pool 'FM5423', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2051	968	0,08
57	Fannie Mae Pool 'FM5743', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2051	48	–
113	Fannie Mae Pool 'FM5904', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2051	94	0,01
275	Fannie Mae Pool 'FM5931', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2051	228	0,02
258	Fannie Mae Pool 'FM6117', 3,000 %, con vencimiento el 01/11/2048	225	0,02
147	Fannie Mae Pool 'FM6460', 2,500 %, con vencimiento el 01/03/2051	123	0,01
240	Fannie Mae Pool 'FM6816', 2,500 %, con vencimiento el 01/04/2051	199	0,02
2.478	Fannie Mae Pool 'FM7167', 4,500 %, con vencimiento el 01/08/2050	2.369	0,21
14.192	Fannie Mae Pool 'FM7382', 3,000 %, con vencimiento el 01/05/2051	12.300	1,07
6.571	Fannie Mae Pool 'FM7518', 2,500 %, con vencimiento el 01/06/2051	5.476	0,48
238	Fannie Mae Pool 'FM7529', 3,000 %, con vencimiento el 01/05/2051	206	0,02
262	Fannie Mae Pool 'FM7675', 2,500 %, con vencimiento el 01/06/2051	219	0,02
81	Fannie Mae Pool 'FM7676', 2,500 %, con vencimiento el 01/06/2051	67	0,01
75	Fannie Mae Pool 'FM7694', 3,000 %, con vencimiento el 01/06/2051	65	0,01
219	Fannie Mae Pool 'FM7727', 2,500 %, con vencimiento el 01/06/2051	185	0,02
831	Fannie Mae Pool 'FM7869', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2051	696	0,06
1.020	Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2051	852	0,07
800	Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2051	673	0,06
716	Fannie Mae Pool 'FM8025', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2051	602	0,05
285	Fannie Mae Pool 'FM8166', 3,000 %, con vencimiento el 01/06/2051	250	0,02
1.507	Fannie Mae Pool 'FM8188', 3,000 %, con vencimiento el 01/03/2040	1.382	0,12
2.923	Fannie Mae Pool 'FM8189', 3,000 %, con vencimiento el 01/08/2038	2.706	0,24
1.203	Fannie Mae Pool 'FM8210', 3,000 %, con vencimiento el 01/04/2050	1.048	0,09
1.423	Fannie Mae Pool 'FM8576', 3,000 %, con vencimiento el 01/02/2050	1.244	0,11
2.986	Fannie Mae Pool 'FM8685', 3,000 %, con vencimiento el 01/09/2051	2.577	0,22
2.706	Fannie Mae Pool 'FM8786', 2,500 %, con vencimiento el 01/10/2051	2.258	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 US Mortgage-Backed Securities Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
396	Fannie Mae Pool 'FM8864', 2,500 %, con vencimiento el 01/10/2051	331	0,03
76	Fannie Mae Pool 'FM8977', 2,500 %, con vencimiento el 01/09/2051	64	0,01
450	Fannie Mae Pool 'FM9044', 3,000 %, con vencimiento el 01/10/2051	392	0,03
2.484	Fannie Mae Pool 'FM9264', 2,000 %, con vencimiento el 01/10/2041	2.076	0,18
1.708	Fannie Mae Pool 'FM9292', 3,000 %, con vencimiento el 01/11/2051	1.483	0,13
2.414	Fannie Mae Pool 'FM9362', 3,000 %, con vencimiento el 01/06/2038	2.256	0,20
153	Fannie Mae Pool 'FM9412', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2051	128	0,01
15.415	Fannie Mae Pool 'FM9434', 2,000 %, con vencimiento el 01/11/2051	12.339	1,07
5.070	Fannie Mae Pool 'FM9456', 3,500 %, con vencimiento el 01/11/2051	4.624	0,40
5.844	Fannie Mae Pool 'FM9507', 3,000 %, con vencimiento el 01/03/2037	5.463	0,48
14.841	Fannie Mae Pool 'FM9579', 2,000 %, con vencimiento el 01/07/2051	11.754	1,02
314	Fannie Mae Pool 'FM9867', 2,500 %, con vencimiento el 01/12/2051	261	0,02
1.015	Fannie Mae Pool 'FS0028', 2,500 %, con vencimiento el 01/09/2051	847	0,07
214	Fannie Mae Pool 'FS0041', 3,000 %, con vencimiento el 01/11/2050	187	0,02
1.288	Fannie Mae Pool 'FS0316', 1,500 %, con vencimiento el 01/11/2041	1.033	0,09
3.442	Fannie Mae Pool 'FS0352', 2,000 %, con vencimiento el 01/01/2052	2.733	0,24
337	Fannie Mae Pool 'FS0408', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2052	294	0,03
249	Fannie Mae Pool 'FS0464', 2,000 %, con vencimiento el 01/01/2052	198	0,02
2.174	Fannie Mae Pool 'FS0520', 3,000 %, con vencimiento el 01/02/2052	1.885	0,16
429	Fannie Mae Pool 'FS0534', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2051	358	0,03
2.244	Fannie Mae Pool 'FS0551', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2052	1.875	0,16
1.548	Fannie Mae Pool 'FS0582', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2052	1.293	0,11
1.390	Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2052	1.109	0,10
801	Fannie Mae Pool 'FS0612', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2052	641	0,06
5.677	Fannie Mae Pool 'FS1107', 2,500 %, con vencimiento el 01/12/2051	4.723	0,41
502	Fannie Mae Pool 'FS1289', 3,000 %, con vencimiento el 01/03/2052	440	0,04
321	Fannie Mae Pool 'FS1403', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2045	286	0,02
2.979	Fannie Mae Pool 'FS1538', 3,000 %, con vencimiento el 01/04/2052	2.553	0,22
413	Fannie Mae Pool 'FS1539', 3,000 %, con vencimiento el 01/11/2048	367	0,03
757	Fannie Mae Pool 'FS1553', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2050	632	0,05
1.243	Fannie Mae Pool 'FS1628', 2,500 %, con vencimiento el 01/04/2052	1.047	0,09
694	Fannie Mae Pool 'FS1938', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2052	575	0,05
6.504	Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2049	5.897	0,51
631	Fannie Mae Pool 'FS3009', 2,000 %, con vencimiento el 01/05/2042	528	0,05
5.265	Fannie Mae Pool 'FS3191', 5,500 %, con vencimiento el 01/10/2052	5.221	0,45
1.643	Fannie Mae Pool 'FS3411', 6,000 %, con vencimiento el 01/01/2053	1.660	0,14
2.471	Fannie Mae Pool 'FS3571', 3,500 %, con vencimiento el 01/08/2052	2.208	0,19
1.220	Fannie Mae Pool 'FS3589', 4,500 %, con vencimiento el 01/01/2050	1.191	0,10
11.862	Fannie Mae Pool 'FS3803', 5,500 %, con vencimiento el 01/01/2053	11.778	1,02
6.895	Fannie Mae Pool 'FS4269', 2,000 %, con vencimiento el 01/10/2051	5.531	0,48
6.384	Fannie Mae Pool 'FS4270', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2052	5.093	0,44
2.297	Fannie Mae Pool 'FS4570', 5,000 %, con vencimiento el 01/12/2047	2.280	0,20
10.785	Fannie Mae Pool 'FS4875', 6,000 %, con vencimiento el 01/05/2053	10.870	0,95
2.530	Fannie Mae Pool 'FS5059', 3,500 %, con vencimiento el 01/11/2048	2.295	0,20
96	Fannie Mae Pool 'FS5708', 5,000 %, con vencimiento el 01/06/2053	94	0,01
7.332	Fannie Mae Pool 'FS5772', 5,000 %, con vencimiento el 01/06/2053	7.119	0,62
2.027	Fannie Mae Pool 'FS6779', 6,500 %, con vencimiento el 01/12/2053	2.072	0,18
400	Fannie Mae Pool 'FS7294', 5,500 %, con vencimiento el 01/05/2044	406	0,04
25	Fannie Mae Pool 'MA0619', 5,500 %, con vencimiento el 01/11/2040	25	–
4	Fannie Mae Pool 'MA0706', 4,500 %, con vencimiento el 01/04/2031	4	–
9	Fannie Mae Pool 'MA0734', 4,500 %, con vencimiento el 01/05/2031	9	–
5	Fannie Mae Pool 'MA0776', 4,500 %, con vencimiento el 01/06/2031	5	–
115	Fannie Mae Pool 'MA0913', 4,500 %, con vencimiento el 01/11/2031	114	0,01
132	Fannie Mae Pool 'MA0939', 4,500 %, con vencimiento el 01/12/2031	130	0,01
26	Fannie Mae Pool 'MA0968', 4,500 %, con vencimiento el 01/12/2031	26	–
168	Fannie Mae Pool 'MA1177', 3,500 %, con vencimiento el 01/09/2042	153	0,01
10	Fannie Mae Pool 'MA1221', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2042	10	–
41	Fannie Mae Pool 'MA1363', 3,000 %, con vencimiento el 01/02/2043	36	–
1.280	Fannie Mae Pool 'MA1393', 4,000 %, con vencimiento el 01/03/2043	1.229	0,11
287	Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2043	278	0,02
206	Fannie Mae Pool 'MA1629', 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2043	199	0,02
133	Fannie Mae Pool 'MA1664', 4,500 %, con vencimiento el 01/11/2043	129	0,01
189	Fannie Mae Pool 'MA1711', 4,500 %, con vencimiento el 01/12/2043	183	0,02
383	Fannie Mae Pool 'MA2672', 3,000 %, con vencimiento el 01/07/2036	353	0,03
372	Fannie Mae Pool 'MA2832', 3,000 %, con vencimiento el 01/12/2036	342	0,03
217	Fannie Mae Pool 'MA4175', 1,500 %, con vencimiento el 01/11/2040	175	0,02
2.697	Fannie Mae Pool 'MA4181', 1,500 %, con vencimiento el 01/11/2050	2.021	0,18
625	Fannie Mae Pool 'MA4204', 2,000 %, con vencimiento el 01/12/2040	525	0,05
5.291	Fannie Mae Pool 'MA4208', 2,000 %, con vencimiento el 01/12/2050	4.186	0,36
449	Fannie Mae Pool 'MA4342', 1,500 %, con vencimiento el 01/05/2041	360	0,03
718	Fannie Mae Pool 'MA4387', 2,000 %, con vencimiento el 01/07/2041	601	0,05
1.325	Fannie Mae Pool 'MA4474', 2,000 %, con vencimiento el 01/11/2041	1.106	0,10
1.276	Fannie Mae Pool 'MA4500', 1,500 %, con vencimiento el 01/12/2041	1.024	0,09
2.108	Fannie Mae Pool 'MA4501', 2,000 %, con vencimiento el 01/12/2041	1.759	0,15
513	Fannie Mae Pool 'MA4540', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2042	428	0,04
2.682	Fannie Mae Pool 'MA4570', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2042	2.236	0,19
4.061	Fannie Mae Pool 'MA4587', 2,500 %, con vencimiento el 01/04/2042	3.512	0,31
797	Fannie Mae REMICS, Serie 2010 2, Clase AI, 5,500 %, con vencimiento el 25/02/2040	126	0,01
860	Fannie Mae REMICS, Serie 2012 124, Clase SD, 0,714 %, con vencimiento el 25/11/2042 *	96	0,01
1.189	Fannie Mae REMICS, Serie 2012 22, Clase SM, 1,064 %, con vencimiento el 25/03/2042 *	136	0,01
542	Fannie Mae REMICS, Serie 2012 9, Clase PT, 11,502 %, con vencimiento el 25/07/2036 *	640	0,06
682	Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Clase BC, 6,500 %, con vencimiento el 25/07/2042	715	0,06
3.179	Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Clase CB, 5,500 %, con vencimiento el 25/04/2042	3.225	0,28
131	Fannie Mae REMICS, Serie 2015 39, Clase LZ, 3,000 %, con vencimiento el 25/06/2045	115	0,01
5.141	Fannie Mae REMICS, Serie 2016 48, Clase IA, 4,500 %, con vencimiento el 25/06/2038	711	0,06
2.127	Fannie Mae REMICS, Serie 2017 74, Clase PZ, 3,500 %, con vencimiento el 25/10/2047	1.671	0,15
3.355	Fannie Mae REMICS, Serie 2018 3, Clase IO, 4,000 %, con vencimiento el 25/02/2048	658	0,06
1.098	Fannie Mae REMICS, Serie 2018 74, Clase AB, 3,500 %, con vencimiento el 25/10/2048	998	0,09
840	Fannie Mae REMICS, Serie 2019 25, Clase PI, 5,000 %, con vencimiento el 25/05/2048	167	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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
3.618	Fannie Mae REMICS, Serie 2019 38, Clase SH, 0,591 %, con vencimiento el 25/07/2049 *	366	0,03
1.852	Fannie Mae REMICS, Serie 2019 44, Clase SM, 0,614 %, con vencimiento el 25/08/2049 *	249	0,02
1.955	Fannie Mae REMICS, Serie 2019 45, Clase BS, 0,614 %, con vencimiento el 25/08/2049 *	208	0,02
3.531	Fannie Mae REMICS, Serie 2019 5, Clase IO, 4,500 %, con vencimiento el 25/03/2049	692	0,06
1.098	Fannie Mae REMICS, Serie 2019 57, Clase NS, 0,564 %, con vencimiento el 25/10/2049 *	118	0,01
1.360	Fannie Mae REMICS, Serie 2019 58, Clase HS, 0,564 %, con vencimiento el 25/10/2049 *	143	0,01
2.833	Fannie Mae REMICS, Serie 2019 59, Clase SH, 0,564 %, con vencimiento el 25/10/2049 *	320	0,03
1.173	Fannie Mae REMICS, Serie 2020 26, Clase SA, 0,514 %, con vencimiento el 25/05/2050 *	123	0,01
968	Fannie Mae REMICS, Serie 2020 47, Clase GZ, 2,000 %, con vencimiento el 25/07/2050	555	0,05
694	Fannie Mae REMICS, Serie 2020 62, Clase AI, 2,500 %, con vencimiento el 25/09/2050	109	0,01
1.581	Fannie Mae REMICS, Serie 2020 62, Clase BI, 2,000 %, con vencimiento el 25/09/2050	206	0,02
4.787	Fannie Mae REMICS, Serie 2020 63, Clase KI, 2,500 %, con vencimiento el 25/09/2050	366	0,03
2.337	Fannie Mae REMICS, Serie 2020 67, Clase IH, 2,000 %, con vencimiento el 25/09/2050	305	0,03
2.416	Fannie Mae REMICS, Serie 2020 71, Clase IA, 2,000 %, con vencimiento el 25/03/2041	103	0,01
147	Fannie Mae REMICS, Serie 2020 74, Clase EI, 2,500 %, con vencimiento el 25/10/2050	24	–
12.602	Fannie Mae REMICS, Serie 2020 88, Clase GI, 2,500 %, con vencimiento el 25/12/2050	1.889	0,16
1.020	Fannie Mae REMICS, Serie 2020 89, Clase DI, 2,500 %, con vencimiento el 25/12/2050	156	0,01
8.422	Fannie Mae REMICS, Serie 2020 91, Clase IO, 2,500 %, con vencimiento el 25/12/2050	1.267	0,11
6.013	Fannie Mae REMICS, Serie 2020 93, Clase LI, 2,500 %, con vencimiento el 25/01/2051	827	0,07
7.388	Fannie Mae REMICS, Serie 2021 33, Clase AI, 2,500 %, con vencimiento el 25/05/2047	977	0,08
1.959	Fannie Mae REMICS, Serie 2021 4, Clase GI, 3,000 %, con vencimiento el 25/02/2051	327	0,03
23.981	Fannie Mae REMICS, Serie 2021 42, Clase NI, 2,500 %, con vencimiento el 25/11/2048	3.280	0,29
7.625	Fannie Mae REMICS, Serie 2021 46, Clase BI, 2,500 %, con vencimiento el 25/12/2048	1.037	0,09
7.248	Fannie Mae REMICS, Serie 2021 49, Clase GI, 2,500 %, con vencimiento el 25/10/2048	943	0,08
4.982	Fannie Mae REMICS, serie 2021 52, clase CI, 2,500 %, con vencimiento el 25/12/2047	681	0,06
1.115	Fannie Mae REMICS, Serie 2021 54, Clase KI, 2,500 %, con vencimiento el 25/05/2049	146	0,01
8.932	Fannie Mae REMICS, Serie 2021 59, Clase TI, 2,500 %, con vencimiento el 25/09/2051	1.324	0,12
1.474	Fannie Mae REMICS, Serie 2021 61, Clase KI, 2,500 %, con vencimiento el 25/04/2049	202	0,02
785	Fannie Mae REMICS, Serie 2021 62, Clase GI, 2,500 %, con vencimiento el 25/10/2047	114	0,01
848	Fannie Mae REMICS, Serie 2021 63, Clase QI, 2,500 %, con vencimiento el 25/06/2051	107	0,01
5.706	Fannie Mae REMICS, Serie 2021 85, Clase IN, 2,500 %, con vencimiento el 25/02/2050	896	0,08
2.428	Fannie Mae REMICS, Serie 2021 89, Clase AI, 2,500 %, con vencimiento el 25/04/2048	358	0,03
12.466	Fannie Mae REMICS, Serie 2021 91, Clase IG, 2,500 %, con vencimiento el 25/01/2052	1.800	0,16
11.600	Fannie Mae REMICS, Serie 2022 29, Clase KZ, 1,500 %, con vencimiento el 25/06/2042	8.052	0,70
687	Fannie Mae REMICS, Serie 2022 57, Clase BC, 4,000 %, con vencimiento el 25/09/2052	646	0,06
280	Fannie Mae-Aces, Serie 2016 M11, Clase AL, 2,944 %, con vencimiento el 25/07/2039	249	0,02
15.261	Fannie Mae-Aces, Serie 2019 M11, Clase X1, 1,184 %, con vencimiento el 25/06/2029 *	641	0,06
14.693	Fannie Mae-Aces, Serie 2019 M13, Clase X1, 0,826 %, con vencimiento el 25/06/2034 *	559	0,05
37.266	Fannie Mae-Aces, Serie 2019 M14, Clase X1, 0,557 %, con vencimiento el 25/06/2029 *	862	0,07
4.842	Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M11, Clase IO, 1,767 %, con vencimiento el 25/01/2029 *	322	0,03
33.589	Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M16, Clase X1, 0,462 %, con vencimiento el 25/04/2032 *	837	0,07
4.433	Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M24, Clase X1, 1,594 %, con vencimiento el 25/01/2037 *	393	0,03
15.141	Fannie Mae-Aces, Serie 2020 M31, Clase X2, 1,231 %, con vencimiento el 25/12/2032 *	854	0,07
34	Freddie Mac Gold Pool 'A29586', 5,000 %, con vencimiento el 01/01/2035	34	–
9	Freddie Mac Gold Pool 'A30703', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2034	9	–
85	Freddie Mac Gold Pool 'A35950', 5,000 %, con vencimiento el 01/07/2035	84	0,01
10	Freddie Mac Gold Pool 'A36526', 5,000 %, con vencimiento el 01/08/2035	10	–
36	Freddie Mac Gold Pool 'A39036', 5,000 %, con vencimiento el 01/05/2035	35	–
–	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	–	–
1	Freddie Mac Gold Pool 'C91046', 6,500 %, con vencimiento el 01/05/2027	1	–
938	Freddie Mac Gold Pool 'C91981', 3,000 %, con vencimiento el 01/02/2038	858	0,07
–	Freddie Mac Gold Pool 'G00556', 8,000 %, con vencimiento el 01/09/2026	–	–
–	Freddie Mac Gold Pool 'G00726', 8,000 %, con vencimiento el 01/06/2027	–	–
–	Freddie Mac Gold Pool 'G00931', 8,000 %, con vencimiento el 01/11/2026	–	–
24	Freddie Mac Gold Pool 'G04581', 6,500 %, con vencimiento el 01/08/2038	25	–
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	–
86	Freddie Mac Gold Pool 'G07335', 7,000 %, con vencimiento el 01/03/2039	92	0,01
202	Freddie Mac Gold Pool 'G07509', 6,500 %, con vencimiento el 01/09/2039	207	0,02
888	Freddie Mac Gold Pool 'G08700', 4,500 %, con vencimiento el 01/03/2046	863	0,08
136	Freddie Mac Gold Pool 'G16672', 3,000 %, con vencimiento el 01/03/2033	129	0,01
1.114	Freddie Mac Gold Pool 'G60329', 5,500 %, con vencimiento el 01/06/2040	1.133	0,10
3.325	Freddie Mac Gold Pool 'G60344', 4,000 %, con vencimiento el 01/12/2045	3.138	0,27
4.614	Freddie Mac Gold Pool 'G61814', 3,500 %, con vencimiento el 01/09/2048	4.189	0,36
8.136	Freddie Mac Gold Pool 'G67701', 3,000 %, con vencimiento el 01/10/2046	7.157	0,62
1	Freddie Mac Gold Pool 'H00790', 5,500 %, con vencimiento el 01/05/2037	1	–
42	Freddie Mac Gold Pool 'H02425', 5,500 %, con vencimiento el 01/02/2038	42	–
1	Freddie Mac Gold Pool 'H09170', 5,500 %, con vencimiento el 01/01/2038	1	–
265	Freddie Mac Gold Pool 'J39722', 3,000 %, con vencimiento el 01/10/2033	248	0,02
162	Freddie Mac Gold Pool 'J39962', 3,000 %, con vencimiento el 01/12/2033	152	0,01
157	Freddie Mac Gold Pool 'Q26702', 4,000 %, con vencimiento el 01/06/2044	149	0,01
1.217	Freddie Mac Gold Pool 'U69040', 4,000 %, con vencimiento el 01/05/2045	1.147	0,10
58	Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000 %, con vencimiento el 01/10/2042	55	–
346	Freddie Mac Gold Pool 'U90378', 4,000 %, con vencimiento el 01/11/2042	327	0,03
299	Freddie Mac Gold Pool 'U90436', 4,000 %, con vencimiento el 01/11/2042	283	0,02
32	Freddie Mac Gold Pool 'U90598', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2042	29	–
78	Freddie Mac Gold Pool 'U90608', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2042	71	0,01
30	Freddie Mac Gold Pool 'U90768', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2043	28	–
53	Freddie Mac Gold Pool 'U90778', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2043	49	–
77	Freddie Mac Gold Pool 'U90794', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2043	71	0,01
140	Freddie Mac Gold Pool 'U90828', 3,500 %, con vencimiento el 01/02/2043	128	0,01
104	Freddie Mac Gold Pool 'U90879', 3,500 %, con vencimiento el 01/02/2043	95	0,01
103	Freddie Mac Gold Pool 'U90903', 3,500 %, con vencimiento el 01/02/2043	94	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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
124	Freddie Mac Gold Pool 'U91027', 3,500 %, con vencimiento el 01/02/2043	114	0,01
3.498	Freddie Mac Gold Pool 'U99124', 3,500 %, con vencimiento el 01/03/2045	3.122	0,27
1.742	Freddie Mac Gold Pool 'U99135', 4,000 %, con vencimiento el 01/02/2044	1.674	0,15
56.415	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K065, Clase X1, 0,661 %, con vencimiento el 25/04/2027 *	983	0,09
81.656	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K069, Clase X1, 0,343 %, con vencimiento el 25/09/2027 *	897	0,08
54.532	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K079, Clase XAM, 0,080 %, con vencimiento el 25/06/2028 *	274	0,02
57.720	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K081, Clase XAM, 0,072 %, con vencimiento el 25/08/2028 *	279	0,02
879	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K091, Clase X1, 0,561 %, con vencimiento el 25/03/2029 *	21	–
7.962	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K105, Clase X1, 1,522 %, con vencimiento el 25/01/2030 *	568	0,05
11.316	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K110, Clase X1, 1,695 %, con vencimiento el 25/04/2030 *	895	0,08
5.963	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K115, Clase X1, 1,324 %, con vencimiento el 25/06/2030 *	393	0,03
8.724	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K116, Clase X1, 1,422 %, con vencimiento el 25/07/2030 *	607	0,05
984	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K121, Clase X1, 1,021 %, con vencimiento el 25/10/2030 *	51	–
102.709	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K123, Clase X1, 0,771 %, con vencimiento el 25/12/2030 *	4.146	0,36
3.582	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K124, Clase X1, 0,718 %, con vencimiento el 25/12/2030 *	138	0,01
12.494	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K132, Clase X1, 0,508 %, con vencimiento el 25/08/2031 *	381	0,03
63.980	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K141, Clase X1, 0,305 %, con vencimiento el 25/02/2032 *	1.345	0,12
61.452	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K142, Clase X1, 0,296 %, con vencimiento el 25/03/2032 *	1.250	0,11
85.262	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K143, Clase X1, 0,342 %, con vencimiento el 25/04/2055 *	2.032	0,18
17.883	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K148, Clase X1, 0,250 %, con vencimiento el 25/07/2032 *	356	0,03
28.465	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates KG06, Clase X1, 0,532 %, con vencimiento el 25/10/2031 *	898	0,08
4.167	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Serie K 1515, Clase X1, 1,509 %, con vencimiento el 25/02/2035 *	459	0,04
6.599	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Serie K 154, Clase X1, 0,353 %, con vencimiento el 25/01/2033 *	188	0,02
39.997	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Serie K 160, Clase X1, 0,209 %, con vencimiento el 25/08/2033 *	802	0,07
28.950	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Serie K 162, Clase X1, 0,370 %, con vencimiento el 25/12/2033 *	934	0,08
5.015	Freddie Mac Non Gold Pool '841075', 3,268 %, con vencimiento el 01/01/2049 *	4.705	0,41
2.293	Freddie Mac Non Gold Pool '841076', 3,006 %, con vencimiento el 01/11/2048 *	2.160	0,19
450	Freddie Mac Non Gold Pool '841077', 2,875 %, con vencimiento el 01/11/2047 *	435	0,04
788	Freddie Mac Non Gold Pool '841081', 3,096 %, con vencimiento el 01/02/2050 *	744	0,06
85	Freddie Mac Pool 'QA5770', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2050	74	0,01
293	Freddie Mac Pool 'QA7238', 3,500 %, con vencimiento el 01/02/2050	265	0,02
2.856	Freddie Mac Pool 'QA7256', 3,000 %, con vencimiento el 01/02/2050	2.476	0,22
116	Freddie Mac Pool 'QA9685', 3,000 %, con vencimiento el 01/05/2050	101	0,01
174	Freddie Mac Pool 'QA9686', 3,000 %, con vencimiento el 01/05/2050	152	0,01
421	Freddie Mac Pool 'QB5092', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2050	354	0,03
294	Freddie Mac Pool 'QB5093', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2050	246	0,02
72	Freddie Mac Pool 'QB8602', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	58	0,01
134	Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	108	0,01
68	Freddie Mac Pool 'QB8773', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	55	–
72	Freddie Mac Pool 'QB9482', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	58	0,01
212	Freddie Mac Pool 'QB9484', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	171	0,01
146	Freddie Mac Pool 'QB9485', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	119	0,01
78	Freddie Mac Pool 'QB9961', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	63	0,01
63	Freddie Mac Pool 'QC0160', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	51	–
76	Freddie Mac Pool 'QC0161', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	61	0,01
76	Freddie Mac Pool 'QC0885', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2051	62	0,01
69	Freddie Mac Pool 'QC1164', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2051	55	–
155	Freddie Mac Pool 'QC2044', 2,500 %, con vencimiento el 01/05/2051	131	0,01
507	Freddie Mac Pool 'QC3242', 3,000 %, con vencimiento el 01/06/2051	440	0,04
413	Freddie Mac Pool 'QC3690', 2,500 %, con vencimiento el 01/07/2051	346	0,03
387	Freddie Mac Pool 'QC4689', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	324	0,03
421	Freddie Mac Pool 'QC4690', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	352	0,03
336	Freddie Mac Pool 'QC4818', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	281	0,02
480	Freddie Mac Pool 'QC4824', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	402	0,03
3.730	Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	3.121	0,27
1.804	Freddie Mac Pool 'QC7411', 2,500 %, con vencimiento el 01/09/2051	1.506	0,13
3.581	Freddie Mac Pool 'QC8573', 2,500 %, con vencimiento el 01/10/2051	2.986	0,26
914	Freddie Mac Pool 'QD1347', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2051	762	0,07
3.823	Freddie Mac Pool 'QD1596', 2,000 %, con vencimiento el 01/12/2051	3.064	0,27
83	Freddie Mac Pool 'QD1954', 3,000 %, con vencimiento el 01/11/2051	72	0,01
6.219	Freddie Mac Pool 'QD2419', 3,000 %, con vencimiento el 01/12/2051	5.437	0,47
246	Freddie Mac Pool 'QD4146', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2052	206	0,02
524	Freddie Mac Pool 'QD5620', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2052	417	0,04
636	Freddie Mac Pool 'QD5628', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2052	505	0,04
89	Freddie Mac Pool 'QD5827', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2052	72	0,01
820	Freddie Mac Pool 'QD5960', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2052	651	0,06
520	Freddie Mac Pool 'QD5961', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2052	413	0,04
3.180	Freddie Mac Pool 'QD6079', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2052	2.659	0,23
262	Freddie Mac Pool 'QD6142', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2052	219	0,02
166	Freddie Mac Pool 'QD6216', 3,000 %, con vencimiento el 01/02/2052	142	0,01
269	Freddie Mac Pool 'QD7365', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2052	215	0,02
2.402	Freddie Mac Pool 'QE8530', 5,500 %, con vencimiento el 01/08/2052	2.414	0,21
2.695	Freddie Mac Pool 'QE8532', 5,500 %, con vencimiento el 01/08/2052	2.696	0,23
5.679	Freddie Mac Pool 'QE8537', 5,000 %, con vencimiento el 01/08/2052	5.513	0,48
87	Freddie Mac Pool 'QF0921', 5,000 %, con vencimiento el 01/09/2052	85	0,01
1.939	Freddie Mac Pool 'QF3429', 5,500 %, con vencimiento el 01/11/2052	1.943	0,17
725	Freddie Mac Pool 'QF4924', 6,000 %, con vencimiento el 01/12/2052	735	0,06
157	Freddie Mac Pool 'QF6516', 6,500 %, con vencimiento el 01/01/2053	160	0,01
159	Freddie Mac Pool 'QF6690', 6,500 %, con vencimiento el 01/01/2053	162	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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
183	Freddie Mac Pool 'QF8222', 6,500 %, con vencimiento el 01/02/2053	186	0,02
285	Freddie Mac Pool 'QF8298', 6,500 %, con vencimiento el 01/03/2053	291	0,03
3.264	Freddie Mac Pool 'QF9586', 6,500 %, con vencimiento el 01/03/2053	3.328	0,29
996	Freddie Mac Pool 'QG2834', 5,000 %, con vencimiento el 01/04/2053	967	0,08
1.125	Freddie Mac Pool 'RA1293', 3,000 %, con vencimiento el 01/09/2049	982	0,09
6.185	Freddie Mac Pool 'RA2194', 3,000 %, con vencimiento el 01/02/2050	5.403	0,47
354	Freddie Mac Pool 'RA2729', 2,500 %, con vencimiento el 01/06/2050	294	0,03
378	Freddie Mac Pool 'RA3882', 2,000 %, con vencimiento el 01/11/2050	303	0,03
5.374	Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2050	4.512	0,39
17.298	Freddie Mac Pool 'RA4142', 2,500 %, con vencimiento el 01/12/2050	14.520	1,26
1.703	Freddie Mac Pool 'RA4175', 2,500 %, con vencimiento el 01/12/2050	1.420	0,12
64	Freddie Mac Pool 'RA4349', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2051	53	–
421	Freddie Mac Pool 'RA4414', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2051	349	0,03
2.102	Freddie Mac Pool 'RA4526', 3,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	1.821	0,16
69	Freddie Mac Pool 'RA4532', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2051	58	0,01
538	Freddie Mac Pool 'RA4703', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	430	0,04
1.429	Freddie Mac Pool 'RA5117', 2,000 %, con vencimiento el 01/05/2051	1.141	0,10
165	Freddie Mac Pool 'RA5373', 2,000 %, con vencimiento el 01/06/2051	132	0,01
424	Freddie Mac Pool 'RB0714', 2,000 %, con vencimiento el 01/12/2041	354	0,03
1.603	Freddie Mac Pool 'RB5110', 1,500 %, con vencimiento el 01/05/2041	1.287	0,11
7.944	Freddie Mac Pool 'RB5125', 2,000 %, con vencimiento el 01/09/2041	6.641	0,58
2.132	Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, con vencimiento el 01/10/2041	1.711	0,15
271	Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, con vencimiento el 01/11/2041	218	0,02
3.358	Freddie Mac Pool 'RB5138', 2,000 %, con vencimiento el 01/12/2041	2.802	0,24
517	Freddie Mac Pool 'RB5145', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2042	431	0,04
10.302	Freddie Mac Pool 'SC0190', 2,500 %, con vencimiento el 01/09/2041	8.933	0,78
1.531	Freddie Mac Pool 'SC0319', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2042	1.279	0,11
3.038	Freddie Mac Pool 'SC0399', 2,000 %, con vencimiento el 01/05/2042	2.545	0,22
138	Freddie Mac Pool 'SD0247', 4,000 %, con vencimiento el 01/07/2047	130	0,01
216	Freddie Mac Pool 'SD0422', 4,500 %, con vencimiento el 01/07/2045	211	0,02
135	Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2051	110	0,01
320	Freddie Mac Pool 'SD0618', 3,000 %, con vencimiento el 01/02/2051	277	0,02
4.479	Freddie Mac Pool 'SD0630', 4,000 %, con vencimiento el 01/02/2050	4.198	0,37
2.422	Freddie Mac Pool 'SD0731', 2,000 %, con vencimiento el 01/05/2051	1.929	0,17
2.543	Freddie Mac Pool 'SD0777', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2051	2.107	0,18
838	Freddie Mac Pool 'SD0849', 2,500 %, con vencimiento el 01/01/2052	701	0,06
361	Freddie Mac Pool 'SD0952', 3,000 %, con vencimiento el 01/04/2052	315	0,03
1.447	Freddie Mac Pool 'SD1070', 3,500 %, con vencimiento el 01/04/2052	1.303	0,11
14.665	Freddie Mac Pool 'SD1143', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2050	14.083	1,22
1.644	Freddie Mac Pool 'SD1218', 4,000 %, con vencimiento el 01/07/2049	1.545	0,13
6.953	Freddie Mac Pool 'SD1463', 3,000 %, con vencimiento el 01/12/2051	6.000	0,52
4.292	Freddie Mac Pool 'SD1876', 5,500 %, con vencimiento el 01/11/2052	4.267	0,37
9.290	Freddie Mac Pool 'SD2245', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	9.214	0,80
6.692	Freddie Mac Pool 'SD2284', 6,000 %, con vencimiento el 01/12/2052	6.761	0,59
909	Freddie Mac Pool 'SD2981', 6,500 %, con vencimiento el 01/05/2053	929	0,08
373	Freddie Mac Pool 'SD2991', 2,500 %, con vencimiento el 01/09/2051	312	0,03
3.846	Freddie Mac Pool 'SD3305', 1,500 %, con vencimiento el 01/08/2051	2.877	0,25
6.718	Freddie Mac Pool 'SD3382', 5,000 %, con vencimiento el 01/06/2053	6.523	0,57
2.935	Freddie Mac Pool 'SD3400', 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2052	2.780	0,24
1.721	Freddie Mac Pool 'SD3553', 6,000 %, con vencimiento el 01/07/2053	1.732	0,15
4.923	Freddie Mac Pool 'SD3637', 6,000 %, con vencimiento el 01/08/2053	4.952	0,43
188	Freddie Mac Pool 'SD3722', 5,000 %, con vencimiento el 01/05/2053	184	0,02
1.933	Freddie Mac Pool 'SD3879', 5,000 %, con vencimiento el 01/05/2053	1.877	0,16
4.035	Freddie Mac Pool 'SD3900', 5,500 %, con vencimiento el 01/08/2053	4.000	0,35
985	Freddie Mac Pool 'SD4169', 6,500 %, con vencimiento el 01/10/2053	1.004	0,09
580	Freddie Mac Pool 'SD7509', 3,000 %, con vencimiento el 01/11/2049	506	0,04
4.233	Freddie Mac Pool 'SD7523', 2,500 %, con vencimiento el 01/08/2050	3.543	0,31
202	Freddie Mac Pool 'SD7525', 2,500 %, con vencimiento el 01/10/2050	169	0,01
3.595	Freddie Mac Pool 'SD7526', 2,500 %, con vencimiento el 01/10/2050	3.013	0,26
641	Freddie Mac Pool 'SD7534', 2,500 %, con vencimiento el 01/02/2051	539	0,05
22.145	Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2051	18.547	1,61
15.004	Freddie Mac Pool 'SD8222', 4,000 %, con vencimiento el 01/06/2052	13.819	1,20
1.049	Freddie Mac Pool 'ZA2343', 3,500 %, con vencimiento el 01/05/2034	996	0,09
1.440	Freddie Mac Pool 'ZA2415', 3,000 %, con vencimiento el 01/06/2036	1.327	0,12
238	Freddie Mac Pool 'ZA5297', 4,000 %, con vencimiento el 01/03/2048	223	0,02
216	Freddie Mac Pool 'ZI9993', 5,000 %, con vencimiento el 01/05/2040	214	0,02
2.060	Freddie Mac Pool 'ZM1466', 3,500 %, con vencimiento el 01/07/2046	1.878	0,16
352	Freddie Mac Pool 'ZN0480', 3,500 %, con vencimiento el 01/10/2042	321	0,03
749	Freddie Mac Pool 'ZN0538', 3,500 %, con vencimiento el 01/11/2042	683	0,06
1.942	Freddie Mac Pool 'ZN0608', 3,500 %, con vencimiento el 01/02/2043	1.787	0,16
69	Freddie Mac Pool 'ZN0614', 3,500 %, con vencimiento el 01/02/2043	62	0,01
80	Freddie Mac Pool 'ZN0628', 3,500 %, con vencimiento el 01/02/2043	73	0,01
55	Freddie Mac Pool 'ZN2185', 4,500 %, con vencimiento el 01/12/2048	53	–
9	Freddie Mac Pool 'ZS0823', 5,000 %, con vencimiento el 01/12/2034	9	–
286	Freddie Mac Pool 'ZS1355', 6,000 %, con vencimiento el 01/03/2037	295	0,03
5	Freddie Mac Pool 'ZS1530', 5,500 %, con vencimiento el 01/07/2037	5	–
122	Freddie Mac Pool 'ZS3059', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2038	124	0,01
9.408	Freddie Mac Pool 'ZS4751', 3,500 %, con vencimiento el 01/01/2048	8.528	0,74
129	Freddie Mac Pool 'ZS8673', 3,000 %, con vencimiento el 01/10/2032	121	0,01
210	Freddie Mac Pool 'ZS9826', 3,000 %, con vencimiento el 01/10/2046	184	0,02
36	Freddie Mac Pool 'ZT0474', 4,500 %, con vencimiento el 01/08/2048	34	–
2.055	Freddie Mac Pool 'ZT1101', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2043	1.817	0,16
700	Freddie Mac Pool 'ZT1107', 3,500 %, con vencimiento el 01/03/2043	638	0,06
125	Freddie Mac Pool 'ZT1159', 3,500 %, con vencimiento el 01/02/2044	114	0,01
130	Freddie Mac Pool 'ZT1257', 3,000 %, con vencimiento el 01/01/2046	116	0,01
32	Freddie Mac Pool 'ZT1854', 4,500 %, con vencimiento el 01/03/2049	30	–
125	Freddie Mac Pool 'ZT1970', 3,500 %, con vencimiento el 01/04/2033	120	0,01
1.646	Freddie Mac Pool 'ZT2228', 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2049	1.488	0,13
4.600	Freddie Mac REMICS 3810, Clase WA, 5,357 %, con vencimiento el 15/06/2040 *	4.569	0,40

^ *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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
2.627	Freddie Mac REMICS 3998, Clase DS, 1,061 %, con vencimiento el 15/02/2042 *	310	0,03
1.993	Freddie Mac REMICS 4134, Clase IM, 3,500 %, con vencimiento el 15/11/2042	318	0,03
390	Freddie Mac REMICS 4280, Clase AI, 3,000 %, con vencimiento el 15/02/2028	4	–
4.800	Freddie Mac REMICS 4377, Clase UZ, 3,000 %, con vencimiento el 15/08/2044	3.771	0,33
131	Freddie Mac REMICS 4403, Clase IG, 3,500 %, con vencimiento el 15/07/2032	3	–
1.110	Freddie Mac REMICS 4715, Clase JS, 0,711 %, con vencimiento el 15/08/2047 *	121	0,01
240	Freddie Mac REMICS 4759, Clase MI, 4,000 %, con vencimiento el 15/09/2045	14	–
1.165	Freddie Mac REMICS 4808, Clase SB, 0,761 %, con vencimiento el 15/07/2048 *	144	0,01
173	Freddie Mac REMICS 4813, Clase CJ, 3,000 %, con vencimiento el 15/08/2048	149	0,01
1.411	Freddie Mac REMICS 4856, Clase IO, 5,000 %, con vencimiento el 15/01/2049	254	0,02
752	Freddie Mac REMICS 4870, Clase ES, 0,561 %, con vencimiento el 15/04/2049 *	82	0,01
1.491	Freddie Mac REMICS 4882, Clase S, 0,611 %, con vencimiento el 15/05/2049 *	160	0,01
2.340	Freddie Mac REMICS 4921, Clase SN, 0,614 %, con vencimiento el 25/10/2049 *	249	0,02
1.112	Freddie Mac REMICS 4936, Clase YZ, 2,500 %, con vencimiento el 25/12/2049	899	0,08
1.231	Freddie Mac REMICS 4962, Clase SP, 0,614 %, con vencimiento el 25/03/2050 *	130	0,01
2.905	Freddie Mac REMICS 4988, Clase AZ, 2,000 %, con vencimiento el 25/07/2050	1.672	0,15
2.169	Freddie Mac REMICS 4995, Clase IQ, 2,500 %, con vencimiento el 25/07/2050	319	0,03
9.398	Freddie Mac REMICS 4995, Clase QI, 2,500 %, con vencimiento el 25/07/2050	1.462	0,13
4.757	Freddie Mac REMICS 5000, Clase IB, 2,500 %, con vencimiento el 25/07/2050	583	0,05
3.770	Freddie Mac REMICS 5000, Clase UI, 2,500 %, con vencimiento el 25/07/2050	607	0,05
1.566	Freddie Mac REMICS 5027, Clase HI, 2,000 %, con vencimiento el 25/10/2050	209	0,02
2.995	Freddie Mac REMICS 5038, Clase PJ, 0,750 %, con vencimiento el 25/10/2050	2.088	0,18
138	Freddie Mac REMICS 5040, Clase IB, 2,500 %, con vencimiento el 25/11/2050	20	–
2.178	Freddie Mac REMICS 5058, Clase IL, 2,500 %, con vencimiento el 25/01/2051	375	0,03
732	Freddie Mac REMICS 5059, Clase IB, 2,500 %, con vencimiento el 25/01/2051	120	0,01
4.890	Freddie Mac REMICS 5070, Clase NI, 2,000 %, con vencimiento el 25/02/2051	662	0,06
8.697	Freddie Mac REMICS 5078, Clase EI, 1,500 %, con vencimiento el 25/01/2051	870	0,08
20.107	Freddie Mac REMICS 5085, Clase IK, 2,500 %, con vencimiento el 25/03/2051	3.161	0,27
10.383	Freddie Mac REMICS 5092, Clase IU, 2,500 %, con vencimiento el 25/02/2051	1.180	0,10
3.377	Freddie Mac REMICS 5113, Clase NI, 2,500 %, con vencimiento el 25/06/2051	433	0,04
11.132	Freddie Mac REMICS 5134, Clase KI, 2,500 %, con vencimiento el 25/07/2048	1.484	0,13
10.480	Freddie Mac REMICS 5135, Clase DI, 2,500 %, con vencimiento el 25/05/2048	1.362	0,12
1.402	Freddie Mac REMICS 5149, Clase NI, 2,500 %, con vencimiento el 25/01/2051	193	0,02
4.768	Freddie Mac REMICS 5152, Clase IO, 2,500 %, con vencimiento el 25/10/2051	763	0,07
9.076	Freddie Mac REMICS 5160, Clase IU, 2,500 %, con vencimiento el 25/11/2050	1.175	0,10
9.365	Freddie Mac REMICS 5162, Clase DI, 2,500 %, con vencimiento el 25/11/2051	1.209	0,11
7.700	Freddie Mac REMICS 5169, Clase PW, 2,000 %, con vencimiento el 25/09/2051	5.016	0,44
1.404	Freddie Mac REMICS 5173, Clase LI, 2,500 %, con vencimiento el 25/05/2050	203	0,02
7.200	Freddie Mac REMICS 5178, Clase CY, 2,000 %, con vencimiento el 25/01/2042	4.732	0,41
8.774	Freddie Mac REMICS 5180, Clase IP, 3,000 %, con vencimiento el 25/01/2052	1.757	0,15
756	Freddie Mac REMICS 5190, Clase GI, 2,500 %, con vencimiento el 25/10/2048	102	0,01
5.294	Freddie Mac REMICS 5202, Clase NI, 3,000 %, con vencimiento el 25/08/2046	715	0,06
4.900	Freddie Mac REMICS 5209, Clase EQ, 3,000 %, con vencimiento el 25/04/2052	3.625	0,32
3.434	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA2, Serie 2021 DNA2, Clase M2, 144A, 7,622 %, con vencimiento el 25/08/2033 *	3.506	0,30
1.685	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA5, Serie 2022 DNA5, Clase M1A, 144A, 8,272 %, con vencimiento el 25/06/2042 *	1.732	0,15
1.062	Freddie Mac Strips 312, Clase S1, 0,511 %, con vencimiento el 15/09/2043 *	113	0,01
–	Ginnie Mae I Pool '410304', 7,500 %, con vencimiento el 15/12/2025	–	–
–	Ginnie Mae I Pool '417463', 7,000 %, con vencimiento el 15/09/2025	–	–
–	Ginnie Mae I Pool '430208', 7,000 %, con vencimiento el 15/09/2027	–	–
–	Ginnie Mae I Pool '462669', 7,000 %, con vencimiento el 15/04/2028	–	–
–	Ginnie Mae I Pool '486470', 6,500 %, con vencimiento el 15/08/2028	–	–
–	Ginnie Mae I Pool '486516', 6,500 %, con vencimiento el 15/09/2028	–	–
–	Ginnie Mae I Pool '519569', 8,000 %, con vencimiento el 15/05/2030	–	–
21	Ginnie Mae I Pool '646044', 6,500 %, con vencimiento el 15/10/2037	22	–
1	Ginnie Mae I Pool '652203', 5,000 %, con vencimiento el 15/03/2036	1	–
2	Ginnie Mae I Pool '658182', 6,000 %, con vencimiento el 15/11/2036	2	–
1	Ginnie Mae I Pool '675375', 5,000 %, con vencimiento el 15/05/2038	1	–
1	Ginnie Mae I Pool '676940', 5,000 %, con vencimiento el 15/04/2038	1	–
4	Ginnie Mae I Pool '683926', 5,000 %, con vencimiento el 15/02/2038	4	–
6	Ginnie Mae I Pool '684334', 5,000 %, con vencimiento el 15/02/2038	5	–
2	Ginnie Mae I Pool '684754', 5,000 %, con vencimiento el 15/04/2038	2	–
1	Ginnie Mae I Pool '684848', 5,000 %, con vencimiento el 15/04/2038	1	–
2	Ginnie Mae I Pool '686062', 5,000 %, con vencimiento el 15/05/2038	2	–
50	Ginnie Mae I Pool '698086', 6,000 %, con vencimiento el 15/04/2039	51	–
8	Ginnie Mae I Pool '701501', 5,000 %, con vencimiento el 15/12/2038	9	–
240	Ginnie Mae I Pool '701947', 5,000 %, con vencimiento el 15/06/2039	242	0,02
108	Ginnie Mae I Pool '733600', 5,000 %, con vencimiento el 15/04/2040	107	0,01
233	Ginnie Mae I Pool '733627', 5,000 %, con vencimiento el 15/05/2040	232	0,02
1	Ginnie Mae I Pool '780732', 7,000 %, con vencimiento el 15/03/2028	1	–
–	Ginnie Mae I Pool '781001', 7,500 %, con vencimiento el 15/03/2029	–	–
42	Ginnie Mae I Pool '781590', 5,500 %, con vencimiento el 15/04/2033	43	–
280	Ginnie Mae I Pool '781994', 5,500 %, con vencimiento el 15/11/2033	286	0,02
2	Ginnie Mae I Pool '782198', 6,000 %, con vencimiento el 15/10/2037	2	–
266	Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, con vencimiento el 15/06/2048	248	0,02
115	Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, con vencimiento el 15/09/2042	103	0,01
140	Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, con vencimiento el 15/09/2042	126	0,01
42	Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, con vencimiento el 15/10/2042	37	–
223	Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000 %, con vencimiento el 15/10/2042	197	0,02
192	Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000 %, con vencimiento el 15/11/2042	170	0,01
1.532	Ginnie Mae I Pool 'BS8462', 3,500 %, con vencimiento el 15/06/2050	1.418	0,12
6	Ginnie Mae II Pool '4040', 6,500 %, con vencimiento el 20/10/2037	6	–
8	Ginnie Mae II Pool '4170', 6,000 %, con vencimiento el 20/06/2038	9	–
603	Ginnie Mae II Pool '4245', 6,000 %, con vencimiento el 20/09/2038	634	0,06
92	Ginnie Mae II Pool '4602', 6,000 %, con vencimiento el 20/12/2039	96	0,01
100	Ginnie Mae II Pool '4617', 4,500 %, con vencimiento el 20/01/2040	98	0,01
51	Ginnie Mae II Pool '4696', 4,500 %, con vencimiento el 20/05/2040	50	–
31	Ginnie Mae II Pool '4747', 5,000 %, con vencimiento el 20/07/2040	32	–
36	Ginnie Mae II Pool '4772', 5,000 %, con vencimiento el 20/08/2040	36	–
3	Ginnie Mae II Pool '4774', 6,000 %, con vencimiento el 20/08/2040	4	–

^ *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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
76	Ginnie Mae II Pool '4802', 5,000 %, con vencimiento el 20/09/2040	76	0,01
32	Ginnie Mae II Pool '4855', 5,000 %, con vencimiento el 20/11/2040	32	–
12	Ginnie Mae II Pool '4923', 4,500 %, con vencimiento el 20/01/2041	12	–
7	Ginnie Mae II Pool '4928', 6,000 %, con vencimiento el 20/01/2041	8	–
405	Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500 %, con vencimiento el 20/03/2041	397	0,03
895	Ginnie Mae II Pool '783050', 5,000 %, con vencimiento el 20/07/2040	888	0,08
662	Ginnie Mae II Pool '783298', 4,500 %, con vencimiento el 20/04/2041	649	0,06
62	Ginnie Mae II Pool '784106', 3,500 %, con vencimiento el 20/01/2046	57	–
1.899	Ginnie Mae II Pool '784577', 4,000 %, con vencimiento el 20/07/2047	1.771	0,15
59	Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000 %, con vencimiento el 20/01/2050	52	–
492	Ginnie Mae II Pool '785360', 2,000 %, con vencimiento el 20/03/2051	387	0,03
8.511	Ginnie Mae II Pool '785944', 3,000 %, con vencimiento el 20/02/2052	7.492	0,65
1.945	Ginnie Mae II Pool '786077', 3,000 %, con vencimiento el 20/03/2052	1.709	0,15
2.789	Ginnie Mae II Pool '786082', 3,000 %, con vencimiento el 20/11/2051	2.458	0,21
266	Ginnie Mae II Pool '786095', 3,000 %, con vencimiento el 20/04/2052	227	0,02
1.423	Ginnie Mae II Pool '786107', 3,000 %, con vencimiento el 20/03/2052	1.254	0,11
1.281	Ginnie Mae II Pool '786108', 3,500 %, con vencimiento el 20/03/2052	1.147	0,10
404	Ginnie Mae II Pool '786134', 3,000 %, con vencimiento el 20/04/2052	346	0,03
274	Ginnie Mae II Pool '786335', 4,500 %, con vencimiento el 20/09/2052	263	0,02
8.501	Ginnie Mae II Pool '786348', 4,500 %, con vencimiento el 20/08/2052	8.138	0,71
651	Ginnie Mae II Pool '786474', 5,000 %, con vencimiento el 20/01/2053	641	0,06
2.648	Ginnie Mae II Pool '786726', 2,000 %, con vencimiento el 20/03/2051	2.105	0,18
977	Ginnie Mae II Pool '786795', 6,000 %, con vencimiento el 20/07/2053	984	0,09
1.383	Ginnie Mae II Pool '786916', 5,500 %, con vencimiento el 20/08/2053	1.386	0,12
293	Ginnie Mae II Pool '786928', 6,500 %, con vencimiento el 20/09/2053	298	0,03
1.850	Ginnie Mae II Pool '786963', 6,000 %, con vencimiento el 20/09/2053	1.878	0,16
2.076	Ginnie Mae II Pool '786973', 6,000 %, con vencimiento el 20/09/2053	2.087	0,18
1.642	Ginnie Mae II Pool '787058', 5,000 %, con vencimiento el 20/08/2053	1.612	0,14
200	Ginnie Mae II Pool '787154', 6,500 %, con vencimiento el 20/11/2053	204	0,02
894	Ginnie Mae II Pool '787228', 6,000 %, con vencimiento el 20/01/2054	906	0,08
2.900	Ginnie Mae II Pool '787236', 6,500 %, con vencimiento el 20/01/2054	2.957	0,26
914	Ginnie Mae II Pool '892346', 8,148 %, con vencimiento el 20/08/2059 *	930	0,08
166	Ginnie Mae II Pool '892614', 7,532 %, con vencimiento el 20/08/2060 *	170	0,01
832	Ginnie Mae II Pool 'AV0243', 3,500 %, con vencimiento el 20/08/2046	764	0,07
968	Ginnie Mae II Pool 'AV8311', 3,500 %, con vencimiento el 20/08/2046	886	0,08
1.119	Ginnie Mae II Pool 'AV8312', 3,500 %, con vencimiento el 20/08/2046	1.023	0,09
401	Ginnie Mae II Pool 'AZ3074', 4,000 %, con vencimiento el 20/02/2047	374	0,03
466	Ginnie Mae II Pool 'BC5293', 3,500 %, con vencimiento el 20/08/2047	427	0,04
2.877	Ginnie Mae II Pool 'BC5429', 3,500 %, con vencimiento el 20/10/2047	2.636	0,23
248	Ginnie Mae II Pool 'BD3554', 3,500 %, con vencimiento el 20/10/2047	227	0,02
1.291	Ginnie Mae II Pool 'BD3636', 3,500 %, con vencimiento el 20/10/2047	1.180	0,10
29	Ginnie Mae II Pool 'BG7951', 4,500 %, con vencimiento el 20/06/2048	27	–
600	Ginnie Mae II Pool 'BH1521', 4,500 %, con vencimiento el 20/07/2048	572	0,05
879	Ginnie Mae II Pool 'BH1870', 4,500 %, con vencimiento el 20/08/2048	849	0,07
611	Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500 %, con vencimiento el 20/02/2050	553	0,05
116	Ginnie Mae II Pool 'BM9734', 4,000 %, con vencimiento el 20/10/2049	109	0,01
460	Ginnie Mae II Pool 'BS1728', 4,000 %, con vencimiento el 20/01/2050	440	0,04
403	Ginnie Mae II Pool 'BS1742', 4,000 %, con vencimiento el 20/02/2050	384	0,03
70	Ginnie Mae II Pool 'BS8546', 2,500 %, con vencimiento el 20/12/2050	58	0,01
460	Ginnie Mae II Pool 'BT1888', 2,500 %, con vencimiento el 20/12/2050	390	0,03
914	Ginnie Mae II Pool 'BT9472', 4,000 %, con vencimiento el 20/05/2050	851	0,07
2.222	Ginnie Mae II Pool 'BU3196', 4,000 %, con vencimiento el 20/05/2050	2.069	0,18
769	Ginnie Mae II Pool 'BW7380', 4,500 %, con vencimiento el 20/07/2050	731	0,06
930	Ginnie Mae II Pool 'BW7384', 4,000 %, con vencimiento el 20/08/2050	870	0,08
1.267	Ginnie Mae II Pool 'BX2423', 3,000 %, con vencimiento el 20/10/2050	1.114	0,10
89	Ginnie Mae II Pool 'CK9592', 4,000 %, con vencimiento el 20/06/2052	84	0,01
83	Ginnie Mae II Pool 'CL5523', 3,000 %, con vencimiento el 20/04/2052	72	0,01
498	Ginnie Mae II Pool 'CW6992', 6,000 %, con vencimiento el 20/09/2053	504	0,04
146	Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500 %, con vencimiento el 20/04/2046	134	0,01
80	Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500 %, con vencimiento el 20/05/2046	74	0,01
137	Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500 %, con vencimiento el 20/06/2046	126	0,01
83	Ginnie Mae II Pool 'MA3803', 3,500 %, con vencimiento el 20/07/2046	76	0,01
5.053	Ginnie Mae II Pool 'MA4003', 3,000 %, con vencimiento el 20/10/2046	4.489	0,39
712	Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000 %, con vencimiento el 20/02/2047	632	0,06
350	Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, con vencimiento el 20/06/2047	330	0,03
2.008	Ginnie Mae II Pool 'MA4586', 3,500 %, con vencimiento el 20/07/2047	1.840	0,16
72	Ginnie Mae II Pool 'MA4587', 4,000 %, con vencimiento el 20/07/2047	68	0,01
106	Ginnie Mae II Pool 'MA4654', 4,500 %, con vencimiento el 20/08/2047	103	0,01
144	Ginnie Mae II Pool 'MA4781', 5,000 %, con vencimiento el 20/10/2047	144	0,01
176	Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000 %, con vencimiento el 20/11/2047	166	0,01
161	Ginnie Mae II Pool 'MA4901', 4,000 %, con vencimiento el 20/12/2047	152	0,01
11.832	Ginnie Mae II Pool 'MA4961', 3,000 %, con vencimiento el 20/01/2048	10.519	0,91
50	Ginnie Mae II Pool 'MA5020', 4,000 %, con vencimiento el 20/02/2048	47	–
79	Ginnie Mae II Pool 'MA5078', 4,000 %, con vencimiento el 20/03/2048	74	0,01
159	Ginnie Mae II Pool 'MA5138', 4,500 %, con vencimiento el 20/04/2048	154	0,01
117	Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500 %, con vencimiento el 20/05/2048	113	0,01
90	Ginnie Mae II Pool 'MA5194', 5,000 %, con vencimiento el 20/05/2048	90	0,01
16	Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500 %, con vencimiento el 20/06/2048	16	–
123	Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, con vencimiento el 20/07/2048	119	0,01
1.673	Ginnie Mae II Pool 'MA5399', 4,500 %, con vencimiento el 20/08/2048	1.620	0,14
37	Ginnie Mae II Pool 'MA5467', 4,500 %, con vencimiento el 20/09/2048	36	–
6.022	Ginnie Mae II Pool 'MA5530', 5,000 %, con vencimiento el 20/10/2048	5.970	0,52
212	Ginnie Mae II Pool 'MA5597', 5,000 %, con vencimiento el 20/11/2048	210	0,02
57	Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500 %, con vencimiento el 20/12/2048	55	–
267	Ginnie Mae II Pool 'MA5653', 5,000 %, con vencimiento el 20/12/2048	265	0,02
184	Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500 %, con vencimiento el 20/01/2049	178	0,02
190	Ginnie Mae II Pool 'MA5712', 5,000 %, con vencimiento el 20/01/2049	188	0,02
187	Ginnie Mae II Pool 'MA5713', 5,500 %, con vencimiento el 20/01/2049	188	0,02
88	Ginnie Mae II Pool 'MA5764', 4,500 %, con vencimiento el 20/02/2049	85	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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
2.190	Ginnie Mae II Pool 'MA5766', 5,500 %, con vencimiento el 20/02/2049	2.214	0,19
118	Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500 %, con vencimiento el 20/03/2049	115	0,01
485	Ginnie Mae II Pool 'MA5820', 5,500 %, con vencimiento el 20/03/2049	491	0,04
11	Ginnie Mae II Pool 'MA5877', 4,500 %, con vencimiento el 20/04/2049	10	–
126	Ginnie Mae II Pool 'MA5878', 5,000 %, con vencimiento el 20/04/2049	125	0,01
466	Ginnie Mae II Pool 'MA5879', 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2049	471	0,04
330	Ginnie Mae II Pool 'MA5934', 5,500 %, con vencimiento el 20/05/2049	333	0,03
3.277	Ginnie Mae II Pool 'MA5989', 5,500 %, con vencimiento el 20/06/2049	3.310	0,29
3.383	Ginnie Mae II Pool 'MA6157', 5,000 %, con vencimiento el 20/09/2049	3.355	0,29
192	Ginnie Mae II Pool 'MA6217', 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2049	164	0,01
109	Ginnie Mae II Pool 'MA6412', 4,500 %, con vencimiento el 20/01/2050	105	0,01
77	Ginnie Mae II Pool 'MA6542', 3,500 %, con vencimiento el 20/03/2050	70	0,01
111	Ginnie Mae II Pool 'MA6602', 4,500 %, con vencimiento el 20/04/2050	108	0,01
4.388	Ginnie Mae II Pool 'MA6657', 3,500 %, con vencimiento el 20/05/2050	4.011	0,35
3.745	Ginnie Mae II Pool 'MA6658', 4,000 %, con vencimiento el 20/05/2050	3.524	0,31
181	Ginnie Mae II Pool 'MA6818', 2,000 %, con vencimiento el 20/08/2050	148	0,01
1.809	Ginnie Mae II Pool 'MA6869', 4,500 %, con vencimiento el 20/09/2050	1.752	0,15
3.650	Ginnie Mae II Pool 'MA6931', 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	3.099	0,27
2.263	Ginnie Mae II Pool 'MA6935', 4,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	2.191	0,19
3.521	Ginnie Mae II Pool 'MA6994', 2,000 %, con vencimiento el 20/11/2050	2.869	0,25
27.620	Ginnie Mae II Pool 'MA7051', 2,000 %, con vencimiento el 20/12/2050	22.504	1,96
2.074	Ginnie Mae II Pool 'MA7135', 2,000 %, con vencimiento el 20/01/2051	1.691	0,15
703	Ginnie Mae II Pool 'MA7192', 2,000 %, con vencimiento el 20/02/2051	573	0,05
15.094	Ginnie Mae II Pool 'MA7312', 2,500 %, con vencimiento el 20/04/2051	12.800	1,11
741	Ginnie Mae II Pool 'MA7314', 3,500 %, con vencimiento el 20/04/2051	675	0,06
4.483	Ginnie Mae II Pool 'MA7316', 4,500 %, con vencimiento el 20/04/2051	4.342	0,38
4.387	Ginnie Mae II Pool 'MA7420', 3,500 %, con vencimiento el 20/06/2051	3.992	0,35
235	Ginnie Mae II Pool 'MA7471', 2,000 %, con vencimiento el 20/07/2051	192	0,02
3.576	Ginnie Mae II Pool 'MA7475', 4,000 %, con vencimiento el 20/07/2051	3.366	0,29
159	Ginnie Mae II Pool 'MA7533', 2,000 %, con vencimiento el 20/08/2051	130	0,01
14.111	Ginnie Mae II Pool 'MA7534', 2,500 %, con vencimiento el 20/08/2051	11.955	1,04
7.028	Ginnie Mae II Pool 'MA7648', 2,000 %, con vencimiento el 20/10/2051	5.725	0,50
422	Ginnie Mae II Pool 'MA7704', 2,000 %, con vencimiento el 20/11/2051	343	0,03
3.197	Ginnie Mae II Pool 'MA7990', 4,000 %, con vencimiento el 20/04/2052	2.977	0,26
4.975	Ginnie Mae II Pool 'MA8045', 4,000 %, con vencimiento el 20/05/2052	4.632	0,40
1.090	Ginnie Mae II Pool 'MA8100', 4,000 %, con vencimiento el 20/06/2052	1.015	0,09
14.196	Ginnie Mae II Pool 'MA8197', 2,500 %, con vencimiento el 20/08/2052	12.029	1,05
112	Ginnie Mae II Pool 'MA8263', 2,000 %, con vencimiento el 20/09/2052	91	0,01
1.579	Ginnie Mae II Pool 'MA8268', 4,500 %, con vencimiento el 20/09/2052	1.509	0,13
4.482	Ginnie Mae II Pool 'MA8269', 5,000 %, con vencimiento el 20/09/2052	4.384	0,38
646	Ginnie Mae II Pool 'MA8348', 5,000 %, con vencimiento el 20/10/2052	633	0,06
575	Ginnie Mae II Pool 'MA8422', 2,000 %, con vencimiento el 20/11/2052	468	0,04
4.953	Ginnie Mae II Pool 'MA8428', 5,000 %, con vencimiento el 20/11/2052	4.842	0,42
1.285	Ginnie Mae II Pool 'MA8429', 5,500 %, con vencimiento el 20/11/2052	1.279	0,11
2.522	Ginnie Mae II Pool 'MA8484', 2,000 %, con vencimiento el 20/12/2052	2.056	0,18
2.230	Ginnie Mae II Pool 'MA8489', 4,500 %, con vencimiento el 20/12/2052	2.132	0,19
4.567	Ginnie Mae II Pool 'MA8647', 5,000 %, con vencimiento el 20/02/2053	4.468	0,39
3.661	Ginnie Mae II Pool 'MA8725', 5,000 %, con vencimiento el 20/03/2053	3.580	0,31
2.059	Ginnie Mae II Pool 'MA8794', 2,000 %, con vencimiento el 20/03/2053	1.678	0,15
96	Ginnie Mae II Pool 'MA8798', 4,000 %, con vencimiento el 20/04/2053	89	0,01
12.127	Ginnie Mae II Pool 'MA8800', 5,000 %, con vencimiento el 20/04/2053	11.853	1,03
23.101	Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2053	22.965	2,00
4.394	Ginnie Mae II Pool 'MA8878', 5,000 %, con vencimiento el 20/05/2053	4.293	0,37
999	Ginnie Mae II Pool 'MA9011', 2,500 %, con vencimiento el 20/07/2053	847	0,07
2.000	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 4,500 % ±	1.910	0,17
2.000	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,500 % ±	1.987	0,17
584	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2004 81, Clase SK, 0,764 %, con vencimiento el 16/10/2034 *	22	–
1.011	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2008 40, Clase SC, 0,914 %, con vencimiento el 16/05/2038 *	65	0,01
1.287	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2008 79, Clase ID, 1,366 %, con vencimiento el 20/06/2035 *	72	0,01
194	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2010 H02, Clase FA, 6,131 %, con vencimiento el 20/02/2060 *	193	0,02
443	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H20, Clase AF, 5,793 %, con vencimiento el 20/10/2060 *	441	0,04
163	Government National Mortgage Association, Serie 2010 H22, Clase FE, 5,813 %, con vencimiento el 20/05/2059 *	162	0,01
233	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2010 H28, Clase FE, 5,863 %, con vencimiento el 20/12/2060 *	232	0,02
596	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2011 146, Clase KS, 0,664 %, con vencimiento el 16/11/2041 *	60	0,01
807	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2011 79, Clase KS, 0,000 %, con vencimiento el 20/05/2041 *	62	0,01
1.759	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2012 H21, Clase FA, 5,963 %, con vencimiento el 20/07/2062 *	1.752	0,15
8.878	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2013 93, Clase SA, 0,764 %, con vencimiento el 16/06/2043 *	1.033	0,09
485	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2014 118, Clase HS, 0,766 %, con vencimiento el 20/08/2044 *	55	–
786	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2014 2, Clase CI, 4,500 %, con vencimiento el 20/01/2044	163	0,01
2.233	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2014 60, Clase SA, 0,664 %, con vencimiento el 16/04/2044 *	209	0,02
7.542	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2015 136, Clase IO, 0,374 %, con vencimiento el 16/08/2055 *	97	0,01
3.446	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2015 177, Clase MI, 5,000 %, con vencimiento el 20/10/2044	685	0,06
2.395	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2015 20, Clase PI, 3,500 %, con vencimiento el 20/02/2045	390	0,03
26.044	Government National Mortgage Association, Serie 2017 111, Clase IO, 0,526 %, con vencimiento el 16/02/2059 *	780	0,07
1.738	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2017 19, Clase SE, 0,714 %, con vencimiento el 16/02/2047 *	165	0,01
3.478	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2017 26, Clase IQ, 5,000 %, con vencimiento el 20/02/2040	581	0,05
6.860	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2017 8, Clase IO, 0,447 %, con vencimiento el 16/08/2058 *	158	0,01
461	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2017 H22, Clase JF, 6,199 %, con vencimiento el 20/10/2067 *	458	0,04
1.667	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2018 125, Clase HS, 0,816 %, con vencimiento el 20/09/2048 *	156	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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
2.598	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2018 134, Clase SM, 0,766 %, con vencimiento el 20/10/2048 *	245	0,02
749	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2018 168, Clase PA, 4,000 %, con vencimiento el 20/08/2048	699	0,06
621	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2018 37, Clase QA, 2,750 %, con vencimiento el 20/03/2048	535	0,05
506	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2018 H09, Clase FE, 5,495 %, con vencimiento el 20/06/2068 *	500	0,04
2.471	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2018 H13, Clase DF, 5,598 %, con vencimiento el 20/07/2068 *	2.446	0,21
500	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2019 128, Clase AL, 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2049	341	0,03
534	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2019 18, Clase TP, 3,500 %, con vencimiento el 20/02/2049	484	0,04
11.651	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2019 85, Clase LS, 0,000 %, con vencimiento el 20/07/2049 *	264	0,02
139	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2019 H01, Clase FT, 5,863 %, con vencimiento el 20/10/2068 *	138	0,01
269	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2019 H08, Clase FE, 6,113 %, con vencimiento el 20/01/2069 *	263	0,02
302	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2019 H10, Clase FB, 6,063 %, con vencimiento el 20/06/2069 *	296	0,03
5.060	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2020 116, Clase GI, 2,500 %, con vencimiento el 20/08/2050	678	0,06
1.748	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2020 122, Clase IM, 2,500 %, con vencimiento el 20/08/2050	235	0,02
3.585	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2020 123, Clase EI, 2,500 %, con vencimiento el 20/08/2050	480	0,04
450	Government National Mortgage Association, Serie 2020 129, Clase IE, 2,500 %, con vencimiento el 20/09/2050	61	0,01
155	Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Clase IH, 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	21	–
5.264	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2020 160, Clase QI, 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	917	0,08
222	Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Clase VI, 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	31	–
677	Government National Mortgage Association, Serie 2020 160, Clase YI, 2,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	88	0,01
4.065	Government National Mortgage Association, Serie 2020 181, Clase WI, 2,000 %, con vencimiento el 20/12/2050	454	0,04
1.435	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2020 187, Clase MI, 3,000 %, con vencimiento el 20/12/2050	248	0,02
3.878	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2020 191, Clase IX, 2,500 %, con vencimiento el 20/12/2050	680	0,06
4.531	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2020 36, Clase GS, 0,666 %, con vencimiento el 20/03/2050 *	586	0,05
478	Government National Mortgage Association, Serie 2020 47, Clase MI, 3,500 %, con vencimiento el 20/04/2050	87	0,01
1.333	Government National Mortgage Association, Serie 2020 47, Clase NI, 3,500 %, con vencimiento el 20/04/2050	243	0,02
921	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2020 61, Clase CI, 4,000 %, con vencimiento el 20/03/2050	177	0,02
809	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2020 85, Clase CI, 3,500 %, con vencimiento el 20/04/2050	141	0,01
5.787	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2020 H08, Clase BI, 0,026 %, con vencimiento el 01/04/2070 *	179	0,02
1.271	Government National Mortgage Association, Serie 2020 H09, Clase FL, 6,613 %, con vencimiento el 20/05/2070 *	1.270	0,11
148	Government National Mortgage Association, Serie 2020 H12, Clase F, 5,963 %, con vencimiento el 20/07/2070 *	144	0,01
1.053	Government National Mortgage Association, Serie 2020 H13, Clase FA, 5,913 %, con vencimiento el 20/07/2070 *	1.023	0,09
28.167	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2021 110, Clase IO, 0,873 %, con vencimiento el 16/11/2063 *	1.802	0,16
1.077	Government National Mortgage Association, Serie 2021 14, Clase AB, 1,340 %, con vencimiento el 16/06/2063	804	0,07
6.454	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2021 156, Clase IE, 2,500 %, con vencimiento el 20/09/2051	1.077	0,09
12.857	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2021 158, Clase IN, 2,500 %, con vencimiento el 20/09/2051	1.741	0,15
3.474	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2021 180, Clase IO, 0,912 %, con vencimiento el 16/11/2063 *	234	0,02
15.794	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2021 191, Clase NI, 3,000 %, con vencimiento el 20/10/2051	3.005	0,26
2.765	Government National Mortgage Association, Serie 2021 21, Clase AH, 1,400 %, con vencimiento el 16/06/2063	2.069	0,18
7.191	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2021 216, Clase NI, 3,000 %, con vencimiento el 20/12/2051	1.367	0,12
1.812	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2021 26, Clase AI, 2,000 %, con vencimiento el 20/02/2051	212	0,02
871	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2021 29, Clase AG, 5,000 %, con vencimiento el 20/02/2051	847	0,07
49.048	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2021 37, Clase IO, 0,805 %, con vencimiento el 16/01/2061 *	2.819	0,25
6.307	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2021 46, Clase NI, 2,500 %, con vencimiento el 20/03/2051	998	0,09
21.174	Government National Mortgage Association, Serie 2021 5, Clase IO, 1,112 %, con vencimiento el 16/01/2061 *	1.635	0,14
28.708	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2021 60, Clase IO, 0,826 %, con vencimiento el 16/05/2063 *	1.678	0,15
5.109	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2021 7, Clase TI, 2,500 %, con vencimiento el 16/01/2051	874	0,08
579	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2021 8, Clase AQ, 5,000 %, con vencimiento el 20/01/2051	576	0,05
3.600	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2021 9, Clase MI, 2,500 %, con vencimiento el 20/01/2051	485	0,04
5.400	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2022 102, Clase CB, 2,250 %, con vencimiento el 16/06/2064 *	3.075	0,27
1.100	Government National Mortgage Association, Serie 2022 139, Clase AL, 4,000 %, con vencimiento el 20/07/2051	982	0,09
9.200	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2022 147, Clase B, 2,200 %, con vencimiento el 16/10/2063	6.363	0,55
9.385	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2022 158, Clase AL, 2,100 %, con vencimiento el 16/08/2064	6.772	0,59
4.326	Government National Mortgage Association, serie 2022 3, clase IO, 0,640 %, con vencimiento el 16/02/2061 *	212	0,02
9.238	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2022 5, Clase LI, 3,500 %, con vencimiento el 20/01/2052	1.624	0,14
1.466	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2022 50, Clase NI, 3,000 %, con vencimiento el 20/09/2048	227	0,02
3.221	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2022 54, Clase Z, 2,000 %, con vencimiento el 16/10/2063 *	1.537	0,13
38.689	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2022 55, Clase IO, 0,566 %, con vencimiento el 16/01/2063 *	1.718	0,15
1.900	Government National Mortgage Association, Serie 2022 63, Clase LM, 3,500 %, con vencimiento el 20/10/2050	1.576	0,14
1.300	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2022 86, Clase C, 2,250 %, con vencimiento el 16/10/2063 *	621	0,05
16.406	Government National Mortgage Association, Serie 2023 179, Clase IO, 0,611 %, con vencimiento el 16/09/2063 *	673	0,06
6.353	Asociación Hipotecaria Nacional Gubernamental, Serie 2023 8, Clase AZ, 3,750 %, con vencimiento el 16/01/2065	4.562	0,40
6.599	Government National Mortgage Association, Serie 2023 92, Clase AH, 2,000 %, con vencimiento el 16/06/2064	5.079	0,44
5.999	Government National Mortgage Association, Serie 2023 92, Clase IA, 0,611 %, con vencimiento el 16/06/2064 *	375	0,03
3.329	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Clase A, 144A, 7,165 %, con vencimiento el 15/09/2031 *	2.381	0,21
3.454	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Serie 2018 SRP5, Clase B, 144A, 8,365 %, con vencimiento el 15/09/2031 *	1.174	0,10

^ 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 al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas (continuación)			
227	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC20, Serie 2014 GC20, Clase A5, 3,998 %, con vencimiento el 10/04/2047	227	0,02
2.120	GS Mortgage Securities Trust 2017-GS8, Serie 2017 GS8, Clase A4, 3,469 %, con vencimiento el 10/11/2050	1.969	0,17
1.096	HGI CRE CLO 2021-FL2 Ltd, Serie 2021 FL2, Clase A, 144A, 6,436 %, con vencimiento el 17/09/2036 *	1.087	0,10
1.885	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2018-C8, Serie 2018 C8, Clase A4, 4,211 %, con vencimiento el 15/06/2051	1.778	0,15
1.307	MF1 2021-FL6 Ltd, Serie 2021 FL6, Clase A, 144A, 6,536 %, con vencimiento el 16/07/2036 *	1.301	0,11
2.423	MF1 2021-FL7 Ltd, Serie 2021 FL7, Clase A, 144A, 6,514 %, con vencimiento el 16/10/2036 *	2.406	0,21
980	New Residential Mortgage Loan Trust 2018-3, Serie 2018 3A, Clase A1, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 25/05/2058 *	944	0,08
1.366	New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM3, Serie 2021 NQM3, Clase A1, 144A, 1,156 %, con vencimiento el 27/11/2056 *	1.150	0,10
1.480	Store Master Funding I-VII XIV XIX XX, Serie 2021 1A, Clase A3, 144A, 2,860 %, con vencimiento el 20/06/2051	1.256	0,11
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 1.224.272 $)		1.130.316	98,31
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	1.973	0,17
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 2.037 $)		1.973	0,17
Bonos y obligaciones del Estado: 1,03 % (28 de febrero de 2023: 2,42 %)			
Estados Unidos: 1,03 % (28 de febrero de 2023: 2,42 %)			
5.140	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 14/03/2024	5.130	0,45
2.690	United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 16/04/2024	2.672	0,23
60	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 1,125 %, con vencimiento el 28/02/2025	58	–
4.320	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 0,750 %, con vencimiento el 30/04/2026	3.983	0,35
		11.843	1,03
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 12.173 $)		11.843	1,03
Organismos de inversión colectiva: 1,52 % (28 de febrero de 2023: 0,10 %)			
17.502	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	17.502	1,52
Total de organismos de inversión colectiva (coste 17.502 $)		17.502	1,52
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 1.273.391 $)		1.178.166	102,47

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Futuros: 0,03 % (28 de febrero de 2023: 0,03 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		313	0,03
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		1.178.479	102,50
Valores garantizados por hipotecas: (0,55 %) (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
(7.700)	Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 % ±	(6.335)	(0,55)
Total de valores garantizados por hipotecas (coste (6.335) $)		(6.335)	(0,55)
Total de inversiones vendidas en corto a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste (6,335 $))		(6.335)	(0,55)
Futuros: (0,02 %) (28 de febrero de 2023: (0,06 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(247)	(0,02)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(6.582)	(0,57)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		1.171.897	101,93
Excedente de pasivos respecto a otros activos		(22.189)	(1,93)
Patrimonio		1.149.708 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 37.649.000 USD o el 3,28 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

± 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	82,30
Organismos de inversión colectiva	1,24
Instrumentos financieros derivados	0,02
Otros activos	16,44
Total de activos	100,00

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 2025	Bank of America Merrill Lynch	470	$ 113.135	$ (247)
U.S. 10 Year Note (CBT) junio de 2024	Bank of America Merrill Lynch	278	30.702	67
U.S. 10 Year Ultra Note junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	131	14.956	54
U.S. 5 Year Note (CBT) junio de 2024	Bank of America Merrill Lynch	375	40.090	39
U.S. Long Bond (CBT) junio 2024	Bank of America Merrill Lynch	171	20.392	153
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 353 $)				$ 313
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (731) $)				(247)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (378) $)				$ 66

^ *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 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por activos: 0,32 % (28 de febrero de 2023: 2,61 %)			
60	Soundview Home Loan Trust 2006-2, Serie 2006 2, Clase M2, 5,960 %, con vencimiento el 25/03/2036 *	59	0,32
Total de valores garantizados por activos (coste 59 $)		59	0,32
Valores garantizados por hipotecas: 19,49 % (28 de febrero de 2023: 19,86 %)			
100	BANK 2017-BNK7, Serie 2017 BNK7, Clase C, 4,010 %, con vencimiento el 15/09/2060 *	83	0,45
7.461	Benchmark 2018-B7 Mortgage Trust, Serie 2018 B7, Clase XA, 0,405 %, con vencimiento el 15/05/2053 *	106	0,57
100	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Clase 1B1, 144A, 8,422 %, con vencimiento el 25/10/2041 *	102	0,56
100	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Serie 2021 R03, Clase 1B1, 144A, 8,072 %, con vencimiento el 25/12/2041 *	102	0,55
109	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2015 C03, Clase 1M2, 10,436 %, con vencimiento el 25/07/2025 *	114	0,62
19	Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, con vencimiento el 01/07/2043	17	0,09
80	Fannie Mae Pool 'BR4393', 2,000 %, con vencimiento el 01/03/2051	63	0,35
123	Fannie Mae Pool 'CA5220', 3,000 %, con vencimiento el 01/02/2050	106	0,58
81	Fannie Mae Pool 'CB1878', 3,000 %, con vencimiento el 01/10/2051	70	0,38
167	Fannie Mae Pool 'CB2164', 3,000 %, con vencimiento el 01/11/2051	145	0,79
86	Fannie Mae Pool 'CB2375', 2,500 %, con vencimiento el 01/12/2051	71	0,39
263	Fannie Mae Pool 'FM3445', 4,000 %, con vencimiento el 01/09/2048	246	1,34
83	Fannie Mae Pool 'FM9195', 2,500 %, con vencimiento el 01/10/2051	69	0,38
81	Fannie Mae Pool 'FM9292', 3,000 %, con vencimiento el 01/11/2051	71	0,38
84	Fannie Mae Pool 'FM9579', 2,000 %, con vencimiento el 01/07/2051	67	0,36
87	Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, con vencimiento el 01/02/2052	69	0,38
82	Fannie Mae Pool 'FS1107', 2,500 %, con vencimiento el 01/12/2051	68	0,37
171	Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2049	155	0,84
70	Fannie Mae Pool 'MA4158', 2,000 %, con vencimiento el 01/10/2050	56	0,30
80	Fannie Mae Pool 'MA4305', 2,000 %, con vencimiento el 01/04/2051	63	0,34
70	Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2050	59	0,32
78	Freddie Mac Pool 'RA5921', 2,500 %, con vencimiento el 01/09/2051	65	0,35
67	Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, con vencimiento el 01/10/2041	54	0,29
17	Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, con vencimiento el 01/11/2041	14	0,07
325	Freddie Mac Pool 'SD0176', 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2049	293	1,59
85	Freddie Mac Pool 'SD0777', 2,500 %, con vencimiento el 01/11/2051	70	0,38
78	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Serie 2021 DNA5, Clase M2, 144A, 6,972 %, con vencimiento el 25/01/2034 *	79	0,43
100	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, Serie 2022 DNA3, Clase B1, 144A, 10,972 %, con vencimiento el 25/04/2042 *	107	0,59
128	Ginnie Mae II Pool 'MA6658', 4,000 %, con vencimiento el 20/05/2050	121	0,66
212	Ginnie Mae II Pool 'MA7473', 3,000 %, con vencimiento el 20/07/2051	186	1,01
225	Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, con vencimiento el 20/09/2051	198	1,07
87	Ginnie Mae II Pool 'MA7883', 3,500 %, con vencimiento el 20/02/2052	78	0,43
100	Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 % ±	98	0,53
96	Government National Mortgage Association, serie 2022 3, clase IO, 0,640 %, con vencimiento el 16/02/2061 *	5	0,03
27	New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Serie 2021 NQ2R, Clase A3, 144A, 1,353 %, con vencimiento el 25/10/2058 *	24	0,13
250	Towd Point Mortgage Trust 2017-4, Serie 2017 4, Clase B2, 144A, 3,639 %, con vencimiento el 25/06/2057 *	208	1,13
85	Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Clase A1, 144A, 5,811 %, con vencimiento el 25/05/2068	84	0,46
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 3.994 $)		3.586	19,49
Bonos y obligaciones corporativos: 33,94 % (28 de febrero de 2023: 31,20 %)			
Australia: 0,42 % (28 de febrero de 2023: 0,42 %)			
20	BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000 %, con vencimiento el 30/09/2043	19	0,10
20	Glencore Finance Canada Ltd, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 15/11/2041	20	0,11
40	Glencore Funding LLC, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 27/03/2027	39	0,21
		78	0,42
Bélgica: 0,30 % (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	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, con vencimiento el 01/06/2040	18	0,10
		55	0,30
Brasil: 1,45 % (28 de febrero de 2023: 1,38 %)			
110	Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, con vencimiento el 01/02/2029	110	0,60
60	Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125 %, con vencimiento el 15/01/2032	49	0,27
100	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, con vencimiento el 21/11/2036	107	0,58
		266	1,45
Canadá: 1,09 % (28 de febrero de 2023: 1,11 %)			
30	Bank of Montreal, 1,850 %, con vencimiento el 01/05/2025	29	0,16
20	Bank of Nova Scotia/The, 1,300 %, con vencimiento el 11/06/2025	19	0,10
20	Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, con vencimiento el 30/05/2041	20	0,11
10	MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 01/02/2029	10	0,05
10	Rogers Communications Inc, 5,300 %, con vencimiento el 15/02/2034	10	0,05
40	Royal Bank of Canada, 1,150 %, con vencimiento el 10/06/2025	38	0,21
10	Teck Resources Ltd, 3,900 %, con vencimiento el 15/07/2030	9	0,05
70	Toronto-Dominion Bank/The, 1,150 %, con vencimiento el 12/06/2025	66	0,36
		201	1,09
Colombia: 0,40 % (28 de febrero de 2023: 0,36 %)			
100	Ecopetrol SA, 5,875 %, con vencimiento el 28/05/2045	74	0,40
Francia: 1,05 % (28 de febrero de 2023: 1,03 %)			
200	BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, con vencimiento el 14/08/2028	193	1,05
Israel: 0,61 % (28 de febrero de 2023: 1,21 %)			
120	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, con vencimiento el 01/10/2026	111	0,61
Macao: 1,02 % (28 de febrero de 2023: 0,93 %)			
200	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 26/08/2028	188	1,02
México: 0,51 % (28 de febrero de 2023: 0,51 %)			
100	Southern Copper Corp, 5,250 %, con vencimiento el 08/11/2042	94	0,51
Supranacional: 1,34 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
INR 20.000	Inter-American Development Bank, 7,350 %, con vencimiento el 06/10/2030	246	1,34
Reino Unido: 1,16 % (28 de febrero de 2023: 1,25 %)			
11	BAT Capital Corp, 3,557 %, con vencimiento el 15/08/2027	11	0,06
40	BAT Capital Corp, 4,540 %, con vencimiento el 15/08/2047	30	0,16
200	Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/07/2031	173	0,94
		214	1,16
Estados Unidos: 24,59 % (28 de febrero de 2023: 22,39 %)			
10	Abbott Laboratories, 3,750 %, con vencimiento el 30/11/2026	10	0,05
10	Abbott Laboratories, 4,750 %, con vencimiento el 30/11/2036	10	0,05
20	Abbott Laboratories, 4,900 %, con vencimiento el 30/11/2046	19	0,11
100	AbbVie Inc, 3,600 %, con vencimiento el 14/05/2025	98	0,53
10	AbbVie Inc, 4,800 %, con vencimiento el 15/03/2029	10	0,05
80	AbbVie Inc, 3,200 %, con vencimiento el 21/11/2029	73	0,40
10	AbbVie Inc, 4,950 %, con vencimiento el 15/03/2031	10	0,05
10	AbbVie Inc, 5,050 %, con vencimiento el 15/03/2034	10	0,06
20	AbbVie Inc, 4,250 %, con vencimiento el 21/11/2049	17	0,09
10	Air Lease Corp, 5,300 %, con vencimiento el 01/02/2028	10	0,05
20	Alphabet Inc, 1,100 %, con vencimiento el 15/08/2030	16	0,09
20	Alphabet Inc, 2,050 %, con vencimiento el 15/08/2050	12	0,06
32	Altria Group Inc, 4,400 %, con vencimiento el 14/02/2026	32	0,17
8	Altria Group Inc, 4,800 %, con vencimiento el 14/02/2029	8	0,04

^ 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 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
20	Altria Group Inc, 5,800 %, con vencimiento el 14/02/2039	20	0,11
30	Altria Group Inc, 5,950 %, con vencimiento el 14/02/2049	30	0,16
40	Amazon.com Inc, 1,500 %, con vencimiento el 03/06/2030	33	0,18
50	Amazon.com Inc, 2,500 %, con vencimiento el 03/06/2050	31	0,17
20	Aon North America Inc, 5,450 %, con vencimiento el 01/03/2034	20	0,11
50	AT&T Inc, 1,650 %, con vencimiento el 01/02/2028	44	0,24
10	Ball Corp, 3,125 %, con vencimiento el 15/09/2031	8	0,05
20	Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, con vencimiento el 15/01/2049	18	0,10
40	Boeing Co/The, 4,875 %, con vencimiento el 01/05/2025	40	0,22
50	Boeing Co/The, 5,150 %, con vencimiento el 01/05/2030	49	0,27
40	Boeing Co/The, 5,705 %, con vencimiento el 01/05/2040	39	0,21
50	Boeing Co/The, 5,805 %, con vencimiento el 01/05/2050	48	0,26
40	BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, con vencimiento el 04/05/2026	38	0,21
20	BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, con vencimiento el 06/04/2030	19	0,10
20	BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, con vencimiento el 24/02/2050	13	0,07
13	Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, con vencimiento el 26/07/2029	12	0,07
10	Bristol-Myers Squibb Co, 5,100 %, con vencimiento el 22/02/2031	10	0,05
20	Bristol-Myers Squibb Co, 5,200 %, con vencimiento el 22/02/2034	20	0,11
260	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, con vencimiento el 01/05/2032	206	1,12
10	Centene Corp, 4,250 %, con vencimiento el 15/12/2027	10	0,05
10	Centene Corp, 4,625 %, con vencimiento el 15/12/2029	9	0,05
20	Charles Schwab Corp/The, 5,875 %, con vencimiento el 24/08/2026	20	0,11
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	0,41
40	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, con vencimiento el 01/04/2038	34	0,19
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	29	0,16
10	Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, con vencimiento el 31/01/2032	8	0,05
40	Cigna Group/The, 4,375 %, con vencimiento el 15/10/2028	39	0,21
20	Cigna Group/The, 4,800 %, con vencimiento el 15/08/2038	19	0,10
20	Cigna Group/The, 4,900 %, con vencimiento el 15/12/2048	18	0,10
150	Citigroup Inc, 5,500 %, con vencimiento el 13/09/2025	150	0,81
200	Citigroup Inc, 2,572 %, con vencimiento el 03/06/2031 *	169	0,92
10	Citigroup Inc, 8,125 %, con vencimiento el 15/07/2039	13	0,07
50	Citigroup Inc, 4,650 %, con vencimiento el 23/07/2048	45	0,24
50	Coca-Cola Co/The, 2,500 %, con vencimiento el 15/03/2051	31	0,17
30	Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,036 %, con vencimiento el 15/11/2033	31	0,17
40	Comcast Corp, 4,150 %, con vencimiento el 15/10/2028	39	0,21
10	Consolidated Edison Co of New York Inc, Serie 20A, 3,350 %, con vencimiento el 01/04/2030	9	0,05
60	Coterra Energy Inc, 4,375 %, con vencimiento el 15/03/2029	58	0,31
30	Deere & Co, 3,750 %, con vencimiento el 15/04/2050	25	0,13
150	Delta Air Lines Inc, 7,375 %, con vencimiento el 15/01/2026	155	0,84
160	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 20/10/2028	156	0,85
40	Devon Energy Corp, 5,850 %, con vencimiento el 15/12/2025	40	0,22
40	Devon Energy Corp, 5,000 %, con vencimiento el 15/06/2045	35	0,19
20	Diamondback Energy Inc, 3,500 %, con vencimiento el 01/12/2029	18	0,10
10	DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 01/12/2026	8	0,04
30	Elevance Health Inc, 3,650 %, con vencimiento el 01/12/2027	29	0,16
10	Eli Lilly & Co, 4,700 %, con vencimiento el 09/02/2034	10	0,05
20	Energy Transfer LP, 5,250 %, con vencimiento el 15/04/2029	20	0,11
20	Energy Transfer LP, 6,250 %, con vencimiento el 15/04/2049	20	0,11
10	Energy Transfer Operating LP, Serie G, 7,125 %, Perpetuo *	10	0,05
20	EOG Resources Inc, 4,375 %, con vencimiento el 15/04/2030	19	0,11
20	EOG Resources Inc, 4,950 %, con vencimiento el 15/04/2050	19	0,10
150	EQT Corp, 5,000 %, con vencimiento el 15/01/2029	146	0,80
10	Exelon Corp, 5,625 %, con vencimiento el 15/06/2035	10	0,05
10	Ford Motor Co, 6,100 %, con vencimiento el 19/08/2032	10	0,05
230	Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, con vencimiento el 28/05/2027	224	1,22
220	Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, con vencimiento el 13/11/2030	195	1,06
20	General Motors Co, 5,950 %, con vencimiento el 01/04/2049	19	0,11
20	Home Depot Inc/The, 3,250 %, con vencimiento el 15/04/2032	18	0,10
40	Home Depot Inc/The, 3,300 %, con vencimiento el 15/04/2040	31	0,17
10	Honeywell International Inc, 5,000 %, con vencimiento el 01/03/2035	10	0,05
20	Humana Inc, 3,700 %, con vencimiento el 23/03/2029	19	0,10
10	Intel Corp, 5,125 %, con vencimiento el 10/02/2030	10	0,06
10	JPMorgan Chase & Co, 3,897 %, con vencimiento el 23/01/2049 *	8	0,04
10	Kenvue Inc, 4,900 %, con vencimiento el 22/03/2033	10	0,05
10	Kinder Morgan Inc, 5,200 %, con vencimiento el 01/03/2048	9	0,05
40	Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, con vencimiento el 08/08/2024	40	0,22
10	MDC Holdings Inc, 6,000 %, con vencimiento el 15/01/2043	10	0,05
30	Merck & Co Inc, 1,450 %, con vencimiento el 24/06/2030	25	0,13
77	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 20/06/2027	77	0,42
40	Mondelez International Inc, 1,500 %, con vencimiento el 04/05/2025	38	0,21
110	Morgan Stanley, 2,188 %, con vencimiento el 28/04/2026 *	106	0,58
70	Morgan Stanley, 3,622 %, con vencimiento el 01/04/2031 *	64	0,35
20	MPLX LP, 4,800 %, con vencimiento el 15/02/2029	20	0,11
20	MPLX LP, 5,500 %, con vencimiento el 15/02/2049	19	0,10
20	NIKE Inc, 3,375 %, con vencimiento el 27/03/2050	15	0,08
40	Northrop Grumman Corp, 3,250 %, con vencimiento el 15/01/2028	38	0,20
20	Northrop Grumman Corp, 5,250 %, con vencimiento el 01/05/2050	19	0,11
10	ONEOK Inc, 5,550 %, con vencimiento el 01/11/2026	10	0,06
20	ONEOK Inc, 5,650 %, con vencimiento el 01/11/2028	20	0,11
20	PepsiCo Inc, 1,625 %, con vencimiento el 01/05/2030	17	0,09
10	Philip Morris International Inc, 4,875 %, con vencimiento el 13/02/2029	10	0,05
20	Philip Morris International Inc, 2,100 %, con vencimiento el 01/05/2030	17	0,09
10	Philip Morris International Inc, 5,250 %, con vencimiento el 13/02/2034	10	0,05
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	0,06
10	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/03/2032	10	0,05
40	RTX Corp, 2,250 %, con vencimiento el 01/07/2030	34	0,18
10	RTX Corp, 6,000 %, con vencimiento el 15/03/2031	10	0,06
10	RTX Corp, 4,500 %, con vencimiento el 01/06/2042	9	0,05
10	Solventum Corp, 144A, 5,400 %, con vencimiento el 01/03/2029	10	0,05
20	Solventum Corp, 144A, 5,450 %, con vencimiento el 13/03/2031	20	0,11
20	Solventum Corp, 144A, 5,900 %, con vencimiento el 30/04/2054	20	0,11

^ *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 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
60	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 20/09/2025	43	0,24
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	59	0,32
10	T-Mobile USA Inc, 2,875 %, con vencimiento el 15/02/2031	9	0,05
20	T-Mobile USA Inc, 3,500 %, con vencimiento el 15/04/2031	18	0,10
10	T-Mobile USA Inc, 5,150 %, con vencimiento el 15/04/2034	10	0,05
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	0,06
50	Union Pacific Corp, 2,891 %, con vencimiento el 06/04/2036	40	0,22
40	Union Pacific Corp, 3,839 %, con vencimiento el 20/03/2060	30	0,17
10	United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 15/04/2026	10	0,05
20	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 15/04/2029	18	0,10
40	UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, con vencimiento el 15/05/2030	34	0,18
20	UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, con vencimiento el 15/05/2040	14	0,08
20	UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, con vencimiento el 15/08/2049	15	0,08
40	US Bancorp, 1,450 %, con vencimiento el 12/05/2025	38	0,21
10	US Bancorp, 5,775 %, con vencimiento el 12/06/2029 *	10	0,06
10	US Bancorp, 5,836 %, con vencimiento el 12/06/2034 *	10	0,06
10	Verizon Communications Inc, 4,500 %, con vencimiento el 10/08/2033	9	0,05
20	Visa Inc, 2,050 %, con vencimiento el 15/04/2030	17	0,09
30	Visa Inc, 4,300 %, con vencimiento el 14/12/2045	27	0,15
10	Warnermedia Holdings Inc, 6,412 %, con vencimiento el 15/03/2026	10	0,05
10	Waste Connections Inc, 5,000 %, con vencimiento el 01/03/2034	10	0,05
140	Western Midstream Operating LP, 5,250 %, con vencimiento el 01/02/2050	124	0,67
20	Williams Cos Inc/The, 4,850 %, con vencimiento el 01/03/2048	18	0,10
		4.524	24,59
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 7.255 $)		6.244	33,94
Bonos y obligaciones del Estado: 36,49 % (28 de febrero de 2023: 27,36 %)			
Brasil: 1,47 % (28 de febrero de 2023: 1,33 %)			
BRL 579	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2033	112	0,61
200	Bono Internacional del Gobierno de Brasil, 5,000 %, con vencimiento el 27/01/2045	159	0,86
		271	1,47
Indonesia: 1,00 % (28 de febrero de 2023: 2,35 %)			
200	Bono Internacional del Estado de Indonesia, 4,625 %, con vencimiento el 15/04/2043	184	1,00
México: 7,98 % (28 de febrero de 2023: 7,42 %)			
MXN 25.890	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, con vencimiento el 13/11/2042	1.314	7,14
200	Bono Internacional del Estado de México, 4,350 %, con vencimiento el 15/01/2047	154	0,84
		1.468	7,98
Perú: 0,18 % (28 de febrero de 2023: 0,17 %)			
30	Bono Internacional del Estado de Perú, 6,550 %, con vencimiento el 14/03/2037	32	0,18
Estados Unidos: 25,86 % (28 de febrero de 2023: 15,97 %)			
360	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125 %, con vencimiento el 15/01/2033 β	347	1,89
10	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 2,750 %, con vencimiento el 30/04/2027	10	0,05
130	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,625 %, con vencimiento el 31/03/2028	127	0,69
250	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,625 %, con vencimiento el 31/03/2030	241	1,31
120	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 4,000 %, con vencimiento el 31/07/2030	118	0,64
110	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, con vencimiento el 31/01/2031	108	0,59
280	United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, con vencimiento el 28/02/2031	280	1,52
10	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 1,875 %, con vencimiento el 15/02/2032	8	0,05
230	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 1,750 %, con vencimiento el 15/08/2041	153	0,83
10	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 2,375 %, con vencimiento el 15/02/2042	7	0,04
70	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 4,000 %, con vencimiento el 15/11/2042	65	0,35
20	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, con vencimiento el 15/02/2043	18	0,10
80	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, con vencimiento el 15/05/2043	73	0,40
60	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, con vencimiento el 15/11/2043	62	0,34
110	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, con vencimiento el 15/02/2049	85	0,46
50	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, con vencimiento el 15/05/2049	38	0,21
50	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 2,250 %, con vencimiento el 15/08/2049	33	0,18
200	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, con vencimiento el 15/08/2050	105	0,57
230	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, con vencimiento el 15/11/2050	129	0,70
230	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, con vencimiento el 15/02/2051	138	0,75
710	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, con vencimiento el 15/05/2051	479	2,61
50	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, con vencimiento el 15/08/2051	31	0,17
370	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 1,875 %, con vencimiento el 15/11/2051	221	1,20
62	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, con vencimiento el 15/02/2052	41	0,22
257	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, con vencimiento el 15/05/2052	194	1,05
50	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, con vencimiento el 15/08/2052	39	0,21
40	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, con vencimiento el 15/11/2052	37	0,20
178	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,625 %, con vencimiento el 15/02/2053	156	0,85
490	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 15/05/2053	429	2,33
260	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2053	249	1,35
590	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, con vencimiento el 15/11/2053	628	3,41
110	United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, con vencimiento el 15/02/2054	108	0,59
		4.757	25,86
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 7.857 $)		6.712	36,49
Obligaciones de préstamo: 4,83 % (28 de febrero de 2023: 5,39 %)			
51	1011778 Bc Ulc, 7,583 %, con vencimiento el 21/09/2030 *	51	0,28
59	Allied Universal Holdco LLC, 9,183 %, con vencimiento el 14/05/2028 *	58	0,32
10	AmWINS Group, Inc., 7,697 %, con vencimiento el 17/02/2028 *	10	0,05
58	Avolon TLB Borrower 1 (US) LLC, 7,320 %, con vencimiento el 22/06/2028 *	58	0,32
20	Brown Group Holding LLC, 8,183 %, con vencimiento el 07/06/2028 *	19	0,11
68	Charter Communications Operating LLC, 7,329 %, con vencimiento el 09/12/2030 *	67	0,36
49	Citadel Securities LP, 7,836 %, con vencimiento el 29/07/2030 *	49	0,26
10	DCert Buyer, Inc., 9,333 %, con vencimiento el 16/10/2026 *	9	0,05
19	Gainwell Acquisition Corp, 9,448 %, con vencimiento el 01/10/2027 *	19	0,10
68	Genesee & Wyoming Inc, 7,448 %, con vencimiento el 30/12/2026 *	68	0,37
65	Grifols Worldwide Operations USA Inc, 7,538 %, con vencimiento el 15/11/2027 *	64	0,35
10	GVC Holdings Gibraltar Ltd, 7,948 %, con vencimiento el 16/03/2027 *	10	0,05
57	Harbor Freight Tools USA Inc, 8,197 %, con vencimiento el 19/10/2027 *	57	0,31
19	ICON Luxembourg S.a.r.l., 7,860 %, con vencimiento el 01/07/2028 *	19	0,10
5	Indigo Merger Sub, Inc., 7,860 %, con vencimiento el 01/07/2028 *	5	0,03
35	Jazz Financing Lux S.a.r.l., 8,447 %, con vencimiento el 05/05/2028 *	35	0,19
35	Nexstar Broadcasting Inc, 7,951 %, con vencimiento el 19/09/2026 *	35	0,19
20	Quikrete Holdings, Inc., 8,197 %, con vencimiento el 18/03/2029 *	20	0,11

^ *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 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Obligaciones de préstamo (continuación)			
60	Sotera Health, 8,197 %, con vencimiento el 13/12/2026 *	60	0,33
29	Station Casinos LLC, 7,683 %, con vencimiento el 08/02/2027 *	29	0,16
18	UFC Holdings LLC, 8,336 %, con vencimiento el 29/04/2026 *	18	0,10
68	Verscend Holding Corp., 9,447 %, con vencimiento el 27/08/2025 *	68	0,37
60	Virgin Media Bristol LLC, 7,932 %, con vencimiento el 04/01/2028 *	59	0,32
Total de obligaciones de préstamo (coste 892 $)		887	4,83
Organismos de inversión colectiva: 0,72 % (28 de febrero de 2023: 7,28 %)			
133	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	133	0,72
Total de organismos de inversión colectiva (coste 133 $)		133	0,72
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 20.190 $)		17.621	95,79

Contratos (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Opciones compradas: 0,18 % (28 de febrero de 2023: 0,11 %)			
–	CME 3 Month SOFR Futures April 2024 Put 94,75, con vencimiento el 12/04/2024 (Morgan Stanley)	1	0,01
–	CME 3 Month SOFR Futures December 2024 Put 96,00, con vencimiento el 13/12/2024 (Morgan Stanley)	18	0,10
–	U.S. 5 Años Abril 2024 Call 107,25, con vencimiento el 22/03/2024 – Morgan Stanley	1	–
–	U.S. 5 Años Abril 2024 Call 107,50, con vencimiento el 22/03/2024 – Morgan Stanley	1	0,01
–	Bono estadounidense Abril 2024 Call 120,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Morgan Stanley	2	0,01
300	USD Call/CAD Put 1,3720, con vencimiento el 22/03/2024 (BNP Paribas)	–	–
340	USD Call/CHF Put 0,8725, con vencimiento el 16/03/2024 (Goldman Sachs)	5	0,02
390	USD Call/EUR Put 1,0808, con vencimiento el 12/03/2024 (BNP Paribas)	2	0,01
326	USD Put/AUD Call 0,6686, con vencimiento el 18/04/2024 (BNP Paribas)	1	0,01
350	USD Put/JPY Call 143,42, con vencimiento el 19/04/2024 (BNP Paribas)	1	0,01
Total de opciones compradas (coste 30 $)		32	0,18
Swaps de incumplimiento de crédito: 0,56 % (28 de febrero de 2023: 0,31 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		103	0,56
Swaps sobre índices: 2,10 % (28 de febrero de 2023: 4,56 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		387	2,10
Contratos de divisas a plazo: 0,11 % (28 de febrero de 2023: 0,06 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		20	0,11
Futuros: 0,40 % (28 de febrero de 2023: 0,85 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		74	0,40
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		18.237	99,14

Contratos (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Opciones suscritas: (0,10 %) (28 de febrero de 2023: (0,21 %))			
–	CME 3 Month SOFR Futures December 2024 Call 97,1250, con vencimiento el 13/12/2024 (Morgan Stanley)	(2)	(0,01)
–	CME 3 Month SOFR Futures December 2024 Put 95,50, con vencimiento el 13/12/2024 (Morgan Stanley)	(10)	(0,06)
–	U.S. 5 Años Abril 2024 Call 108,50, con vencimiento el 22/03/2024 – Morgan Stanley	–	–
–	U.S. 5 Años Abril 2024 Put 106,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Morgan Stanley	(1)	–
–	Bono estadounidense Abril 2024 Call 121,00, con vencimiento el 22/03/2024 – Morgan Stanley	(2)	(0,01)
–	U.S. Bond April 2024 Call 122,00, con vencimiento el 22/03/2024 (Morgan Stanley)	(2)	(0,01)
(340)	USD Call/CHF Put 0,8890, con vencimiento el 16/03/2024 – Goldman Sachs	(1)	(0,01)
Total de opciones suscritas (coste (21) $)		(18)	(0,10)
Swaps de tasas de interés: (0,02 %) (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(4)	(0,02)
Contratos de divisas a plazo: (0,34 %) (28 de febrero de 2023: (0,31 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(62)	(0,34)
Futuros: (0,21 %) (28 de febrero de 2023: (0,65 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(39)	(0,21)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(123)	(0,67)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		18.114	98,47
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		282	1,53
Patrimonio		18.396 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 1.732.000 USD o el 9,42 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

± 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 29 de febrero de 2024.

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

INR – Rupia india

MXN – Peso mexicano

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	87,63
Otros valores mobiliarios negociables en otro mercado regulado	4,68
Organismos de inversión colectiva	0,70
Instrumentos financieros derivados	3,25
Otros activos	3,74
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.HY.CDSI 5 años, 5,000 % – Vender	20 de diciembre de 2028	485	$ 30
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % – Vender	20 de diciembre de 2028	3.543	73
Apreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): 57 $)				$ 103
Depreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): – $)				–
Apreciación neta de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): 57 $)				$ 103

^ *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 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

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, Receive Fixed 10,262 %	02 de enero de 2029	3.440	$ (4)
Apreciación latente de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 (en miles): – $)				$ –
Depreciación latente de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 (en miles): – $)				(4)
Depreciación neta de swaps de tipos de interés (28 de febrero de 2023 (en miles): – $)				$ (4)

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 de febrero de 2047	325	$ 112
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,600 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15 de febrero de 2048	285	52
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,050 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15 de febrero de 2048	1.466	163
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,150 %, Receive Floating USD Sofr Compound	15 de mayo de 2048	151	14
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,530 %, Receive Floating USD Sofr Compound	31 de octubre de 2030	1.773	41
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,540 %, Receive Floating USD Sofr Compound	31 de octubre de 2030	214	5
Apreciación latente de swaps sobre índices (28 de febrero de 2023 (en miles): 842 $)				$ 387
Depreciación latente de swaps sobre índices (28 de febrero de 2023 (en miles): (2) $)				–
Apreciación neta de swaps sobre índices (28 de febrero de 2023 (en miles): 840 $)				$ 387

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)
19 de abril de 2024	BNP Paribas	Compra	USD	407	Venta	EUR	371		$ 5
19 de abril de 2024	BNP Paribas	Compra	NOK	1.919	Venta	EUR	169		(3)
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	67	Venta	CAD	90		1
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	148	Venta	CHF	130		–
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	87	Venta	EUR	80		–
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	28	Venta	IDR	439.678		–
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	81	Venta	MXN	1.400		–
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	CHF	80	Venta	USD	91		–
19 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	EUR	4	Venta	USD	4		–
19 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	USD	439	Venta	CNH	3.125		4
19 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	USD	182	Venta	MXN	3.140		–
19 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	IDR	439.327	Venta	USD	29		(1)
19 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	MXN	1.778	Venta	USD	103		–
19 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	349	Venta	GBP	274		4
19 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	204	Venta	JPY	29.420		6
19 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	JPY	37.712	Venta	USD	253		–
19 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	CAD	544	Venta	USD	406		(5)
19 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	JPY	119.578	Venta	USD	838		(34)
19 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	AUD	971	Venta	USD	652		(19)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 11 $)									$ 20
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (58) $)									(62)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (47) $)									$ (42)

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)	$ (9.465)	$ 37
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2024	Morgan Stanley	24	5.730	(21)
Índice SOFR de 3 meses Diciembre 2025	Morgan Stanley	27	6.499	14
Índice SOFR de 3 meses Marzo 2024	Morgan Stanley	(9)	(2.130)	(2)
Índice SOFR de 3 meses Marzo 2025	Morgan Stanley	2	479	1
Dólar australiano Divisa Marzo 2024	Morgan Stanley	3	195	(3)
Euro-Bund marzo 2024	Morgan Stanley	(3)	(430)	2
Bonos Euro-Buxl a 30 años marzo de 2024	Morgan Stanley	(1)	(144)	(2)
Euro-OAT marzo 2024	Morgan Stanley	2	276	–
Long Gilt junio 2024	Morgan Stanley	2	248	2
U.S. 10 Year Note (CBT) junio de 2024	Morgan Stanley	25	2.761	6
U.S. 10 Year Ultra Note junio 2024	Morgan Stanley	(7)	(799)	(3)
U.S. 2 Year Note (CBT) junio de 2024	Morgan Stanley	(24)	(4.914)	(3)
U.S. 5 Year Note (CBT) junio de 2024	Morgan Stanley	69	7.377	7
U.S. Long Bond (CBT) junio 2024	Morgan Stanley	(11)	(1.312)	(5)
U.S. Ultra Bond (CBT) junio 2024	Morgan Stanley	4	511	5
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 156 $)				$ 74
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (120) $)				(39)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 36 $)				$ 35

^ *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 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos: 13,30 % (28 de febrero de 2023: 14,55 %)			
Alemania: 2,94 % (28 de febrero de 2023: 5,33 %)			
4.250	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 5,125 %, con vencimiento el 29/09/2025	4.266	2,94
Supranacional: 10,36 % (28 de febrero de 2023: 9,22 %)			
7.300	International Bank for Reconstruction & Development, 2,500 %, con vencimiento el 25/11/2024	7.155	4,93
ZAR 49.800	International Bank for Reconstruction & Development, 6,500 %, con vencimiento el 21/01/2027	2.465	1,70
MXN 51.300	International Bank for Reconstruction & Development, 7,250 %, con vencimiento el 21/01/2027	2.846	1,96
BRL 12.600	International Bank for Reconstruction & Development, 9,500 %, con vencimiento el 09/02/2029	2.558	1,77
		15.024	10,36
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 18.977 $)		19.290	13,30
Bonos y obligaciones del Estado: 85,07 % (28 de febrero de 2023: 84,35 %)			
Australia: 4,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
AUD 8.950	Bono del Estado de Australia, Serie 137, 2,750 %, con vencimiento el 21/04/2024	5.806	4,00
Brasil: 5,31 % (28 de febrero de 2023: 4,34 %)			
BRL 38.410	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2025	7.709	5,31
Chile: 3,21 % (28 de febrero de 2023: 0,87 %)			
4.813	Bono Internacional del Estado de Chile, 4,950 %, con vencimiento el 05/01/2036	4.653	3,21
Colombia: 4,45 % (28 de febrero de 2023: 4,89 %)			
COP 28.320.000	Colombian TES, Serie B, 9,250 %, con vencimiento el 28/05/2042	6.454	4,45
Alemania: 4,06 % (28 de febrero de 2023: 5,44 %)			
EUR 5.480	Bono del Tesoro alemán, cupón cero, con vencimiento el 17/04/2024	5.896	4,06
México: 9,02 % (28 de febrero de 2023: 13,18 %)			
MXN 106.000	Mexican Bonos, Serie MS, 8,000 %, con vencimiento el 24/05/2035	5.693	3,92
MXN 60.000	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, con vencimiento el 13/11/2042	3.044	2,10
MXN 42.000	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, con vencimiento el 07/11/2047	2.160	1,49
MXN 43.000	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, con vencimiento el 31/07/2053	2.184	1,51
		13.081	9,02
Nueva Zelanda: 1,37 % (28 de febrero de 2023: 1,27 %)			
NZD 2.370	Bono del Estado de Nueva Zelanda, Serie 0534, 4,250 %, con vencimiento el 15/05/2034	1.386	0,95
NZD 1.480	Bono del Estado de Nueva Zelanda, Serie 0551, 2,750 %, con vencimiento el 15/05/2051	608	0,42
		1.994	1,37
Noruega: 3,90 % (28 de febrero de 2023: 3,78 %)			
NOK 60.200	Bono del Estado de Noruega, Serie 476, 144A, 3,000 %, con vencimiento el 14/03/2024	5.664	3,90
Sudáfrica: 3,27 % (28 de febrero de 2023: 4,06 %)			
ZAR 56.100	Bono del Estado de la República de Sudáfrica, Serie R214, 6,500 %, con vencimiento el 28/02/2041	1.739	1,20
ZAR 79.600	Bono del Estado de la República de Sudáfrica, Serie 2048, 8,750 %, con vencimiento el 28/02/2048	2.999	2,07
		4.738	3,27
Reino Unido: 6,64 % (28 de febrero de 2023: 4,35 %)			
GBP 15.570	United Kingdom Gilt, 1,250 %, con vencimiento el 31/07/2051	9.634	6,64
Estados Unidos: 39,84 % (28 de febrero de 2023: 29,58 %)			
8.750	Obligación de Tasa Flotante del Tesoro de los Estados Unidos – Cuando se emite, 5,501 %, con vencimiento el 31/10/2025 *	8.749	6,03
31.400	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2033	29.625	20,42
5.580	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, con vencimiento el 15/02/2052	3.652	2,52
11.640	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, con vencimiento el 15/08/2052	9.001	6,20
7.070	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2053	6.771	4,67
		57.798	39,84
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 129.624 $)		123.427	85,07
Organismos de inversión colectiva: 1,79 % (28 de febrero de 2023: 2,53 %)			
2.596	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	2.596	1,79
Total de organismos de inversión colectiva (coste 2.596 $)		2.596	1,79
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 151.197 $)		145.313	100,16
Contratos de divisas a plazo: 0,59 % (28 de febrero de 2023: 1,94 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		855	0,59
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		146.168	100,75
Contratos de divisas a plazo: (1,62 %) (28 de febrero de 2023: (2,45 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(2.346)	(1,62)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(2.346)	(1,62)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		143.822	99,13
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		1.263	0,87
Patrimonio		145.085 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 5.664.000 USD o el 3,90 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

ABREVIATURAS:

AUD – Dólar australiano
BRL – Real brasileño
COP – Peso colombiano
EUR – Euro
GBP – Libra esterlina
MXN – Peso mexicano
NOK – Corona noruega
NZD – Dólar neozelandés
ZAR – Rand sudafricano

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	96,25
Organismos de inversión colectiva	1,75
Instrumentos financieros derivados	0,58
Otros activos	1,42
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)
06 de marzo de 2024	Barclays	Compra	AUD	2.240	Venta	USD	1.477	$	(21)
06 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	7.412	Venta	AUD	11.420		(13)
06 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	AUD	7.220	Venta	USD	4.817		(123)
06 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	1.481	Venta	AUD	2.260		12
06 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	AUD	4.220	Venta	USD	2.839		(95)
08 de marzo de 2024	Citi	Compra	USD	4.737	Venta	GBP	3.780		(35)
08 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	4.738	Venta	GBP	3.750		4
08 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	GBP	1.430	Venta	USD	1.806		(1)
11 de marzo de 2024	Barclays	Compra	INR	273.900	Venta	USD	3.276		26
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	395	Venta	AUD	605		1
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	AUD	–		–

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Calendario 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 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	–	Venta	AUD	–	$ –
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	300	Venta	AUD	493	3
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	69	Venta	AUD	133	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	103	Venta	CAD	175	1
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	CAD	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	1	Venta	CAD	2	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	444	Venta	CAD	643	4
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	584	Venta	CAD	789	2
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	424	Venta	CNY	3.813	4
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	2.416	Venta	CNY	17.200	13
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	CNY	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	–	Venta	CNY	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	1.834	Venta	CNY	14.058	20
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	78	Venta	DKK	542	(1)
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	59	Venta	DKK	432	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	1	Venta	DKK	13	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	13	Venta	DKK	119	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	DKK	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	ILS	5	Venta	EUR	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	–	Venta	EUR	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	PLN	8	Venta	EUR	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SEK	6	Venta	EUR	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	1.656	Venta	EUR	1.935	(3)
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	–	Venta	EUR	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NOK	–	Venta	EUR	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	DKK	2	Venta	EUR	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	DKK	7	Venta	EUR	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	JPY	4.451	Venta	EUR	30	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	3	Venta	EUR	4	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SEK	5	Venta	EUR	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	MXN	53	Venta	EUR	1	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	131	Venta	EUR	122	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CAD	1	Venta	EUR	1	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	MXN	22	Venta	EUR	1	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CAD	12	Venta	EUR	8	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	JPY	5.257	Venta	EUR	32	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	11	Venta	EUR	8	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CNY	307	Venta	EUR	39	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CNY	–	Venta	EUR	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	PLN	3	Venta	EUR	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	–	Venta	EUR	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	–	Venta	EUR	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	9.426	Venta	EUR	8.763	(49)
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NOK	9	Venta	EUR	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	–	Venta	EUR	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	1.216	Venta	GBP	1.041	1
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	JPY	1.012	Venta	GBP	4	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	1.608	Venta	GBP	1.279	(6)
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	28	Venta	GBP	21	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	PLN	1	Venta	GBP	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NOK	3	Venta	GBP	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NOK	–	Venta	GBP	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	JPY	3.489	Venta	GBP	20	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	MXN	10	Venta	GBP	1	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	1	Venta	GBP	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	–	Venta	GBP	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	ILS	2	Venta	GBP	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CNY	–	Venta	GBP	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	3	Venta	GBP	2	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CAD	6	Venta	GBP	3	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CAD	–	Venta	GBP	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	DKK	3	Venta	GBP	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	MXN	26	Venta	GBP	1	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CNY	142	Venta	GBP	15	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	13	Venta	GBP	11	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	–	Venta	GBP	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SEK	–	Venta	GBP	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SEK	3	Venta	GBP	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	PLN	3	Venta	GBP	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	DKK	–	Venta	GBP	–	–

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Calendario 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 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	–	Venta	GBP	–	$ –
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	–	Venta	GBP	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	–	Venta	ILS	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	16	Venta	ILS	76	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	95	Venta	ILS	345	(2)
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	72	Venta	ILS	282	(1)
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	ILS	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	3.665	Venta	JPY	539.890	57
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	2.773	Venta	JPY	439.618	60
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	10	Venta	JPY	1.704	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	643	Venta	JPY	119.158	15
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	1	Venta	JPY	248	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	248	Venta	MXN	4.248	(1)
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	9	Venta	MXN	185	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	43	Venta	MXN	938	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	MXN	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	179	Venta	MXN	3.286	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	39	Venta	NOK	454	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	52	Venta	NOK	555	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	9	Venta	NOK	121	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	12	Venta	NZD	24	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	–	Venta	NZD	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	NZD	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	69	Venta	NZD	113	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	53	Venta	NZD	92	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	27	Venta	PLN	137	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	3	Venta	PLN	11	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	114	Venta	PLN	496	(1)
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	153	Venta	PLN	621	(2)
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	PLN	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	SEK	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	59	Venta	SEK	619	(1)
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	11	Venta	SEK	137	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	–	Venta	SEK	2	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	45	Venta	SEK	503	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	117	Venta	SGD	158	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	89	Venta	SGD	129	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	SGD	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	–	Venta	SGD	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	21	Venta	SGD	36	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	10.357	Venta	USD	11.143	55
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	40	Venta	USD	44	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	13	Venta	USD	14	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	2.397	Venta	USD	3.014	11
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	4	Venta	EUR	4	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	85	Venta	EUR	79	(1)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	24	Venta	GBP	19	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	64	Venta	GBP	53	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	90	Venta	USD	113	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	4	Venta	USD	4	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	268	Venta	USD	175	(1)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	8.130	Venta	USD	10.226	37
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	1.881	Venta	USD	2.024	11
15 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	6.315	Venta	JPY	900.000	297
15 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	JPY	4.066.000	Venta	USD	28.536	(1.349)
15 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	JPY	26.000	Venta	USD	175	(1)
19 de marzo de 2024	Citi	Compra	USD	257	Venta	NOK	2.700	3
19 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	NOK	31.000	Venta	USD	2.965	(44)
19 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	603	Venta	NOK	6.300	10
19 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	NOK	31.000	Venta	USD	3.016	(96)
11 de abril de 2024	HSBC	Compra	NOK	7.700	Venta	USD	749	(24)
11 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	726	Venta	NOK	7.700	–
12 de abril de 2024	Barclays	Compra	USD	2.083	Venta	NZD	3.410	7
12 de abril de 2024	Barclays	Compra	NZD	770	Venta	USD	480	(11)
16 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	5.822	Venta	MYR	27.800	(40)
16 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	MYR	27.800	Venta	USD	6.015	(153)
19 de abril de 2024	HSBC	Compra	USD	6.380	Venta	BRL	31.260	124
25 de abril de 2024	Citi	Compra	CAD	850	Venta	USD	630	(3)
26 de abril de 2024	Citi	Compra	KRW	11.400.000	Venta	USD	8.606	(41)
29 de abril de 2024	Citi	Compra	USD	7.060	Venta	MXN	123.100	(91)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Calendario 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)
29 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	MXN	4.700	Venta	USD	272	$	1
30 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	USD	1.214	Venta	COP	4.880.000		(17)
02 de mayo de 2024	Morgan Stanley	Compra	HUF	1.160.000	Venta	USD	3.250		(72)
07 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	EUR	14.130	Venta	USD	15.361		(45)
07 de mayo de 2024	Morgan Stanley	Compra	EUR	1.260	Venta	USD	1.364		2
15 de mayo de 2024	HSBC	Compra	USD	7.142	Venta	ZAR	136.700		62
28 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	CNH	19.270	Venta	USD	2.692		(2)
06 de junio de 2024	JP Morgan	Compra	AUD	11.420	Venta	USD	7.434		12
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 3.132 $)								$	855
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (3.966) $)									(2.346)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (834) $)								$	(1.491)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas: 23,66 % (28 de febrero de 2023: 21,89 %)			
1.304	Fannie Mae Pool 'MA4785', 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2052	1.266	0,86
2.366	Fannie Mae Pool 'MA4841', 5,000 %, con vencimiento el 01/12/2052	2.298	1,57
2.477	Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	2.457	1,68
891	Freddie Mac Pool 'RA7790', 5,000 %, con vencimiento el 01/08/2052	865	0,59
2.743	Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	2.598	1,78
1.956	Freddie Mac Pool 'SD8257', 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2052	1.853	1,27
1.195	Freddie Mac Pool 'SD8267', 5,000 %, con vencimiento el 01/11/2052	1.160	0,79
3.645	Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	3.615	2,47
1.454	Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500 %, con vencimiento el 20/02/2053	1.446	0,99
2.587	Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2053	2.572	1,76
4.628	Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, con vencimiento el 20/05/2053	4.602	3,15
1.627	Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000 %, con vencimiento el 20/06/2053	1.590	1,09
2.226	Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500 %, con vencimiento el 20/06/2053	2.213	1,51
1.716	Ginnie Mae II Pool 'MA9106', 5,500 %, con vencimiento el 20/08/2053	1.705	1,16
4.398	Ginnie Mae II Pool 'MA9171', 5,500 %, con vencimiento el 20/09/2053	4.372	2,99
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 35.020 $)		34.612	23,66
Bonos y obligaciones corporativos: 7,72 % (28 de febrero de 2023: 7,26 %)			
Australia: 2,21 % (28 de febrero de 2023: 4,87 %)			
3.220	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 6,094 %, con vencimiento el 14/03/2025 *	3.235	2,21
México: 1,01 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
2.320	Petroleos Mexicanos, 6,950 %, con vencimiento el 28/01/2060	1.480	1,01
Estados Unidos: 4,50 % (28 de febrero de 2023: 2,39 %)			
2.880	General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, con vencimiento el 06/04/2026	2.882	1,97
1.015	Jabil Inc, 3,000 %, con vencimiento el 15/01/2031	868	0,60
2.850	Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, con vencimiento el 18/05/2026	2.821	1,93
		6.571	4,50
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 11.422 $)		11.286	7,72
Bonos y obligaciones del Estado: 63,28 % (28 de febrero de 2023: 65,08 %)			
Brasil: 3,61 % (28 de febrero de 2023: 7,30 %)			
BRL 27.300	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2033	5.284	3,61
Colombia: 6,98 % (28 de febrero de 2023: 5,75 %)			
COP 16.800.000	Colombian TES, Serie B, 9,250 %, con vencimiento el 28/05/2042	3.829	2,62
COP 35.300.000	Colombian TES, Series B, 7,250 %, con vencimiento el 26/10/2050	6.388	4,36
		10.217	6,98
México: 6,01 % (28 de febrero de 2023: 5,75 %)			
MXN 48.900	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, con vencimiento el 07/11/2047	2.514	1,72
MXN 123.500	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, con vencimiento el 31/07/2053	6.273	4,29
		8.787	6,01
Nueva Zelanda: 2,59 % (28 de febrero de 2023: 2,68 %)			
NZD 9.210	Bono del Estado de Nueva Zelanda, Serie 0551, 2,750 %, con vencimiento el 15/05/2051	3.784	2,59
Sudáfrica: 3,55 % (28 de febrero de 2023: 2,91 %)			
ZAR 137.800	Bono del Estado de la República de Sudáfrica, Serie 2048, 8,750 %, con vencimiento el 28/02/2048	5.192	3,55
Reino Unido: 2,37 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
GBP 5.600	United Kingdom Gilt, 1,250 %, con vencimiento el 31/07/2051	3.465	2,37
Estados Unidos: 38,17 % (28 de febrero de 2023: 32,72 %)			
23.090	Obligación de Tasa Flotante del Tesoro de los Estados Unidos – Cuando se emite, 5,418 %, con vencimiento el 30/04/2025 *	23.103	15,80
36.650	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 2,750 %, con vencimiento el 15/08/2032	32.727	22,37
		55.830	38,17
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 93.044 $)		92.559	63,28
Organismos de inversión colectiva: 5,53 % (28 de febrero de 2023: 5,67 %)			
8.090	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	8.090	5,53
Total de organismos de inversión colectiva (coste 8.090 $)		8.090	5,53
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 147.576 $)		146.547	100,19
Contratos de divisas a plazo: 2,08 % (28 de febrero de 2023: 2,41 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		3.036	2,08
Futuros: 0,17 % (28 de febrero de 2023: 0,41 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		256	0,17
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		149.839	102,44
Contratos de divisas a plazo: (2,69 %) (28 de febrero de 2023: (4,38 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(3.927)	(2,69)
Futuros: (0,03 %) (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(51)	(0,03)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(3.978)	(2,72)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		145.861	99,72
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		408	0,28
Patrimonio		146.269 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 3.235.000 $ o el 2,21 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

ABREVIATURAS:

BRL – Real brasileño
COP – Peso colombiano
GBP – Libra esterlina
MXN – Peso mexicano
NZD – Dólar neozelandés
ZAR – Rand sudafricano

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	89,00
Organismos de inversión colectiva	5,20
Instrumentos financieros derivados	2,12
Otros activos	3,68
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)
06 de marzo de 2024	Barclays	Compra	AUD	14.710	Venta	USD	9.839	$ (276)
06 de marzo de 2024	Citi	Compra	USD	2.110	Venta	AUD	3.150	62
06 de marzo de 2024	Citi	Compra	AUD	4.990	Venta	USD	3.342	(98)
06 de marzo de 2024	HSBC	Compra	USD	802	Venta	AUD	1.220	9
06 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	27.440	Venta	AUD	42.280	(48)
06 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	AUD	23.090	Venta	USD	15.334	(323)

^ *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 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Calendario 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)
06 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	1.629	Venta	AUD	2.470	$	24
06 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	AUD	6.330	Venta	USD	4.178		(62)
08 de marzo de 2024	HSBC	Compra	USD	557	Venta	GBP	440		2
08 de marzo de 2024	HSBC	Compra	GBP	640	Venta	USD	812		(4)
08 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	4.877	Venta	GBP	3.860		4
08 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	GBP	550	Venta	USD	700		(5)
08 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	GBP	650	Venta	USD	819		2
11 de marzo de 2024	Barclays	Compra	USD	2.042	Venta	INR	170.000		(7)
11 de marzo de 2024	Barclays	Compra	INR	680.000	Venta	USD	8.197		–
11 de marzo de 2024	Barclays	Compra	INR	100.000	Venta	USD	1.201		4
12 de marzo de 2024	Barclays	Compra	USD	489	Venta	CHF	430		2
12 de marzo de 2024	Barclays	Compra	CHF	9.870	Venta	USD	11.607		(431)
12 de marzo de 2024	Citi	Compra	CHF	4.330	Venta	USD	5.007		(104)
12 de marzo de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	48.898	Venta	CHF	42.360		934
12 de marzo de 2024	Goldman Sachs	Compra	CHF	13.640	Venta	USD	15.671		(227)
12 de marzo de 2024	HSBC	Compra	CHF	380	Venta	USD	432		(2)
12 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	5.966	Venta	CHF	5.100		192
13 de marzo de 2024	Citi	Compra	USD	2.026	Venta	KRW	2.700.000		–
13 de marzo de 2024	Citi	Compra	KRW	10.680.000	Venta	USD	8.168		(150)
13 de marzo de 2024	Citi	Compra	KRW	1.700.000	Venta	USD	1.276		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	21	Venta	EUR	19		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	4.523	Venta	EUR	4.166		16
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	–	Venta	GBP	–		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	7.139	Venta	USD	7.681		40
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	11.735	Venta	USD	14.761		54
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	30	Venta	USD	38		–
15 de marzo de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	5.855	Venta	JPY	830.000		305
15 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	9.699	Venta	JPY	1.378.000		485
15 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	JPY	2.208.000	Venta	USD	15.496		(733)
15 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	JPY	1.070.000	Venta	USD	7.346		(192)
19 de marzo de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	5.786	Venta	NOK	61.220		19
19 de marzo de 2024	Goldman Sachs	Compra	NOK	60.700	Venta	USD	5.924		(206)
19 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	NOK	62.400	Venta	USD	5.967		(89)
19 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	6.559	Venta	NOK	68.800		78
19 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	NOK	43.500	Venta	USD	4.168		(71)
19 de marzo de 2024	UBS	Compra	USD	266	Venta	NOK	2.800		2
22 de marzo de 2024	Barclays	Compra	USD	9.550	Venta	SEK	98.000		87
22 de marzo de 2024	Goldman Sachs	Compra	SEK	76.800	Venta	USD	7.354		61
22 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	1.308	Venta	SEK	13.600		(5)
22 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	SEK	13.500	Venta	USD	1.321		(17)
22 de marzo de 2024	UBS	Compra	SEK	21.300	Venta	USD	2.038		19
12 de abril de 2024	Barclays	Compra	USD	26.321	Venta	NZD	42.400		505
12 de abril de 2024	Citi	Compra	USD	3.293	Venta	NZD	5.350		36
12 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	167	Venta	NZD	270		2
12 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	NZD	5.350	Venta	USD	3.313		(56)
12 de abril de 2024	Standard Chartered Bank	Compra	NZD	480	Venta	USD	292		–
12 de abril de 2024	UBS	Compra	NZD	550	Venta	USD	339		(4)
18 de abril de 2024	Barclays	Compra	NOK	2.400	Venta	USD	229		(2)
18 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	NOK	148.900	Venta	USD	14.538		(501)
18 de abril de 2024	UBS	Compra	USD	7.319	Venta	NOK	78.200		(52)
19 de abril de 2024	HSBC	Compra	USD	221	Venta	BRL	1.100		1
19 de abril de 2024	HSBC	Compra	BRL	5.980	Venta	USD	1.221		(24)
02 de mayo de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	2.793	Venta	HUF	1.020.000		(1)
02 de mayo de 2024	Morgan Stanley	Compra	HUF	1.020.000	Venta	USD	2.858		(63)
07 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	EUR	5.450	Venta	USD	5.939		(31)
13 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	HUF	60.000	Venta	USD	166		(2)
13 de mayo de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	2.436	Venta	HUF	890.000		(2)
13 de mayo de 2024	Morgan Stanley	Compra	HUF	3.460.000	Venta	USD	9.531		(56)
15 de mayo de 2024	HSBC	Compra	USD	5.392	Venta	ZAR	103.200		47
15 de mayo de 2024	Morgan Stanley	Compra	ZAR	3.000	Venta	USD	154		1
17 de mayo de 2024	HSBC	Compra	USD	2.660	Venta	CLP	2.640.000		(66)
17 de mayo de 2024	HSBC	Compra	CLP	7.040.000	Venta	USD	7.284		(17)
06 de junio de 2024	JP Morgan	Compra	AUD	41.570	Venta	USD	27.059		43
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 13.024 $)								$	3.036
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (23.627) $)									(3.927)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (10.603) $)								$	(891)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
Euro-OAT marzo 2024	Morgan Stanley	(135)	$ (18.631)	$ 256
Bono a 10 años de Japón (OSE) marzo 2024	Morgan Stanley	(32)	(31.219)	(51)
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 2.190 $)				$ 256
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): – $)				(51)
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 2.190 $)				$ 205

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global High Yield Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos: 94,58 % (28 de febrero de 2023: 95,87 %)			
Australia: 0,51 % (28 de febrero de 2023: 0,37 %)			
150	Mineral Resources Ltd, 144A, 9,250 %, con vencimiento el 01/10/2028	158	0,51
Brasil: 1,77 % (28 de febrero de 2023: 2,19 %)			
350	Braskem Netherlands Finance BV, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 10/01/2028	308	0,99
300	CSN Resources SA, 4,625 %, con vencimiento el 10/06/2031	242	0,78
		550	1,77
Canadá: 6,77 % (28 de febrero de 2023: 3,28 %)			
311	Air Canada 2020-2 Clase A Pass Through Trust, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 01/04/2029	306	0,98
250	Athabasca Oil Corp, 144A, 9,750 %, con vencimiento el 01/11/2026	264	0,85
485	Baytex Energy Corp, 144A, 8,750 %, con vencimiento el 01/04/2027	503	1,62
375	Greenfire Resources Ltd, 144A, 12,000 %, con vencimiento el 01/10/2028	393	1,26
440	Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2026	434	1,39
220	Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/04/2029	209	0,67
		2.109	6,77
República Checa: 1,90 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
575	Allwyn Entertainment Financing UK Plc, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 30/04/2029	593	1,90
Finlandia: 1,66 % (28 de febrero de 2023: 0,28 %)			
537	Nokia Oyj, 6,625 %, con vencimiento el 15/05/2039	519	1,66
Francia: 2,14 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
EUR 450	Altice France SA/France, 5,875 %, con vencimiento el 01/02/2027	440	1,41
235	Societe Generale SA, 144A, 7,132 %, con vencimiento el 19/01/2055 *	228	0,73
		668	2,14
Israel: 5,20 % (28 de febrero de 2023: 3,42 %)			
400	Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 30/03/2026	376	1,21
150	Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 30/03/2028	135	0,43
150	Energean Israel Finance Ltd, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 30/09/2033	145	0,47
150	Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 30/06/2025	147	0,47
239	Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 30/06/2030	219	0,70
600	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,000 %, con vencimiento el 15/04/2024	600	1,92
		1.622	5,20
Italia: 0,34 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
EUR 100	Itelyum Regeneration Spa, 4,625 %, con vencimiento el 01/10/2026	106	0,34
México: 2,77 % (28 de febrero de 2023: 1,49 %)			
370	Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, con vencimiento el 15/11/2029	280	0,90
450	Petroleos Mexicanos, 5,950 %, con vencimiento el 28/01/2031	349	1,12
290	Petroleos Mexicanos, 6,700 %, con vencimiento el 16/02/2032	234	0,75
		863	2,77
Reino Unido: 4,94 % (28 de febrero de 2023: 2,55 %)			
EUR 450	Ardonagh Finco Ltd, 6,875 %, con vencimiento el 15/02/2031	483	1,55
176	British Airways 2019-1 Clase AA Pass Through Trust, 144A, 3,300 %, con vencimiento el 15/12/2032	158	0,51
61	British Airways 2020-1 Clase A Pass Through Trust, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 15/11/2032	57	0,18
160	Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 6,750 %, con vencimiento el 01/10/2026	157	0,50
EUR 100	eG Global Finance Plc, 11,000 %, con vencimiento el 30/11/2028	113	0,36
350	eG Global Finance Plc, 144A, 12,000 %, con vencimiento el 30/11/2028	370	1,19
200	Howden UK Refinance Plc / Howden UK Refinance 2 Plc / Howden US Refinance LLC, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 15/02/2032	201	0,65
		1.539	4,94
Estados Unidos: 66,58 % (28 de febrero de 2023: 77,01 %)			
650	Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/12/2027	600	1,93
550	Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 15/08/2027	536	1,72
55	AmeriTex HoldCo Intermediate LLC, 144A, 10,250 %, con vencimiento el 15/10/2028	58	0,18
360	ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2028	310	0,99
250	Arko Corp, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 15/11/2029	217	0,70
250	Brundage-Bone Concrete Bomping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 01/02/2026	247	0,79
385	Burford Capital Finance LLC, 6,125 %, con vencimiento el 12/08/2025	380	1,22
420	Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/04/2030	403	1,29
75	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, con vencimiento el 23/10/2045	69	0,22
505	Cimarex Energy Co, 3,900 %, con vencimiento el 15/05/2027	448	1,44
355	Cimarex Energy Co, 4,375 %, con vencimiento el 15/03/2029	326	1,05
100	Concentrix Corp, 6,850 %, con vencimiento el 02/08/2033	98	0,31
400	Credit Acceptance Corp, 144A, 9,250 %, con vencimiento el 15/12/2028	424	1,36
300	Delta Air Lines Inc, 2,900 %, con vencimiento el 28/10/2024	294	0,94
450	Embecta Corp, 144A, 5,00 %, con vencimiento el 15/02/2030	359	1,15
250	Enova International Inc, 144A, 11,250 %, con vencimiento el 15/12/2028	262	0,84
325	FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 01/01/2030	308	0,99
GBP 250	Ford Motor Credit Co LLC, 2,748 %, con vencimiento el 14/06/2024	313	1,00
250	Ford Motor Credit Co LLC, 4,063 %, con vencimiento el 01/11/2024	247	0,79
350	Freedom Mortgage Corp, 144A, 6,625 %, con vencimiento el 15/01/2027	334	1,07
250	Gap Inc/The, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 01/10/2031	202	0,65
145	General Motors Financial Co Inc, 3,950 %, con vencimiento el 13/04/2024	145	0,46
395	GrubHub Holdings Inc, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 01/07/2027	345	1,11
145	Hercules LLC, 6,500 %, con vencimiento el 30/06/2029	142	0,46
270	Home BancShares Inc/AR, 3,125 %, con vencimiento el 30/01/2032 *	207	0,67
453	IRB Holding Corp, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/06/2025	454	1,46
350	Jefferson Capital Holdings LLC, 144A, 9,500 %, con vencimiento el 15/02/2029	354	1,14
210	Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, con vencimiento el 08/08/2024	207	0,67
125	Liberty Interactive LLC, 8,500 %, con vencimiento el 15/07/2029	83	0,26
150	Liberty Interactive LLC, 8,250 %, con vencimiento el 01/02/2030	98	0,31
400	Lindblad Expeditions LLC, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 15/02/2027	402	1,29
410	Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 01/10/2026	397	1,28
175	Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 01/05/2029	161	0,52
100	National Health Investors Inc, 3,000 %, con vencimiento el 01/02/2031	80	0,26
150	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 30/09/2026	145	0,47
175	New York Community Bancorp Inc, 8,332 %, con vencimiento el 06/11/2028 *	146	0,47
175	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 15/02/2028	169	0,54
300	PRA Group Inc, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2029	252	0,81
275	PROG Holdings Inc, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 15/11/2029	253	0,81
475	QVC Inc, 4,375 %, con vencimiento el 01/09/2028	390	1,25
175	Radian Group Inc, 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2024	173	0,56
255	Regency Centers LP, 3,750 %, con vencimiento el 15/06/2024	253	0,81
95	Rocket Mortgage LLC, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 15/01/2028	92	0,29
600	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 11,625 %, con vencimiento el 15/08/2027	649	2,08
440	Sabre GLBL Inc, 144A, 9,250 %, con vencimiento el 15/04/2025	413	1,33
150	Sabre GLBL Inc, 144A, 7,375 %, con vencimiento el 01/09/2025	141	0,45
480	Sabre GLBL Inc, 144A, 8,625 %, con vencimiento el 01/06/2027	423	1,36

^ *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 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
450	Sitio Royalties Operating Partnership LP / Sitio Finance Corp, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 01/11/2028	460	1,48
50	Solaris Midstream Holdings LLC, 144A, 7,625 %, con vencimiento el 01/04/2026	50	0,16
EUR 300	Standard Industries Inc/NJ, 2,250 %, con vencimiento el 21/11/2026	304	0,98
376	Synchrony Financial, 4,375 %, con vencimiento el 19/03/2024	376	1,21
55	Synchrony Financial, 7,250 %, 02/02/2033	53	0,17
95	Texas Capital Bancshares Inc, 4,000 %, con vencimiento el 06/05/2031 *	81	0,26
500	TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/03/2026	500	1,60
250	Transocean Titan Financing Ltd, 144A, 8,375 %, con vencimiento el 01/02/2028	257	0,82
350	TripAdvisor Inc, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/07/2025	351	1,13
324	Turning Point Brands Inc, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 15/02/2026	318	1,02
205	Uber Technologies Inc, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 01/11/2026	209	0,67
275	United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/04/2029	257	0,82
1.122	Valvoline Inc, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 15/02/2030	1.116	3,58
700	Vector Group Ltd, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 01/11/2026	705	2,26
805	Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 01/02/2029	738	2,37
450	Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 01/06/2028	457	1,47
300	Viking Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/05/2025	300	0,96
450	Viking Cruises Ltd, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2029	450	1,44
674	Walgreens Boots Alliance Inc, 3,800 %, con vencimiento el 18/11/2024	665	2,13
100	World Acceptance Corp, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 01/11/2026	93	0,30
		20.749	66,58
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 28.833 $)		29.476	94,58
Bonos y obligaciones del Estado: 0,85 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Paraguay: 0,85 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
EUR 300	Bono Internacional del Estado de Egipto, 5,625 %, con vencimiento el 16/04/2030	265	0,85
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 214 $)		265	0,85
Organismos de inversión colectiva: 2,30 % (28 de febrero de 2023: 3,81 %)			
718	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	718	2,30
Total de organismos de inversión colectiva (coste 718 $)		718	2,30

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Acciones preferentes: 0,25 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Estados Unidos: 0,25 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
2	BrightSpring Health Services Inc	76	0,25
Total de acciones preferentes (coste 100 $)		76	0,25
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 29.865 $)		30.535	97,98
Contratos de divisas a plazo: 0,12 % (28 de febrero de 2023: 0,10 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		38	0,12
Futuros: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,01 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		1	–
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		30.574	98,10
Contratos de divisas a plazo: (0,23 %) (28 de febrero de 2023: (1,94 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(71)	(0,23)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(71)	(0,23)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		30.503	97,87
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		661	2,13
Patrimonio		31.164 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 20.655.000 USD o el 66,29 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

ABREVIATURAS:

EUR – Euro

GBP – Libra esterlina

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	94,24
Organismos de inversión colectiva	2,27
Instrumentos financieros derivados	0,12
Otros activos	3,37
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)
08 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	GBP	180	Venta	USD	227	$ –
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CAD	1	Venta	CHF	1	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	1	Venta	CHF	1	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	CHF	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CAD	2.672	Venta	EUR	1.838	(18)
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	11	Venta	EUR	13	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CAD	294	Venta	GBP	173	(2)
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	161	Venta	GBP	137	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	2	Venta	SEK	19	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CAD	3	Venta	SEK	24	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	SEK	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CAD	12.203	Venta	USD	9.028	(35)
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	50	Venta	USD	63	1
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	6.671	Venta	USD	7.176	37
07 de mayo de 2024	Barclays	Compra	USD	162	Venta	EUR	150	–
07 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	433	Venta	EUR	400	(1)
07 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	EUR	4.250	Venta	USD	4.620	(13)
07 de mayo de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	226	Venta	EUR	210	(2)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 10 $)								$ 38
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (202) $)								(71)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (192) $)								$ (33)

^ *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 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Listado de contratos de futuros

	Contraparte	Valor nominal	Valor teórico (en miles)	Apreciación/ (Depreciación) latente de contratos (en miles)
U.S. 10 Year Note (CBT) junio de 2024	Citi	26	$ 2.871	$ 1
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 2 $)				$ 1
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): – $)				–
Apreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): 2 $)				$ 1

^ *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 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas: 13,23 % (28 de febrero de 2023: 13,19 %)			
987	Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	935	0,45
1.501	Fannie Mae Pool 'MA4785', 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2052	1.458	0,70
3.217	Fannie Mae Pool 'MA4841', 5,000 %, con vencimiento el 01/12/2052	3.124	1,51
3.606	Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	3.576	1,73
1.461	Freddie Mac Pool 'RA7790', 5,000 %, con vencimiento el 01/08/2052	1.418	0,68
1.819	Freddie Mac Pool 'SD8257', 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2052	1.723	0,83
1.792	Freddie Mac Pool 'SD8267', 5,000 %, con vencimiento el 01/11/2052	1.740	0,84
4.356	Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	4.320	2,08
8.798	Ginnie Mae II Pool 'MA8348', 5,000 %, con vencimiento el 20/10/2052	8.611	4,15
533	Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, con vencimiento el 20/05/2053	530	0,26
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 27.629 $)		27.435	13,23
Bonos y obligaciones corporativos: 0,95 % (28 de febrero de 2023: 6,05 %)			
México: 0,95 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
3.110	Petroleos Mexicanos, 6,950 %, con vencimiento el 28/01/2060	1.984	0,95
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 1.972 $)		1.984	0,95
Bonos y obligaciones del Estado: 84,27 % (28 de febrero de 2023: 78,56 %)			
Australia: 4,48 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
AUD 14.310	Bono del Estado de Australia, Serie 137, 2,750 %, con vencimiento el 21/04/2024	9.283	4,48
Brasil: 3,87 % (28 de febrero de 2023: 5,44 %)			
BRL 16.370	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2027	3.289	1,59
BRL 8.110	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2029	1.606	0,77
BRL 9.230	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2031	1.800	0,87
BRL 6.860	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2033	1.329	0,64
		8.024	3,87
Colombia: 6,19 % (28 de febrero de 2023: 5,87 %)			
COP 14.690.000	Colombian TES, Series B, 7,000 %, con vencimiento el 26/03/2031	3.269	1,58
COP 36.690.000	Colombian TES, Serie B, 9,250 %, con vencimiento el 28/05/2042	8.361	4,03
COP 6.640.000	Colombian TES, Series B, 7,250 %, con vencimiento el 26/10/2050	1.202	0,58
		12.832	6,19
Alemania: 4,57 % (28 de febrero de 2023: 5,84 %)			
EUR 8.810	Bono del Tesoro alemán, cupón cero, con vencimiento el 17/04/2024	9.478	4,57
México: 10,06 % (28 de febrero de 2023: 12,40 %)			
MXN 116.400	Mexican Bonos, Series M, 8,500 %, con vencimiento el 18/11/2038	6.445	3,11
MXN 114.600	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, con vencimiento el 13/11/2042	5.815	2,80
MXN 80.200	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, con vencimiento el 07/11/2047	4.124	1,99
MXN 88.100	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, con vencimiento el 31/07/2053	4.475	2,16
		20.859	10,06
Nueva Zelanda: 0,76 % (28 de febrero de 2023: 0,82 %)			
NZD 3.860	Bono del Estado de Nueva Zelanda, Serie 0551, 2,750 %, con vencimiento el 15/05/2051	1.586	0,76
Noruega: 4,40 % (28 de febrero de 2023: 0,74 %)			
NOK 97.000	Bono del Estado de Noruega, Serie 476, 144A, 3,000 %, con vencimiento el 14/03/2024	9.127	4,40
Sudáfrica: 4,34 % (28 de febrero de 2023: 3,69 %)			
ZAR 108.600	Bono del Estado de la República de Sudáfrica, Serie R214, 6,500 %, con vencimiento el 28/02/2041	3.366	1,62
ZAR 149.500	Bono del Estado de la República de Sudáfrica, Serie 2048, 8,750 %, con vencimiento el 28/02/2048	5.633	2,72
		8.999	4,34
Reino Unido: 10,11 % (28 de febrero de 2023: 0,76 %)			
GBP 9.500	United Kingdom Gilt, 3,250 %, con vencimiento el 31/01/2033	11.270	5,43
GBP 15.670	United Kingdom Gilt, 1,250 %, con vencimiento el 31/07/2051	9.696	4,68
		20.966	10,11
Estados Unidos: 35,49 % (28 de febrero de 2023: 28,57 %)			
8.110	Obligación de Tasa Flotante del Tesoro de los Estados Unidos – Cuando se emite, 5,501 %, con vencimiento el 31/10/2025 *	8.109	3,91
37.750	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2033	35.616	17,17
12.440	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2033	12.072	5,82
11.280	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, con vencimiento el 15/08/2052	8.723	4,21
9.480	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2053	9.079	4,38
		73.599	35,49
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 179.817 $)		174.753	84,27
Organismos de inversión colectiva: 1,73 % (28 de febrero de 2023: 1,99 %)			
3.580	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	3.580	1,73
Total de organismos de inversión colectiva (coste 3.580 $)		3.580	1,73
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 212.998 $)		207.752	100,18
Contratos de divisas a plazo: 0,45 % (28 de febrero de 2023: 0,71 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		942	0,45
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		208.694	100,63
Contratos de divisas a plazo: (1,85 %) (28 de febrero de 2023: (2,07 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(3.847)	(1,85)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(3.847)	(1,85)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		204.847	98,78
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		2.529	1,22
Patrimonio		207.376 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 9.127.000 USD o el 4,40 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

ABREVIATURAS:

AUD	–	Dólar australiano
BRL	–	Real brasileño
COP	–	Peso colombiano
EUR	–	Euro
GBP	–	Libra esterlina
MXN	–	Peso mexicano
NOK	–	Corona noruega
NZD	–	Dólar neozelandés
ZAR	–	Rand sudafricano

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	96,39
Organismos de inversión colectiva	1,69
Instrumentos financieros derivados	0,44
Otros activos	1,48
Total de activos	100,00

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(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)
06 de marzo de 2024	Barclays	Compra	AUD	6.360	Venta	USD	4.194	$ (59)
06 de marzo de 2024	HSBC	Compra	USD	2.109	Venta	AUD	3.190	35
06 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	15.362	Venta	AUD	23.670	(27)
06 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	AUD	11.020	Venta	USD	7.352	(188)
06 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	4.225	Venta	AUD	6.400	64
06 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	AUD	15.880	Venta	USD	10.659	(334)
08 de marzo de 2024	Citi	Compra	USD	8.822	Venta	GBP	7.040	(66)
08 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	6.433	Venta	GBP	5.110	(18)
08 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	5.256	Venta	GBP	4.160	4
11 de marzo de 2024	Barclays	Compra	INR	511.000	Venta	USD	6.112	48
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	25	Venta	AUD	48	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	–	Venta	AUD	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	266	Venta	AUD	248	1
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	38	Venta	CAD	63	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	–	Venta	CAD	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	393	Venta	CAD	323	2
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	153	Venta	CNY	1.377	1
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	–	Venta	CNY	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	1.628	Venta	CNY	7.045	7
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	52	Venta	DKK	222	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	4	Venta	DKK	43	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	592	Venta	EUR	692	(1)
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	6.278	Venta	EUR	3.538	(4)
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	–	Venta	EUR	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	1.026	Venta	GBP	494	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	–	Venta	GBP	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	–	Venta	ILS	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	63	Venta	ILS	141	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	6	Venta	ILS	28	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	–	Venta	JPY	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	233	Venta	JPY	43.129	6
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	2.470	Venta	JPY	220.605	30
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	167	Venta	MXN	1.736	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	–	Venta	MXN	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	16	Venta	MXN	339	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	35	Venta	NOK	227	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	3	Venta	NOK	45	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	4	Venta	NZD	9	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	10	Venta	PLN	49	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	–	Venta	PLN	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	103	Venta	PLN	253	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	40	Venta	SEK	253	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	4	Venta	SEK	49	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	–	Venta	SEK	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	7	Venta	SGD	13	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	79	Venta	SGD	64	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	9.226	Venta	USD	5.599	19
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	NZD	–	Venta	USD	–	–
12 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	870	Venta	USD	1.094	4
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	1	Venta	GBP	–	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	–	Venta	GBP	–	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	USD	–	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	31	Venta	USD	39	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	6	Venta	USD	6	–
15 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	10.192	Venta	JPY	1.448.000	510
15 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	JPY	6.411.000	Venta	USD	44.994	(2.127)
19 de marzo de 2024	HSBC	Compra	USD	2.098	Venta	NOK	21.900	36
19 de marzo de 2024	HSBC	Compra	NOK	33.200	Venta	USD	3.218	(91)
19 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	NOK	64.100	Venta	USD	6.130	(92)
19 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	4.251	Venta	NOK	44.400	68
19 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	NOK	17.900	Venta	USD	1.741	(55)
12 de abril de 2024	Barclays	Compra	USD	1.020	Venta	NZD	1.670	3
16 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	6.030	Venta	MYR	28.800	(43)
16 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	MYR	28.800	Venta	USD	6.232	(159)
18 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	NOK	68.000	Venta	USD	6.639	(229)
26 de abril de 2024	Citi	Compra	KRW	22.050.000	Venta	USD	16.644	(79)
29 de abril de 2024	Citi	Compra	USD	4.233	Venta	MXN	73.800	(54)
30 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	USD	2.685	Venta	COP	10.790.000	(36)
02 de mayo de 2024	Morgan Stanley	Compra	HUF	2.250.000	Venta	USD	6.304	(139)
07 de mayo de 2024	Goldman Sachs	Compra	EUR	2.150	Venta	USD	2.343	(12)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Calendario 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)
07 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	EUR	10.640	Venta	USD	11.567	$	(34)
07 de mayo de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	1.313	Venta	EUR	1.210		1
15 de mayo de 2024	HSBC	Compra	USD	9.132	Venta	ZAR	174.800		79
06 de junio de 2024	JP Morgan	Compra	AUD	23.670	Venta	USD	15.407		24
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 1.448 $)								$	942
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (4.239) $)									(3.847)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (2.791) $)								$	(2.905)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por activos: 0,40 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
4.380	Bellemeade Re 2023-1 Ltd, Serie 2023 1, Clase M1B, 144A, 9,572 %, con vencimiento el 25/10/2033 *	4.527	0,39
136	Eagle RE 2021-1 Ltd, Serie 2021 1, Clase M1C, 144A, 8,022 %, con vencimiento el 25/10/2033 *	136	0,01
Total de valores garantizados por activos (coste 4.701 $)		4.663	0,40
Valores garantizados por hipotecas: 14,72 % (28 de febrero de 2023: 17,87 %)			
11.135	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Serie 2020 SBT1, Clase 1M2, 144A, 9,086 %, con vencimiento el 25/02/2040 *	11.739	1,02
12.085	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Serie 2020 SBT1, Clase 2M2, 144A, 9,086 %, con vencimiento el 25/02/2040 *	12.737	1,11
4.300	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R02, Serie 2023 R02, Clase 1B1, 144A, 10,872 %, con vencimiento el 25/01/2043 *	4.729	0,41
7.602	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C02, Clase 2M2C, 9,086 %, con vencimiento el 25/09/2029 *	8.015	0,70
2.124	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C06, Clase 2M2, 8,236 %, con vencimiento el 25/02/2030 *	2.205	0,19
5.930	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2021 R02, Clase 2B1, 144A, 8,622 %, con vencimiento el 25/11/2041 *	6.111	0,53
2.343	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA4, Serie 2020 HQA4, Clase B1, 144A, 10,686 %, con vencimiento el 25/09/2050 *	2.573	0,22
5.855	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA5, Serie 2020 HQA5, Clase B1, 144A, 9,322 %, con vencimiento el 25/11/2050 *	6.480	0,56
3.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-HQA2, Serie 2021 HQA2, Clase B1, 144A, 8,472 %, con vencimiento el 25/12/2033 *	3.220	0,28
4.720	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, Serie 2022 DNA3, Clase M1B, 144A, 8,222 %, con vencimiento el 25/04/2042 *	4.892	0,43
5.105	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, Serie 2022 DNA3, Clase M2, 144A, 9,672 %, con vencimiento el 25/04/2042 *	5.440	0,47
2.780	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA4, Serie 2022 DNA4, Clase M1B, 144A, 8,672 %, con vencimiento el 25/05/2042 *	2.926	0,25
12.635	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA4, Serie 2022 DNA4, Clase M2, 144A, 10,572 %, con vencimiento el 25/05/2042 *	13.721	1,19
7.420	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA5, Serie 2022 DNA5, Clase M1B, 144A, 9,822 %, con vencimiento el 25/06/2042 *	8.041	0,70
13.690	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA5, Serie 2022 DNA5, Clase M2, 144A, 12,072 %, con vencimiento el 25/06/2042 *	15.466	1,34
5.005	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA6, Serie 2022 DNA6, Clase M2, 144A, 11,072 %, con vencimiento el 25/09/2042 *	5.607	0,49
2.600	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA2, Serie 2022 HQA2, Clase M2, 144A, 11,322 %, con vencimiento el 25/07/2042 *	2.870	0,25
7.950	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2023-DNA1, Serie 2023 DNA1, Clase B1, 144A, 13,472 %, con vencimiento el 25/03/2043 *	9.079	0,79
6.710	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2023-HQA3, Serie 2023 HQA3, Clase M2, 144A, 8,672 %, con vencimiento el 25/11/2043 *	7.022	0,61
12.697	Freddie Mac STACR Trust 2018-HQA2, Serie 2018 HQA2, Clase M2B, 144A, 7,736 %, con vencimiento el 25/10/2048 *	13.146	1,14
20.047	Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2053	19.928	1,73
3.232	STACR Trust 2018-HRP2, Serie 2018 HRP2, Clase B1, 144A, 9,636 %, con vencimiento el 25/02/2047 *	3.540	0,31
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 168,201 $)		169.487	14,72
Bonos y obligaciones corporativos: 57,95 % (28 de febrero de 2023: 58,40 %)			
Argentina: 0,65 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
2.129	YPF SA, 9,000 %, con vencimiento el 12/02/2026	2.130	0,18
5.350	YPF SA, 144A, 9,500 %, con vencimiento el 17/01/2031	5.394	0,47
		7.524	0,65
Australia: 0,54 % (28 de febrero de 2023: 0,40 %)			
1.710	Mineral Resources Ltd, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 01/05/2027	1.727	0,15
3.860	Mineral Resources Ltd, 144A, 9,250 %, con vencimiento el 01/10/2028	4.053	0,35
AUD 730	NBN Co Ltd, 2,200 %, con vencimiento el 16/12/2030	392	0,04
		6.172	0,54
Bermudas: 0,22 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
2.460	RenaissanceRe Holdings Ltd, 5,750 %, con vencimiento el 05/06/2033	2.482	0,22
Brasil: 2,97 % (28 de febrero de 2023: 2,47 %)			
680	Amaggi Luxembourg International Sarl, 5,250 %, con vencimiento el 28/01/2028	651	0,06
6.040	Braskem Netherlands Finance BV, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 12/01/2031	5.920	0,52
5.070	CSN Resources SA, 144A, 8,875 %, con vencimiento el 05/12/2030	5.205	0,45
2.488	ERO Copper Corp, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 15/02/2030	2.347	0,20
3.420	Minerva Luxembourg SA, 144A, 8,875 %, con vencimiento el 13/09/2033	3.599	0,31
2.270	Raizen Fuels Finance SA, 144A, 6,450 %, con vencimiento el 05/03/2034	2.284	0,20
1.535	Rumo Luxembourg Sarl, 144A, 4,200 %, con vencimiento el 18/01/2032	1.281	0,11
13.775	XP Inc, 144A, 3,250 %, con vencimiento el 01/07/2026	12.872	1,12
		34.159	2,97
Canadá: 4,36 % (28 de febrero de 2023: 2,19 %)			
3.349	Air Canada 2015-1 Clase A Pass Through Trust, 144A, 3,600 %, con vencimiento el 15/03/2027	3.170	0,28
6.676	Air Canada 2020-2 Clase A Pass Through Trust, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 01/04/2029	6.553	0,57
5.590	Antares Holdings LP, 144A, 2,750 %, con vencimiento el 15/01/2027	4.983	0,43
9.280	Baytex Energy Corp, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 30/04/2030	9.657	0,84
11.190	Hudbay Minerals Inc, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 01/04/2026	10.796	0,94
8.930	Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2026	8.803	0,76
6.600	Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/04/2029	6.270	0,54
		50.232	4,36
Chile: 0,54 % (28 de febrero de 2023: 0,99 %)			
6.680	ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, con vencimiento el 27/04/2026	6.202	0,54
Colombia: 0,63 % (28 de febrero de 2023: 0,95 %)			
3.100	Ecopetrol SA, 8,875 %, con vencimiento el 13/01/2033	3.261	0,28
4.420	Geopark Ltd, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 17/01/2027	4.009	0,35
		7.270	0,63
República Checa: 0,44 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
4.850	Allwyn Entertainment Financing UK Plc, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 30/04/2029	5.002	0,44
Alemania: 3,37 % (28 de febrero de 2023: 0,35 %)			
41.200	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,375 %, con vencimiento el 18/07/2025	38.735	3,37
Irlanda: 1,08 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
3.330	Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 6,375 %, con vencimiento el 04/05/2028	3.381	0,29
8.900	GGAM Finance Ltd, 144A, 7,750 %, con vencimiento el 15/05/2026	9.050	0,79
		12.431	1,08
Israel: 2,93 % (28 de febrero de 2023: 0,76 %)			
8.385	Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 30/03/2026	7.884	0,68
5.940	Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 30/03/2028	5.334	0,46
3.545	Energean Israel Finance Ltd, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 30/09/2033	3.426	0,30
7.700	Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 30/06/2025	7.555	0,66
8.040	Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 30/06/2027	7.717	0,67
1.980	Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 30/06/2030	1.816	0,16
		33.732	2,93
Italia: 0,59 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
6.850	Telecom Italia SpA/Milano, 144A, 5,303 %, con vencimiento el 30/05/2024	6.831	0,59
Jersey: 0,65 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
7.410	Aston Martin Capital Holdings Ltd, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 30/11/2025	7.520	0,65
Luxemburgo: 0,66 % (28 de febrero de 2023: 0,79 %)			
2.535	Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/08/2029	2.186	0,19
10.770	Altice France Holding SA, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 15/02/2028	5.449	0,47
		7.635	0,66

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
México: 0,55 % (28 de febrero de 2023: 0,24 %)			
3.770	Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, con vencimiento el 15/11/2029	2.851	0,25
1.005	Braskem Idesa SAPI, 6,990 %, con vencimiento el 20/02/2032	726	0,06
3.000	Trust Fibra Uno, 4,869 %, con vencimiento el 15/01/2030	2.732	0,24
		6.309	0,55
Panamá: 0,28 % (28 de febrero de 2023: 0,29 %)			
3.884	AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, con vencimiento el 31/05/2030	3.263	0,28
Supranacional: 7,02 % (28 de febrero de 2023: 1,11 %)			
37.800	International Bank for Reconstruction & Development, 0,500 %, con vencimiento el 28/10/2025	35.231	3,06
MXN 61.000	International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, con vencimiento el 22/01/2026	3.244	0,28
BRL 17.100	International Bank for Reconstruction & Development, 5,000 %, con vencimiento el 22/01/2026	3.242	0,28
38.700	International Bank for Reconstruction & Development, 4,625 %, con vencimiento el 01/08/2028	39.078	3,40
		80.795	7,02
Suiza: 0,30 % (28 de febrero de 2023: 0,15 %)			
3.450	UBS Group AG, 144A, 5,699 %, con vencimiento el 08/02/2035 *	3.414	0,30
Reino Unido: 1,08 % (28 de febrero de 2023: 1,17 %)			
6.070	Connect Finco SARL / Connect US FINCO LLC, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 01/10/2026	5.960	0,52
GBP 1.075	Nationwide Building Society, 5,750 %, Perpetuo *	1.262	0,11
3.625	NatWest Group plc, 4,600 %, Perpetuo*	2.730	0,23
2.900	Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/07/2031	2.511	0,22
		12.463	1,08
Estados Unidos: 27,52 % (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	3.684	0,32
7.770	Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/12/2027	7.174	0,62
6.505	Alaska Airlines 2020-1 Clase A Pass Through Trust, 144A, 4,800 %, con vencimiento el 15/08/2027	6.328	0,55
2.680	AmeriTex HoldCo Intermediate LLC, 144A, 10,250 %, con vencimiento el 15/10/2028	2.811	0,24
5.515	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2026	5.095	0,44
435	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 15/08/2027	316	0,03
1.890	Ares Capital Corp, 3,250 %, con vencimiento el 15/07/2025	1.816	0,16
2.530	Ares Capital Corp, 2,875 %, con vencimiento el 15/06/2028	2.217	0,19
7.945	Bain Capital Specialty Finance Inc, 2,950 %, con vencimiento el 10/03/2026	7.439	0,65
9.170	Blackstone Secured Lending Fund, 2,125 %, con vencimiento el 15/02/2027	8.234	0,72
2.645	Blackstone Secured Lending Fund, 2,850 %, con vencimiento el 30/09/2028	2.304	0,20
1.160	Blue Owl Capital Corp, 4,000 %, con vencimiento el 30/03/2025	1.133	0,10
4.330	Blue Owl Capital Corp, 2,625 %, con vencimiento el 15/01/2027	3.927	0,34
5.515	Blue Owl Credit Income Corp, 3,125 %, con vencimiento el 23/09/2026	5.024	0,44
2.550	Blue Owl Credit Income Corp, 7,750 %, con vencimiento el 16/09/2027	2.610	0,23
4.040	Blue Owl Technology Finance Corp, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/12/2025	3.852	0,33
10.861	Blue Owl Technology Finance Corp, 144A, 3,750 %, con vencimiento el 17/06/2026	9.993	0,87
2.170	Capital One Financial Corp, 6,312 %, con vencimiento el 08/06/2029 *	2.222	0,19
3.015	Capital One Financial Corp, 7,624 %, con vencimiento el 30/10/2031 *	3.301	0,29
3.723	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 15/03/2026	3.689	0,32
4.900	Civitas Resources Inc, 144A, 8,375 %, con vencimiento el 01/07/2028	5.134	0,45
6.860	Consolidated Communications Inc, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2028	5.672	0,49
10.105	Credit Acceptance Corp, 6,625 %, con vencimiento el 15/03/2026	10.075	0,87
6.020	DaVita Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 01/06/2030	5.301	0,46
27.582	DISH Network Corp, 3,375 %, con vencimiento el 15/08/2026	16.446	1,43
2.670	Enviri Corp, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 31/07/2027	2.497	0,22
5.215	FS KKR Capital Corp, 3,125 %, con vencimiento el 12/10/2028	4.508	0,39
7.270	Golub Capital BDC Inc, 2,500 %, con vencimiento el 24/08/2026	6.638	0,58
6.560	Golub Capital BDC Inc, 2,050 %, con vencimiento el 15/02/2027	5.788	0,50
13.773	Graham Packaging Co Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 15/08/2028	12.220	1,06
5.387	IRB Holding Corp, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/06/2025	5.399	0,47
12.890	KeyBank NA/Cleveland OH, serie BKNt, 5,674 %, con vencimiento el 14/06/2024 *	12.845	1,12
1.025	Liberty Interactive LLC, 8,250 %, con vencimiento el 01/02/2030	670	0,06
12.100	Main Street Capital Corp, 3,000 %, con vencimiento el 14/07/2026	11.200	0,97
6.945	MicroStrategy Inc, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 15/06/2028	6.704	0,58
9.888	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 20/06/2027	9.898	0,86
8.820	Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 01/02/2026	8.324	0,72
18.660	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 15/09/2025	18.581	1,61
9.530	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 30/09/2026	9.212	0,80
3.830	Nexstar Media Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 01/11/2028	3.405	0,30
5.000	NFP Corp, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 01/10/2030	5.266	0,46
3.255	Nordstrom Inc, 2,300 %, con vencimiento el 08/04/2024	3.245	0,28
7.265	PRA Group Inc, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2029	6.092	0,53
1.640	Regal Rexnord Corp, 144A, 6,400 %, con vencimiento el 15/04/2033	1.685	0,15
3.190	Star Parent Inc, 144A, 9,000 %, con vencimiento el 01/10/2030	3.371	0,29
5.954	Synchrony Bank, 5,625 %, con vencimiento el 23/08/2027	5.796	0,50
987	Synchrony Financial, 4,250 %, con vencimiento el 15/08/2024	978	0,08
7.135	Synchrony Financial, 7,250 %, 02/02/2033	6.941	0,60
4.315	Travel + Leisure Co, 144A, 6,625 %, con vencimiento el 31/07/2026	4.364	0,38
5.099	Uber Technologies Inc, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 01/11/2026	5.193	0,45
4.080	Univision Communications Inc, 144A, 6,625 %, con vencimiento el 01/06/2027	3.958	0,34
11.180	Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 01/06/2028	11.367	0,99
7.940	Viasat Inc, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 15/04/2027	7.462	0,65
7.500	Viking Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/05/2025	7.495	0,65
		316.899	27,52
Zambia: 1,57 % (28 de febrero de 2023: 1,50 %)			
3.773	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 01/04/2025	3.773	0,33
5.970	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 01/03/2026	5.970	0,52
8.800	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/10/2027	8.377	0,72
		18.120	1,57
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 698.732 $)		667.190	57,95
Bonos y obligaciones del Estado: 23,78 % (28 de febrero de 2023: 11,58 %)			
Brasil: 3,36 % (28 de febrero de 2023: 3,45 %)			
BRL 136.410	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2027	27.409	2,38
BRL 56.890	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2029	11.269	0,98
		38.678	3,36
Colombia: 6,00 % (28 de febrero de 2023: 2,95 %)			
COP 211.704.000	Colombian TES, Series B, 7,000 %, con vencimiento el 26/03/2031	47.111	4,09
COP 121.618.000	Colombian TES, Series B, 7,250 %, con vencimiento el 26/10/2050	22.008	1,91
		69.119	6,00
México: 5,51 % (28 de febrero de 2023: 2,93 %)			
MXN 758.600	Mexican Bonos, Series M, 7,500 %, con vencimiento el 26/05/2033	40.014	3,48
MXN 460.800	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, con vencimiento el 31/07/2053	23.406	2,03
		63.420	5,51

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones del Estado (continuación)			
España: 3,04 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
EUR 48.420	Bono del Estado de España, 144A, 1,900 %, con vencimiento el 31/10/2052	34.988	3,04
Reino Unido: 5,87 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
GBP 61.470	United Kingdom Gilt, 3,750 %, con vencimiento el 22/10/2053	67.561	5,87
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 255.971 $)		273.766	23,78
Obligaciones de préstamo: 0,47 % (28 de febrero de 2023: 0,43 %)			
2.168	Flutter Financing BV, 8,863 %, con vencimiento el 04/07/2028 *	2.175	0,19
3.300	Star Parent Inc, 9,348 %, con vencimiento el 19/09/2030 *	3.263	0,28
Total de obligaciones de préstamo (coste 5.384 $)		5.438	0,47
Organismos de inversión colectiva: 1,78 % (28 de febrero de 2023: 7,05 %)			
20.461	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	20.461	1,78
Total de organismos de inversión colectiva (coste 20.461 $)		20.461	1,78
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 1.153.450 $)		1.141.005	99,10
Contratos de divisas a plazo: 0,53 % (28 de febrero de 2023: 0,29 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		6.119	0,53
Futuros: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		55	–
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		1.147.179	99,63
Swaps de incumplimiento de crédito: (0,18 %) (28 febrero de 2023: (0,07 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(2.085)	(0,18)
Contratos de divisas a plazo: (0,41 %) (28 de febrero de 2023: (1,02 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(4.746)	(0,41)
Futuros: (0,02 %) (28 de febrero de 2023: (0,31 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(274)	(0,02)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(7.105)	(0,61)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		1.140.074	99,02
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		11.306	0,98
Patrimonio		1.151.380 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 575.462.000 USD o el 49,97 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

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

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	95,08
Otros valores mobiliarios negociables en otro mercado regulado	0,46
Organismos de inversión colectiva	1,74
Instrumentos financieros derivados	0,53
Otros activos	2,19
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)
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 % – Vender	20 de diciembre de 2025	3.390	$ (59)
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 % – Vender	20 de junio de 2026	15.700	(663)
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 % – Vender	20 de diciembre de 2025	1.605	(28)
JP Morgan	Altice Luxembourg S.A., 5,000 % – Vender	20 de diciembre de 2025	1.605	(420)
JP Morgan	Altice Luxembourg S.A., 5,000 % – Vender	20 de diciembre de 2025	3.495	(915)
Apreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): 1.309 $)				$ –
Depreciación latente de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): (878) $)				(2.085)
Depreciación neta de swaps de incumplimiento de crédito (28 de febrero de 2023 (en miles): 431 $)				$ (2.085)

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)
04 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	154	Venta	BRL	767		$ –
04 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	BRL	68	Venta	USD	14		–
04 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	BRL	699	Venta	USD	142		(2)
08 de marzo de 2024	Citi	Compra	USD	31.690	Venta	GBP	25.290		(235)
08 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	57.600	Venta	GBP	45.590		49
08 de marzo de 2024	UBS	Compra	GBP	16.860	Venta	USD	21.416		(132)
12 de marzo de 2024	Barclays	Compra	CHF	50.570	Venta	USD	58.855		(1.596)
12 de marzo de 2024	HSBC	Compra	CHF	49.460	Venta	USD	57.529		(1.527)
12 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	115.734	Venta	CHF	100.030		2.471
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	15	Venta	CNH	112		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	–	Venta	CZK	1		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	7.358	Venta	EUR	6.827		(23)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	2.034	Venta	EUR	1.875		4
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	16	Venta	GBP	13		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	108	Venta	GBP	85		–

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Calendario 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 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	196	Venta	SGD	264		$ –
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	483	Venta	SGD	648		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CZK	795	Venta	USD	34		(1)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	368.731	Venta	USD	396.727		2.054
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	2	Venta	USD	3		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CZK	12	Venta	USD	–		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	34	Venta	USD	26		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	27.031	Venta	USD	34.000		123
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SEK	25.218	Venta	USD	2.392		42
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	77.113	Venta	USD	57.446		(98)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	2.468	Venta	USD	2.674		(5)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CNH	9.060	Venta	USD	1.261		(3)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	6.571	Venta	USD	4.286		(13)
15 de marzo de 2024	HSBC	Compra	USD	23.608	Venta	JPY	3.349.000		1.215
15 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	JPY	3.349.000	Venta	USD	23.504		(1.111)
02 de abril de 2024	BNY Mellon	Compra	BRL	771	Venta	USD	155		–
19 de abril de 2024	HSBC	Compra	USD	3.341	Venta	BRL	16.370		65
07 de mayo de 2024	HSBC	Compra	EUR	2.020	Venta	USD	2.185		4
07 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	31.580	Venta	EUR	29.050		92
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 3.510 $)									$ 6.119
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (12.389) $)									(4.746)
Apreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (8.879) $)									$ 1.373

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 marzo de 2024	Citi	118	$ 16.982	$ (274)
U.S. 10 Year Ultra Note junio 2024	Citi	656	74.897	55
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): – $)				$ 55
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (3.704) $)				(274)
Depreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (3.704) $)				$ (219)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas: 28,85 % (28 de febrero de 2023: 81,49 %)			
876	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R04, Serie 2019 R04, Clase 2B1, 144A, 10,686 %, con vencimiento el 25/06/2039 *	934	5,70
547	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Serie 2019 R05, Clase 1B1, 144A, 9,536 %, con vencimiento el 25/07/2039 *	570	3,47
570	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Serie 2020 R01, Clase 1B1, 144A, 8,686 %, con vencimiento el 25/01/2040 *	587	3,58
826	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Serie 2020 DNA3, Clase B1, 144A, 10,536 %, con vencimiento el 25/06/2050 *	911	5,55
347	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA4, Serie 2020 DNA4, Clase B1, 144A, 11,436 %, con vencimiento el 25/08/2050 *	396	2,41
330	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7, Serie 2021 DNA7, Clase B1, 144A, 8,972 %, con vencimiento el 25/11/2041 *	341	2,08
870	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2023-DNA1, Serie 2023 DNA1, Clase B1, 144A, 13,472 %, con vencimiento el 25/03/2043 *	993	6,06
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 4,570 $)		4.732	28,85
Bonos y obligaciones corporativos: 62,22 % (28 de febrero de 2023: 7,23 %)			
Argentina: 2,58 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
220	YPF SA, 8,500 %, con vencimiento el 28/07/2025	215	1,31
209	YPF SA, 9,000 %, con vencimiento el 12/02/2026	209	1,27
		424	2,58
Australia: 1,28 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
200	Mineral Resources Ltd, 144A, 9,250 %, con vencimiento el 01/10/2028	210	1,28
Brasil: 4,04 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
220	3R Lux SARL, 144A, 9,750 %, con vencimiento el 05/02/2031	228	1,39
200	Braskem Netherlands Finance BV, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 12/01/2031	196	1,20
200	CSN Resources SA, 144A, 8,875 %, con vencimiento el 05/12/2030	205	1,25
35	ERO Copper Corp, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 15/02/2030	33	0,20
		662	4,04
Canadá: 4,05 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
180	Greenfire Resources Ltd, 144A, 12,000 %, con vencimiento el 01/10/2028	189	1,15
260	Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2026	256	1,57
230	Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/04/2029	219	1,33
		664	4,05
Chile: 1,36 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
240	ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 144A, 4,050 %, con vencimiento el 27/04/2026	223	1,36
Colombia: 1,55 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
240	Ecopetrol SA, 8,625 %, con vencimiento el 19/01/2029	255	1,55
Israel: 3,25 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
230	Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 30/03/2026	216	1,32
220	Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 30/06/2025	216	1,32
95	Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 30/06/2027	91	0,56
10	Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 30/06/2030	9	0,05
		532	3,25
Paraguay: 1,24 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
200	Aston Martin Capital Holdings Ltd, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 30/11/2025	203	1,24
México: 3,01 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
200	Braskem Idesa SAPI, 6,990 %, con vencimiento el 20/02/2032	144	0,88
130	Grupo Posadas SAB de CV, 7,000 %, con vencimiento el 30/12/2027	115	0,70
270	Petroleos Mexicanos, 5,350 %, con vencimiento el 12/02/2028	235	1,43
		494	3,01
Reino Unido: 1,32 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
220	Connect Finco SARL / Connect US FINCO LLC, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 01/10/2026	216	1,32
Estados Unidos: 38,54 % (28 de febrero de 2023: 6,78 %)			
230	Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/12/2027	212	1,29
240	Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 15/08/2027	234	1,43
220	AmeriTex HoldCo Intermediate LLC, 144A, 10,250 %, con vencimiento el 15/10/2028	231	1,41
110	ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2028	95	0,58
230	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2026	212	1,29
220	Blue Owl Technology Finance Corp, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 15/12/2025	210	1,28
200	CSC Holdings LLC, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/04/2027	180	1,09
200	DISH Network Corp, 144A, 11,750 %, con vencimiento el 15/11/2027	209	1,27
195	Embecta Corp, 144A, 5,00 %, con vencimiento el 15/02/2030	156	0,95
310	Freedom Mortgage Corp, 7,625 %, con vencimiento el 01/05/2026	308	1,88
240	Freedom Mortgage Corp, 144A, 6,625 %, con vencimiento el 15/01/2027	229	1,40
230	Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 8,875 %, con vencimiento el 15/07/2028	243	1,48
340	IRB Holding Corp, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/06/2025	341	2,08
250	KeyBank NA/Cleveland OH, serie BKNt, 5,674 %, con vencimiento el 14/06/2024 *	249	1,52
200	Level 3 Financing Inc, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 15/05/2030	206	1,26
230	MicroStrategy Inc, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 15/06/2028	222	1,35
220	Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 01/02/2026	208	1,27
95	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 30/09/2026	92	0,56
140	New York Community Bancorp Inc, 8,332 %, con vencimiento el 06/11/2028 *	117	0,71
250	Nexstar Media Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 01/11/2028	222	1,35
300	NGL Energy Operating LLC / NGL Energy Finance Corp, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 15/02/2029	303	1,85
165	PROG Holdings Inc, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 15/11/2029	152	0,92
230	Sabre GLBL Inc, 144A, 8,625 %, con vencimiento el 01/06/2027	203	1,24
210	Sitio Royalties Operating Partnership LP / Sitio Finance Corp, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 01/11/2028	215	1,31
90	Star Parent Inc, 144A, 9,000 %, con vencimiento el 01/10/2030	95	0,58
200	Transocean Titan Financing Ltd, 144A, 8,375 %, con vencimiento el 01/02/2028	205	1,25
130	United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/04/2029	121	0,74
220	Univision Communications Inc, 144A, 6,625 %, con vencimiento el 01/06/2027	213	1,30
240	Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 01/02/2029	220	1,34
210	Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 01/06/2028	213	1,30
220	Viasat Inc, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 15/04/2027	207	1,26
		6.323	38,54
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 9.883 $)		10.206	62,22
Bonos y obligaciones del Estado: 6,85 % (28 de febrero de 2023: 4,43 %)			
Brasil: 0,97 % (28 de febrero de 2023: 1,90 %)			
BRL 800	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2029	158	0,97
Colombia: 2,82 % (28 de febrero de 2023: 1,72 %)			
COP 765.000	Colombian TES, Series B, 7,250 %, con vencimiento el 18/10/2034	161	0,98
COP 1.670.000	Colombian TES, Series B, 7,250 %, con vencimiento el 26/10/2050	302	1,84
		463	2,82
Paraguay: 1,10 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
200	Bono Internacional del Estado de Egipto, 6,588 %, con vencimiento el 21/02/2028	181	1,10
México: 1,96 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
MXN 6.100	Mexican Bonos, Series M, 7,500 %, con vencimiento el 26/05/2033	322	1,96
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 1.124 $)		1.124	6,85
Obligaciones de préstamo: 4,06 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
120	Cotiviti Inc, 0,000 %, con vencimiento el 24/02/2031 *	120	0,73
240	Prairie ECI Acquiror LP, 0,000 %, con vencimiento el 01/08/2029 *	238	1,45
310	Westjet Airlines, 0,000 %, con vencimiento el 31/01/2031 *	308	1,88
Total de obligaciones de préstamo (coste 663 $)		666	4,06

^ 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 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Organismos de inversión colectiva: 7,70 % (28 de febrero de 2023: 4,74 %)			
1.264	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	1.264	7,70
Total de organismos de inversión colectiva (coste 1.264 $)		1.264	7,70
Acciones ordinarias: 0,07 % (28 de febrero de 2023: 0,05 %)			
Estados Unidos: 0,07 % (28 de febrero de 2023: 0,05 %)			
8	Danimer Scientific Inc	11	0,07
Total de acciones ordinarias (coste 534 $)		11	0,07
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		18.003	109,75
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		18.003	109,75
Excedente de pasivos respecto a otros activos		(1.600)	(9,75)
Patrimonio		16.403 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 12.879.000 USD o el 78,53 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

ABREVIATURAS:

REMIC – Conducto de inversiones hipotecarias inmobiliarias.
BRL – Real brasileño
COP – Peso colombiano
MXN – Peso mexicano

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	71,04
Otros valores mobiliarios negociables en otro mercado regulado	2,94
Organismos de inversión colectiva	5,59
Otros activos	20,43
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 Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas: 20,08 % (28 de febrero de 2023: 13,31 %)			
1.508	Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	1.429	2,01
459	Fannie Mae Pool 'MA4785', 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2052	445	0,63
1.109	Fannie Mae Pool 'MA4841', 5,000 %, con vencimiento el 01/12/2052	1.077	1,52
1.247	Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	1.237	1,74
533	Freddie Mac Pool 'RA7790', 5,000 %, con vencimiento el 01/08/2052	517	0,73
1.092	Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	1.034	1,46
707	Freddie Mac Pool 'SD8257', 4,500 %, con vencimiento el 01/10/2052	670	0,94
570	Freddie Mac Pool 'SD8267', 5,000 %, con vencimiento el 01/11/2052	553	0,78
1.740	Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	1.726	2,43
844	Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500 %, con vencimiento el 20/02/2053	840	1,18
1.537	Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2053	1.528	2,15
1.075	Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, con vencimiento el 20/05/2053	1.069	1,50
1.284	Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000 %, con vencimiento el 20/06/2053	1.255	1,77
888	Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500 %, con vencimiento el 20/06/2053	883	1,24
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 14,402 $)		14.263	20,08
Bonos y obligaciones corporativos: 8,95 % (28 de febrero de 2023: 7,90 %)			
Australia: 2,08 % (28 de febrero de 2023: 4,12 %)			
1.470	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 6,094 %, con vencimiento el 14/03/2025 *	1.477	2,08
México: 3,04 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
3.390	Petroleos Mexicanos, 6,950 %, con vencimiento el 28/01/2060	2.162	3,04
Estados Unidos: 3,83 % (28 de febrero de 2023: 3,78 %)			
1.420	General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, con vencimiento el 06/04/2026	1.421	2,00
1.310	Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, con vencimiento el 18/05/2026	1.297	1,83
		2.718	3,83
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 6.337 $)		6.357	8,95
Bonos y obligaciones del Estado: 60,51 % (28 de febrero de 2023: 73,60 %)			
Brasil: 12,09 % (28 de febrero de 2023: 11,00 %)			
BRL 24.470	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2029	4.847	6,82
BRL 19.180	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2031	3.740	5,27
		8.587	12,09
Colombia: 9,82 % (28 de febrero de 2023: 7,24 %)			
COP 11.100.000	Colombian TES, Series B, 6,000 %, con vencimiento el 28/04/2028	2.538	3,57
COP 20.590.000	Colombian TES, Series B, 7,000 %, con vencimiento el 30/06/2032	4.436	6,25
		6.974	9,82
República Dominicana: 4,74 % (28 de febrero de 2023: 4,84 %)			
CZK 91.690	Bono del Estado de la República Checa, Serie 138, 1,750 %, con vencimiento el 23/06/2032	3.365	4,74
México: 16,75 % (28 de febrero de 2023: 20,07 %)			
MXN 36.400	Mexican Bonos, Series M, 8,500 %, con vencimiento el 18/11/2038	2.016	2,84
MXN 155.500	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, con vencimiento el 13/11/2042	7.890	11,10
MXN 38.800	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, con vencimiento el 07/11/2047	1.995	2,81
		11.901	16,75
Sudáfrica: 7,13 % (28 de febrero de 2023: 8,58 %)			
ZAR 33.800	Bono del Estado de la República de Sudáfrica, Serie R214, 6,500 %, con vencimiento el 28/02/2041	1.048	1,47
ZAR 106.700	Bono del Estado de la República de Sudáfrica, Serie 2048, 8,750 %, con vencimiento el 28/02/2048	4.020	5,66
		5.068	7,13
Estados Unidos: 9,98 % (28 de febrero de 2023: 12,74 %)			
7.080	Obligación de Tasa Flotante del Tesoro de los Estados Unidos – Cuando se emite, 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025 *	7.089	9,98
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 43.880 $)		42.984	60,51
Organismos de inversión colectiva: 5,62 % (28 de febrero de 2023: 5,60 %)			
30	Franklin Templeton Global Funds Plc – FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund – Clase LM USD de Capitalización	3.994	5,62
Total de organismos de inversión colectiva (coste 3.500 $)		3.994	5,62
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 68.119 $)		67.598	95,16
Contratos de divisas a plazo: 0,61 % (28 de febrero de 2023: 0,36 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		430	0,61
Futuros: 0,02 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		14	0,02
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		68.042	95,79
Contratos de divisas a plazo: (2,06 %) (28 de febrero de 2023: (5,02 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(1.463)	(2,06)
Futuros: (0,24 %) (28 de febrero de 2023: (0,41 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(167)	(0,24)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(1.630)	(2,30)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		66.412	93,49
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		4.625	6,51
Patrimonio		71.037 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 1.477.000 USD o el 2,08 % del patrimonio neto.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

ABREVIATURAS:

BRL – Real brasileño
COP – Peso colombiano
CZK – Corona checa
MXN – Peso mexicano
ZAR – Rand sudafricano

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	86,96
Organismos de inversión colectiva	5,46
Instrumentos financieros derivados	0,61
Otros activos	6,97
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)
06 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	1.597	Venta	AUD	2.460	$ (3)
06 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	AUD	2.460	Venta	USD	1.641	(42)
08 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	177	Venta	GBP	140	–
08 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	GBP	5.650	Venta	USD	7.138	(6)
11 de marzo de 2024	Barclays	Compra	INR	182.000	Venta	USD	2.177	17
12 de marzo de 2024	Barclays	Compra	CHF	470	Venta	USD	538	(6)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Calendario 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 de marzo de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	19.023	Venta	CHF	16.480	$	363
13 de marzo de 2024	Citi	Compra	KRW	3.060.000	Venta	USD	2.336		(39)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	102	Venta	USD	76		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	3	Venta	USD	4		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	108.928	Venta	USD	71.048		(210)
15 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	JPY	2.584.000	Venta	USD	18.135		(857)
15 de marzo de 2024	UBS	Compra	USD	451	Venta	JPY	67.000		3
12 de abril de 2024	Barclays	Compra	NZD	6.690	Venta	USD	4.166		(93)
12 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	166	Venta	NZD	270		1
18 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	124	Venta	NOK	1.300		1
18 de abril de 2024	Morgan Stanley	Compra	NOK	33.500	Venta	USD	3.271		(113)
23 de abril de 2024	Barclays	Compra	MYR	7.900	Venta	USD	1.687		(20)
23 de abril de 2024	Citi	Compra	MXN	34.800	Venta	USD	2.000		24
23 de abril de 2024	Goldman Sachs	Compra	USD	185	Venta	MXN	3.200		(1)
25 de abril de 2024	Citi	Compra	CAD	9.670	Venta	USD	7.167		(35)
25 de abril de 2024	UBS	Compra	USD	238	Venta	CAD	320		2
30 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	USD	2.182	Venta	COP	8.770.000		(30)
30 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	COP	680.000	Venta	USD	171		–
10 de mayo de 2024	Barclays	Compra	THB	80.700	Venta	USD	2.264		–
10 de mayo de 2024	HSBC	Compra	USD	2.255	Venta	THB	80.700		(8)
15 de mayo de 2024	HSBC	Compra	USD	538	Venta	ZAR	10.300		5
16 de mayo de 2024	Citi	Compra	USD	3.388	Venta	CZK	79.200		11
16 de mayo de 2024	Morgan Stanley	Compra	CZK	2.600	Venta	USD	111		–
06 de junio de 2024	JP Morgan	Compra	AUD	2.460	Venta	USD	1.601		3
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 249 $)								$	430
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (3.482) $)									(1.463)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (3.233) $)								$	(1.033)

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 marzo de 2024	Morgan Stanley	67	$	9.642	$ (167)
Long Gilt junio 2024	Morgan Stanley	40		4.953	14
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): – $)					$ 14
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (283) $)					(167)
Depreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (283) $)					$ (153)

^ *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 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas: 15,34 % (28 de febrero de 2023: 18,58 %)			
60	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R02, Serie 2023 R02, Clase 1B1, 144A, 10,872 %, con vencimiento el 25/01/2043 *	66	0,42
170	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R04, Serie 2023 R04, Clase 1M2, 144A, 8,871 %, con vencimiento el 25/05/2043 *	181	1,14
145	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05, serie 2023 R05, clase 1M2, 144A, 8,421 %, con vencimiento el 25/06/2043 *	152	0,96
167	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R07, Serie 2023 R07, Clase 2M1, 144A, 7,271 %, con vencimiento el 25/09/2043 *	169	1,07
185	Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01, Serie 2024 R01, Clase 1M1, 144A, 6,372 %, con vencimiento el 25/01/2044 *	185	1,17
160	Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01, Serie 2024 R01, Clase 1M2, 144A, 7,122 %, con vencimiento el 25/01/2044 *	161	1,01
80	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2021 R02, Clase 2B1, 144A, 8,622 %, con vencimiento el 25/11/2041 *	82	0,52
600	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7, Serie 2021 DNA7, Clase M2, 144A, 7,122 %, con vencimiento el 25/11/2041 *	605	3,82
65	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, Serie 2022 DNA3, Clase M1B, 144A, 8,222 %, con vencimiento el 25/04/2042 *	67	0,43
70	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, Serie 2022 DNA3, Clase M2, 144A, 9,672 %, con vencimiento el 25/04/2042 *	75	0,47
40	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA4, Serie 2022 DNA4, Clase M1B, 144A, 8,672 %, con vencimiento el 25/05/2042 *	42	0,27
185	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA5, Serie 2022 DNA5, Clase M2, 144A, 12,072 %, con vencimiento el 25/06/2042 *	209	1,32
135	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA6, Serie 2022 DNA6, Clase M1B, 144A, 9,022 %, con vencimiento el 25/09/2042 *	144	0,91
40	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA2, Serie 2022 HQA2, Clase M2, 144A, 11,322 %, con vencimiento el 25/07/2042 *	44	0,28
112	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2023-HQA1, Serie 2023 HQA1, Clase M1A, 144A, 7,322 %, con vencimiento el 25/05/2043 *	114	0,72
38	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2023-HQA2, Serie 2023 HQA2, Clase M1A, 144A, 7,322 %, con vencimiento el 25/06/2043 *	39	0,24
90	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2023-HQA3, Serie 2023 HQA3, Clase M2, 144A, 8,672 %, con vencimiento el 25/11/2043 *	94	0,59
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 2,386 $)		2.429	15,34
Bonos y obligaciones corporativos: 37,68 % (28 de febrero de 2023: 59,55 %)			
Aerolíneas: 1,38 % (28 de febrero de 2023: 1,76 %)			
116	Alaska Airlines 2020-1 Clase A Pass Through Trust, 144A, 4,800 %, con vencimiento el 15/08/2027	113	0,71
105	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 20/06/2027	105	0,67
		218	1,38
Fabricantes de automóviles: 3,49 % (28 de febrero de 2023: 4,84 %)			
190	General Motors Co, 5,600 %, con vencimiento el 15/10/2032	190	1,20
185	Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 2,750 %, con vencimiento el 09/03/2028	163	1,03
EUR 195	Volvo Car AB, 2,500 %, con vencimiento el 07/10/2027	199	1,26
		552	3,49
Bancos: 5,79 % (28 de febrero de 2023: 7,54 %)			
155	Bank of America Corp, 2,456 %, con vencimiento el 22/10/2025 *	152	0,96
EUR 200	BNP Paribas SA, 0,375 %, con vencimiento el 14/10/2027 *	198	1,25
GBP 130	Co-operative Bank Holdings Ltd/The, 6,000 %, con vencimiento el 06/04/2027 *	161	1,02
220	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, con vencimiento el 12/02/2026 *	210	1,33
200	JPMorgan Chase & Co, 0,768 %, con vencimiento el 09/08/2025 *	196	1,23
		917	5,79
Servicios financieros diversificados: 1,33 % (28 de febrero de 2023: 3,70 %)			
225	XP Inc, 144A, 3,250 %, con vencimiento el 01/07/2026	210	1,33
Electricidad: 1,25 % (28 de febrero de 2023: 1,42 %)			
236	AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, con vencimiento el 31/05/2030	198	1,25
Energía: Fuentes alternativas: 1,20 % (28 de febrero de 2023: 1,17 %)			
EUR 205	Vestas Wind Systems Finance BV, 2,000 %, con vencimiento el 15/06/2034	190	1,20
Alimentación: 1,08 % (28 de febrero de 2023: 3,42 %)			
GBP 135	Co-Operative Group Ltd, 5,125 %, con vencimiento el 17/05/2024	171	1,08
Servicios sanitarios: 1,41 % (28 de febrero de 2023: 2,03 %)			
79	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 15/03/2026	78	0,49
145	HCA Inc, 5,000 %, con vencimiento el 15/03/2024	145	0,92
		223	1,41
Organismos de inversión colectiva: 0,76 % (28 de febrero de 2023: 2,59 %)			
130	Main Street Capital Corp, 3,000 %, con vencimiento el 14/07/2026	120	0,76
Minería: 3,61 % (28 de febrero de 2023: 3,46 %)			
35	ERO Copper Corp, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 15/02/2030	33	0,21
220	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/10/2027	209	1,32
175	FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 144A, 4,375 %, con vencimiento el 01/04/2031	157	0,99
175	Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2026	173	1,09
		572	3,61
Multinacional: 2,73 % (28 de febrero de 2023: 3,87 %)			
MXN 4.040	International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, con vencimiento el 22/01/2026	215	1,36
BRL 1.150	International Bank for Reconstruction & Development, 5,000 %, con vencimiento el 22/01/2026	218	1,37
		433	2,73
Petróleo y gas: 7,44 % (28 de febrero de 2023: 8,11 %)			
150	Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250 %, con vencimiento el 15/02/2026	151	0,95
60	Civitas Resources Inc, 144A, 8,375 %, con vencimiento el 01/07/2028	63	0,40
120	Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 30/03/2026	113	0,71
90	Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 30/03/2028	81	0,51
35	Energean Israel Finance Ltd, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 30/09/2033	34	0,21
100	Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 30/06/2025	98	0,62
150	Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 30/06/2030	137	0,87
140	Occidental Petroleum Corp, 6,125 %, con vencimiento el 01/01/2031	143	0,91
200	Raizen Fuels Finance SA, 144A, 6,450 %, con vencimiento el 05/03/2034	201	1,27
165	Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/04/2029	157	0,99
		1.178	7,44
Embalaje y envases: 0,50 % (28 de febrero de 2023: 2,04 %)			
90	Graham Packaging Co Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 15/08/2028	80	0,50
Gasoductos: 2,25 % (28 de febrero de 2023: 1,98 %)			
205	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 30/09/2026	198	1,25
155	Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 01/06/2028	158	1,00
		356	2,25
Semiconductores: 1,22 % (28 de febrero de 2023: 1,21 %)			
235	Micron Technology Inc, 2,703 %, con vencimiento el 15/04/2032	193	1,22
Transporte: 1,29 % (28 de febrero de 2023: 1,25 %)			
EUR 220	FedEx Corp, 0,450 %, con vencimiento el 04/05/2029	204	1,29
Agua: 0,95 % (28 de febrero de 2023: 1,00 %)			
150	Solaris Midstream Holdings LLC, 144A, 7,625 %, con vencimiento el 01/04/2026	150	0,95
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 5.856 $)		5.965	37,68
Bonos y obligaciones del Estado: 43,33 % (28 de febrero de 2023: 10,56 %)			
Soberano: 43,33 % (28 de febrero de 2023: 10,56 %)			
BRL 1.840	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2027	370	2,34
BRL 780	Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2029	154	0,98
COP 2.868.000	Colombian TES, Series B, 7,000 %, con vencimiento el 26/03/2031	638	4,03
COP 1.671.000	Colombian TES, Series B, 7,250 %, con vencimiento el 26/10/2050	302	1,91
MXN 10.500	Mexican Bonos, Series M, 7,500 %, con vencimiento el 26/05/2033	554	3,50
MXN 6.400	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, con vencimiento el 31/07/2053	325	2,05
EUR 650	Bono del Estado de España, 144A, 1,900 %, con vencimiento el 31/10/2052	470	2,97

^ *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 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones del Estado (continuación)			
Soberano (continuación)			
GBP 820	United Kingdom Gilt, 3,750 %, con vencimiento el 22/10/2053	901	5,69
3.140	Obligación de Tasa Flotante del Tesoro de los Estados Unidos – Cuando se emite, 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025 *	3.144	19,86
		6.858	43,33
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 6.592 $)		6.858	43,33
Organismos de inversión colectiva: 3,66 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
579	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	579	3,66
Total de organismos de inversión colectiva (coste 579 $)		579	3,66
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 15.413 $)		15.831	100,01
Contratos de divisas a plazo: 0,34 % (28 de febrero de 2023: 0,58 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		54	0,34
Futuros: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		1	–
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		15.886	100,35
Contratos de divisas a plazo: (0,36 %) (28 de febrero de 2023: (0,43 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(57)	(0,36)
Futuros: (0,02 %) (28 de febrero de 2023: (0,83 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(4)	(0,02)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(61)	(0,38)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		15.825	99,97
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		4	0,03
Patrimonio		15.829 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 5.761.000 USD o el 36,38 % del patrimonio neto.

* Título a interés variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

ABREVIATURAS:

REMIC – Conducto de inversiones hipotecarias inmobiliarias.
BRL – Real brasileño
COP – Peso colombiano
EUR – Euro
GBP – Libra esterlina
MXN – Peso mexicano

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	94,24
Organismos de inversión colectiva	3,58
Instrumentos financieros derivados	0,34
Otros activos	1,84
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)
08 de marzo de 2024	Citi	Compra	USD	439	Venta	GBP	350	$ (3)
08 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	1.200	Venta	GBP	950	1
08 de marzo de 2024	UBS	Compra	GBP	330	Venta	USD	419	(2)
12 de marzo de 2024	Barclays	Compra	CHF	560	Venta	USD	652	(18)
12 de marzo de 2024	HSBC	Compra	CHF	580	Venta	USD	675	(18)
12 de marzo de 2024	Morgan Stanley	Compra	USD	1.319	Venta	CHF	1.140	28
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	21	Venta	USD	26	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	95	Venta	USD	103	1
15 de marzo de 2024	HSBC	Compra	USD	317	Venta	JPY	45.000	16
15 de marzo de 2024	JP Morgan	Compra	JPY	45.000	Venta	USD	316	(15)
19 de abril de 2024	HSBC	Compra	USD	227	Venta	BRL	1.110	4
29 de abril de 2024	JP Morgan	Compra	USD	156	Venta	MXN	2.700	(1)
07 de mayo de 2024	HSBC	Compra	EUR	40	Venta	USD	43	–
07 de mayo de 2024	JP Morgan	Compra	USD	1.272	Venta	EUR	1.170	4
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 86 $)								$ 54
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (64) $)								(57)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 22 $)								$ (3)

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 marzo de 2024	Citi	2	$ 288	$ (4)
U.S. 10 Year Ultra Note junio 2024	Citi	9	1.027	1
Apreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): – $)				$ 1
Depreciación latente de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (123) $)				(4)
Depreciación neta de contratos de futuros (28 de febrero de 2023 (en miles): (123) $)				$ (3)

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

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Valores garantizados por hipotecas: 42,78 %			
1.303	Fannie Mae Pool 'MA4806', 5,000 %, con vencimiento el 01/11/2052	1.265	3,99
637	Fannie Mae Pool 'MA4869', 5,500 %, con vencimiento el 01/01/2053	631	1,99
164	Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	163	0,51
818	Ginnie Mae II Pool 'MA8647', 5,000 %, con vencimiento el 20/02/2053	801	2,53
469	Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500 %, con vencimiento el 20/02/2053	467	1,47
1.146	Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2053	1.139	3,59
1.017	Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, con vencimiento el 20/05/2053	1.011	3,19
490	Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000 %, con vencimiento el 20/06/2053	479	1,51
703	Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500 %, con vencimiento el 20/06/2053	699	2,21
720	Ginnie Mae II Pool 'MA9106', 5,500 %, con vencimiento el 20/08/2053	715	2,26
1.591	Ginnie Mae II Pool 'MA9171', 5,500 %, con vencimiento el 20/09/2053	1.582	4,99
1.587	Ginnie Mae II Pool 'MA9241', 5,500 %, con vencimiento el 20/10/2053	1.577	4,98
1.114	Ginnie Mae II Pool 'MA9305', 5,500 %, con vencimiento el 20/11/2053	1.107	3,49
1.406	Ginnie Mae II Pool 'MA9362', 5,500 %, con vencimiento el 20/12/2053	1.397	4,41
530	Ginnie Mae II Pool 'MA9488', 5,500 %, con vencimiento el 20/02/2054	527	1,66
Total de valores garantizados por hipotecas (coste 13.356 $)		13.560	42,78
Bonos y obligaciones corporativos: 5,55 %			
Estados Unidos: 5,55 %			
260	Dell International LLC / EMC Corp, 3,375 %, con vencimiento el 15/12/2041	190	0,60
70	Devon Energy Corp, 7,875 %, con vencimiento el 30/09/2031	80	0,25
320	Diamondback Energy Inc, 6,250 %, con vencimiento el 15/03/2033	336	1,06
320	Equinix Inc, 2,500 %, con vencimiento el 15/05/2031	267	0,84
300	Golub Capital BDC Inc, 2,500 %, con vencimiento el 24/08/2026	274	0,86
620	Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, con vencimiento el 18/05/2026	614	1,94
		1.761	5,55
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 1.707 $)		1.761	5,55
Bonos y obligaciones del Estado: 45,16 %			
Estados Unidos: 45,16 %			
290	Obligación de Tasa Flotante del Tesoro de los Estados Unidos – Cuando se emite, 5,501 %, con vencimiento el 31/10/2025 *	290	0,92
8.790	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 4,000 %, con vencimiento el 29/02/2028	8.683	27,39
4.550	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 4,875 %, con vencimiento el 31/10/2028	4.662	14,71
700	Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2033	679	2,14
		14.314	45,16
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste 14.160 $)		14.314	45,16
Planes de inversión colectiva: 3,28 %			
1.040	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	1.040	3,28
Total de organismos de inversión colectiva (coste 1.040 $)		1.040	3,28
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 30.263 $)		30.675	96,77
Futuros: 0,05 %			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		14	0,05
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		30.689	96,82
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		30.689	96,82
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		1.010	3,18
Patrimonio		31.699 $	100,00

– Los importes designados como "–" son 0 USD, menos de 1.000 USD, menos de 1.000 acciones o menos del 0,01 %.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	92,78
Organismos de inversión colectiva	3,26
Instrumentos financieros derivados	0,04
Otros activos	3,92
Total de activos	100,00

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 junio 2024	Citi	76	$ 8.677	$ 6
U.S. 5 Year Note (CBT) junio de 2024	Citi	44	4.704	4
U.S. Ultra Bond (CBT) junio 2024	Citi	33	4.220	4
Apreciación latente de contratos de futuros				$ 14
Depreciación latente de contratos de futuros				–
Apreciación neta de contratos de futuros				$ 14

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

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF ClearBridge Value Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Acciones (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias: 96,91 % (28 de febrero de 2023: 99,17 %)			
Vestimenta: 1,63 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
397	Tapestry Inc	18.886	1,63
Bancos: 6,31 % (28 de febrero de 2023: 10,33 %)			
898	Bank of America Corp	30.952	2,68
1.410	First Horizon Corp	19.824	1,71
57	Goldman Sachs Group Inc/The	22.260	1,92
		73.036	6,31
Bebidas: 1,22 % (28 de febrero de 2023: 1,17 %)			
57	Constellation Brands Inc 'A'	14.175	1,22
Biotecnología: 4,75 % (28 de febrero de 2023: 5,57 %)			
33	Argenx SE ADR	12.550	1,08
63	Biogen Inc	13.621	1,18
120	BioNTech SE ADR	10.676	0,92
252	Gilead Sciences Inc	18.161	1,57
		55.008	4,75
Químicos: 1,70 % (28 de febrero de 2023: 2,02 %)			
224	Eastman Chemical Co	19.681	1,70
Carbón: 1,02 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
307	Teck Resources Ltd	11.784	1,02
Servicios comerciales: 2,11 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
290	Block Inc	23.002	1,99
104	R1 RCM Inc	1.460	0,12
		24.462	2,11
Cosmética y cuidado personal: 1,10 % (28 de febrero de 2023: 2,71 %)			
1.017	Coty Inc	12.763	1,10
Distribución y venta al por mayor: 1,41 % (28 de febrero de 2023: 1,10 %)			
JPY 982	Marubeni Corp	16.302	1,41
Servicios financieros diversificados: 5,19 % (28 de febrero de 2023: 2,60 %)			
228	Apollo Global Management Inc	25.476	2,20
166	Capital One Financial Corp	22.863	1,98
249	OneMain Holdings Inc	11.744	1,01
		60.083	5,19
Electricidad: 8,30 % (28 de febrero de 2023: 6,47 %)			
999	AES Corp/The	15.184	1,31
112	Constellation Energy Corp	18.896	1,63
226	NextEra Energy Inc	12.468	1,08
725	PPL Corp	19.122	1,65
559	Vistra Corp	30.456	2,63
		96.126	8,30
Electrónica: 1,19 % (28 de febrero de 2023: 1,32 %)			
81	Atkore Inc	13.718	1,19
Electricidad: 1,74 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
179	ConocoPhillips	20.121	1,74
Energía: Fuentes alternativas: 0,71 % (28 de febrero de 2023: 1,79 %)			
541	Fluence Energy Inc	8.272	0,71
Control ambiental: 1,25 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
80	Clean Harbors Inc	14.473	1,25
Alimentación: 2,08 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
238	Kellanova	13.095	1,13
143	Performance Food Group Co	10.936	0,95
		24.031	2,08
Servicios sanitarios: 1,11 % (28 de febrero de 2023: 2,09 %)			
40	ICON Plc	12.859	1,11
Seguros: 7,89 % (28 de febrero de 2023: 7,60 %)			
445	American International Group Inc	32.419	2,80
783	Corebridge Financial Inc	19.426	1,68
50	Everest Group Ltd	18.566	1,60
1.054	MGIC Investment Corp	20.954	1,81
		91.365	7,89
Internet: 5,60 % (28 de febrero de 2023: 6,89 %)			
111	Expedia Group Inc	15.223	1,31
55	Meta Platforms Inc 'A'	27.034	2,34
285	Uber Technologies Inc	22.596	1,95
		64.853	5,60
Alojamiento: 1,07 % (28 de febrero de 2023: 2,97 %)			
227	Las Vegas Sands Corp	12.388	1,07
Maquinaria: Diversificadas: 1,87 % (28 de febrero de 2023: 1,57 %)			
721	CNH Industrial NV	8.611	0,74
308	Flowserve Corp	13.034	1,13
		21.645	1,87
Minería: 2,17 % (28 de febrero de 2023: 5,43 %)			
666	Freeport-McMoRan Inc	25.169	2,17
Fabricación varios: 1,90 % (28 de febrero de 2023: 1,21 %)			
EUR 111	Siemens AG	21.934	1,90
Petróleo y gas: 7,51 % (28 de febrero de 2023: 9,97 %)			
521	EQT Corp	19.317	1,67
175	Hess Corp	25.547	2,21
562	Noble Corp Plc	23.493	2,03
289	TotalEnergies SE ADR	18.541	1,60
		86.898	7,51
Servicios de petróleo y gas: 1,42 % (28 de febrero de 2023: 3,46 %)			
557	Baker Hughes Co 'A'	16.456	1,42
Farmacéuticas: 6,75 % (28 de febrero de 2023: 4,16 %)			
113	AbbVie Inc	19.874	1,72
232	CVS Health Corp	17.211	1,48
255	Johnson & Johnson	41.107	3,55
		78.192	6,75
Gasoductos: 0,83 % (28 de febrero de 2023: 1,90 %)			
281	Enbridge Inc	9.661	0,83
Bienes inmuebles: 0,77 % (28 de febrero de 2023: 0,86 %)			
117	Howard Hughes Holdings Inc	8.902	0,77
Comercio minorista: 1,13 % (28 de febrero de 2023: 0,78 %)			
86	Target Corp	13.061	1,13
Semiconductores: 3,77 % (28 de febrero de 2023: 2,44 %)			
216	Marvell Technology Inc	15.444	1,34
311	Micron Technology Inc	28.170	2,43
		43.614	3,77
Software: 5,75 % (28 de febrero de 2023: 5,91 %)			
168	Fiserv Inc	25.075	2,17
39	Microsoft Corp	16.163	1,40
226	Oracle Corp	25.271	2,18
		66.509	5,75
Transporte: 4,68 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
140	Canadian Pacific Kansas City Ltd	11.892	1,03
78	Union Pacific Corp	19.694	1,70
152	United Parcel Service Inc 'B'	22.537	1,95
		54.123	4,68
Agua: 0,98 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
GBP 875	United Utilities Group Plc	11.325	0,98
Total de acciones ordinarias (coste 947.434 $)		1.121.875	96,91
Fondos de inversión inmobiliaria: 1,75 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Fondos de inversión inmobiliaria (REIT): 1,75 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
102	American Tower Corp	20.260	1,75
Total de fondos de inversión inmobiliaria (coste 19.062 $)		20.260	1,75
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 966.496 $)		1.142.135	98,66
Contratos de divisas a plazo: 0,05 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		622	0,05
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		1.142.757	98,71
Contratos de divisas a plazo: 0,00 % (28 de febrero de 2023: (0,10 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(6)	–
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(6)	–
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		1.142.751	98,71
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		14.875	1,29
Patrimonio		1.157.626 $	100,00

– Los importes designados como "–" son 0 USD, menos de 1.000 USD, menos de 1.000 acciones o menos del 0,01 %.

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF ClearBridge Value Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

ABREVIATURAS:

ADR – Recibo de depósito estadounidense
EUR – Euro
GBP – Libra esterlina
JPY – Yen japonés

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	97,86
Instrumentos financieros derivados	0,05
Otros activos	2,09
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)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	841	Venta	EUR	781	$ (3)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	10.088	Venta	EUR	9.313	17
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	38	Venta	SGD	49	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	21	Venta	SGD	28	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	1	Venta	USD	1	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	2.133	Venta	USD	1.589	(2)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	110.672	Venta	USD	119.085	605
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	198	Venta	USD	214	(1)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 10 $)								$ 622
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (976) $)								(6)
Apreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (966) $)								$ 616

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias: 98,28 % (28 de febrero de 2023: 93,97 %)		
Bancos: 5,08 % (28 de febrero de 2023: 5,28 %)		
84 Bank of America Corp	2.889	1,36
30 JPMorgan Chase & Co	5.601	2,65
54 US Bancorp	2.259	1,07
	10.749	5,08
Bebidas: 2,29 % (28 de febrero de 2023: 2,85 %)		
37 Coca-Cola Co/The	2.212	1,05
16 PepsiCo Inc	2.630	1,24
	4.842	2,29
Materiales de construcción: 1,03 % (28 de febrero de 2023: 0,85 %)		
8 Vulcan Materials Co	2.169	1,03
Químicos: 3,50 % (28 de febrero de 2023: 4,64 %)		
8 Ecolab Inc	1.759	0,83
3 Linde Plc	1.132	0,54
18 PPG Industries Inc	2.607	1,23
6 Sherwin-Williams Co/The	1.895	0,90
	7.393	3,50
Servicios comerciales: 1,72 % (28 de febrero de 2023: 2,23 %)		
15 Automatic Data Processing Inc	3.640	1,72
Informática: 5,17 % (28 de febrero de 2023: 5,41 %)		
61 Apple Inc	10.937	5,17
Cosmética y cuidado personal: 1,39 % (28 de febrero de 2023: 1,47 %)		
19 Procter & Gamble Co/The	2.947	1,39
Servicios financieros diversificados: 5,03 % (28 de febrero de 2023: 4,58 %)		
9 CME Group Inc	1.907	0,90
16 Intercontinental Exchange Inc	2.236	1,06
23 Visa Inc 'A'	6.483	3,07
	10.626	5,03
Electricidad: 1,06 % (28 de febrero de 2023: 1,27 %)		
16 NextEra Energy Inc	862	0,41
20 Sempra	1.388	0,65
	2.250	1,06
Componentes y equipos eléctricos: 2,74 % (28 de febrero de 2023: 0,89 %)		
9 Eaton Corp Plc	2.650	1,25
30 Emerson Electric Co	3.151	1,49
	5.801	2,74
Electrónica: 2,09 % (28 de febrero de 2023: 2,46 %)		
22 Honeywell International Inc	4.428	2,09
Control ambiental: 1,89 % (28 de febrero de 2023: 1,68 %)		
19 Waste Management Inc	3.995	1,89
Alimentación: 1,16 % (28 de febrero de 2023: 1,29 %)		
4 McCormick & Co Inc/MD	281	0,13
30 Mondelez International Inc	2.164	1,03
	2.445	1,16
Productos sanitarios: 2,79 % (28 de febrero de 2023: 3,08 %)		
8 Stryker Corp	2.670	1,26
6 Thermo Fisher Scientific Inc	3.225	1,53
	5.895	2,79
Servicios sanitarios: 1,96 % (28 de febrero de 2023: 3,11 %)		
8 UnitedHealth Group Inc	4.151	1,96
Seguros: 8,08 % (28 de febrero de 2023: 7,66 %)		
– Berkshire Hathaway Inc	8.018	3,79
20 Hartford Financial Services Group Inc/The	1.959	0,93
13 Progressive Corp/The	2.532	1,20
21 Travelers Cos Inc/The	4.568	2,16
	17.077	8,08
Internet: 10,89 % (28 de febrero de 2023: 5,69 %)		
23 Alphabet Inc	3.261	1,54
28 Alphabet Inc 'A'	3.865	1,83
47 Amazon.com Inc	8.268	3,91
9 Meta Platforms Inc 'A'	4.478	2,12
5 Netflix Inc	3.151	1,49
	23.023	10,89
Medios: 1,67 % (28 de febrero de 2023: 1,98 %)		
53 Comcast Corp	2.271	1,07
11 Walt Disney Co/The	1.258	0,60
	3.529	1,67
Petróleo y gas: 1,16 % (28 de febrero de 2023: 1,53 %)		
10 Pioneer Natural Resources Co	2.447	1,16
Embalaje y envases: 0,67 % (28 de febrero de 2023: 0,65 %)		
19 Crown Holdings Inc	1.423	0,67
Farmacéuticas: 9,39 % (28 de febrero de 2023: 9,05 %)		
18 AbbVie Inc	3.075	1,45
9 Becton Dickinson & Co	2.197	1,04
6 Eli Lilly & Co	4.711	2,23
25 Johnson & Johnson	4.053	1,92
46 Merck & Co Inc	5.817	2,75
	19.853	9,39
Gasoductos: 0,70 % (28 de febrero de 2023: 0,73 %)		
86 Kinder Morgan Inc	1.488	0,70
Comercio minorista: 5,30 % (28 de febrero de 2023: 5,87 %)		
2 Costco Wholesale Corp	1.583	0,75
6 Home Depot Inc/The	2.171	1,02
49 TJX Cos Inc/The	4.821	2,28
45 Walmart Inc	2.636	1,25
	11.211	5,30
Semiconductores: 5,32 % (28 de febrero de 2023: 1,79 %)		
3 ASML Holding NV	2.964	1,40
17 Intel Corp	718	0,34
15 Marvell Technology Inc	1.073	0,51
8 NVIDIA Corp	6.504	3,07
	11.259	5,32
Software: 12,46 % (28 de febrero de 2023: 9,29 %)		
6 Adobe Inc	3.289	1,56
46 Microsoft Corp	19.011	8,99
26 Oracle Corp	2.940	1,39
2 Synopsys Inc	1.103	0,52
	26.343	12,46
Telecomunicaciones: 1,42 % (28 de febrero de 2023: 2,55 %)		
7 Arista Networks Inc	1.866	0,89
7 T-Mobile US Inc	1.125	0,53
	2.991	1,42
Transporte: 2,32 % (28 de febrero de 2023: 2,88 %)		
16 Canadian Pacific Kansas City Ltd	1.385	0,66
5 Union Pacific Corp	1.292	0,61
15 United Parcel Service Inc 'B'	2.226	1,05
	4.903	2,32
Total de acciones ordinarias (coste 140.360 $)	207.815	98,28
Fondos de inversión inmobiliaria: 1,12 % (28 de febrero de 2023: 1,32 %)		
Fondos de inversión inmobiliaria (REIT): 1,12 % (28 de febrero de 2023: 1,32 %)		
12 American Tower Corp	2.381	1,12
Total de fondos de inversión inmobiliaria (coste 2.230 $)	2.381	1,12
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	210.196	99,40
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	210.196	99,40
Excedente de otros activos respecto a los pasivos	1.260	0,60
Patrimonio	211.456 $	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 los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	98,99
Otros activos	1,01
Total de activos	100,00

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Acciones (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias: 96,11 % (28 de febrero de 2023: 94,00 %)			
Vestimenta: 1,27 % (28 de febrero de 2023: 2,34 %)			
228	NIKE Inc	23.665	1,27
Fabricantes de automóviles: 0,53 % (28 de febrero de 2023: 0,78 %)			
49	Tesla Inc	9.867	0,53
Componentes y equipos de automóvil: 0,75 % (28 de febrero de 2023: 1,59 %)			
177	Aptiv Plc	14.066	0,75
Bebidas: 1,52 % (28 de febrero de 2023: 2,54 %)			
483	Monster Beverage Corp	28.516	1,52
Químicos: 1,87 % (28 de febrero de 2023: 1,40 %)			
105	Sherwin-Williams Co/The	34.952	1,87
Servicios comerciales: 2,63 % (28 de febrero de 2023: 4,38 %)			
308	PayPal Holdings Inc	18.576	0,99
72	S&P Global Inc	30.736	1,64
		49.312	2,63
Informática: 3,91 % (28 de febrero de 2023: 4,50 %)			
405	Apple Inc	73.229	3,91
Cosmética y cuidado personal: 1,26 % (28 de febrero de 2023: 1,77 %)			
159	Estee Lauder Cos., Inc. (The) 'A'	23.583	1,26
Distribución y venta al por mayor: 2,52 % (28 de febrero de 2023: 2,87 %)			
48	WW Grainger Inc	47.199	2,52
Servicios financieros diversificados: 5,29 % (28 de febrero de 2023: 5,87 %)			
94	Intercontinental Exchange Inc	12.930	0,69
305	Visa Inc 'A'	86.117	4,60
		99.047	5,29
Electricidad: 0,85 % (28 de febrero de 2023: 0,97 %)			
289	NextEra Energy Inc	15.953	0,85
Componentes y equipos eléctricos: 2,34 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
152	Eaton Corp Plc	43.869	2,34
Electrónica: 1,44 % (28 de febrero de 2023: 2,13 %)			
136	Honeywell International Inc	27.029	1,44
Productos sanitarios: 7,98 % (28 de febrero de 2023: 8,51 %)			
343	Alcon Inc	29.001	1,55
102	Intuitive Surgical Inc	39.435	2,11
97	Stryker Corp	33.741	1,80
83	Thermo Fisher Scientific Inc	47.266	2,52
		149.443	7,98
Servicios sanitarios: 2,70 % (28 de febrero de 2023: 3,99 %)			
102	UnitedHealth Group Inc	50.449	2,70
Seguros: 1,40 % (28 de febrero de 2023: 1,78 %)			
130	Marsh & McLennan Cos Inc	26.210	1,40
Internet: 22,55 % (28 de febrero de 2023: 16,25 %)			
826	Amazon.com Inc	145.878	7,79
237	Meta Platforms Inc 'A'	116.013	6,20
120	Netflix Inc	72.001	3,84
149	Palo Alto Networks Inc	46.216	2,47
530	Uber Technologies Inc	42.090	2,25
		422.198	22,55
Farmacéuticas: 3,25 % (28 de febrero de 2023: 4,30 %)			
43	Eli Lilly & Co	32.135	1,71
145	Zoetis Inc	28.777	1,54
		60.912	3,25
Comercio minorista: 1,56 % (28 de febrero de 2023: 1,08 %)			
192	Target Corp	29.268	1,56
Semiconductores: 11,28 % (28 de febrero de 2023: 7,23 %)			
41	ASML Holding NV	38.646	2,06
433	Intel Corp	18.623	1,00
194	NVIDIA Corp	153.866	8,22
		211.135	11,28
Software: 16,82 % (28 de febrero de 2023: 15,08 %)			
69	Adobe Inc	38.820	2,07
97	Atlassian Corp	20.048	1,07
39	Intuit Inc	25.638	1,37
373	Microsoft Corp	154.079	8,23
148	Salesforce Inc	45.616	2,44
105	Workday Inc 'A'	30.814	1,64
		315.015	16,82
Transporte: 2,39 % (28 de febrero de 2023: 2,09 %)			
110	Union Pacific Corp	27.957	1,49
114	United Parcel Service Inc 'B'	16.852	0,90
		44.809	2,39
Total de acciones ordinarias (coste 1.103.013 $)		1.799.726	96,11
Fondos de inversión inmobiliaria: 1,50 % (28 de febrero de 2023: 1,68 %)			
Fondos de inversión inmobiliaria (REIT): 1,50 % (28 de febrero de 2023: 1,68 %)			
32	Equinix Inc	28.138	1,50
Total de fondos de inversión inmobiliaria (coste 16.028 $)		28.138	1,50
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 1.119.041 $)		1.827.864	97,61
Contratos de divisas a plazo: 0,02 % (28 de febrero de 2023: 0,02 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		392	0,02
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		1.828.256	97,63
Contratos de divisas a plazo: (0,02 %) (28 de febrero de 2023: (0,12 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(312)	(0,02)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(312)	(0,02)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		1.827.944	97,61
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		44.656	2,39
Patrimonio		1.872.600 $	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 los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	96,40
Instrumentos financieros derivados	0,02
Otros activos	3,58
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)
04 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	29.263	Venta	BRL	145.490	$	9
04 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	BRL	140.886	Venta	USD	28.607		(278)
04 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	BRL	4.603	Venta	USD	919		6
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	695	Venta	EUR	641		2
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	931	Venta	EUR	864		(4)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	68.815	Venta	USD	74.046		375
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	14.958	Venta	USD	16.200		(22)
02 de abril de 2024	BNY Mellon	Compra	BRL	149.723	Venta	USD	30.021		(8)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 286 $)								$	392
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (1.551) $)									(312)
Apreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (1.265) $)								$	80

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Acciones (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias: 98,91 % (28 de febrero de 2023: 95,22 %)			
Bebidas: 1,50 % (28 de febrero de 2023: 1,70 %)			
21	Diageo Plc ADR	3.105	1,50
Biotecnología: 12,44 % (28 de febrero de 2023: 14,46 %)			
20	Biogen Inc	4.302	2,08
82	Ionis Pharmaceuticals Inc	3.692	1,78
41	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	2.144	1,03
37	Vertex Pharmaceuticals Inc	15.657	7,55
		25.795	12,44
Materiales de construcción: 2,53 % (28 de febrero de 2023: 3,56 %)			
89	Johnson Controls International plc	5.241	2,53
Servicios comerciales: 1,79 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
4	Cintas Corp	2.766	1,33
6	Paylocity Holding Corp	945	0,46
		3.711	1,79
Informática: 11,88 % (28 de febrero de 2023: 6,43 %)			
13	Accenture Plc 'A'	4.973	2,40
46	Crowdstrike Holdings Inc	15.010	7,24
31	Seagate Technology Holdings Plc	2.851	1,37
30	Western Digital Corp	1.808	0,87
		24.642	11,88
Cosmética y cuidado personal: 0,25 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
3	elf Beauty Inc	521	0,25
Distribución y venta al por mayor: 1,08 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
2	WW Grainger Inc	2.244	1,08
Servicios financieros diversificados: 0,74 % (28 de febrero de 2023: 0,67 %)			
21	Cohen & Steers Inc	1.530	0,74
Electrónica: 5,22 % (28 de febrero de 2023: 6,57 %)			
76	TE Connectivity Ltd	10.837	5,22
Entretenimiento: 4,05 % (28 de febrero de 2023: 4,72 %)			
53	Madison Square Garden Entertainment Corp 'A'	2.032	0,98
34	Madison Square Garden Sports Corp	6.379	3,07
		8.411	4,05
Productos sanitarios: 1,07 % (28 de febrero de 2023: 2,10 %)			
14	Insulet Corp	2.225	1,07
Servicios sanitarios: 7,81 % (28 de febrero de 2023: 9,41 %)			
16	Charles River Laboratories International Inc	4.161	2,01
24	UnitedHealth Group Inc	12.041	5,80
		16.202	7,81
Mobiliario doméstico: 1,48 % (28 de febrero de 2023: 1,46 %)			
38	Dolby Laboratories Inc 'A'	3.077	1,48
Internet: 6,61 % (28 de febrero de 2023: 5,83 %)			
34	Airbnb Inc	5.371	2,59
29	Etsy Inc	2.110	1,02
10	Match Group Inc	363	0,18
3	Meta Platforms Inc 'A'	1.471	0,71
120	Pinterest Inc	4.386	2,11
		13.701	6,61
Medios: 5,38 % (28 de febrero de 2023: 10,44 %)			
180	Comcast Corp	7.725	3,72
47	Liberty Media Corp-Liberty Formula One	3.437	1,66
		11.162	5,38
Minería: 1,94 % (28 de febrero de 2023: 1,49 %)			
106	Freeport-McMoRan Inc	4.019	1,94
Farmacéuticas: 2,15 % (28 de febrero de 2023: 2,14 %)			
25	AbbVie Inc	4.466	2,15
Comercio minorista: 3,57 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
26	Starbucks Corp	2.419	1,17
45	TJX Cos Inc/The	4.499	2,17
2	Tractor Supply Co	483	0,23
		7.401	3,57
Semiconductores: 9,12 % (28 de febrero de 2023: 11,40 %)			
12	Broadcom Inc	16.142	7,79
106	Wolfspeed Inc	2.764	1,33
		18.906	9,12
Software: 18,15 % (28 de febrero de 2023: 12,84 %)			
50	Autodesk Inc	12.799	6,17
31	DocuSign Inc 'A'	1.650	0,80
57	Doximity Inc	1.604	0,77
16	HubSpot Inc	10.161	4,90
5	MongoDB Inc 'A'	2.147	1,04
6	ServiceNow Inc	4.387	2,12
26	Snowflake Inc	4.884	2,35
		37.632	18,15
Telecomunicaciones: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
24	GCI Liberty, Inc. Escrow ∞	–	–
Transporte: 0,15 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
1	Old Dominion Freight Line Inc	310	0,15
Total de acciones ordinarias (coste 132.574 $)		205.138	98,91
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 132.574 $)		205.138	98,91
Contratos de divisas a plazo: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		7	–
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		205.145	98,91
Contratos de divisas a plazo: (0,01 %) (28 de febrero de 2023: (0,10 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(22)	(0,01)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(22)	(0,01)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		205.123	98,90
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		2.267	1,10
Patrimonio		207.390 $	100,00

– Los importes designados como "–" son 0 USD, menos de 1.000 USD, menos de 1.000 acciones o menos del 0,01 %.

∞ El título es valorado de buena fe y a un valor razonable por el Comité de Valoración o según el criterio de este.

ABREVIATURAS:

ADR – Recibo de depósito estadounidense

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	98,58
Instrumentos financieros derivados	–
Otros activos	1,42
Total de activos	100,00

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(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 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	99	Venta	USD	65	$	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	49	Venta	AUD	75		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	65	Venta	AUD	100		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	3	Venta	EUR	3		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	8	Venta	GBP	6		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	1	Venta	SEK	11		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	1	Venta	SEK	7		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	212	Venta	SGD	284		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	2	Venta	SGD	2		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	–	Venta	USD	–		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	44	Venta	USD	48		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	51	Venta	USD	33		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CHF	53	Venta	USD	61		(1)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CNH	5.938	Venta	USD	827		(2)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	832	Venta	USD	895		5
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	189	Venta	USD	238		1
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	6	Venta	USD	8		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SEK	313	Venta	USD	30		1
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	7.108	Venta	USD	5.294		(9)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	5.756	Venta	USD	3.753		(10)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SEK	–	Venta	USD	–		–
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 4 $)								$	7
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (229) $)									(22)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (225) $)								$	(15)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias: 78,82 % (28 de febrero de 2023: 78,26 %)		
Industria aeroespacial y defensa: 1,06 % (28 de febrero de 2023: 2,40 %)		
2 L3Harris Technologies Inc	381	1,06
Bancos: 2,59 % (28 de febrero de 2023: 3,73 %)		
4 JPMorgan Chase & Co	737	2,05
5 US Bancorp	193	0,54
	930	2,59
Bebidas: 1,97 % (28 de febrero de 2023: 1,83 %)		
12 Coca-Cola Co/The	706	1,97
Biotecnología: 1,30 % (28 de febrero de 2023: 1,29 %)		
2 Amgen Inc	466	1,30
Químicos: 0,49 % (28 de febrero de 2023: 2,33 %)		
7 Huntsman Corp	175	0,49
Informática: 4,12 % (28 de febrero de 2023: 4,70 %)		
8 Apple Inc	1.482	4,12
Cosmética y cuidado personal: 3,29 % (28 de febrero de 2023: 1,56 %)		
5 Colgate-Palmolive Co	413	1,15
5 Procter & Gamble Co/The	771	2,14
	1.184	3,29
Servicios financieros diversificados: 4,35 % (28 de febrero de 2023: 3,69 %)		
45 Blue Owl Capital Inc 'A'	802	2,23
1 CME Group Inc	264	0,74
4 Intercontinental Exchange Inc	497	1,38
	1.563	4,35
Electricidad: 4,59 % (28 de febrero de 2023: 4,78 %)		
5 DTE Energy Co	543	1,51
20 PPL Corp	517	1,44
8 Sempra	590	1,64
	1.650	4,59
Componentes y equipos eléctricos: 1,39 % (28 de febrero de 2023: 0,94 %)		
5 Emerson Electric Co	501	1,39
Electrónica: 0,56 % (28 de febrero de 2023: 0,50 %)		
2 Amphenol Corp 'A'	202	0,56
Energía: Fuentes alternativas: 1,41 % (28 de febrero de 2023: 0,97 %)		
18 NextEra Energy Partners LP	507	1,41
Alimentación: 1,50 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)		
8 McCormick & Co Inc/MD	539	1,50
Productos sanitarios: 0,86 % (28 de febrero de 2023: 1,60 %)		
3 Abbott Laboratories	308	0,86
Seguros: 0,44 % (28 de febrero de 2023: 0,88 %)		
1 Chubb Ltd	157	0,44
Internet: 0,79 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)		
1 Meta Platforms Inc 'A'	284	0,79
Organismos de inversión colectiva: 1,58 % (28 de febrero de 2023: 1,97 %)		
23 Ares Capital Corp	467	1,30
7 Trinity Capital Inc	101	0,28
	568	1,58
Maquinaria: Diversificadas: 1,37 % (28 de febrero de 2023: 1,89 %)		
5 Otis Worldwide Corp	492	1,37
Petróleo y gas: 0,84 % (28 de febrero de 2023: 0,48 %)		
1 Pioneer Natural Resources Co	300	0,84
Farmacéuticas: 8,17 % (28 de febrero de 2023: 6,46 %)		
3 AbbVie Inc	596	1,66
– Eli Lilly & Co	324	0,90
3 Johnson & Johnson	549	1,53
10 Merck & Co Inc	1.251	3,48
8 Pfizer Inc	216	0,60
	2.936	8,17
Gasoductos: 11,77 % (28 de febrero de 2023: 12,16 %)		
15 Enbridge Inc	522	1,45
36 Kinder Morgan Inc	624	1,73
10 ONEOK Inc	780	2,17
60 Plains GP Holdings LP, MLP 'A' #	1.037	2,89
35 Williams Cos Inc/The	1.267	3,53
	4.230	11,77
Capital privado: 4,35 % (28 de febrero de 2023: 1,83 %)		
12 Blackstone Inc	1.564	4,35
Comercio minorista: 0,82 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)		
2 Target Corp	293	0,82
Semiconductores: 7,56 % (28 de febrero de 2023: 7,20 %)		
– ASML Holding NV	344	0,96
1 Broadcom Inc	1.188	3,30
5 Marvell Technology Inc	382	1,06
1 NXP Semiconductors NV	200	0,56
4 QUALCOMM Inc	603	1,68
	2.717	7,56
Software: 7,48 % (28 de febrero de 2023: 9,72 %)		
4 Microsoft Corp	1.508	4,20
9 Oracle Corp	1.000	2,78
1 Paychex Inc	181	0,50
	2.689	7,48
Telecomunicaciones: 1,31 % (28 de febrero de 2023: 2,44 %)		
3 T-Mobile US Inc	472	1,31
Transporte: 2,86 % (28 de febrero de 2023: 1,45 %)		
3 Union Pacific Corp	743	2,07
2 United Parcel Service Inc 'B'	286	0,79
	1.029	2,86
Total de acciones ordinarias (coste 19.313 $)	28.325	78,82
Acciones preferentes: 5,31 % (28 de febrero de 2023: 6,35 %)		
Servicios financieros diversificados: 2,92 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)		
16 Apollo Global Management Inc	1.048	2,92
Electricidad: 1,72 % (28 de febrero de 2023: 1,34 %)		
18 NextEra Energy Inc	619	1,72
Gas: 0,34 % (28 de febrero de 2023: 0,38 %)		
3 Spire Inc, Serie A	122	0,34
Medios: 0,33 % (28 de febrero de 2023: 0,69 %)		
8 Paramount Global, Serie A	119	0,33
Total de acciones preferentes (coste 2,360 $)	1.908	5,31
Fondos de inversión inmobiliaria: 15,65 % (28 de febrero de 2023: 8,91 %)		
Fondos de inversión inmobiliaria (REIT): 15,65 % (28 de febrero de 2023: 8,91 %)		
22 AGNC Investment Corp	210	0,58
17 American Homes 4 Rent 'A'	642	1,79
3 American Tower Corp	601	1,67
15 Apartment Income REIT Corp	470	1,31
4 Boston Properties Inc	269	0,75
4 Digital Realty Trust Inc	611	1,70
1 Equinix Inc	581	1,62
8 Equity LifeStyle Properties Inc	564	1,57
4 Extra Space Storage Inc	527	1,46
8 Gaming and Leisure Properties Inc	383	1,07
9 Global Medical REIT Inc	80	0,22
5 Prologis Inc	686	1,91
	5.624	15,65
Total de fondos de inversión inmobiliaria (coste 5.282 $)	5.624	15,65
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 26.955 $)	35.857	99,78
Contratos de divisas a plazo: 0,01 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)		
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	3	0,01
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	35.860	99,79
Contratos de divisas a plazo: (0,01 %) (28 de febrero de 2023: (0,14 %))		
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(3)	(0,01)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	(3)	(0,01)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	35.857	99,78
Excedente de otros activos respecto a los pasivos	79	0,22
Patrimonio	35.936 $	100,00

– Los importes designados como "–" son 0 USD, menos de 1.000 USD, menos de 1.000 acciones o menos del 0,01 %.

Sociedad colectiva comanditaria

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	99,23
Instrumentos financieros derivados	0,01
Otros activos	0,76
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)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	1	Venta	SGD	2	$ –
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	6	Venta	SGD	9	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	306	Venta	USD	228	(1)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	520	Venta	USD	559	3
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CNH	448	Venta	USD	62	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	1.133	Venta	USD	739	(2)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CNH	15	Venta	USD	2	–
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 1 $)								$ 3
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (56) $)								(3)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (55) $)								$ –

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Acciones (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias: 96,71 % (28 de febrero de 2023: 96,28 %)			
Vestimenta: 1,44 % (28 de febrero de 2023: 1,61 %)			
189	NIKE Inc	19.626	1,44
Componentes y equipos de automóvil: 0,66 % (28 de febrero de 2023: 1,25 %)			
113	Aptiv Plc	8.987	0,66
Bancos: 5,73 % (28 de febrero de 2023: 6,59 %)			
288	JPMorgan Chase & Co	53.536	3,92
288	Morgan Stanley	24.770	1,81
		78.306	5,73
Biotecnología: 2,35 % (28 de febrero de 2023: 3,47 %)			
136	BioMarin Pharmaceutical Inc	11.727	0,86
283	Gilead Sciences Inc	20.396	1,49
		32.123	2,35
Materiales de construcción: 4,17 % (28 de febrero de 2023: 3,27 %)			
111	Trane Technologies Plc	31.229	2,29
281	Trex Co Inc	25.754	1,88
		56.983	4,17
Químicos: 1,89 % (28 de febrero de 2023: 1,43 %)			
115	Ecolab Inc	25.842	1,89
Informática: 7,40 % (28 de febrero de 2023: 6,53 %)			
68	Accenture Plc 'A'	25.296	1,85
361	Apple Inc	65.157	4,77
113	Dell Technologies Inc	10.663	0,78
		101.116	7,40
Cosmética y cuidado personal: 3,51 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
289	Colgate-Palmolive Co	24.994	1,83
144	Procter & Gamble Co/The	22.906	1,68
		47.900	3,51
Distribución y venta al por mayor: 0,99 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
260	LKQ Corp	13.571	0,99
Servicios financieros diversificados: 3,74 % (28 de febrero de 2023: 5,42 %)			
27	BlackRock Inc	21.786	1,59
104	Visa Inc 'A'	29.297	2,15
		51.083	3,74
Electricidad: 0,74 % (28 de febrero de 2023: 1,29 %)			
156	Ormat Technologies Inc	10.139	0,74
Componentes y equipos eléctricos: 3,54 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
167	Eaton Corp Plc	48.352	3,54
Energía: Fuentes alternativas: 1,55 % (28 de febrero de 2023: 4,53 %)			
55	Enphase Energy Inc	6.983	0,51
616	Shoals Technologies Group Inc 'A'	7.907	0,58
93	SolarEdge Technologies Inc	6.257	0,46
		21.147	1,55
Control ambiental: 1,58 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
250	Veralto Corp	21.573	1,58
Alimentación: 0,98 % (28 de febrero de 2023: 1,68 %)			
195	McCormick & Co Inc/MD	13.393	0,98
Herramientas manuales/mecánicas: 1,95 % (28 de febrero de 2023: 2,35 %)			
155	Regal Rexnord Corp	26.574	1,95
Productos sanitarios: 5,00 % (28 de febrero de 2023: 5,15 %)			
190	Cooper Cos Inc/The	17.797	1,30
120	Danaher Corp	30.392	2,23
273	Hologic Inc	20.136	1,47
		68.325	5,00
Servicios sanitarios: 2,12 % (28 de febrero de 2023: 2,71 %)			
59	UnitedHealth Group Inc	28.985	2,12
Seguros: 3,86 % (28 de febrero de 2023: 4,57 %)			
294	Hartford Financial Services Group Inc/The	28.092	2,06
112	Travelers Cos Inc/The	24.645	1,80
		52.737	3,86
Internet: 5,23 % (28 de febrero de 2023: 5,25 %)			
328	Alphabet Inc 'A'	45.369	3,32
8	Booking Holdings Inc	25.986	1,91
		71.355	5,23
Maquinaria: Diversificadas: 0,67 % (28 de febrero de 2023: 2,19 %)			
25	Deere & Co	9.081	0,67
Medios: 1,74 % (28 de febrero de 2023: 1,56 %)			
213	Walt Disney Co/The	23.730	1,74
Embalaje y envases: 1,60 % (28 de febrero de 2023: 1,50 %)			
340	Ball Corp	21.783	1,60
Farmacéuticas: 5,60 % (28 de febrero de 2023: 5,46 %)			
350	CVS Health Corp	25.981	1,90
142	Johnson & Johnson	22.916	1,68
230	Novo Nordisk A/S, ADR	27.541	2,02
		76.438	5,60
Comercio minorista: 7,62 % (28 de febrero de 2023: 5,83 %)			
58	Costco Wholesale Corp	42.743	3,13
91	Home Depot Inc/The	34.413	2,52
114	Williams-Sonoma Inc	26.851	1,97
		104.007	7,62
Semiconductores: 5,97 % (28 de febrero de 2023: 3,66 %)			
23	ASML Holding NV	21.682	1,59
18	Broadcom Inc	23.523	1,72
27	Lam Research Corp	25.529	1,87
150	Marvell Technology Inc	10.740	0,79
		81.474	5,97
Software: 12,28 % (28 de febrero de 2023: 8,95 %)			
280	Microsoft Corp	115.659	8,47
94	Salesforce Inc	28.987	2,12
40	Synopsys Inc	23.053	1,69
		167.699	12,28
Telecomunicaciones: 1,36 % (28 de febrero de 2023: 1,86 %)			
385	Cisco Systems Inc	18.600	1,36
Agua: 1,44 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
166	American Water Works Co Inc	19.662	1,44
Total de acciones ordinarias (coste 1.137.550 $)		1.320.591	96,71
Fondos de inversión inmobiliaria: 3,45 % (28 de febrero de 2023: 3,05 %)			
Fondos de inversión inmobiliaria (REIT): 3,45 % (28 de febrero de 2023: 3,05 %)			
26	Equinix Inc	22.733	1,66
183	Prologis Inc	24.392	1,79
		47.125	3,45
Total de fondos de inversión inmobiliaria (coste 39,487 $)		47.125	3,45
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 1.177.037 $)		1.367.716	100,16
Contratos de divisas a plazo: 0,03 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		370	0,03
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		1.368.086	100,19
Contratos de divisas a plazo: 0,00 % (28 de febrero de 2023: (0,05 %))			
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)		(16)	–
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		(16)	–
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		1.368.070	100,19
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		(2.560)	(0,19)
Patrimonio		1.365.510 $	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

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	98,44
Instrumentos financieros derivados	0,03
Otros activos	1,53
Total de activos	100,00

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(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)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	377	Venta	EUR	347	$ –
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	533	Venta	EUR	500	(3)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	1.603	Venta	GBP	1.275	(6)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	1.203	Venta	GBP	951	2
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	1.763	Venta	USD	2.229	(7)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	96	Venta	USD	103	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	28.543	Venta	USD	30.716	153
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	49.346	Venta	USD	62.082	215
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 22 $)								$ 370
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (840) $)								(16)
Apreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (818) $)								$ 354

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF ClearBridge Global Growth Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Acciones (en miles)			Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias: 99,19 % (28 de febrero de 2023: 97,30 %)				
Australia: 1,03 % (28 de febrero de 2023: 1,09 %)				
AUD	18	Brambles Ltd	172	1,03
Brasil: 1,41 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
	–	MercadoLibre Inc	236	1,41
Canadá: 3,60 % (28 de febrero de 2023: 3,76 %)				
CAD	–	Constellation Software Inc/Canada	220	1,31
CAD	2	Loblaw Companies Ltd	212	1,27
	2	Shopify Inc 'A'	169	1,02
			601	3,60
China: 0,36 % (28 de febrero de 2023: 3,72 %)				
	3	Zai Lab Ltd. ADR	60	0,36
Dinamarca: 1,95 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
DKK	2	Novo Nordisk A/S	281	1,68
DKK	–	Zealand Pharma A/S	45	0,27
			326	1,95
Francia: 2,03 % (28 de febrero de 2023: 3,20 %)				
EUR	1	Edenred SE	59	0,35
EUR	–	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	280	1,68
			339	2,03
Alemania: 3,08 % (28 de febrero de 2023: 4,64 %)				
EUR	10	Deutsche Telekom AG	231	1,38
EUR	2	SAP SE	284	1,70
			515	3,08
Hong Kong: 0,61 % (28 de febrero de 2023: 2,63 %)				
HKD	13	AIA Group Ltd	103	0,61
India: 1,08 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
	3	HDFC Bank Ltd ADR	180	1,08
Israel: 1,02 % (28 de febrero de 2023: 0,93 %)				
	1	Nice Ltd ADR	170	1,02
Italia: 0,86 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
EUR	–	Ferrari NV	143	0,86
Japón: 5,19 % (28 de febrero de 2023: 5,48 %)				
JPY	1	Daiichi Sankyo Co Ltd	35	0,21
JPY	1	Hoya Corp	169	1,01
JPY	–	Keyence Corp	136	0,81
JPY	11	Olympus Corp	161	0,96
JPY	–	SMC Corp	176	1,05
JPY	2	Sony Group Corp	192	1,15
			869	5,19
México: 0,52 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
MXN	21	Grupo Bimbo SAB de CV	87	0,52
Países Bajos: 3,14 % (28 de febrero de 2023: 1,61 %)				
	–	Argenx SE ADR	176	1,05
EUR	–	ASML Holding NV	349	2,09
			525	3,14
España: 0,72 % (28 de febrero de 2023: 0,78 %)				
EUR	3	Industria de Diseno Textil SA	120	0,72
Suecia: 0,59 % (28 de febrero de 2023: 1,02 %)				
SEK	8	Hexagon AB	99	0,59
Suiza: 1,02 % (28 de febrero de 2023: 1,84 %)				
CHF	2	Alcon Inc	171	1,02
Taiwán: 2,09 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
TWD	16	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	350	2,09
Reino Unido: 1,96 % (28 de febrero de 2023: 4,29 %)				
GBP	1	London Stock Exchange Group Plc	159	0,95
GBP	4	RELX Plc	169	1,01
			328	1,96
Estados Unidos: 66,93 % (28 de febrero de 2023: 59,75 %)				
	1	AbbVie Inc	125	0,75
	1	Accenture Plc 'A'	291	1,74
	–	Adobe Inc	241	1,44
	3	Alphabet Inc 'A'	454	2,72
	3	Amazon.com Inc	578	3,46
	1	Amphenol Corp 'A'	130	0,78
	4	Apple Inc	645	3,86
	1	Chubb Ltd	137	0,82
	22	Coty Inc	271	1,62
	3	CRH Plc	252	1,51
	1	Dexcom Inc	144	0,86
	1	Eli Lilly & Co	536	3,20
	1	Guidewire Software Inc	111	0,67
GBP	55	Haleon Plc	232	1,39
	2	Intercontinental Exchange Inc	342	2,04
	–	Intuit Inc	233	1,39
	–	Marsh & McLennan Cos Inc	76	0,46
	6	Marvell Technology Inc	400	2,39
	–	McKesson Corp	102	0,61
	1	Meta Platforms Inc 'A'	428	2,56
	2	Microsoft Corp	813	4,86
	–	Monday.com Ltd	84	0,50
	–	Monolithic Power Systems Inc	64	0,38
	1	MoonLake Immunotherapeutics 'A'	45	0,27
CHF	1	Nestle SA	127	0,76
	1	Netflix Inc	375	2,25
	3	NextEra Energy Inc	139	0,83
	1	NVIDIA Corp	463	2,77
	–	Old Dominion Freight Line Inc	49	0,29
	3	Pinterest Inc	113	0,68
	1	S&P Global Inc	244	1,46
	1	Salesforce Inc	327	1,96
	–	Stryker Corp	121	0,72
	1	Target Corp	167	1,00
	1	Thermo Fisher Scientific Inc	308	1,84
	2	TJX Cos Inc/The	160	0,96
	–	TransDigm Group Inc	176	1,05
	1	Trex Co Inc	134	0,80
	3	Uber Technologies Inc	251	1,50
	1	Union Pacific Corp	362	2,16
	–	UnitedHealth Group Inc	155	0,93
	–	Vertex Pharmaceuticals Inc	185	1,11
	1	Visa Inc 'A'	276	1,65
	2	Walt Disney Co/The	210	1,26
	–	Workday Inc 'A'	113	0,67
			11.189	66,93
Total de acciones ordinarias (coste 13.259 $)			16.583	99,19
Warrants: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
Canadá: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
CAD	–	Constellation Software Inc/Canada	–	–
Garantía total (Coste – $)			–	–
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias			16.583	99,19
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias			16.583	99,19
Excedente de otros activos respecto a los pasivos			135	0,81
Patrimonio			16.718 $	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
AUD	–	Dólar australiano
CAD	–	Dólar canadiense
CHF	–	Franco suizo
DKK	–	Corona danesa
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 los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	98,29
Otros activos	1,71
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 29 de febrero de 2024

Acciones (en miles)			Valor (en miles) EUR	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias: 91,66 % (28 de febrero de 2023: 93,42 %)				
Australia: 2,05 % (28 de febrero de 2023: 5,07 %)				
AUD	2070	Transurban Group	16.869	2,05
Brasil: 4,77 % (28 de febrero de 2023: 1,70 %)				
BRL	2.759	Centrais Eletricas Brasileiras SA	22.354	2,72
BRL	3.988	Rumo SA	16.867	2,05
			39.221	4,77
Canadá: 4,89 % (28 de febrero de 2023: 8,77 %)				
CAD	1.189	Gibson Energy Inc	18.190	2,21
CAD	685	Pembina Pipeline Corp	22.081	2,68
			40.271	4,89
Dinamarca: 2,55 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
DKK	406	Orsted AS, 144A	21.005	2,55
Francia: 7,05 % (28 de febrero de 2023: 6,89 %)				
	182	Aeroports de Paris SA	23.003	2,80
	2.214	Getlink SE	34.993	4,25
			57.996	7,05
Alemania: 4,88 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
	1.436	E.ON SE	17.024	2,07
	449	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	23.147	2,81
			40.171	4,88
Italia: 5,29 % (28 de febrero de 2023: 3,23 %)				
	4.002	Enel SpA	23.561	2,86
	2.748	Terna – Rete Elettrica Nazionale	19.941	2,43
			43.502	5,29
Japón: 4,04 % (28 de febrero de 2023: 6,02 %)				
JPY	727	East Japan Railway Co	16.912	2,06
JPY	299	East Japan Railway Co	16.335	1,98
			33.247	4,04
Portugal: 3,37 % (28 de febrero de 2023: 3,39 %)				
	7.522	EDP – Energias de Portugal SA	27.722	3,37
España: 1,84 % (28 de febrero de 2023: 11,53 %)				
	1.029	Redeia Corp SA	15.147	1,84
Reino Unido: 8,41 % (28 de febrero de 2023: 10,87 %)				
GBP	1.438	Severn Trent Plc	41.974	5,10
GBP	2.273	United Utilities Group Plc	27.228	3,31
			69.202	8,41
Estados Unidos: 42,52 % (28 de febrero de 2023: 35,95 %)				
USD	621	CenterPoint Energy Inc	15.805	1,92
USD	101	Cheniere Energy Inc	14.498	1,76
USD	134	Constellation Energy Corp	20.915	2,54
USD	1.313	CSX Corp	46.056	5,60
USD	685	Dominion Energy Inc	30.313	3,68
USD	335	Entergy Corp	31.486	3,83
	852	Ferrovial SE	29.580	3,59
USD	592	NextEra Energy Inc	30.218	3,67
USD	110	Norfolk Southern Corp	25.783	3,13
USD	559	OGE Energy Corp	17.001	2,07
USD	2.544	PG&E Corp	39.257	4,77
USD	307	Public Service Enterprise Group Inc	17.704	2,15
USD	134	Union Pacific Corp	31.323	3,81
			349.939	42,52
Total de acciones ordinarias (coste 747.623 €)			754.292	91,66
Fondos de inversión inmobiliaria: 6,52 % (28 de febrero de 2023: 3,73 %)				
Estados Unidos: 6,52 % (28 de febrero de 2023: 3,73 %)				
USD	186	American Tower Corp	34.178	4,16
USD	191	Crown Castle Inc	19.447	2,36
			53.625	6,52
Total de fondos de inversión inmobiliaria (coste 62.757 €)			53.625	6,52
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 810.380 €)			807.917	98,18
Contratos de divisas a plazo: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,18 %)				
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)			26	–
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias			807.943	98,18
Contratos de divisas a plazo: (0,11 %) (28 de febrero de 2023: (0,10 %))				
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)			(891)	(0,11)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias			(891)	(0,11)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias			807.052	98,07
Excedente de otros activos respecto a los pasivos			15.871	1,93
Patrimonio			822.923 €	100,00

– Los importes designados como "–" son 0 EUR, menos de 1.000 EUR, 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 21.005.000 EUR o el 2,55 % del patrimonio neto.

ABREVIATURAS:

AUD – Dólar australiano
BRL – Real brasileño
CAD – Dólar canadiense
DKK – Corona danesa
GBP – Libra esterlina
JPY – Yen japonés
USD – Dólar estadounidense

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	97,51
Instrumentos financieros derivados	–
Otros activos	2,49
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 29 de febrero de 2024 *(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)
04 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	1.212	Venta	BRL	6.544	€	(4)
04 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	47	Venta	BRL	250		–
04 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	BRL	6.794	Venta	EUR	1.275		(11)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	24	Venta	AUD	39		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	370	Venta	CNH	2.891		(1)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	514	Venta	CNH	3.990		1
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CNH	145	Venta	EUR	19		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CNH	210.181	Venta	EUR	27.202		(205)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	6.719	Venta	EUR	4.651		(31)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	2	Venta	EUR	1		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	83.258	Venta	EUR	77.381		(396)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	300	Venta	EUR	277		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	4.030	Venta	EUR	2.439		(19)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	5	Venta	SGD	7		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	4	Venta	SGD	5		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	2.150	Venta	USD	2.331		(3)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	1.516	Venta	USD	1.635		6
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	78	Venta	AUD	150		1
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CAD	1.248	Venta	AUD	1.409		3
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	261	Venta	AUD	431		2
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	183	Venta	BRL	1.161		(2)
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	614	Venta	BRL	3.326		(4)
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CAD	2.935	Venta	BRL	10.887		(19)
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	DKK	312	Venta	CAD	62		–
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	184	Venta	CAD	315		–
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	996	Venta	CAD	1.458		5
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CAD	1.573	Venta	DKK	8.015		(4)
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	329	Venta	DKK	2.450		–
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	98	Venta	DKK	855		–
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	JPY	874	Venta	EUR	5		–
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	1.115	Venta	EUR	1.305		(4)
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	BRL	25	Venta	EUR	5		–
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	63	Venta	EUR	58		–
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	DKK	84	Venta	EUR	11		–
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	DKK	24	Venta	EUR	3		–
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CAD	17.797	Venta	EUR	12.173		(48)
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	2	Venta	EUR	1		–
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	1.139	Venta	GBP	973		4
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	DKK	34	Venta	GBP	4		–
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CAD	5.260	Venta	GBP	3.073		(2)
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	524	Venta	JPY	85.151		(4)
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	156	Venta	JPY	29.711		(2)
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CAD	2.508	Venta	JPY	278.584		(16)
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CAD	27.734	Venta	USD	20.552		(100)
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	1.728	Venta	USD	2.191		(9)
27 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	5.798	Venta	USD	6.280		(7)
02 de abril de 2024	BNY Mellon	Compra	BRL	6.326	Venta	EUR	1.167		4
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 1.921 €)								€	26
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (1,058) €)									(891)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 863 €)								€	(865)

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

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Acciones (en miles)			Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias: 87,73 % (28 de febrero de 2023: 90,92 %)				
Australia: 4,36 % (28 de febrero de 2023: 9,91 %)				
AUD	2.143	Atlas Arteria Ltd	7.523	2,27
AUD	788	Transurban Group	6.942	2,09
			14.465	4,36
Brasil: 2,81 % (28 de febrero de 2023: 3,91 %)				
BRL	1.810	CCR SA	5.016	1,51
BRL	606	CPFL Energia SA	4.314	1,30
			9.330	2,81
Canadá: 6,85 % (28 de febrero de 2023: 10,67 %)				
CAD	90	Enbridge Inc	3.111	0,94
CAD	342	Gibson Energy Inc	5.646	1,70
CAD	304	Pembina Pipeline Corp	10.577	3,19
CAD	86	TC Energy Corp	3.387	1,02
			22.721	6,85
China: 1,71 % (28 de febrero de 2023: 1,17 %)				
HKD	1.879	China Resources Gas Group Ltd	5.665	1,71
Francia: 2,18 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
EUR	53	Aeroports de Paris SA	7.239	2,18
Alemania: 1,50 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
EUR	388	E.ON SE	4.970	1,50
Italia: 6,44 % (28 de febrero de 2023: 4,87 %)				
EUR	1.625	Enel SpA	10.343	3,12
EUR	2.358	Snam SpA	11.015	3,32
			21.358	6,44
Japón: 3,49 % (28 de febrero de 2023: 3,51 %)				
JPY	279	West Japan Railway Co	11.597	3,49
Portugal: 4,37 % (28 de febrero de 2023: 5,27 %)				
EUR	3.641	EDP – Energias de Portugal SA	14.501	4,37
España: 5,85 % (28 de febrero de 2023: 11,64 %)				
EUR	271	Enagas SA	3.924	1,18
EUR	552	Iberdrola SA	6.334	1,91
EUR	576	Redeia Corp SA	9.165	2,76
			19.423	5,85
Reino Unido: 10,11 % (28 de febrero de 2023: 14,11 %)				
GBP	1.146	National Grid Plc	14.999	4,52
GBP	931	Pennon Group Plc	7.776	2,34
GBP	228	Severn Trent Plc	7.187	2,17
GBP	277	United Utilities Group Plc	3.582	1,08
			33.544	10,11
Estados Unidos: 38,06 % (28 de febrero de 2023: 25,86 %)				
	131	Brookfield Renewable Corporation	3.113	0,94
	38	Constellation Energy Corp	6.320	1,90
	290	Dominion Energy Inc	13.885	4,18
	165	Entergy Corp	16.726	5,04
	209	Eversource Energy	12.252	3,69
EUR	228	Ferrovial SE	8.567	2,58
	191	NextEra Energy Inc	10.505	3,17
	315	NextEra Energy Partners LP	8.643	2,60
	339	OGE Energy Corp	11.136	3,36
	115	Public Service Enterprise Group Inc	7.156	2,16
	194	Southern Co/The	13.033	3,93
	59	Union Pacific Corp	14.957	4,51
			126.293	38,06
Total de acciones ordinarias (coste 305.721 $)			291.106	87,73
Acciones preferentes: 2,48 % (28 de febrero de 2023: 1,42 %) **Brasil: 2,48 % (28 de febrero de 2023: 1,42 %)**				
BRL	854	Centrais Eletricas Brasileiras SA	8.231	2,48
Total de acciones preferentes (coste 6,781 $)			8.231	2,48
Fondos de inversión inmobiliaria: 8,11 % (28 de febrero de 2023: 6,00 %) **Estados Unidos: 8,11 % (28 de febrero de 2023: 6,00 %)**				
	63	American Tower Corp	12.523	3,78
	131	Crown Castle Inc	14.375	4,33
			26.898	8,11
Total de fondos de inversión inmobiliaria (coste 30.813 $)			26.898	8,11
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 343.315 $)			326.235	98,32

Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Contratos de divisas a plazo: 0,08 % (28 de febrero de 2023: 0,01 %)		
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	255	0,08
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	326.490	98,40
Contratos de divisas a plazo: (0,04 %) (28 de febrero de 2023: (0,55 %))		
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(124)	(0,04)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	(124)	(0,04)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	326.366	98,36
Excedente de otros activos respecto a los pasivos	5.443	1,64
Patrimonio	331.809 $	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:

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	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	96,18
Instrumentos financieros derivados	0,08
Otros activos	3,74
Total de activos	100,00

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(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)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	220	Venta	AUD	340	$ (2)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	159	Venta	CNH	1.148	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	1.622	Venta	EUR	1.513	(16)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	7.837	Venta	EUR	7.236	11
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	270	Venta	GBP	213	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	138	Venta	GBP	109	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	2.505	Venta	SGD	3.380	(7)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	510	Venta	SGD	685	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	23	Venta	USD	18	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	70.853	Venta	USD	52.772	(78)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	4.544	Venta	USD	5.715	20
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	968	Venta	USD	1.048	(1)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	40.702	Venta	USD	43.795	224
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CNH	11.711	Venta	USD	1.630	(4)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	1	Venta	USD	1	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	8.999	Venta	USD	5.869	(16)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 24 $)								$ 255
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (2.229) $)								(124)
Apreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (2.205) $)								$ 131

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

		Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias: 91,18 %				
Francia: 11,94 %				
EUR	3	BNP Paribas SA	151	2,68
EUR	2	Nexans SA	162	2,86
EUR	4	TotalEnergies SE	237	4,20
EUR	4	Veolia Environnement SA	124	2,20
			674	11,94
Alemania: 4,87 %				
EUR	1	Gerresheimer AG	102	1,82
EUR	1	Siemens AG	172	3,05
			274	4,87
Hong Kong: 1,80 %				
HKD	13	AIA Group Ltd	102	1,80
Indonesia: 1,95 %				
IDR	282	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	110	1,95
Japón: 5,26 %				
JPY	4	Hitachi Ltd	297	5,26
España: 3,88 %				
EUR	22	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	219	3,88
Reino Unido: 12,29 %				
GBP	1	AstraZeneca Plc	177	3,14
GBP	9	Compass Group Plc	235	4,16
GBP	4	Unilever Plc	177	3,15
GBP	8	United Utilities Group Plc	104	1,84
			693	12,29
Estados Unidos: 49,19 %				
	7	AES Corp/The	103	1,82
	3	American International Group Inc	182	3,23
	–	Biogen Inc	54	0,96
CAD	3	Brookfield Renewable Corp	61	1,09
	2	Charles Schwab Corp/The	108	1,91
	2	Chesapeake Energy Corp	156	2,76
	5	CNH Industrial NV	58	1,03
	11	Coty Inc	137	2,43
	1	Fiserv Inc	204	3,61
	3	Freeport-McMoRan Inc	129	2,28
	1	Johnson & Johnson	174	3,09
	–	Meta Platforms Inc 'A'	239	4,24
	2	NextEra Energy Inc	96	1,69
	2	Oracle Corp	178	3,16
EUR	1	Schneider Electric SE	164	2,91
	2	Uber Technologies Inc	173	3,06
	–	UnitedHealth Group Inc	118	2,10
	3	Vertiv Holdings Co 'A'	224	3,97
	4	Wells Fargo & Co	217	3,85
			2.775	49,19
Total de acciones ordinarias (coste 4.468 $)			5.144	91,18
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 4.468 $)			5.144	91,18
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			5.144	91,18
Contratos de divisas a plazo: 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			5.144	91,18
Excedente de otros activos respecto a los pasivos			497	8,82
Patrimonio			5.641 $	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:

CAD – Dólar canadiense
EUR – Euro
GBP – Libra esterlina
HKD – Dólar de Hong Kong
IDR – Rupia indonesia
JPY – Yen japonés

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	90,74
Otros activos	9,26
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)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	16	Venta	USD	11	$ –
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	9	Venta	USD	11	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	10	Venta	USD	11	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	–	Venta	USD	1	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	–	Venta	USD	–	–
Apreciación latente sobre contratos de divisas a plazo								–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo								–
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo								–

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

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Acciones (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Organismos de inversión colectiva: 2,52 % (28 de febrero de 2023: 4,39 %)			
17.542	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	17.542	2,52
Total de organismos de inversión colectiva (coste 17.542 $)		17.542	2,52
Acciones ordinarias: 96,65 % (28 de febrero de 2023: 95,04 %)			
Publicidad: 0,01 % (28 de febrero de 2023: 0,59 %)			
266	Marin Software Inc	87	0,01
Industria aeroespacial y defensa: 4,10 % (28 de febrero de 2023: 5,27 %)			
73	AAR Corp	4.873	0,70
244	Astronics Corp	4.684	0,67
78	Ducommun Inc	3.713	0,54
207	Kratos Defense & Security Solutions Inc	3.776	0,54
206	Leonardo DRS Inc	4.667	0,67
74	Mercury Systems Inc	2.217	0,32
330	Triumph Group Inc	4.581	0,66
		28.511	4,10
Aerolíneas: 0,29 % (28 de febrero de 2023: 0,67 %)			
27	Allegiant Travel Co	1.981	0,29
Vestimenta: 1,02 % (28 de febrero de 2023: 1,12 %)			
365	Fossil Group Inc	385	0,06
239	Lakeland Industries Inc	4.322	0,62
96	Rocky Brands Inc	2.393	0,34
		7.100	1,02
Fabricantes de automóviles: 0,71 % (28 de febrero de 2023: 0,76 %)			
180	Wabash National Corp	4.916	0,71
Componentes y equipos de automóvil: 3,07 % (28 de febrero de 2023: 2,78 %)			
86	Adient Plc	2.905	0,42
531	Commercial Vehicle Group Inc	3.476	0,50
69	Dana Inc	863	0,12
40	Fox Factory Holding Corp	2.004	0,29
519	Garrett Motion Inc	4.993	0,72
51	Gentherm Inc	2.926	0,42
179	Goodyear Tire & Rubber Co/The	2.124	0,31
195	Shyft Group Inc/The	2.015	0,29
		21.306	3,07
Bancos: 2,27 % (28 de febrero de 2023: 1,67 %)			
75	BankUnited Inc	2.009	0,29
97	BayCom Corp	1.944	0,28
105	Business First Bancshares Inc	2.359	0,34
38	Customers Bancorp Inc	2.036	0,29
63	First Bancshares Inc/The	1.553	0,22
84	Hilltop Holdings Inc	2.594	0,37
65	Seacoast Banking Corp of Florida	1.559	0,23
29	Western Alliance Bancorp	1.697	0,25
		15.751	2,27
Biotecnología: 0,43 % (28 de febrero de 2023: 0,31 %)			
193	NeoGenomics Inc	3.011	0,43
Materiales de construcción: 2,84 % (28 de febrero de 2023: 2,89 %)			
248	Aspen Aerogels Inc	4.251	0,61
48	Gibraltar Industries Inc	3.747	0,54
56	Modine Manufacturing Co	4.984	0,72
610	SmartRent Inc	1.763	0,25
117	Summit Materials Inc 'A'	5.004	0,72
		19.749	2,84
Químicos: 1,38 % (28 de febrero de 2023: 1,84 %)			
421	Arcadium Lithium Plc	2.312	0,33
26	Huntsman Corp	660	0,10
270	Mativ Holdings Inc	4.690	0,68
129	Tronox Holdings Plc	1.892	0,27
		9.554	1,38
Servicios comerciales: 5,96 % (28 de febrero de 2023: 3,90 %)			
274	Acacia Research Corp	1.107	0,16
453	Arlo Technologies Inc	4.726	0,68
149	Cross Country Healthcare Inc	2.733	0,39
97	Evercel Inc	98	0,01
419	Healthcare Services Group Inc	5.351	0,77
22	Herc Holdings Inc	3.507	0,51
74	Korn Ferry	4.738	0,68
58	LiveRamp Holdings Inc	2.020	0,29
143	Repay Holdings Corp 'A'	1.244	0,18
264	Resources Connection Inc	3.650	0,53
157	Sterling Check Corp	2.459	0,35
165	TrueBlue Inc	1.944	0,28
276	Udemy Inc	3.118	0,45
71	V2X Inc	2.726	0,39
106	Vestis Corp	1.987	0,29
		41.408	5,96

Acciones (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Informática: 3,32 % (28 de febrero de 2023: 1,39 %)			
739	Conduent Inc	2.538	0,36
37	Endava Plc ADR	1.373	0,20
174	Grid Dynamics Holdings Inc	2.342	0,34
252	Kyndryl Holdings Inc	5.538	0,80
408	SecureWorks Corp	2.716	0,39
128	TaskUS Inc 'A'	1.698	0,24
163	TTEC Holdings Inc	2.846	0,41
70	WNS Holdings Ltd ADR	4.029	0,58
		23.080	3,32
Cosmética y cuidado personal: 0,34 % (28 de febrero de 2023: 0,30 %)			
16	Inter Parfums Inc	2.393	0,34
Distribución y venta al por mayor: 3,49 % (28 de febrero de 2023: 3,30 %)			
293	Hudson Technologies Inc	4.297	0,62
480	Manitex International Inc	3.271	0,47
334	MRC Global Inc	3.845	0,55
144	Resideo Technologies Inc	3.213	0,46
73	VSE Corp	5.383	0,78
29	WESCO International Inc	4.254	0,61
		24.263	3,49
Servicios financieros diversificados: 2,70 % (28 de febrero de 2023: 2,13 %)			
101	Air Lease Corp 'A'	4.060	0,58
67	Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	2.904	0,42
CAD 550	Canaccord Genuity Group Inc	3.257	0,47
280	GCM Grosvenor Inc	2.369	0,34
51	Moelis & Co 'A'	2.779	0,40
247	Perella Weinberg Partners 'A'	3.374	0,49
		18.743	2,70
Componentes y equipos eléctricos: 1,51 % (28 de febrero de 2023: 1,16 %)			
223	American Superconductor Corp	3.006	0,43
91	Insteel Industries Inc	3.313	0,48
314	nLight Inc	4.152	0,60
		10.471	1,51
Electrónica: 5,42 % (28 de febrero de 2023: 5,34 %)			
34	Advanced Energy Industries Inc	3.450	0,50
219	Applied Optoelectronics Inc	3.500	0,50
168	Benchmark Electronics Inc	5.146	0,74
65	Coherent Corp	3.855	0,56
245	Comtech Telecommunications Corp	1.661	0,24
92	CTS Corp	4.110	0,59
100	FARO Technologies Inc	2.248	0,32
413	Identiv Inc	3.560	0,51
268	Knowles Corp	4.378	0,63
260	Stoneridge Inc	4.559	0,66
55	Vishay Intertechnology Inc	1.188	0,17
		37.655	5,42
Ingeniería y construcción: 3,82 % (28 de febrero de 2023: 3,93 %)			
17	Arcosa Inc	1.433	0,21
408	Concrete Pumping Holdings Inc	3.343	0,48
65	Construction Partners Inc 'A'	3.128	0,45
78	Limbach Holdings Inc	3.866	0,56
502	Mistras Group Inc	4.338	0,62
578	Orion Group Holdings Inc	3.441	0,49
128	Primoris Services Corp	5.040	0,72
19	Sterling Infrastructure Inc	1.985	0,29
		26.574	3,82
Entretenimiento: 0,34 % (28 de febrero de 2023: 0,32 %)			
136	IMAX Corp	2.334	0,34
Control ambiental: 0,77 % (28 de febrero de 2023: 0,55 %)			
237	CECO Environmental Corp	5.355	0,77
Alimentación: 0,67 % (28 de febrero de 2023: 0,51 %)			
120	Krispy Kreme Inc	1.559	0,22
443	SunOpta Inc	3.117	0,45
		4.676	0,67
Herramientas manuales/mecánicas: 0,46 % (28 de febrero de 2023: 0,80 %)			
36	Hurco Cos Inc	930	0,13
228	Luxfer Holdings Plc	2.257	0,33
		3.187	0,46
Productos sanitarios: 3,11 % (28 de febrero de 2023: 2,02 %)			
1.120	Accuray Inc	2.919	0,42
59	AngioDynamics Inc	322	0,05
522	Apyx Medical Corp	1.102	0,16
268	Artivion Inc	5.175	0,74
49	Azenta Inc	3.218	0,46
304	MiMedx Group Inc	2.480	0,36
179	Tactile Systems Technology Inc	2.729	0,39

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Acciones (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias (continuación)			
Productos sanitarios (continuación)			
212	Varex Imaging Corp	3.646	0,53
		21.591	3,11
Servicios sanitarios: 1,42 % (28 de febrero de 2023: 1,33 %)			
456	Community Health Systems Inc	1.275	0,18
41	ModivCare Inc	1.148	0,16
417	Quipt Home Medical Corp	1.790	0,26
90	RadNet Inc	3.399	0,49
84	Select Medical Holdings Corp	2.277	0,33
		9.889	1,42
Constructores de viviendas: 3,18 % (28 de febrero de 2023: 2,86 %)			
61	Beazer Homes USA Inc	1.899	0,27
10	Cavco Industries Inc	3.866	0,56
23	Century Communities Inc	1.970	0,28
14	M/I Homes Inc	1.812	0,26
62	Skyline Champion Corp	5.204	0,75
55	Taylor Morrison Home Corp 'A'	3.082	0,44
19	Toll Brothers Inc	2.227	0,32
59	Tri Pointe Homes Inc	2.070	0,30
		22.130	3,18
Mobiliario doméstico: 0,05 % (28 de febrero de 2023: 0,18 %)			
406	VIA Optronics AG ADR	352	0,05
Productos/utensilios del hogar: 0,47 % (28 de febrero de 2023: 0,40 %)			
40	Spectrum Brands Holdings Inc	3.250	0,47
Seguros: 0,54 % (28 de febrero de 2023: 0,33 %)			
81	Brighthouse Financial Inc	3.769	0,54
Internet: 5,72 % (28 de febrero de 2023: 3,78 %)			
94	Beyond Inc	3.163	0,46
164	Cars.com Inc	3.005	0,43
33	comScore Inc	647	0,09
117	Criteo SA ADR	3.796	0,55
821	DHI Group Inc	2.328	0,33
698	Entravision Communications Corp	2.683	0,39
314	EverQuote Inc	5.032	0,72
81	IAC Inc	4.597	0,66
925	Innovid Corp	1.733	0,25
306	LifeMD Inc	2.433	0,35
415	Magnite Inc	4.981	0,72
366	QuinStreet Inc	5.356	0,77
		39.754	5,72
Hierro/Acero: 2,30 % (28 de febrero de 2023: 3,20 %)			
106	ATI Inc	5.224	0,75
73	Carpenter Technology Corp	4.693	0,67
73	Commercial Metals Co	3.929	0,57
36	Haynes International Inc	2.143	0,31
		15.989	2,30
Alojamiento: 0,06 % (28 de febrero de 2023: 0,61 %)			
136	Century Casinos Inc	396	0,06
Maquinaria: Construcción y Minería: 1,34 % (28 de febrero de 2023: 1,43 %)			
60	Argan Inc	2.790	0,40
536	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	684	0,10
39	BWX Technologies Inc	3.893	0,56
33	Terex Corp	1.908	0,28
		9.275	1,34
Maquinaria: Diversificadas: 1,99 % (28 de febrero de 2023: 2,02 %)			
22	Chart Industries Inc	3.171	0,46
125	Ichor Holdings Ltd	5.332	0,77
745	Intevac Inc	2.883	0,41
65	Power Solutions International Inc	133	0,02
149	Twin Disc Inc	2.312	0,33
		13.831	1,99
Medios: 0,42 % (28 de febrero de 2023: 0,48 %)			
139	Thryv Holdings Inc	2.906	0,42
Fabricación de metal y ferretería: 2,06 % (28 de febrero de 2023: 2,27 %)			
66	Helios Technologies Inc	2.911	0,42
223	Mayville Engineering Co Inc	2.701	0,39
208	Metallus Inc	4.526	0,65
141	Northwest Pipe Co	4.209	0,60
		14.347	2,06
Minería: 1,31 % (28 de febrero de 2023: 1,17 %)			
CAD 525	Capstone Copper Corp	2.761	0,40
671	Ferroglobe Plc	3.048	0,44
CAD 566	Major Drilling Group International Inc	3.281	0,47
		9.090	1,31
Fabricación varios: 1,11 % (28 de febrero de 2023: 1,63 %)			
19	Enpro Inc	3.024	0,43
9	Fabrinet	1.934	0,28
109	Trinity Industries Inc	2.753	0,40
		7.711	1,11
Mobiliario de oficina: 0,49 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
183	Xerox Holdings Corp	3.404	0,49
Petróleo y gas: 2,08 % (28 de febrero de 2023: 2,57 %)			
807	Baytex Energy Corp	2.586	0,37
57	Matador Resources Co	3.605	0,52
103	Northern Oil & Gas Inc	3.666	0,53
227	Patterson-UTI Energy Inc	2.623	0,38
281	Southwestern Energy Co	1.959	0,28
		14.439	2,08
Servicios de petróleo y gas: 3,71 % (28 de febrero de 2023: 2,41 %)			
194	Archrock Inc	3.549	0,51
116	DMC Global Inc	1.942	0,28
217	DNOW Inc	3.059	0,44
432	Mammoth Energy Services Inc	1.580	0,23
273	Matrix Service Co	3.218	0,46
385	Newpark Resources Inc	2.472	0,36
171	ProPetro Holding Corp	1.261	0,18
225	Ranger Energy Services Inc	2.356	0,34
375	Select Water Solutions Inc	3.201	0,46
369	Solaris Oilfield Infrastructure Inc 'A'	3.131	0,45
		25.769	3,71
Embalaje y envases: 0,35 % (28 de febrero de 2023: 0,47 %)			
105	TriMas Corp	2.460	0,35
Farmacéuticas: 0,98 % (28 de febrero de 2023: 0,93 %)			
179	AdaptHealth Corp 'A'	1.829	0,26
219	Organon & Co	3.813	0,55
1.092	Societal CDMO Inc	1.162	0,17
		6.804	0,98
Bienes inmuebles: 0,09 % (28 de febrero de 2023: 0,17 %)			
232	Fathom Holdings Inc	654	0,09
Comercio minorista: 5,41 % (28 de febrero de 2023: 7,40 %)			
33	Advance Auto Parts Inc	2.217	0,32
17	Asbury Automotive Group Inc	3.528	0,51
92	Caleres Inc	3.546	0,51
230	Designer Brands Inc	2.434	0,35
11	Dillard's Inc	4.715	0,68
121	J Jill Inc	3.028	0,44
60	MarineMax Inc	1.995	0,29
838	Noodles & Co 'A'	2.112	0,30
214	Nordstrom Inc	4.480	0,64
82	OneWater Marine Inc 'A'	2.140	0,31
30	Patrick Industries Inc	3.642	0,52
193	Vera Bradley Inc	1.506	0,22
79	Victoria's Secret & Co	2.242	0,32
		37.585	5,41
Ahorro y préstamos: 0,27 % (28 de febrero de 2023: 0,52 %)			
36	Axos Financial Inc	1.898	0,27
Semiconductores: 5,78 % (28 de febrero de 2023: 5,09 %)			
139	Alpha & Omega Semiconductor Ltd	3.033	0,44
84	Amkor Technology Inc	2.601	0,37
399	Amtech Systems Inc	1.929	0,28
111	Cohu Inc	3.563	0,51
112	FormFactor Inc	4.827	0,70
199	inTEST Corp	2.332	0,34
40	IPG Photonics Corp	3.484	0,50
73	Kulicke & Soffa Industries Inc	3.476	0,50
11	Onto Innovation Inc	2.046	0,29
122	Ultra Clean Holdings Inc	5.267	0,76
144	Veeco Instruments Inc	5.208	0,75
68	Vishay Precision Group Inc	2.369	0,34
		40.135	5,78
Software: 2,01 % (28 de febrero de 2023: 1,81 %)			
177	ACV Auctions Inc	3.147	0,45
169	Digi International Inc	5.001	0,72
365	Immersion Corp	2.462	0,36
368	Viant Technology Inc	3.356	0,48
		13.966	2,01
Telecomunicaciones: 2,81 % (28 de febrero de 2023: 4,15 %)			
244	A10 Networks Inc	3.245	0,47
274	Applied Digital Corp	1.136	0,16
106	Aviat Networks Inc	3.761	0,54
83	Clearfield Inc	2.496	0,36

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Acciones (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias (continuación)			
Telecomunicaciones (continuación)			
515	DZS Inc	760	0,11
131	Frequency Electronics Inc	1.409	0,20
347	Infinera Corp	1.742	0,25
297	Ooma Inc	3.025	0,44
657	Ribbon Communications Inc	1.974	0,28
		19.548	2,81
Transporte: 2,67 % (28 de febrero de 2023: 3,64 %)			
262	Ardmore Shipping Corp	4.256	0,61
100	Hub Group Inc 'A'	4.270	0,62
251	Navigator Holdings Ltd	3.757	0,54
383	Radiant Logistics Inc	2.214	0,32
60	Scorpio Tankers Inc	4.056	0,58
		18.553	2,67
Total de acciones ordinarias (coste 618.471 $)		671.600	96,65
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 636.013 $)		689.142	99,17
Contratos de divisas a plazo: 0,04 % (28 de febrero de 2023: 0,02 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		292	0,04
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		689.434	99,21

Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Contratos de divisas a plazo: (0,02 %) (28 de febrero de 2023: (0,22 %))		
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(170)	(0,02)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	(170)	(0,02)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	689.264	99,19
Excedente de otros activos respecto a los pasivos	5.626	0,81
Patrimonio	694.890 $	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

CAD – Dólar canadiense

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	95,81
Organismos de inversión colectiva	2,50
Instrumentos financieros derivados	0,04
Otros activos	1,65
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)
04 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	5.572	Venta	BRL	27.702	$ 2
04 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	BRL	1.172	Venta	USD	235	1
04 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	BRL	26.530	Venta	USD	5.387	(53)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	236	Venta	AUD	366	(2)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	281	Venta	AUD	430	1
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	208	Venta	CNH	1.488	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	138	Venta	CNH	1.000	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	1.465	Venta	EUR	1.365	(10)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	1.166	Venta	EUR	1.077	2
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	6	Venta	GBP	5	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	330	Venta	PLN	1.337	(5)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	3	Venta	SEK	30	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	3	Venta	SEK	29	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	460	Venta	SGD	619	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	1.985	Venta	SGD	2.680	(6)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	4.950	Venta	USD	5.366	(13)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	100	Venta	USD	66	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SEK	720	Venta	USD	68	1
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	119	Venta	USD	149	1
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	PLN	33.397	Venta	USD	8.256	106
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	2.768	Venta	USD	2.056	1
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	50.453	Venta	USD	37.575	(54)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	9.003	Venta	USD	5.871	(18)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CNH	3.352	Venta	USD	465	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	32.990	Venta	USD	35.504	177
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CNH	22.573	Venta	USD	3.144	(8)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SEK	2	Venta	USD	–	–
02 de abril de 2024	BNY Mellon	Compra	BRL	27.320	Venta	USD	5.478	(1)
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 150 $)								$ 292
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (1.623) $)								(170)
Apreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (1.473) $)								$ 122

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Acciones (en miles)		Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Organismos de inversión colectiva: 3,75 % (28 de febrero de 2023: 3,48 %)			
13	ETF iShares Russell 2000 Value – ETF	1.915	2,00
1.681	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	1.681	1,75
Total de organismos de inversión colectiva (coste 3.487 $)		3.596	3,75
Acciones ordinarias: 96,40 % (28 de febrero de 2023: 97,23 %)			
Industria aeroespacial y defensa: 2,10 % (28 de febrero de 2023: 1,09 %)			
89	Leonardo DRS Inc	2.014	2,10
Vestimenta: 2,33 % (28 de febrero de 2023: 2,41 %)			
12	Carter's Inc	952	0,99
30	Steven Madden Ltd	1.283	1,34
		2.235	2,33
Componentes y equipos de automóvil: 3,33 % (28 de febrero de 2023: 3,47 %)			
48	Gentex Corp	1.750	1,82
32	Miller Industries Inc/TN	1.445	1,51
		3.195	3,33
Biotecnología: 0,79 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
19	Pliant Therapeutics Inc	762	0,79
Materiales de construcción: 2,04 % (28 de febrero de 2023: 2,02 %)			
26	Louisiana-Pacific Corp	1.954	2,04
Químicos: 3,22 % (28 de febrero de 2023: 3,48 %)			
18	Innospec Inc	2.224	2,32
4	Quaker Chemical Corp	868	0,90
		3.092	3,22
Servicios comerciales: 9,74 % (28 de febrero de 2023: 7,42 %)			
3	AMN Healthcare Services Inc	176	0,18
31	Cass Information Systems Inc	1.473	1,54
157	Dun & Bradstreet Holdings Inc	1.660	1,73
81	Forrester Research Inc	1.633	1,70
45	Korn Ferry	2.868	2,99
36	Valvoline Inc	1.534	1,60
		9.344	9,74
Informática: 0,52 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
9	Crane NXT Co	502	0,52
Cosmética y cuidado personal: 1,90 % (28 de febrero de 2023: 2,16 %)			
12	Inter Parfums Inc	1.826	1,90
Distribución y venta al por mayor: 0,84 % (28 de febrero de 2023: 2,20 %)			
55	Hudson Technologies Inc	801	0,84
Servicios financieros diversificados: 8,07 % (28 de febrero de 2023: 7,55 %)			
56	Air Lease Corp 'A'	2.242	2,34
41	Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	1.780	1,86
17	Houlihan Lokey Inc 'A'	2.133	2,22
41	Lazard Inc 'A'	1.587	1,65
		7.742	8,07
Electrónica: 6,67 % (28 de febrero de 2023: 5,96 %)			
31	Atmus Filtration Technologies Inc	747	0,78
31	Brady Corp 'A'	1.811	1,89
26	ESCO Technologies Inc	2.601	2,71
55	Kimball Electronics Inc	1.241	1,29
		6.400	6,67
Ingeniería y construcción: 3,75 % (28 de febrero de 2023: 2,22 %)			
33	Arcosa Inc	2.769	2,89
10	Exponent Inc	826	0,86
		3.595	3,75
Productos sanitarios: 6,65 % (28 de febrero de 2023: 5,87 %)			
38	Bio-Techne Corp	2.831	2,95
34	Enovis Corp	2.008	2,09
24	Envista Holdings Corp	505	0,53
5	UFP Technologies Inc	1.034	1,08
		6.378	6,65
Constructores de viviendas: 3,11 % (28 de febrero de 2023: 3,71 %)			
6	LCI Industries	809	0,85
26	Skyline Champion Corp	2.171	2,26
		2.980	3,11
Seguros: 3,60 % (28 de febrero de 2023: 4,88 %)			
10	RLI Corp	1.417	1,48
1	White Mountains Insurance Group Ltd	2.040	2,12
		3.457	3,60
Internet: 2,97 % (28 de febrero de 2023: 2,92 %)			
41	Ziff Davis Inc	2.850	2,97
Ocio: 2,04 % (28 de febrero de 2023: 1,59 %)			
22	Brunswick Corp/DE	1.959	2,04
Alojamiento: 0,51 % (28 de febrero de 2023: 1,99 %)			
169	Century Casinos Inc	492	0,51
Maquinaria: Diversificadas: 3,52 % (28 de febrero de 2023: 3,50 %)			
17	Esab Corp	1.690	1,76
5	Kadant Inc	1.684	1,76
		3.374	3,52
Fabricación de metal y ferretería: 1,76 % (28 de febrero de 2023: 0,65 %)			
54	Janus International Group Inc	779	0,81
16	Northwest Pipe Co	488	0,51
13	Ryerson Holding Corp	422	0,44
		1.689	1,76
Fabricación varios: 5,16 % (28 de febrero de 2023: 5,33 %)			
14	Enpro Inc	2.143	2,24
4	Fabrinet	776	0,81
20	John Bean Technologies Corp	2.027	2,11
		4.946	5,16
Servicios de petróleo y gas: 1,69 % (28 de febrero de 2023: 1,54 %)			
CAD 159	Pason Systems Inc	1.622	1,69
Farmacéuticas: 2,36 % (28 de febrero de 2023: 3,27 %)			
141	Catalyst Pharmaceuticals Inc	2.263	2,36
Bienes inmuebles: 4,63 % (28 de febrero de 2023: 3,88 %)			
281	Kennedy-Wilson Holdings Inc	2.469	2,57
54	Marcus & Millichap Inc	1.971	2,06
		4.440	4,63
Comercio minorista: 1,36 % (28 de febrero de 2023: 1,49 %)			
45	Movado Group Inc	1.303	1,36
Semiconductores: 9,55 % (28 de febrero de 2023: 9,18 %)			
11	Cirrus Logic Inc	968	1,01
35	Cohu Inc	1.138	1,19
48	FormFactor Inc	2.074	2,16
21	MKS Instruments Inc	2.591	2,70
3	Onto Innovation Inc	475	0,49
55	Vishay Precision Group Inc	1.917	2,00
		9.163	9,55
Software: 0,63 % (28 de febrero de 2023: 2,94 %)			
15	Simulations Plus Inc	608	0,63
Transporte: 1,56 % (28 de febrero de 2023: 3,63 %)			
8	Landstar System Inc	1.500	1,56
Total de acciones ordinarias (coste 82.912 $)		92.486	96,40
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 86.399 $)		96.082	100,15
Contratos de divisas a plazo: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)		1	–
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		96.083	100,15
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		96.083	100,15
Excedente de pasivos respecto a otros activos		(148)	(0,15)
Patrimonio		95.935 $	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:

ETF – Fondo cotizado

CAD – Dólar canadiense

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	95,85
Organismos de inversión colectiva	3,73
Instrumentos financieros derivados	–
Otros activos	0,42
Total de activos	100,00

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(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)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	7	Venta	EUR	6	$	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SEK	29	Venta	USD	3		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	181	Venta	USD	194		1
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): – $)								$	1
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (2) $)									–
Apreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (2) $)								$	1

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Acciones (en miles)			Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Organismos de inversión colectiva: 4,76 % (28 de febrero de 2023: 4,24 %)				
	209	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	209	4,76
Total de organismos de inversión colectiva (coste 209 $)			209	4,76
Acciones ordinarias: 96,05 % (28 de febrero de 2023: 96,21 %)				
Australia: 3,53 % (28 de febrero de 2023: 3,53 %)				
AUD	25	Hansen Technologies Ltd	79	1,81
AUD	18	IPH Ltd	76	1,72
			155	3,53
Bélgica: 0,91 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
EUR	2	Azelis Group NV	40	0,91
Brasil: 1,68 % (28 de febrero de 2023: 1,03 %)				
BRL	18	Odontoprev SA	45	1,01
BRL	5	TOTVS SA	29	0,67
			74	1,68
Canadá: 6,22 % (28 de febrero de 2023: 1,16 %)				
	1	Colliers International Group Inc	95	2,16
	1	FirstService Corp	114	2,60
	1	RB Global Inc	64	1,46
			273	6,22
Francia: 0,81 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
EUR	1	Lectra	35	0,81
Italia: 3,16 % (28 de febrero de 2023: 3,01 %)				
EUR	1	Carel Industries SpA, 144A	30	0,68
EUR	–	DiaSorin SpA	44	1,00
EUR	9	GVS SpA, 144A	65	1,48
			139	3,16
Japón: 11,23 % (28 de febrero de 2023: 11,67 %)				
JPY	1	As One Corp	38	0,88
JPY	4	BML Inc	77	1,76
JPY	1	Hirose Electric Co Ltd	53	1,21
JPY	3	JCU Corp	80	1,83
JPY	2	Miura Co Ltd	43	0,97
JPY	1	OBIC Business Consultants Co Ltd	43	0,98
JPY	3	TKC Corp	79	1,81
JPY	2	USS Co Ltd	26	0,59
JPY	2	Zuken Inc	53	1,20
			492	11,23
Jersey: 0,77 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
GBP	3	JTC Plc, 144A	34	0,77
Países Bajos: 1,07 % (28 de febrero de 2023: 2,14 %)				
EUR	–	IMCD NV	47	1,07
Polonia: 1,26 % (28 de febrero de 2023: 1,33 %)				
PLN	3	Asseco Poland SA	55	1,26
Corea del Sur: 1,76 % (28 de febrero de 2023: 1,99 %)				
KRW	10	NICE Information Service Co Ltd	77	1,76
Suecia: 1,33 % (28 de febrero de 2023: 1,07 %)				
SEK	9	Karnov Group AB	58	1,33
Suiza: 1,66 % (28 de febrero de 2023: 1,79 %)				
CHF	–	Kardex Holding AG	37	0,85
CHF	–	VZ Holding AG	36	0,81
			73	1,66
Reino Unido: 13,88 % (28 de febrero de 2023: 12,45 %)				
GBP	10	Auction Technology Group Plc	77	1,75
GBP	1	Croda International Plc	43	0,97
GBP	1	Diploma Plc	52	1,20
GBP	7	DiscoverIE Group Plc	62	1,41
GBP	1	Intertek Group Plc	48	1,09
GBP	71	Learning Technologies Group Plc	74	1,68
GBP	14	Marlowe Plc	91	2,07
GBP	27	Restore Plc	79	1,80
GBP	–	Spirax-Sarco Engineering Plc	50	1,14
GBP	2	Victrex Plc	33	0,77
			609	13,88
Estados Unidos: 46,01 % (28 de febrero de 2023: 52,24 %)				
	1	Arcosa Inc	77	1,75
	–	Brunswick Corp/DE	33	0,75
	1	Cognex Corp	57	1,29
	1	Enovis Corp	73	1,66
	–	Enpro Inc	25	0,57
	1	Esab Corp	82	1,87
	1	ESCO Technologies Inc	58	1,33
	1	FormFactor Inc	56	1,28
	1	Forrester Research Inc	25	0,56
	1	Gentex Corp	45	1,03
	1	Haemonetics Corp	88	2,02
	–	Houlihan Lokey Inc 'A'	47	1,08
	1	Innospec Inc	93	2,11
	–	Installed Building Products Inc	51	1,17
	–	Inter Parfums Inc	66	1,51
	1	John Bean Technologies Corp	70	1,60
	–	Kadant Inc	86	1,96
	6	Kennedy-Wilson Holdings Inc	49	1,12
	–	Landstar System Inc	56	1,27
	–	LCI Industries	23	0,52
	–	Lincoln Electric Holdings Inc	93	2,12
	–	Littelfuse Inc	66	1,50
	1	Marcus & Millichap Inc	30	0,69
	1	MKS Instruments Inc	108	2,46
	–	Quaker Chemical Corp	72	1,64
	–	Ralph Lauren Corp 'A'	68	1,55
	–	Rogers Corp	49	1,11
	1	SEI Investments Co	78	1,78
	1	UFP Industries Inc	68	1,55
	–	Valmont Industries Inc	59	1,35
	2	Valvoline Inc	92	2,09
	1	Ziff Davis Inc	75	1,72
			2.018	46,01
Vietnam: 0,77 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
GBP	3	XP Power Ltd	34	0,77
Total de acciones ordinarias (coste 4.303 $)			4.213	96,05
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias			4.422	100,81
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias			4.422	100,81
Excedente de pasivos respecto a otros activos			(36)	(0,81)
Patrimonio			4.386 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 129.000 USD o el 2,93 % 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	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	94,89
Organismos de inversión colectiva	4,71
Otros activos	0,40
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 29 de febrero de 2024

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 %)			
GBP	54	Evraz Plc †	–
Total de acciones ordinarias (coste 313 €)			–
Excedente de pasivos respecto a otros activos			–
Patrimonio			– €

– Los importes designados como "–" son 0 EUR, menos de 1.000 EUR, menos de 1.000 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 los 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 29 de febrero de 2024

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

– Los importes designados como "–" son 0 USD, menos de 1.000 USD, menos de 1.000 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:

HKD – Dólar de Hong Kong

Análisis del total de activos	% del total de los 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^α

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

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 $)		–
Excedente de pasivos respecto a otros activos		–
Patrimonio		– $

– Los importes designados como "–" son 0 USD, menos de 1.000 USD, menos de 1.000 acciones o menos del 0,01 %.

† Poca liquidez.

α El 27 de abril de 2022, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^ dejó de cotizar en bolsa.

ABREVIATURAS:

ADR – Recibo de depósito estadounidense

Análisis del total de activos	% del total de los 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

FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Acciones (en miles)			Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Organismos de inversión colectiva: 1,31 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
	1.620	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	1.620	1,31
Total de organismos de inversión colectiva (coste 1.620 $)			1.620	1,31
Acciones ordinarias: 98,60 % (28 de febrero de 2023: 101,05 %)				
Dinamarca: 2,83 % (28 de febrero de 2023: 3,50 %)				
DKK	26	Coloplast A/S	3.512	2,83
Francia: 11,23 % (28 de febrero de 2023: 10,14 %)				
EUR	5	Kering SA	2.203	1,78
EUR	10	L'Oreal SA	4.541	3,66
EUR	15	Pernod Ricard SA	2.465	1,99
EUR	17	Sartorius Stedim Biotech	4.713	3,80
			13.922	11,23
Irlanda: 3,62 % (28 de febrero de 2023: 5,88 %)				
EUR	50	Kingspan Group Plc	4.495	3,62
Italia: 8,69 % (28 de febrero de 2023: 8,65 %)				
EUR	14	Ferrari NV	5.935	4,79
EUR	67	Moncler SpA	4.839	3,90
			10.774	8,69
Países Bajos: 10,18 % (28 de febrero de 2023: 5,90 %)				
EUR	3	Adyen NV, 144A	4.697	3,79
EUR	8	ASML Holding NV	7.930	6,39
			12.627	10,18
Suecia: 8,75 % (28 de febrero de 2023: 9,97 %)				
SEK	107	Assa Abloy AB	3.051	2,46
SEK	282	Atlas Copco AB	4.908	3,96
SEK	247	Hexagon AB	2.893	2,33
			10.852	8,75
Reino Unido: 2,10 % (28 de febrero de 2023: 7,55 %)				
GBP	43	Croda International Plc	2.611	2,10
Estados Unidos: 51,20 % (28 de febrero de 2023: 43,39 %)				
	11	Autodesk Inc	2.790	2,25
	14	Cadence Design Systems Inc	4.272	3,45
AUD	18	CSL Ltd	3.424	2,76
	16	Estee Lauder Cos., Inc. (The) 'A'	2.343	1,89
	5	IDEXX Laboratories Inc	2.591	2,09
	31	Illumina Inc	4.382	3,53
	13	Linde Plc	5.867	4,73
	10	Mastercard Inc	4.559	3,68
	2	Mettler-Toledo International Inc	3.068	2,47
	17	Microsoft Corp	7.079	5,71
	23	NIKE Inc	2.407	1,94
	15	NVIDIA Corp	11.771	9,49
	17	ResMed Inc	2.932	2,36
	13	Veeva Systems Inc 'A'	2.881	2,32
	16	Zoetis Inc	3.134	2,53
			63.500	51,20
Total de acciones ordinarias (coste 100.292 $)			122.293	98,60
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 101.912 $)			123.913	99,91
Contratos de divisas a plazo: 0,31 % (28 de febrero de 2023: 0,03 %)				
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)			385	0,31
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias			124.298	100,22
Contratos de divisas a plazo: (0,02 %) (28 de febrero de 2023: (1,01 %))				
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)			(22)	(0,02)
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias			(22)	(0,02)
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias			124.276	100,20
Excedente de pasivos respecto a otros activos			(255)	(0,20)
Patrimonio			124.021 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 4.697.000 USD o el 3,79 % del patrimonio neto.

ABREVIATURAS:

AUD – Dólar australiano
DKK – Corona danesa
EUR – Euro
GBP – Libra esterlina
SEK – Corona sueca

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	98,22
Organismos de inversión colectiva	1,30
Instrumentos financieros derivados	0,31
Otros activos	0,17
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)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	2.192	Venta	EUR	2.042	$	(18)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	211	Venta	EUR	194		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	79	Venta	GBP	62		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	134	Venta	USD	171		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	2.360	Venta	USD	2.968		10
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	1.894	Venta	USD	2.053		(4)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	70.246	Venta	USD	75.597		375
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 41 $)								$	385
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (1.422) $)									(22)
Apreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (1.381) $)								$	363

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

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Acciones (en miles)			Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Organismos de inversión colectiva: 0,67 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
	142	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	142	0,67
Total de organismos de inversión colectiva (coste 142 $)			142	0,67
Acciones ordinarias: 57,04 % (28 de febrero de 2023: 56,65 %)				
Australia: 14,00 % (28 de febrero de 2023: 13,13 %)				
AUD	74	AGL Energy Ltd	407	1,92
AUD	110	APA Group	562	2,66
AUD	583	Aurizon Holdings Ltd	1.446	6,84
AUD	62	Transurban Group	546	2,58
			2.961	14,00
China: 12,83 % (28 de febrero de 2023: 13,32 %)				
HKD	386	China Merchants Port Holdings Co Ltd	479	2,27
HKD	5.420	China Tower Corp Ltd, 144A	661	3,12
HKD	1.588	Guangdong Investment Ltd	943	4,46
HKD	1.106	Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	629	2,98
			2.712	12,83
Hong Kong: 6,45 % (28 de febrero de 2023: 5,49 %)				
HKD	74	CLP Holdings Ltd	611	2,89
HKD	226	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	752	3,56
			1.363	6,45
India: 4,79 % (28 de febrero de 2023: 7,70 %)				
INR	162	NHPC Ltd	172	0,81
INR	246	Power Grid Corp of India Ltd	842	3,98
			1.014	4,79
Malasia: 2,86 % (28 de febrero de 2023: 2,57 %)				
MYR	50	Petronas Gas Bhd	187	0,88
MYR	524	Westports Holdings Bhd	418	1,98
			605	2,86
Nueva Zelanda: 7,23 % (28 de febrero de 2023: 5,98 %)				
NZD	228	Chorus Ltd	1.093	5,17
NZD	88	Contact Energy Ltd	435	2,06
			1.528	7,23
Filipinas: 1,70 % (28 de febrero de 2023: 1,10 %)				
PHP	53	Manila Electric Co	360	1,70
Singapur: 4,55 % (28 de febrero de 2023: 4,14 %)				
SGD	772	Capitaland India Trust	582	2,75
SGD	606	NETLINK NBN TRUST	380	1,80
			962	4,55
Tailandia: 2,63 % (28 de febrero de 2023: 3,22 %)				
THB	2.545	Digital Telecommunications Infrastructure Fund	555	2,63
Total de acciones ordinarias (coste 13.391 $)			12.060	57,04
Fondos de inversión inmobiliaria: 41,92 % (28 de febrero de 2023: 42,58 %)				
Australia: 20,10 % (28 de febrero de 2023: 20,53 %)				
AUD	70	Charter Hall Long Wale REIT	169	0,80
AUD	349	Charter Hall Retail REIT	803	3,80
AUD	233	GPT Group/The	657	3,11
AUD	184	Region RE Ltd	264	1,25
AUD	614	Scentre Group	1.240	5,86
AUD	174	Stockland	507	2,40
AUD	482	Vicinity Ltd	609	2,88
			4.249	20,10
Hong Kong: 8,61 % (28 de febrero de 2023: 8,91 %)				
HKD	1.152	Fortune Real Estate Investment Trust	662	3,13
HKD	234	Link REIT	1.157	5,48
			1.819	8,61
India: 6,31 % (28 de febrero de 2023: 4,22 %)				
INR	292	Embassy Office Parks REIT	1.335	6,31
Nueva Zelanda: 1,96 % (28 de febrero de 2023: 2,04 %)				
NZD	810	Kiwi Property Group Ltd	415	1,96
Singapur: 4,94 % (28 de febrero de 2023: 6,88 %)				
SGD	249	CapitaLand Integrated Commercial Trust	364	1,72
SGD	106	Frasers Centrepoint Trust	173	0,81
SGD	298	Mapletree Industrial Trust	509	2,41
			1.046	4,94
Total de fondos de inversión inmobiliaria (coste 10.040 $)			8.864	41,92
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 23.573 $)			21.066	99,63
Contratos de divisas a plazo: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)			–	–
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias			21.066	99,63
Contratos de divisas a plazo: 0,00 % (28 de febrero de 2023: (0,07 %))				
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			21.066	99,63
Excedente de otros activos respecto a los pasivos			78	0,37
Patrimonio			21.144 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 661.000 USD o el 3,12 % del patrimonio neto.

ABREVIATURAS:

AUD – Dólar australiano
HKD – Dólar de Hong Kong
INR – Rupia india
MYR – Ringgit malasio
NZD – Dólar neozelandés
PHP – Peso filipino
SGD – Dólar de Singapur
THB – Baht tailandés

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	95,77
Organismos de inversión colectiva	0,65
Otros activos	3,58
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)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	–	Venta	AUD	–	$ –
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	–	Venta	AUD	1	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	–	Venta	CNH	–	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	2	Venta	SGD	3	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	2	Venta	SGD	3	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	309	Venta	USD	230	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CNH	7	Venta	USD	1	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	AUD	34	Venta	USD	22	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	CNH	–	Venta	USD	–	–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	SGD	4	Venta	USD	3	–
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 1 $)								–
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (19) $)								–
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (18) $)								–

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Acciones (en miles)			Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Organismos de inversión colectiva: 1,33 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
	420	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	420	1,33
Total de organismos de inversión colectiva (coste 420 $)			420	1,33
Acciones ordinarias: 99,24 % (28 de febrero de 2023: 99,55 %)				
Brasil: 6,81 % (28 de febrero de 2023: 6,02 %)				
BRL	169	B3 SA – Brasil Bolsa Balcao	436	1,38
BRL	166	Cosan SA	568	1,80
	–	MercadoLibre Inc	359	1,13
BRL	104	Odontoprev SA	253	0,80
BRL	73	WEG SA	538	1,70
			2.154	6,81
Chile: 2,52 % (28 de febrero de 2023: 2,16 %)				
GBP	35	Antofagasta Plc	797	2,52
China: 20,48 % (28 de febrero de 2023: 28,67 %)				
HKD	55	Alibaba Group Holding Ltd	510	1,61
	6	Alibaba Group Holding Ltd ADR	418	1,32
HKD	141	China Merchants Bank Co Ltd	546	1,72
CNH	17	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	378	1,19
HKD	4	JD.com Inc	50	0,16
	10	JD.com Inc ADR	225	0,71
HKD	42	Meituan 'B', 144A	424	1,34
HKD	226	Minth Group Ltd	384	1,22
HKD	108	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	481	1,52
CNH	17	Proya Cosmetics Co., Ltd	248	0,78
HKD	111	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	200	0,63
CNH	47	Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	407	1,29
CNH	4	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co.,Ltd.	156	0,49
HKD	49	Tencent Holdings Ltd	1.726	5,46
HKD	78	Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	183	0,58
HKD	240	Xinyi Solar Holdings Ltd	146	0,46
			6.482	20,48
Hong Kong: 1,97 % (28 de febrero de 2023: 2,94 %)				
HKD	77	AIA Group Ltd	624	1,97
India: 20,62 % (28 de febrero de 2023: 17,02 %)				
INR	11	Asian Paints Ltd	374	1,18
INR	65	HDFC Bank Ltd	1.107	3,50
INR	81	ICICI Bank Ltd	1.034	3,27
INR	24	Kotak Mahindra Bank Ltd	489	1,55
INR	4	Maruti Suzuki India Ltd	568	1,79
INR	30	Reliance Industries Ltd	1.061	3,35
INR	11	Tata Consultancy Services Ltd	535	1,69
INR	20	Titan Co Ltd	896	2,83
INR	4	UltraTech Cement Ltd	461	1,46
			6.525	20,62
Indonesia: 4,57 % (28 de febrero de 2023: 3,54 %)				
IDR	927	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	353	1,11
IDR	1.920	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	750	2,37
IDR	1.352	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	344	1,09
			1.447	4,57
México: 4,78 % (28 de febrero de 2023: 4,57 %)				
MXN	71	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	733	2,32
MXN	117	Orbia Advance Corp SAB de CV	216	0,68
MXN	141	Wal-Mart de México SAB de CV	563	1,78
			1.512	4,78
Perú: 0,87 % (28 de febrero de 2023: 1,15 %)				
	2	Credicorp Ltd	276	0,87
Filipinas: 0,31 % (28 de febrero de 2023: 0,43 %)				
PHP	148	Robinsons Retail Holdings Inc	99	0,31
Arabia Saudita: 2,87 % (28 de febrero de 2023: 1,78 %)				
SAR	29	Al Rajhi Bank	683	2,16
SAR	3	Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co	226	0,71
			909	2,87
Sudáfrica: 1,23 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)				
ZAR	4	Capitec Bank Holdings Ltd	389	1,23
Corea del Sur: 16,39 % (28 de febrero de 2023: 15,91 %)				
KRW	1	LG Chem Ltd	429	1,36
KRW	–	LG Energy Solution Ltd	85	0,27
KRW	2	NAVER Corp	268	0,85
KRW	50	Samsung Electronics Co Ltd	2.761	8,72
KRW	1	Samsung SDI Co Ltd	249	0,79
KRW	12	SK Hynix Inc	1.394	4,40
			5.186	16,39

Acciones (en miles)			Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Taiwán: 12,76 % (28 de febrero de 2023: 12,47 %)				
TWD	46	Delta Electronics Inc	429	1,36
TWD	28	Globalwafers Co Ltd	494	1,56
TWD	142	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	3.114	9,84
			4.037	12,76
Estados Unidos: 3,06 % (28 de febrero de 2023: 2,42 %)				
	1	EPAM Systems Inc	272	0,86
	3	Globant SA	697	2,20
			969	3,06
Total de acciones ordinarias (coste 37.296 $)			31.406	99,24
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias			31.826	100,57
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias			31.826	100,57
Excedente de pasivos respecto a otros activos			(179)	(0,57)
Patrimonio			31.647 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 607.000 USD o el 1,92 % del patrimonio neto.

ABREVIATURAS:

ADR	–	Recibo de depósito estadounidense
BRL	–	Real brasileño
CNH	–	Renminbi chino
GBP	–	Libra esterlina
HKD	–	Dólar de Hong Kong
IDR	–	Rupia indonesia
INR	–	Rupia india
KRW	–	Won surcoreano
MXN	–	Peso mexicano
PHP	–	Peso filipino
SAR	–	Riyal saudí
TWD	–	Dólar taiwanés
ZAR	–	Rand sudafricano

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	98,27
Organismos de inversión colectiva	1,31
Otros activos	0,42
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 Martin Currie European Unconstrained Fund

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Acciones (en miles)			Valor (en miles) EUR	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias: 98,91 % (28 de febrero de 2023: 99,83 %)				
Dinamarca: 3,82 % (28 de febrero de 2023: 3,76 %)				
DKK	59	Coloplast A/S	7.211	3,82
Francia: 18,79 % (28 de febrero de 2023: 21,05 %)				
	173	Dassault Systemes SE	7.511	3,98
	14	Kering SA	6.053	3,20
	22	L'Oreal SA	9.893	5,24
	27	Pernod Ricard SA	4.160	2,20
	31	Sartorius Stedim Biotech	7.877	4,17
			35.494	18,79
Alemania: 5,97 % (28 de febrero de 2023: 7,65 %)				
	80	Infineon Technologies AG	2.665	1,41
	97	Nemetschek SE	8.614	4,56
			11.279	5,97
Irlanda: 4,84 % (28 de febrero de 2023: 6,83 %)				
	109	Kingspan Group Plc	9.148	4,84
Italia: 16,43 % (28 de febrero de 2023: 15,71 %)				
	46	Ferrari NV	18.152	9,61
	193	Moncler SpA	12.877	6,82
			31.029	16,43
Países Bajos: 17,23 % (28 de febrero de 2023: 8,94 %)				
	5	Adyen NV, 144A	7.420	3,93
	21	ASML Holding NV	18.024	9,54
	42	BE Semiconductor Industries NV	7.089	3,76
			32.533	17,23
Suecia: 13,41 % (28 de febrero de 2023: 13,48 %)				
SEK	330	Assa Abloy AB	8.742	4,63
SEK	555	Atlas Copco AB	8.930	4,73
SEK	707	Hexagon AB	7.652	4,05
			25.324	13,41
Suiza: 4,51 % (28 de febrero de 2023: 3,36 %)				
CHF	6	Partners Group Holding AG	8.516	4,51
Reino Unido: 4,17 % (28 de febrero de 2023: 12,44 %)				
GBP	99	Croda International Plc	5.533	2,93
GBP	1.508	Oxford Nanopore Technologies Plc	2.344	1,24
			7.877	4,17
Estados Unidos: 9,74 % (28 de febrero de 2023: 6,61 %)				
USD	25	Linde Plc	10.354	5,48
USD	7	Mettler-Toledo International Inc	8.046	4,26
			18.400	9,74

Acciones (en miles)	Valor (en miles) EUR	% del valor neto de los activos
Total de acciones ordinarias (coste 177.839 €)	186.811	98,91
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 177.839 €)	186.811	98,91
Contratos de divisas a plazo: 0,00 % (28 de febrero de 2023: 0,01 %)		
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	3	–
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	186.814	98,91
Contratos de divisas a plazo: 0,00 % (28 de febrero de 2023: (0,01 %))		
Depreciación latente de contratos (véase más abajo)	(9)	–
Total de pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	(9)	–
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	186.805	98,91
Excedente de otros activos respecto a los pasivos	2.073	1,09
Patrimonio	188.878 €	100,00

– Los importes designados como "–" son 0 EUR, menos de 1.000 EUR, 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 7.420.000 EUR o el 3,93 % 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 los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	98,84
Instrumentos financieros derivados	–
Otros activos	1,16
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)	
04 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	761	Venta	BRL	4.108	€	(3)
04 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	25	Venta	BRL	136		–
04 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	BRL	125	Venta	EUR	23		–
04 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	BRL	4.120	Venta	EUR	773		(6)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	64	Venta	EUR	60		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	2	Venta	EUR	2		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	1	Venta	USD	–		–
02 de abril de 2024	BNY Mellon	Compra	BRL	4.089	Venta	EUR	755		3
Apreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 22 €)								€	3
Depreciación latente de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): (20) €)									(9)
Depreciación neta de contratos de divisas a plazo (28 de febrero de 2023 (en miles): 2 €)								€	(6)

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

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Martin Currie Improving Society Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Acciones (en miles)			Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Acciones ordinarias: 99,00 %				
Brasil: 5,36 %				
	–	MercadoLibre Inc	332	5,36
Dinamarca: 5,81 %				
DKK	6	Novozymes A/S	359	5,81
Francia: 4,74 %				
EUR	9	Veolia Environnement SA	293	4,74
India: 4,82 %				
	6	HDFC Bank Ltd ADR	298	4,82
Indonesia: 3,18 %				
IDR	503	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	197	3,18
Italia: 4,26 %				
EUR	8	Amplifon SpA	264	4,26
Japón 1,15 %				
JPY	5	LITALICO Inc	71	1,15
Nigeria: 3,47 %				
GBP	179	Airtel Africa Plc, 144A	215	3,47
Suecia: 1,54 %				
SEK	3	MIPS AB	95	1,54
Emiratos Árabes Unidos: 1,80 %				
AED	249	Emirates Central Cooling Systems Corp	111	1,80
Reino Unido: 9,80 %				
GBP	4	Croda International Plc	270	4,36
GBP	12	FDM Group Holdings Plc	58	0,94
GBP	16	Mears Group Plc	73	1,19
GBP	15	Vistry Group Plc	205	3,31
			606	9,80
Estados Unidos: 53,07 %				
	6	Coursera Inc	97	1,57
	1	Deere & Co	239	3,86
	1	Ecolab Inc	302	4,88
	5	Energy Recovery Inc	77	1,24
	3	Everbridge Inc	77	1,25
	2	Illumina Inc	231	3,74
	1	Intuitive Surgical Inc	464	7,51
	2	Masimo Corp	215	3,48
	2	Planet Fitness Inc 'A'	95	1,53
	3	Revvity Inc	327	5,29
	2	Stride Inc	99	1,59
	1	Valmont Industries Inc	249	4,03
	1	Veeva Systems Inc 'A'	283	4,57
	5	Verra Mobility Corp 'A'	98	1,59
	3	Xylem Inc/NY	430	6,94
			3.283	53,07

Acciones (en miles)	Valor (en miles) USD	% del valor neto de los activos
Total de acciones ordinarias (coste 6.132 $)	6.124	99,00
Total de inversiones a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (coste 6.132 $)	6.124	99,00
Contratos de divisas a plazo: 0,08 %		
Apreciación latente sobre contratos (véase más abajo)	5	0,08
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias	6.129	99,08
Contratos de divisas a plazo: 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	6.129	99,08
Excedente de otros activos respecto a los pasivos	57	0,92
Patrimonio	6.186 $	100,00

– 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. Al 29 de febrero de 2024, estos títulos sumaban 215.000 USD o el 3,47 % del patrimonio neto.

ABREVIATURAS:

ADR – Recibo de depósito estadounidense
AED – Dírham de los Emiratos Árabes Unidos
DKK – Corona danesa
EUR – Euro
GBP – Libra esterlina
IDR – Rupia indonesia
JPY – Yen japonés
SEK – Corona sueca

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	97,97
Instrumentos financieros derivados	0,08
Otros activos	1,95
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)
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	2	Venta	EUR	1		$ –
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	USD	24	Venta	GBP	19		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	13	Venta	USD	17		–
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	GBP	1.078	Venta	USD	1.357		5
15 de marzo de 2024	BNY Mellon	Compra	EUR	91	Venta	USD	97		–
Apreciación latente sobre contratos de divisas a plazo									$ 5
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo									–
Apreciación neta de contratos de divisas a plazo									$ 5

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

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Franklin Responsible Income 2028 Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) EUR	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos: 95,43 % (28 de febrero de 2023: 92,33 %)			
Australia: 1,31 % (28 de febrero de 2023: 1,34 %)			
1.300	Macquarie Group Ltd, 0,350 %, due 03/03/2028	1.150	1,31
Bélgica: 2,49 % (28 de febrero de 2023: 2,19 %)			
900	Azelis Finance NV, 5,750 %, con vencimiento el 15/03/2028	930	1,06
1.200	Crelan SA, 5,750 %, con vencimiento el 26/01/2028	1.252	1,43
		2.182	2,49
China: 1,20 % (28 de febrero de 2023: 1,32 %)			
1.200	Prosus NV, 1,539 %, con vencimiento el 03/08/2028	1.056	1,20
República Checa: 1,44 % (28 de febrero de 2023: 1,77 %)			
1.300	CEZ AS, 3,000 %, con vencimiento el 05/06/2028	1.258	1,44
Dinamarca: 3,88 % (28 de febrero de 2023: 1,57 %)			
1.000	Danske Bank A/S, 4,500 %, con vencimiento el 09/11/2028 *	1.018	1,16
1.400	H Lundbeck A/S, 0,875 %, con vencimiento el 14/10/2027	1.253	1,43
1.300	Nykredit Realkredit AS, 0,375 %, con vencimiento el 17/01/2028	1.135	1,29
		3.406	3,88
Finlandia: 1,49 % (28 de febrero de 2023: 1,55 %)			
1.500	OP Corporate Bank plc, 0,375 %, con vencimiento el 16/06/2028	1.303	1,49
Francia: 19,20 % (28 de febrero de 2023: 16,09 %)			
600	Adevinta ASA, 3,000 %, con vencimiento el 15/11/2027	604	0,69
1.100	ALD SA, 3,875 %, con vencimiento el 24/01/2028	1.097	1,25
500	Altice France SA/France, 3,375 %, con vencimiento el 15/01/2028	408	0,47
1.500	BNP Paribas SA, 0,500 %, con vencimiento el 19/02/2028 *	1.361	1,55
1.200	BPCE SA, 4,375 %, con vencimiento el 13/07/2028	1.220	1,39
600	CAB SELAS, 3,375 %, con vencimiento el 01/02/2028	547	0,62
1.400	Credit Agricole SA, 0,375 %, con vencimiento el 20/04/2028	1.225	1,40
1.500	Engie SA, 1,750 %, con vencimiento el 27/03/2028	1.398	1,59
1.400	Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1,625 %, con vencimiento el 27/11/2027	1.303	1,49
320	KOC Holding SASU, 5,625 %, con vencimiento el 15/10/2023	319	0,36
300	iliad SA, 1,875 %, con vencimiento el 11/02/2028	274	0,31
1.300	La Banque Postale SA, 1,000 %, con vencimiento el 09/02/2028 *	1.193	1,36
1.300	Orano SA, 2,750 %, con vencimiento el 08/03/2028	1.247	1,42
200	Paprec Holding SA, 6,500 %, con vencimiento el 17/11/2027	210	0,24
1.000	RCI Banque SA, 4,875 %, con vencimiento el 21/09/2028	1.037	1,18
900	Rexel SA, 2,125 %, con vencimiento el 15/12/2028	830	0,95
1.500	Société Générale SA, 0,125 %, con vencimiento el 18/02/2028	1.311	1,50
1.200	TDF Infrastructure SASU, 5,625 %, con vencimiento el 21/07/2028	1.258	1,43
		16.842	19,20
Alemania: 2,51 % (28 de febrero de 2023: 3,54 %)			
1.200	Commerzbank AG, 4,625 %, con vencimiento el 21/03/2028 *	1.214	1,38
1.000	Deutsche Lufthansa AG, 3,750 %, con vencimiento el 11/02/2028	986	1,13
		2.200	2,51
Irlanda: 3,05 % (28 de febrero de 2023: 3,05 %)			
1.400	AIB Group Plc, 2,250 %, con vencimiento el 04/04/2028 *	1.334	1,52
1.300	Bank of Ireland Group Plc, 4,875 %, con vencimiento el 16/07/2028 *	1.343	1,53
		2.677	3,05
Italia: 5,01 % (28 de febrero de 2023: 7,49 %)			
900	Autostrade per l'Italia SpA, 1,625 %, con vencimiento el 25/01/2028	830	0,95
350	IMA Industria Macchine Automatiche SpA, 3,750 %, con vencimiento el 15/01/2028	335	0,38
1.500	Intesa Sanpaolo SpA, 1,750 %, con vencimiento el 20/03/2028	1.393	1,59
400	Italmatch Chemicals SpA, 10,000 %, con vencimiento el 06/02/2028	421	0,48
1.000	Mundys SpA, 1,875 %, con vencimiento el 12/02/2028	914	1,04
500	TeamSystem SpA, 7,692 %, con vencimiento el 15/02/2028 *	501	0,57
		4.394	5,01
Japón: 1,00 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
1.000	NTT Finance Corp, 0,399 %, con vencimiento el 13/12/2028	872	1,00
Luxemburgo: 2,11 % (28 de febrero de 2023: 3,14 %)			
1.500	Logicor Financing Sarl, 4,625 %, con vencimiento el 25/07/2028	1.504	1,71
350	Cellnex Telecom SA, 4,000 %, con vencimiento el 15/11/2027	348	0,40
		1.852	2,11
Países Bajos: 4,85 % (28 de febrero de 2023: 2,14 %)			
1.300	ABN AMRO Bank NV, 4,000 %, con vencimiento el 16/01/2028	1.315	1,50
1.200	Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, con vencimiento el 27/01/2028 *	1.229	1,40
1.300	ING Groep NV, 4,875 %, con vencimiento el 14/11/2027 *	1.333	1,52
400	TenneT Holding BV, 1,375 %, con vencimiento el 05/06/2028	375	0,43
		4.252	4,85
Noruega: 1,51 % (28 de febrero de 2023: 0,00 %)			
1.500	Telenor ASA, 0,250 %, con vencimiento el 14/02/2028	1.327	1,51
Portugal: 1,34 % (28 de febrero de 2023: 2,24 %)			
1.100	Caixa Geral de Depositos SA, 5,750 %, con vencimiento el 31/10/2028 *	1.172	1,34
España: 7,24 % (28 de febrero de 2023: 9,71 %)			
1.300	Abertis Infraestructuras SA, 4,125 %, con vencimiento el 31/01/2028	1.311	1,49
400	Arena Luxembourg Finance Sarl, 1,875 %, con vencimiento el 01/02/2028	361	0,41
1.000	Banco de Sabadell SA, 5,250 %, con vencimiento el 07/02/2029 *	1.033	1,18
1.400	CaixaBank SA, 0,750 %, con vencimiento el 26/05/2028 *	1.272	1,45
300	Ibercaja Banco SA, 4,375 %, con vencimiento el 30/07/2028 *	302	0,34
800	Unicaja Banco SA, 7,250 %, con vencimiento el 15/11/2027 *	856	0,98
1.200	Werfen SA/Spain, 4,625 %, con vencimiento el 06/06/2028	1.216	1,39
		6.351	7,24
Suecia: 5,30 % (28 de febrero de 2023: 2,67 %)			
1.600	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,375 %, con vencimiento el 21/06/2028	1.385	1,58
1.200	Svenska Handelsbanken AB, 3,750 %, con vencimiento el 01/11/2027	1.214	1,39
600	Swedbank AB, Series gmtn, 4,250 %, con vencimiento el 11/07/2028	608	0,69
500	Verisure Holding AB, 9,250 %, con vencimiento el 15/10/2027	535	0,61
900	Volvo Car AB, 4,250 %, con vencimiento el 31/05/2028	903	1,03
		4.645	5,30
Suiza: 2,56 % (28 de febrero de 2023: 2,49 %)			
1.000	Cloverie Plc para Zurich Insurance Co Ltd, 1,500 %, con vencimiento el 15/12/2028	921	1,05
1.300	UBS Group AG, 4,625 %, con vencimiento el 17/03/2028 *	1.324	1,51
		2.245	2,56
Reino Unido: 12,16 % (28 de febrero de 2023: 14,60 %)			
1.500	Barclays Plc, 0,877 %, con vencimiento el 28/01/2028 *	1.380	1,57
1.300	easyJet FinCo BV, 1,875 %, con vencimiento el 03/03/2028	1.210	1,38
1.500	Motability Operations Group Plc, 0,125 %, con vencimiento el 20/07/2028	1.295	1,48
1.500	National Grid Plc, 0,163 %, con vencimiento el 20/01/2028	1.310	1,49
1.400	Nationwide Building Society, 0,250 %, con vencimiento el 14/09/2028	1.212	1,38
1.200	NatWest Markets Plc, 4,250 %, con vencimiento el 13/01/2028	1.229	1,40
1.300	Sage Group Plc/The, 3,820 %, con vencimiento el 15/02/2028	1.314	1,50
1.400	Santander UK Group Holdings Plc, 3,530 %, con vencimiento el 25/08/2028 *	1.378	1,57
400	Victoria Plc, 3,625 %, con vencimiento el 24/08/2026	340	0,39
		10.668	12,16
Estados Unidos: 15,78 % (28 de febrero de 2023: 14,75 %)			
600	Avantor Funding Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/07/2028	586	0,67
640	S&P Global Inc, 1,500 %, con vencimiento el 15/01/2027	600	0,68
300	Carrier Global Corp, 4,125 %, con vencimiento el 29/05/2028	305	0,35
200	Coty Inc, 5,750 %, con vencimiento el 15/09/2028	208	0,24
1.000	Crown European Holdings SA, 5,000 %, con vencimiento el 15/05/2028	1.025	1,17
1.400	DXC Capital Funding DAC, 0,450 %, con vencimiento el 15/09/2027	1.238	1,41
1.300	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000 %, con vencimiento el 22/03/2028	1.221	1,39
800	IQVIA Inc, 2,250 %, con vencimiento el 15/01/2028	742	0,85

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

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Franklin Responsible Income 2028 Fund^

Cartera de inversiones al 29 de febrero de 2024 *(continuación)*

Valor nominal (en miles)		Valor (en miles) EUR	% del valor neto de los activos
Bonos y obligaciones corporativos (continuación)			
Estados Unidos (continuación)			
1.400	JPMorgan Chase & Co, 1,638 %, con vencimiento el 18/05/2028 *	1.312	1,50
1.200	LKQ European Holdings BV, 4,125 %, con vencimiento el 01/04/2028	1.203	1,37
1.000	Morgan Stanley, 4,813 %, con vencimiento el 25/10/2028 *	1.035	1,18
1.300	PVH Corp, 3,125 %, con vencimiento el 15/12/2027	1.267	1,44
900	Schneider Electric SE, 1,500 %, con vencimiento el 15/01/2028	844	0,96
1.500	Thermo Fisher Scientific Inc, 0,500 %, con vencimiento el 01/03/2028	1.343	1,53
1.000	Verizon Communications Inc, 1,375 %, con vencimiento el 02/11/2028	914	1,04
		13.843	15,78
Total de bonos y pagarés corporativos (coste 82.295 €)		83.695	95,43
Bonos y obligaciones del Estado: 2,08 % (28 de febrero de 2023: 2,07 %)			
Rumanía: 2,08 % (28 de febrero de 2023: 2,07 %)			
2.000	Romanian Government International Bond, 2,125 %, con vencimiento el 07/03/2028	1.829	2,08
Total de bonos y obligaciones del Estado (coste: 1.775 €)		1.829	2,08
Total de activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		85.524	97,51
Total de activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias		85.524	97,51
Excedente de otros activos respecto a los pasivos		2.180	2,49
Patrimonio		87.704 €	100,00

– Los importes designados como "–" son 0 EUR, menos de 1.000 EUR, menos de 1.000 acciones o menos del 0,01 %.

* Título de tipo variable. El tipo de interés mostrado indica el tipo vigente a 29 de febrero de 2024.

Análisis del total de activos	% del total de los activos
Valores mobiliarios admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial o negociados en un mercado regulado	97,42
Otros activos	2,58
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

[Esta página se ha dejado intencionadamente en blanco]

Estado de situación financiera

(en miles)	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund A 29 de febrero de 2024	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund A 28 de febrero de 2023	FTGF Western Asset US Core Bond Fund A 29 de febrero de 2024	FTGF Western Asset US Core Bond Fund A 28 de febrero de 2023	FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund A 29 de febrero de 2024	FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund A 28 de febrero de 2023	FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund A 29 de febrero de 2024	FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund A 28 de febrero de 2023
ACTIVO CIRCULANTE:								
Liquidez y equivalentes de liquidez (nota 8)	$ 1	$ 1	$ –	$ –	$ 11.569	$ 34.310	€ 1.317	€ 4.251
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 8)	–	–	1.697	2.060	4.243	7.065	1.090	2.191
Activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (Nota 2):								
Inversiones	1.126.235	844.196	190.499	140.166	813.413	1.183.129	47.809	125.838
Inversiones pignoradas	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	102	64	460	556	–	4
Contratos de swap	–	–	1.346	2.534	10.341	8.276	–	–
Apreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	–	–	416	540	16	72
Apreciación latente de contratos de futuros	–	–	156	303	1.495	2.474	9	476
Cuentas por cobrar por inversiones vendidas (Nota 2)	–	–	2.944	1.429	9.664	17.093	–	–
Cuentas por cobrar por acciones participativas rescatables vendidas	–	–	109	53	1.264	429	–	–
Intereses y otros ingresos por cobrar	2.161	2.036	1.419	1.107	6.463	8.995	473	1.280
Dividendos por cobrar	–	–	17	8	7	10	13	31
Comisiones de gestión por pagar	–	–	–	–	–	–	–	–
Otros activos	–	–	–	–	–	–	–	–
Total activo circulante	**1.128.397**	**846.233**	**198.289**	**147.724**	**859.335**	**1.262.877**	**50.727**	**134.143**
PASIVO CIRCULANTE:								
Descubierto de efectivo (Nota 8)	–	–	1.402	620	1.193	849	60	–
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 8)	–	–	1.640	2.826	5.946	445	7	9
Pasivo financiero a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (Nota 2):								
Inversiones vendidas en corto	–	–	740	–	5.842	–	–	–
Opciones	–	–	70	70	215	615	–	4
Contratos de swap	–	–	1	46	1.640	1.867	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	–	–	1.408	2.578	15	338
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	75	180	552	3.625	224	1.065
Cuentas por pagar por inversiones adquiridas (Nota 2)	9.918	9.879	8.473	11.726	24.808	101.191	525	187
Distribuciones pagables a los tenedores de participaciones reembolsables	3.318	2.054	166	132	158	148	2	1
Comisión de gestión por pagar (Nota 4)	513	363	95	71	385	487	3	3
Comisiones de Administrador y Depositario por pagar (Nota 4)	30	24	18	16	57	73	8	14
Comisiones de servicios a los accionistas por pagar (Nota 4)	–	–	9	1	20	20	–	–
Cuentas por pagar por acciones participativas rescatables readquiridas	–	–	49	1	1.503	1.904	–	–
Gastos acumulados y otros pasivos	200	298	91	116	353	375	54	55
Pasivos (excluye los activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables)	**13.979**	**12.618**	**12.829**	**15.805**	**44.080**	**114.177**	**898**	**1.676**
Total de activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables	**$1.114.418**	**$ 833.615**	**$ 185.460**	**$ 131.919**	**$ 815.255**	**$1.148.700**	**€ 49.829**	**€ 132.467**

(en miles)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund A 29 de febrero de 2024	FTGF Western Asset Global High Yield Fund A 28 de febrero de 2023	Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund^ A 29 de febrero de 2024	Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund^ A 28 de febrero de 2023	Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund^ A 29 de febrero de 2024	Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund^ A 28 de febrero de 2023	Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^ A 29 de febrero de 2024	Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^ A 28 de febrero de 2023
ACTIVO CIRCULANTE:								
Liquidez y equivalentes de liquidez (nota 8)	$ 1.100	$ 3.850	$ 15	$ 14	$ 17	$ 17	$ 12	$ 45
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 8)	101	162	–	–	–	–	–	–
Activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (Nota 2):								
Inversiones	47.559	52.716	–	–	–	–	–	–
Inversiones pignoradas	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratos de swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Apreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	34	60	–	–	–	–	–	–
Apreciación latente de contratos de futuros	8	38	–	–	–	–	–	–
Cuentas por cobrar por inversiones vendidas (Nota 2)	295	554	–	–	–	–	–	–
Cuentas por cobrar por acciones participativas rescatables vendidas	59	4	–	–	–	–	–	–
Intereses y otros ingresos por cobrar	673	739	–	–	–	–	–	–
Dividendos por cobrar	–	–	–	–	–	–	–	–
Comisiones de gestión por pagar	–	–	–	–	–	–	–	–
Otros activos	–	–	–	–	–	–	–	–
Total activo circulante	**49.829**	**58.123**	**15**	**14**	**17**	**17**	**12**	**45**
PASIVO CIRCULANTE:								
Descubierto de efectivo (Nota 8)	235	140	–	–	–	–	–	–
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 8)	8	38	–	–	–	–	–	–
Pasivo financiero a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (Nota 2):								
Inversiones vendidas en corto	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratos de swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	24	271	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Cuentas por pagar por inversiones adquiridas (Nota 2)	736	4	–	–	–	–	–	–
Distribuciones pagables a los tenedores de participaciones reembolsables	90	89	–	–	–	–	–	–
Comisión de gestión por pagar (Nota 4)	33	41	–	–	–	–	–	–
Comisiones de Administrador y Depositario por pagar (Nota 4)	10	11	–	–	–	–	–	3
Comisiones de servicios a los accionistas por pagar (Nota 4)	1	4	–	–	–	–	–	–
Cuentas por pagar por acciones participativas rescatables readquiridas	103	–	1	–	–	–	–	–
Gastos acumulados y otros pasivos	70	94	14	14	17	17	12	42
Pasivos (excluye los activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables)	**1.310**	**692**	**15**	**14**	**17**	**17**	**12**	**45**
Total de activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables	**$ 48.519**	**$ 57.431**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**

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^	
A	A	A	A	A	A	A	A	A	A
29 de febrero de 2024	28 de febrero de 2023	29 de febrero de 2024	28 de febrero de 2023	29 de febrero de 2024	28 de febrero de 2023	29 de febrero de 2024	28 de febrero de 2023	29 de febrero de 2024	28 de febrero de 2023
$ 675	$ 1.425	$ 15.928	$ 20.391	$ 682	$ 63	$ 23	$ 60	$ 18	$ 35
–	–	1.402	882	1.418	1.126	–	–	–	–
–	–	222.636	202.891	96.006	123.407	–	–	–	–
–	–	1	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	421	102	–	–	–	–
–	–	364	775	14	1	–	–	–	–
–	–	43	74	8	–	–	–	–	–
–	–	221	4.780	179	608	–	–	–	–
–	–	245	28	27	8	–	–	–	–
–	–	2.793	2.851	1.557	1.920	–	–	–	–
–	–	16	15	4	5	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	1	–	–	–	–	–	2	–	–
675	**1.426**	**243.649**	**232.687**	**100.316**	**127.240**	**23**	**62**	**18**	**35**
–	–	–	559	–	155	–	–	–	–
–	–	39	27	237	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	219	116	–	–	–	–
–	–	1.576	4.011	1	35	–	–	–	–
–	–	139	29	–	31	–	–	–	–
–	–	541	266	2.660	1.250	–	–	–	–
–	12	86	94	163	172	–	–	–	–
–	14	94	91	57	67	–	–	–	–
2	9	22	20	13	14	–	3	–	3
–	2	6	6	5	7	–	–	–	–
662	1.366	102	45	35	74	11	11	–	–
11	23	104	184	48	79	12	48	18	32
675	**1.426**	**2.709**	**5.332**	**3.438**	**2.000**	**23**	**62**	**18**	**35**
$ –	**$ –**	**$ 240.940**	**$ 227.355**	**$ 96.878**	**$ 125.240**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^		FTGF Western Asset Global Credit Fund^		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^	
A	A	A	A	A	A	A	A	A	A
29 de febrero de 2024	28 de febrero de 2023	29 de febrero de 2024	28 de febrero de 2023	29 de febrero de 2024	28 de febrero de 2023	29 de febrero de 2024	28 de febrero de 2023	29 de febrero de 2024	28 de febrero de 2023
$ 48	$ 998	$ 3.781	$ 3.559	$ 3.684	$ 4.735	$ 211	$ 743	€ 12	€ 31
550	1.540	3.313	2.733	1.024	1.544	1.107	1.074	–	–
248.280	433.473	464.601	532.162	138.973	146.874	29.411	43.765	–	–
–	–	–	–	–	152	–	–	–	–
–	–	–	–	1	19	–	–	–	–
–	–	–	213	–	–	–	–	–	–
34	162	2.849	3.707	542	1.011	90	343	–	–
–	–	638	4.839	52	338	82	202	–	–
220	771	363	2.646	411	3.576	52	1	–	–
461	41	295	2.043	–	1	–	1	–	–
2.578	4.375	4.644	2.855	990	1.086	368	491	–	–
64	20	46	127	13	15	4	6	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	1	–	–	–	–	–	–
252.235	**441.380**	**480.530**	**554.885**	**145.690**	**159.351**	**31.325**	**46.626**	**12**	**31**
236	522	2	484	8	–	29	–	–	–
1	6	5	1	123	17	23	3	–	–
–	–	–	–	412	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	4	–	–	–	–
–	–	498	–	–	–	188	76	–	–
182	1.130	177	3.219	371	2.097	1	90	–	–
82	373	82	61	230	1.043	21	34	–	–
219	770	364	25.758	14.941	9.282	–	306	–	–
15	15	2	2	–	–	–	–	–	–
151	200	142	153	14	17	1	2	–	–
26	32	36	36	15	15	8	9	–	3
13	13	12	11	–	–	–	–	–	–
523	299	590	1.106	25	72	–	–	–	–
159	313	82	84	131	101	57	56	12	28
1.607	**3.673**	**1.992**	**30.915**	**16.270**	**12.648**	**328**	**576**	**12**	**31**
$ 250.628	**$ 437.707**	**$ 478.538**	**$ 523.970**	**$ 129.420**	**$ 146.703**	**$ 30.997**	**$ 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^ A 29 de febrero de 2024	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ A 28 de febrero de 2023	Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^ A 29 de febrero de 2024	Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^ A 28 de febrero de 2023	FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ A 29 de febrero de 2024	FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ A 28 de febrero de 2023	Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^ A 29 de febrero de 2024	Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^ A 28 de febrero de 2023
ACTIVO CIRCULANTE:								
Liquidez y equivalentes de liquidez (nota 8)	$ 26.798	$ 63.691	$ –	$ 30	$ 4.674	$ 3.203	$ –	$ –
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 8)	33.984	250.586	–	–	3.657	3.915	–	–
Activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (Nota 2):								
Inversiones	1.150.354	1.913.653	–	–	361.536	267.865	–	–
Inversiones pignoradas	69.547	1.590	–	–	–	–	–	–
Opciones	5.129	6.090	–	–	93	566	–	–
Contratos de swap	82.650	155.867	–	–	232	1.033	–	–
Apreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	8.511	21.504	–	–	1.501	536	–	–
Apreciación latente de contratos de futuros	18.244	20.467	–	–	620	53	–	–
Cuentas por cobrar por inversiones vendidas (Nota 2)	1.403	13.260	–	–	1.216	5.180	–	–
Cuentas por cobrar por acciones participativas rescatables vendidas	445	1.024	–	–	459	2.133	–	–
Intereses y otros ingresos por cobrar	19.663	36.399	–	–	4.748	3.427	–	–
Dividendos por cobrar	332	487	–	–	8	8	–	–
Comisiones de gestión por pagar	–	–	–	–	–	–	–	–
Otros activos	–	–	–	–	–	1	–	–
Total activo circulante	**1.417.060**	**2.484.618**	**–**	**30**	**378.744**	**287.920**	**–**	**–**
PASIVO CIRCULANTE:								
Descubierto de efectivo (Nota 8)	4	83.849	–	–	1.022	2	–	–
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 8)	56.547	76.579	–	–	119	119	–	–
Pasivo financiero a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (Nota 2):								
Inversiones vendidas en corto	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	7.886	46.352	–	–	17	36	–	–
Contratos de swap	18.195	43.002	–	–	286	761	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	6.458	43.616	–	–	403	2.965	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	19.662	47.194	–	–	253	890	–	–
Cuentas por pagar por inversiones adquiridas (Nota 2)	97.494	4.384	–	–	3.733	7.800	–	–
Distribuciones pagables a los tenedores de participaciones reembolsables	–	–	–	–	–	–	–	–
Comisión de gestión por pagar (Nota 4)	1.269	2.062	–	–	27	24	–	–
Comisiones de Administrador y Depositario por pagar (Nota 4)	80	151	–	–	29	22	–	–
Comisiones de servicios a los accionistas por pagar (Nota 4)	104	136	–	–	–	–	–	–
Cuentas por pagar por acciones participativas rescatables readquiridas	3.476	3.140	–	–	4	82	–	–
Gastos acumulados y otros pasivos	916	1.652	–	30	170	207	–	–
Pasivos (excluye los activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables)	**212.091**	**352.117**	**–**	**30**	**6.063**	**12.908**	**–**	**–**
Total de activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables	**$1.204.969**	**$2.132.501**	**$ –**	**$ –**	**$ 372.681**	**$ 275.012**	**$ –**	**$ –**

(en miles)	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^¥ A 29 de febrero de 2024	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^¥ A 28 de febrero de 2023	FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund A 29 de febrero de 2024	FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund A 28 de febrero de 2023	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ A 29 de febrero de 2024	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ A 28 de febrero de 2023	FTGF Brandywine Global High Yield Fund^ A 29 de febrero de 2024	FTGF Brandywine Global High Yield Fund^ A 28 de febrero de 2023
ACTIVO CIRCULANTE:								
Liquidez y equivalentes de liquidez (nota 8)	$ 41	$ 136	$ –	$ 223	$ 13	$ 1.762	$ 80	$ 5
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 8)	–	194	–	–	1.146	2.709	68	8
Activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (Nota 2):								
Inversiones	–	8.571	145.313	164.330	146.547	538.707	30.535	10.360
Inversiones pignoradas	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratos de swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Apreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	92	855	3.132	3.036	13.024	38	10
Apreciación latente de contratos de futuros	–	59	–	–	256	2.190	1	2
Cuentas por cobrar por inversiones vendidas (Nota 2)	–	155	139	490	3.081	1.798	412	248
Cuentas por cobrar por acciones participativas rescatables vendidas	–	–	138	117	1	1.797	–	1
Intereses y otros ingresos por cobrar	–	104	1.469	1.781	1.371	5.523	501	175
Dividendos por cobrar	–	1	357	345	123	233	5	2
Comisiones de gestión por pagar	–	2	–	–	–	–	–	–
Otros activos	–	8	–	–	–	–	–	–
Total activo circulante	**41**	**9.322**	**148.271**	**170.418**	**155.574**	**567.743**	**31.640**	**10.811**
PASIVO CIRCULANTE:								
Descubierto de efectivo (Nota 8)	–	–	79	4	9	7	–	–
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 8)	–	26	–	850	270	2.495	–	–
Pasivo financiero a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (Nota 2):								
Inversiones vendidas en corto	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratos de swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	107	2.346	3.966	3.927	23.627	71	202
Depreciación latente de contratos de futuros	–	5	–	–	51	–	–	–
Cuentas por pagar por inversiones adquiridas (Nota 2)	–	145	139	490	2.526	1.798	287	163
Distribuciones pagables a los tenedores de participaciones reembolsables	–	–	–	–	–	–	8	1
Comisión de gestión por pagar (Nota 4)	–	–	72	83	101	260	1	–
Comisiones de Administrador y Depositario por pagar (Nota 4)	11	13	18	24	16	38	8	7
Comisiones de servicios a los accionistas por pagar (Nota 4)	–	–	10	11	1	–	–	–
Cuentas por pagar por acciones participativas rescatables readquiridas	–	–	179	2.595	2.176	–	60	–
Gastos acumulados y otros pasivos	30	31	343	386	228	247	41	44
Pasivos (excluye los activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables)	**41**	**327**	**3.186**	**8.409**	**9.305**	**28.472**	**476**	**417**
Total de activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables	**$ –**	**$ 8.995**	**$ 145.085**	**$ 162.009**	**$ 146.269**	**$ 539.271**	**$ 31.164**	**$ 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^θ		FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^μ		Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^	
A 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023	A 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023	A 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023	A 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023	A 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023
$ 3.392	$ 1.723	$ 73	$ 416	£ 46	£ 1.256	$ 123	$ 1.005	$ 196	$ 136
1.450	629	2.654	4.167	–	297	–	978	328	541
519.423	557.051	1.178.166	1.148.337	–	43.921	–	94.192	17.621	17.280
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	32	19
–	–	–	–	–	–	–	–	490	899
12	8	–	–	–	27	–	35	20	11
166	317	313	353	–	45	–	4	74	156
–	–	224.075	46.919	–	–	–	–	–	99
899	–	–	–	–	–	–	–	–	–
2.040	1.998	4.961	4.402	–	686	–	1.007	174	173
84	45	72	5	–	–	–	8	1	5
–	–	–	–	–	–	–	–	8	4
–	–	–	–	–	1	–	–	–	1
527.466	**561.771**	**1.410.314**	**1.204.599**	**46**	**46.233**	**123**	**97.229**	**18.944**	**19.324**
533	–	3.121	878	–	–	–	–	119	–
–	–	72		–	–	–	6	105	389
			54						
–	–	6.335	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	18	38
–	–	–	–	–	–	–	74	4	2
6	1.683	–	–	–	7	–	404	62	58
306	73	247	731	–	29	–	103	39	120
–	–	250.542	83.125	–	229	–	1.787	137	193
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
43	77	15	13	–	–	–	4	–	–
39	38	77	69	3	11	6	12	17	31
1	2	–	–	–	–	–	–	–	–
98	–	–	–	–	–	28	–	–	–
284	350	197	222	43	45	89	64	47	52
1.310	**2.223**	**260.606**	**85.092**	**46**	**321**	**123**	**2.454**	**548**	**883**
$ 526.156	**$ 559.548**	**$1.149.708**	**$1.119.507**	**£ –**	**£ 45.912**	**$ –**	**$ 94.775**	**$ 18.396**	**$ 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 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023	A 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023	A 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023	A 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023	A 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023
$ –	$ 422	$ 2.172	$ 2.173	$ 2	$ 32.149	$ –	$ –	$ 15	$ –
320	–	–	–	5.330	25.134	–	980	–	–
207.752	204.726	–	–	1.141.005	1.153.805	18.003	45.793	–	8.488
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	1.309	–	–	–	–
942	1.448	–	–	6.119	3.510	–	403	–	–
–	–	–	–	55	–	–	69	–	–
–	9.346	–	–	894	838	4.373	–	–	134
1	–	–	–	2.418	2.452	–	–	–	–
2.171	2.543	–	–	16.923	15.517	246	215	–	137
629	601	–	–	89	337	3	11	–	2
–	–	–	–	–	–	–	–	–	21
–	–	–	–	–	8	–	1	–	–
211.815	**219.086**	**2.172**	**2.173**	**1.172.835**	**1.235.059**	**22.625**	**47.472**	**15**	**8.782**
1	3	–	–	3.226	1	152	–	–	103
320	110	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	2.085	878	–	37	–	–
3.847	4.239	–	–	4.746	12.389	–	379	–	192
–	–	–	–	274	3.704	–	175	–	–
–	9.308	–	–	4.968	5.978	663	–	–	30
–	–	–	–	147	106	–	–	–	–
105	100	–	–	681	701	3	39	–	–
22	27	–	–	82	77	13	20	2	7
–	1	–	–	74	78	–	–	–	1
16	4	–	–	4.823	714	5.311	–	–	–
128	148	2.172	2.173	349	128	80	66	13	60
4.439	**13.940**	**2.172**	**2.173**	**21.455**	**24.754**	**6.222**	**716**	**15**	**393**
$ 207.376	**$ 205.146**	**$ –**	**$ –**	**$1.151.380**	**$1.210.305**	**$ 16.403**	**$ 46.756**	**$ –**	**$ 8.389**

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de situación financiera *(continuación)*

(en miles)	Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund^ A 29 de febrero de 2024	Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund^ A 28 de febrero de 2023	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ A 29 de febrero de 2024	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ A 28 de febrero de 2023	FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ A 29 de febrero de 2024	FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ A 28 de febrero de 2023	FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^ A 29 de febrero de 2024	FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^ A 28 de febrero de 2023
ACTIVO CIRCULANTE:								
Liquidez y equivalentes de liquidez (nota 8)	$ 15	$ –	$ 2.984	$ 1.879	$ 37	$ 1.147	$ –	$ –
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 8)	–	–	1.171	664	63	431	1.087	–
Activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (Nota 2):								
Inversiones	–	–	67.598	69.694	15.831	13.130	30.675	–
Inversiones pignoradas	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratos de swap	–	–	–	–	–	33	–	–
Apreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	430	249	54	86	–	–
Apreciación latente de contratos de futuros	–	–	14	–	1	–	14	–
Cuentas por cobrar por inversiones vendidas (Nota 2)	–	–	–	327	–	–	–	–
Cuentas por cobrar por acciones participativas rescatables vendidas	–	–	–	–	–	–	–	–
Intereses y otros ingresos por cobrar	–	–	930	948	194	186	163	–
Dividendos por cobrar	–	–	7	9	2	–	2	–
Comisiones de gestión por pagar	–	–	4	–	3	5	1	–
Otros activos	–	–	–	–	–	4	–	–
Total activo circulante	**15**	**–**	**73.138**	**73.770**	**16.185**	**15.022**	**31.942**	**–**
PASIVO CIRCULANTE:								
Descubierto de efectivo (Nota 8)	–	–	1	1	9	–	218	–
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 8)	–	–	288	122	–	–	–	–
Pasivo financiero a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (Nota 2):								
Inversiones vendidas en corto	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratos de swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	1.463	3.482	57	64	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	167	283	4	123	–	–
Cuentas por pagar por inversiones adquiridas (Nota 2)	–	–	–	327	209	–	–	–
Distribuciones pagables a los tenedores de participaciones reembolsables	–	–	–	–	–	–	–	–
Comisión de gestión por pagar (Nota 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Comisiones de Administrador y Depositario por pagar (Nota 4)	–	–	11	13	20	4	4	–
Comisiones de servicios a los accionistas por pagar (Nota 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Cuentas por pagar por acciones participativas rescatables readquiridas	15	–	–	–	–	–	–	–
Gastos acumulados y otros pasivos	–	–	171	132	57	27	21	–
Pasivos (excluye los activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables)	**15**	**–**	**2.101**	**4.360**	**356**	**218**	**243**	**–**
Total de activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables	**$ –**	**$ –**	**$ 71.037**	**$ 69.410**	**$ 15.829**	**$ 14.804**	**$ 31.699**	**$ –**

(en miles)	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund A 29 de febrero de 2024	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund A 28 de febrero de 2023	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund A 29 de febrero de 2024	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund A 28 de febrero de 2023	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund A 29 de febrero de 2024	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund A 28 de febrero de 2023	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund A 29 de febrero de 2024	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund A 28 de febrero de 2023
ACTIVO CIRCULANTE:								
Liquidez y equivalentes de liquidez (nota 8)	$ 62.331	$ 54.486	$ 2.718	$ 11.596	$ 219	$ 2.053	$ 9.574	$ 11.074
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 8)	290	530	–	–	–	–	–	–
Activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (Nota 2):								
Inversiones	1.827.864	1.172.787	205.138	214.039	35.857	36.590	1.367.716	1.629.033
Inversiones pignoradas	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratos de swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Apreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	392	286	7	4	3	1	370	22
Apreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Cuentas por cobrar por inversiones vendidas (Nota 2)	1.083	2.355	28	179	3	–	9.448	3.682
Cuentas por cobrar por acciones participativas rescatables vendidas	2.610	1.211	115	5	1	–	1.647	29.209
Intereses y otros ingresos por cobrar	109	67	2	14	11	7	6	20
Dividendos por cobrar	1.409	1.120	86	42	41	72	658	740
Comisiones de gestión por pagar	–	–	–	–	–	–	–	–
Otros activos	–	–	–	–	–	–	–	4
Total activo circulante	**1.896.088**	**1.232.842**	**208.094**	**225.879**	**36.135**	**38.723**	**1.389.419**	**1.673.784**
PASIVO CIRCULANTE:								
Descubierto de efectivo (Nota 8)	2	5	–	–	74	–	5.786	7
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Pasivo financiero a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (Nota 2):								
Inversiones vendidas en corto	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratos de swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	312	1.551	22	229	3	56	16	840
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Cuentas por pagar por inversiones adquiridas (Nota 2)	18.684	429	28	179	3	–	10.962	3.682
Distribuciones pagables a los tenedores de participaciones reembolsables	–	–	–	–	–	–	–	–
Comisión de gestión por pagar (Nota 4)	1.176	795	196	200	20	33	583	704
Comisiones de Administrador y Depositario por pagar (Nota 4)	189	165	40	43	10	11	105	130
Comisiones de servicios a los accionistas por pagar (Nota 4)	154	109	36	35	–	4	115	170
Cuentas por pagar por acciones participativas rescatables readquiridas	2.792	3.685	208	176	34	44	6.183	28.161
Gastos acumulados y otros pasivos	179	368	174	224	55	47	159	111
Pasivos (excluye los activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables)	**23.488**	**7.107**	**704**	**1.086**	**199**	**195**	**23.909**	**33.805**
Total de activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables	**$1.872.600**	**$1.225.735**	**$ 207.390**	**$ 224.793**	**$ 35.936**	**$ 38.528**	**$1.365.510**	**$1.639.979**

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^α		FTGF ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Growth Fund^		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^		FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	
A 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023	A 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023	A 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023	A 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023	A 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023
$ 22	$ –	$ 17.644	$ 12.361	$ 17	$ 59	$ 1	$ 55	$ 1.969	$ 9.110
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	2.583	1.142.135	921.986	–	–	–	–	210.196	180.681
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	622	10	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	3.823	4.380	–	–	–	–	–	43
–	–	1.295	724	–	–	–	–	4	–
–	–	69	72	–	–	–	–	4	10
–	5	1.533	989	–	–	–	–	176	160
–	23	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	2	–	–	–	–	–	–
22	**2.611**	**1.167.121**	**940.524**	**17**	**59**	**1**	**55**	**212.349**	**190.004**
–	–	614	2.030	–	–	–	–	6	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	20	6	976	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	3.823	6.635	–	–	–	–	–	43
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	715	609	–	–	–	–	185	165
3	7	90	86	–	–	–	–	26	27
–	–	57	56	–	–	–	–	28	23
–	–	4.096	288	17	29	–	–	562	55
19	50	94	118	–	30	1	55	86	81
22	**77**	**9.495**	**10.798**	**17**	**59**	**1**	**55**	**893**	**394**
$ –	**$ 2.534**	**$1.157.626**	**$ 929.726**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ 211.456**	**$ 189.610**

FTGF ClearBridge Global Growth Fund^		FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^η	
A 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023	A 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023	A 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023	A 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023	A 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023
$ 185	$ 385	€ 17.951	€ 25.979	$ 24	$ 50	$ 10.286	$ 8.169	$ 506	$ –
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
16.583	12.823	807.917	1.032.510	–	–	326.235	399.290	5.144	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	26	1.921	–	–	255	24	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
95	–	450	3.932	–	–	294	3.321	3	–
–	–	747	2.238	–	–	27	1.858	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	1	–
9	13	1.466	1.740	–	–	2.107	2.085	9	–
–	–	–	–	–	–	–	–	6	–
–	–	–	3	–	–	–	14	–	–
16.872	**13.221**	**828.557**	**1.068.323**	**24**	**50**	**339.204**	**414.761**	**5.669**	**–**
–	–	1	2	–	–	–	6	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	891	1.058	–	–	124	2.229	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
52	–	450	2.286	–	–	5.843	3.872	3	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
3	6	655	826	–	–	296	377	–	–
8	9	69	103	–	3	28	31	10	–
–	–	76	99	–	–	51	74	–	–
50	–	3.388	1.022	–	–	989	2.062	–	–
41	27	104	94	24	47	64	62	15	–
154	**42**	**5.634**	**5.490**	**24**	**50**	**7.395**	**8.713**	**28**	**–**
$ 16.718	**$ 13.179**	**€ 822.923**	**€1.062.833**	**$ –**	**$ –**	**$ 331.809**	**$ 406.048**	**$ 5.641**	**$ –**

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de situación financiera *(continuación)*

(en miles)	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund A 29 de febrero de 2024	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund A 28 de febrero de 2023	FTGF Royce US Smaller Companies Fund A 29 de febrero de 2024	FTGF Royce US Smaller Companies Fund A 28 de febrero de 2023	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^ A 29 de febrero de 2024	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^ A 28 de febrero de 2023	Legg Mason US Equity Fund^ A 29 de febrero de 2024	Legg Mason US Equity Fund^ A 28 de febrero de 2023
ACTIVO CIRCULANTE:								
Liquidez y equivalentes de liquidez (nota 8)	$ 1.913	$ 1	$ 12	$ –	$ –	$ –	$ 23	$ 23
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 8)	–	330	–	–	–	–	–	–
Activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (Nota 2):								
Inversiones	689.142	744.113	96.082	78.654	4.422	4.273	–	–
Inversiones pignoradas	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratos de swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Apreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	292	150	1	–	–	–	–	–
Apreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Cuentas por cobrar por inversiones vendidas (Nota 2)	3.223	1.897	294	144	–	–	–	–
Cuentas por cobrar por acciones participativas rescatables vendidas	6.008	711	64	1	–	–	–	–
Intereses y otros ingresos por cobrar	13	–	1	–	–	–	–	–
Dividendos por cobrar	406	474	34	16	7	8	–	–
Comisiones de gestión por pagar	–	–	–	–	11	–	–	–
Otros activos	–	–	–	1	–	–	–	–
Total activo circulante	**700.997**	**747.676**	**96.488**	**78.816**	**4.440**	**4.281**	**23**	**23**
PASIVO CIRCULANTE:								
Descubierto de efectivo (Nota 8)	4	643	–	142	8	–	–	–
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Pasivo financiero a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (Nota 2):								
Inversiones vendidas en corto	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratos de swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	170	1.623	–	2	–	–	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Cuentas por pagar por inversiones adquiridas (Nota 2)	1.393	1.944	343	358	–	–	–	–
Distribuciones pagables a los tenedores de participaciones reembolsables	–	–	–	–	–	–	–	–
Comisión de gestión por pagar (Nota 4)	595	624	97	83	–	1	–	–
Comisiones de Administrador y Depositario por pagar (Nota 4)	74	82	15	16	6	7	–	–
Comisiones de servicios a los accionistas por pagar (Nota 4)	111	109	12	12	–	–	–	–
Cuentas por pagar por acciones participativas rescatables readquiridas	3.599	915	25	37	–	–	–	–
Gastos acumulados y otros pasivos	161	207	61	68	40	19	23	23
Pasivos (excluye los activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables)	**6.107**	**6.147**	**553**	**718**	**54**	**27**	**23**	**23**
Total de activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables	**$ 694.890**	**$ 741.529**	**$ 95.935**	**$ 78.098**	**$ 4.386**	**$ 4.254**	**$ –**	**$ –**

(en miles)	Legg Mason Japan Equity Fund^ A 29 de febrero de 2024	Legg Mason Japan Equity Fund^ A 28 de febrero de 2023	FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^β A 29 de febrero de 2024	FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^β A 28 de febrero de 2023	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund^ A 29 de febrero de 2024	Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund^ A 28 de febrero de 2023	Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^ A 29 de febrero de 2024	Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^ A 28 de febrero de 2023
ACTIVO CIRCULANTE:								
Liquidez y equivalentes de liquidez (nota 8)	¥ 126.058	¥ 114.974	$ 57	$ 12	$ 28	$ 28	€ 83	€ 65
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (Nota 2):								
Inversiones	–	–	–	3.598	–	–	–	–
Inversiones pignoradas	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratos de swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Apreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	–	–	–	–	–	–
Apreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Cuentas por cobrar por inversiones vendidas (Nota 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Cuentas por cobrar por acciones participativas rescatables vendidas	–	–	–	–	–	–	–	–
Intereses y otros ingresos por cobrar	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividendos por cobrar	–	–	–	14	–	–	–	–
Comisiones de gestión por pagar	–	–	–	–	–	–	–	–
Otros activos	–	–	–	4	–	–	–	–
Total activo circulante	**126.058**	**114.974**	**57**	**3.628**	**28**	**28**	**83**	**65**
PASIVO CIRCULANTE:								
Descubierto de efectivo (Nota 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Pasivo financiero a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (Nota 2):								
Inversiones vendidas en corto	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratos de swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Cuentas por pagar por inversiones adquiridas (Nota 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Distribuciones pagables a los tenedores de participaciones reembolsables	–	–	–	–	–	–	–	–
Comisión de gestión por pagar (Nota 4)	–	–	–	2	–	–	–	–
Comisiones de Administrador y Depositario por pagar (Nota 4)	–	–	3	14	–	–	–	–
Comisiones de servicios a los accionistas por pagar (Nota 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Cuentas por pagar por acciones participativas rescatables readquiridas	–	–	–	–	–	–	–	–
Gastos acumulados y otros pasivos	126.058	114.974	54	74	28	28	83	65
Pasivos (excluye los activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables)	**126.058**	**114.974**	**57**	**90**	**28**	**28**	**83**	**65**
Total de activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables	**¥ –**	**¥ –**	**$ –**	**$ 3.538**	**$ –**	**$ –**	**€ –**	**€ –**

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^		FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^δ		Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund^		Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^	
A	A	A	A	A	A	A	A	A	A
29 de febrero de 2024	28 de febrero de 2023	29 de febrero de 2024	28 de febrero de 2023	29 de febrero de 2024	28 de febrero de 2023	29 de febrero de 2024	28 de febrero de 2023	29 de febrero de 2024	28 de febrero de 2023
€ 1.417	€ 1.256	$ 2.264	$ 402	$ 61	$ 60	$ 38	$ 41	$ 2.544	$ 2.569
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	20.883	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	3	–	–	–	–	–	–
–	–	–	1	–	–	–	–	–	–
11	3	–	62	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
1.428	**1.259**	**2.264**	**21.351**	**61**	**60**	**38**	**41**	**2.544**	**2.569**
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	90	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	25	–	–	–	–	–	–
–	3	2	11	–	–	–	–	–	4
–	–	–	2	–	–	–	–	–	–
1.175	1.185	2.213	–	59	59	1	2	2.517	2.516
253	71	49	133	2	1	37	39	27	49
1.428	**1.259**	**2.264**	**261**	**61**	**60**	**38**	**41**	**2.544**	**2.569**
€ –	**€ –**	**$ –**	**$ 21.090**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**

Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund^		Legg Mason Martin Currie Greater China 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^	
A	A	A	A	A	A	A	A	A	A
29 de febrero de 2024	28 de febrero de 2023	29 de febrero de 2024	28 de febrero de 2023	29 de febrero de 2024	28 de febrero de 2023	29 de febrero de 2024	28 de febrero de 2023	29 de febrero de 2024	28 de febrero de 2023
$ 51	$ 51	$ 61	$ 61	$ –	$ 87	$ 134	$ 156	$ –	$ 174
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	123.913	142.529	21.066	24.963	31.826	34.547
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	385	41	–	1	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	63	154	518	–	–	–
–	–	–	–	82	85	–	–	107	104
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	70	61	131	145	27	31
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
51	**51**	**61**	**61**	**124.513**	**142.957**	**21.849**	**25.265**	**31.960**	**34.856**
–	–	–	–	180	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	22	1.422	–	19	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	63	154	507	–	75	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	64	76	8	18	16	26
–	–	–	–	16	19	8	9	10	11
–	–	–	–	7	8	–	3	–	1
51	51	38	38	89	184	5	–	40	–
–	–	23	23	51	45	177	95	172	116
51	**51**	**61**	**61**	**492**	**1.908**	**705**	**144**	**313**	**154**
$ –	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ 124.021**	**$ 141.049**	**$ 21.144**	**$ 25.121**	**$ 31.647**	**$ 34.702**

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de situación financiera *(continuación)*

(en miles)	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^ A 29 de febrero de 2024	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^ A 28 de febrero de 2023	FTGF Martin Currie Improving Society Fund^γ A 29 de febrero de 2024	FTGF Martin Currie Improving Society Fund^γ A 28 de febrero de 2023	Franklin Responsible Income 2028 Fund^ A 29 de febrero de 2024	Franklin Responsible Income 2028 Fund^ A 28 de febrero de 2023	Franklin Templeton Global Funds Plc A 29 de febrero de 2024	Franklin Templeton Global Funds Plc A 28 de febrero de 2023
ACTIVO CIRCULANTE:								
Liquidez y equivalentes de liquidez (nota 8)	€ 930	€ 780	$ 110	$ –	€ 1.298	€ 1.848	$ 216.937	$ 331.948
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 8)	–	–	–	–	–	–	67.581	312.657
Activos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (Nota 2):								
Inversiones	186.811	188.780	6.124	–	85.524	34.759	15.732.630	17.052.700
Inversiones pignoradas	–	–	–	–	–	–	69.548	1.742
Opciones	–	–	–	–	–	–	5.817	7.318
Contratos de swap	–	–	–	–	–	–	95.480	170.266
Apreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	3	22	5	–	–	–	28.242	53.350
Apreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	22.250	32.496
Cuentas por cobrar por inversiones vendidas (Nota 2)	–	4.857	–	–	–	–	269.303	135.703
Cuentas por cobrar por acciones participativas rescatables vendidas	1.196	1.732	–	–	–	689	20.881	48.971
Intereses y otros ingresos por cobrar	–	–	–	–	946	344	80.950	103.724
Dividendos por cobrar	65	57	1	–	18	11	10.289	10.290
Comisiones de gestión por pagar	–	–	11	–	–	9	44	64
Otros activos	–	1	–	–	2	2	2	59
Total activo circulante	**189.005**	**196.229**	**6.251**	**–**	**87.788**	**37.662**	**16.619.954**	**18.261.288**
PASIVO CIRCULANTE:								
Descubierto de efectivo (Nota 8)	–	3	–	–	–	–	18.339	91.015
Cuentas de margen y efectivo restringido (Nota 8)	–	–	–	–	–	–	65.750	84.123
Pasivo financiero a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias (Nota 2):								
Inversiones vendidas en corto	–	–	–	–	–	–	13.329	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	8.206	47.119
Contratos de swap	–	–	–	–	–	–	23.116	46.859
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	9	20	–	–	–	–	28.790	121.367
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	22.426	59.938
Cuentas por pagar por inversiones adquiridas (Nota 2)	–	4.372	–	–	–	815	466.191	301.633
Distribuciones pagables a los tenedores de participaciones reembolsables	–	–	–	–	–	–	4.155	2.826
Comisión de gestión por pagar (Nota 4)	54	55	–	–	32	–	8.560	9.548
Comisiones de Administrador y Depositario por pagar (Nota 4)	23	41	21	–	9	2	1.478	1.695
Comisiones de servicios a los accionistas por pagar (Nota 4)	1	1	–	–	–	–	910	1.005
Cuentas por pagar por acciones participativas rescatables readquiridas	–	2.603	–	–	–	–	48.290	54.803
Gastos acumulados y otros pasivos	40	37	44	–	43	22	10.107	11.327
Pasivos (excluye los activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables)	**127**	**7.132**	**65**	**–**	**84**	**839**	**719.647**	**833.258**
Total de activos netos atribuibles a tenedores de acciones participativas rescatables	**€ 188.878**	**€ 189.097**	**$ 6.186**	**$ –**	**€ 87.704**	**€ 36.823**	**$ 15.900.307**	**$ 17.428.030**

Los importes que se indican con "–" equivalen a cero USD/EUR/JPY/GBP o son inferiores a 1.000 USD/EUR/JPY/GBP.

Las cifras en euros para 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 USD en la cifra total de Franklin Templeton Global Funds Plc para el ejercicio cerrado el 29 de febrero de 2024 utilizando el tipo de cierre en USD/EUR de 0,9252 (28 de febrero de 2023: 0,9454).

Las cifras del yen de Legg Mason Japan Equity Fund^ se han convertido a dólares estadounidenses en la cifra total de Franklin Templeton Global Funds Plc para el ejercicio cerrado el 29 de febrero de 2024 utilizando el tipo de cierre USD/JPY de 149,9200 (28 de febrero de 2023: 136,1550).

Las cifras en libras esterlinas de FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund han sido convertidas a dólares estadounidenses en la cifra total de Franklin Templeton Global Funds Plc para el ejercicio cerrado el 29 de febrero de 2024 utilizando el tipo de cierre USD/GBP de 0,7922 (28 de febrero de 2023: 0,8314).

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 operar.*

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

γ *A partir del 20 de junio de 2023, FTGF Martin Currie Improving Society Fund^ comenzó a operar.*

δ *El 17 de julio de 2023, FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^ dejó de cotizar en bolsa.*

η *A partir del 22 de septiembre de 2023, FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^ comenzó a operar.*

θ *A partir del 23 de octubre de 2023, FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^ dejó de operar.*

λ *A partir del 6 de noviembre de 2023, FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^ comenzó a operar.*

μ *A partir del 10 de noviembre de 2023, FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^ dejó de operar.*

¥ *A partir del 5 de diciembre de 2023, FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^ dejó de operar.*

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

En nombre del Consejo de Administración

Fionnuala Doris
Consejero

Joseph Keane
Consejero

13 de junio de 2024

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de situación financiera *(continuación)*

	29 de febrero de 2024			28 de febrero de 2023			28 de febrero de 2022		
	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund									
Clase A USD de Capitalización	$ 243.001	2.080	116,83	$ 164.832	1.477	111,57	$ 131.265	1.197	109,62
Clase A USD de Distribución (D)	737.375	737.387	1,00	526.302	526.316	1,00	640.232	640.245	1,00
Clase B USD de Capitalización	1	–	110,97	74	1	106,43	73	1	104,91
Clase B USD de Distribución (D)	174	174	1,00	218	218	1,00	–	–	–
Clase C USD de Capitalización	168	2	109,18	153	1	105,01	5.317	51	103,69
Clase C USD de Distribución (D)	–	–	–	134	134	1,00	140	140	1,00
Clase X USD de Distribución (D)	133.030	133.032	1,00	141.184	141.186	1,00	141.538	141.540	1,00
Clase A (G) USD de Capitalización	461	4	117,06	481	4	111,80	488	4	109,85
Clase A (G) USD de Distribución (D)	201	200	1,00	230	230	1,00	264	264	1,00
Clase L (G) USD de Distribución (D)	7	7	1,00	7	7	1,00	7	7	1,00
FTGF Western Asset US Core Bond Fund									
Clase A USD de Capitalización	$ 29.383	224	130,97	$ 29.314	230	127,44	$ 35.416	245	144,44
Clase A USD de Distribución (D)	36.683	414	88,70	35.001	391	89,45	80.771	775	104,18
Clase B USD de Distribución (D)	–	–	–	–	–	–	2	–	104,24
Clase C USD de Capitalización	3.877	32	120,21	5.503	47	117,55	8.586	64	133,90
Clase C USD de Distribución (D)	2.470	28	88,74	2.543	28	89,49	3.580	34	104,21
Clase E USD de Capitalización	1.002	11	88,85	803	9	86,98	2.222	22	99,25
Clase F USD de Capitalización	90.592	755	120,02	31.628	272	116,19	58.355	445	131,23
Clase F USD de Distribución (D)	15.485	177	87,33	11.329	129	87,97	14.031	137	102,43
Clase X USD de Capitalización	1.499	14	105,04	2.156	21	101,70	2.384	21	114,69
Clase X USD de Distribución (D)	198	2	86,29	266	3	87,02	298	3	101,33
Clase Premier USD de Capitalización	9	–	105,41	8.681	85	101,94	19.841	173	114,85
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	2.570	22	105,86
Clase LM USD de Capitalización	3.219	36	89,71	3.593	42	86,47	3.558	37	97,13
Clase GA USD de Capitalización	1.015	8	129,60	1.059	8	125,95	1.232	9	142,64
Clase GE USD de Capitalización	28	–	119,49	43	–	116,84	60	–	133,11
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund									
Clase A USD de Capitalización	$ 94.104	642	146,51	$ 103.760	730	142,14	$ 122.223	748	163,35
Clase A USD de Distribución (D)	29.679	309	95,93	28.475	295	96,61	47.095	412	114,18
Clase A USD de Distribución (M) Plus	3.621	46	78,76	4.183	52	80,27	7.597	79	95,64
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	516	11	74,45	5.786	111	77,22	6.011	89	93,32
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	698	7	89,59	715	8	88,75	1.452	12	104,74
Clase B USD de Distribución (D)	12	–	95,73	11	–	96,41	86	1	114,12
Clase C USD de Capitalización	16.755	127	131,73	16.162	126	128,45	23.167	156	148,35
Clase C USD de Distribución (D)	8.069	84	96,61	7.865	81	97,30	10.764	94	114,99
Clase E USD de Capitalización	11.694	109	107,66	13.647	130	105,09	21.829	180	121,50
Clase F USD de Capitalización	415.738	3.552	117,03	524.507	4.647	112,86	675.110	5.237	128,91
Clase F USD de Distribución (D)	8.584	95	89,96	8.486	94	90,60	11.889	111	107,08
Clase X USD de Capitalización	2.844	26	108,99	2.793	27	105,00	8.356	70	119,85
Clase X USD de Distribución (D)	2.994	36	83,64	3.236	38	84,24	5.357	54	99,58
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	119	1	85,64	285	3	84,29	2.903	26	98,90
Clase Premier USD de Capitalización	202.351	1.435	141,03	374.417	2.760	135,67	491.421	3.179	154,57
Clase Premier USD de Distribución (M)	4.507	49	91,09	2.837	31	91,71	2.929	27	108,14
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	–	–	96,22	31.663	316	94,59	22.936	185	110,65
Clase LM USD de Distribución (M)	10.586	135	78,43	16.273	206	78,97	22.527	242	93,11
Clase LM EUR de Capitalización	325	3	119,61	1.375	11	117,39	1.726	12	125,79
Clase LM GBP de Capitalización (cubierta)	34	–	135,77	34	–	131,13	27	–	150,84
Clase A (G) USD de Capitalización	174	1	148,81	169	1	144,38	200	1	165,90
Clase A (G) USD de Distribución (D)	794	8	96,68	833	9	97,37	1.106	10	115,07
Clase B (G) USD de Distribución (D)	3	–	96,68	3	–	97,38	4	–	115,09
Clase L (G) USD de Capitalización	207	2	136,77	202	2	133,36	234	2	154,01
Clase L (G) USD de Distribución (D)	847	9	96,69	983	10	97,38	1.141	10	115,09
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund									
Clase A USD de Distribución (D)	€ 1.201	13	98,79	€ 35	–	93,08	€ 50	–	117,82
Clase A EUR de Distribución (D)	892	9	94,79	862	9	91,32	1.190	11	108,97
Clase C USD de Distribución (D)	56	1	98,18	54	1	92,57	65	1	117,09
Clase F EUR de Distribución (Q)	–	–	–	–	–	–	1	–	124,95
Clase Premier EUR de Capitalización	5.161	54	95,65	7.303	81	90,38	1.825	17	106,44
Clase LM EUR de Capitalización	41.686	419	99,50	123.205	1.314	93,74	145.011	1.317	110,07
Clase GA EUR de Capitalización	467	4	118,00	636	6	112,08	741	6	132,69
Clase GA EUR de Distribución (A)	267	3	106,14	278	3	101,67	391	3	120,65
Clase GE EUR de Capitalización	99	1	108,81	94	1	103,97	112	1	123,83
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund^									
Clase A USD de Capitalización	$ –	–	–	$ –	–	–	$ 23.402	144	162,96
Clase A USD de Distribución (D)	–	–	–	–	–	–	7.876	90	87,34
Clase A USD de Distribución (M)	–	–	–	–	–	–	252	3	92,27
Clase A USD de Distribución (M) Plus	–	–	–	–	–	–	207	2	91,74
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	–	–	–	–	–	–	30	–	89,13
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	1.481	9	142,92
Clase A HKD de Distribución (M) Plus	–	–	–	–	–	–	452	38	92,09
Clase B USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	13	–	156,15
Clase B USD de Distribución (D)	–	–	–	–	–	–	64	1	87,30
Clase C USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	7.053	47	151,17
Clase C USD de Distribución (D)	–	–	–	–	–	–	4.005	46	87,30
Clase F USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	3.094	29	108,26
Clase Premier USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	1	–	98,57
Clase Premier USD de Distribución (M)	–	–	–	–	–	–	1	–	97,46
Clase A (G) USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	757	5	161,24
Clase A (G) USD de Distribución (D)	–	–	–	–	–	–	3.274	37	88,89
Clase B (G) USD de Distribución (D)	–	–	–	–	–	–	5	–	88,98
Clase L (G) USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	890	6	149,79
Clase L (G) USD de Distribución (D)	–	–	–	–	–	–	135	2	88,90
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund									
Clase A USD de Capitalización	$ 11.157	68	163,58	$ 9.390	61	154,26	$ 12.161	74	165,33
Clase A USD de Distribución (D)	10.954	109	100,33	13.012	132	98,88	15.078	137	109,94
Clase A USD de Distribución (M)	1.479	17	85,24	1.619	19	83,98	2.287	25	93,16
Clase A USD de Distribución (M) Plus	1.369	18	77,00	683	9	77,14	879	10	86,54
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	138	3	72,88	166	3	74,10	47	1	84,12
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	1.578	11	134,67	3.009	22	129,52	4.100	26	142,38
Clase A EUR de Distribución (M) (cubierta)	1.525	20	69,13	2.671	36	69,49	3.395	38	79,05
Clase A Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	222	4	57,59	201	3	58,69	252	3	67,69
Clase A GBP de Distribución (M) (cubierta)	427	4	82,64	498	5	81,90	581	5	91,73
Clase A HKD de Distribución (M) Plus	49	5	74,93	49	5	75,26	110	10	84,03
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	929	1.598	0,78	960	1.626	0,80	1.033	1.563	0,90
Clase B USD de Distribución (D)	188	2	100,30	262	3	98,86	531	5	109,92
Clase C USD de Capitalización	5.572	38	146,50	6.279	45	138,84	6.780	45	149,55
Clase C USD de Distribución (D)	7.866	78	100,30	8.448	85	98,85	10.758	98	109,90
Clase A ZAR de Distribución (M) (cubierta) Plus	7.827	229	654,80	349	9	681,64	451	9	788,67
Clase E USD de Capitalización	1.175	9	128,46	1.240	10	121,87	1.505	11	131,41
Clase E USD de Distribución (D)	453	5	83,54	583	7	82,33	661	7	91,53
Clase E Euro de Capitalización (cubierta)	60	1	99,23	92	1	96,02	125	1	106,18
Clase E EUR de Distribución (M) (cubierta)	40	1	70,51	30	–	70,87	36	–	80,64

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de situación financiera *(continuación)*

	29 de febrero de 2024			28 de febrero de 2023			28 de febrero de 2022		
	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund (continuación)									
Clase F USD de Capitalización	$ 19.213	125	153,36	$ 17.061	119	143,75	$ 20.347	133	153,16
Clase F USD de Distribución (D)	4.382	52	83,54	4.951	60	82,33	5.501	60	91,53
Clase X USD de Distribución (D)	695	8	83,67	697	8	82,45	1.399	15	91,68
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	251	2	104,99	8	–	100,36	–	–	–
Clase X GBP de Distribución (D) (cubierta)	32	–	78,87	60	1	78,21	76	1	87,81
Clase Premier USD de Capitalización	36.527	196	186,39	34.965	201	174,28	44.980	243	185,22
Clase Premier USD de Distribución (M)	349	3	104,23	368	4	102,68	12.098	106	113,85
Clase Premier CHF de Capitalización (cubierta)	59.744	522	101,29	54.671	522	98,72	3.442	28	111,13
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	781	5	135,82	1.365	10	129,55	4.740	30	141,32
Clase Premier EUR de Distribución (M) (cubierta)	33	–	66,82	39	1	67,15	69	1	76,38
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	49.523	266	138,99
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta)	337	3	79,76	827	9	79,03	2.899	24	88,49
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	135	2	69,27	203	2	69,00	205	2	77,65
Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)	2.701	80	134,58	2.666	95	124,47	3.664	121	127,30
Clase LM AUD de Distribución (M) (cubierta)	62.490	1.054	91,24	59.726	973	91,26	93.108	1.251	102,46
Clase LM GBP de Capitalización (cubierta)	262	1	144,88	207	1	135,69	148	1	145,04
FTGF Western Asset US High Yield Fund									
Clase A USD de Capitalización	$ 15.896	82	194,34	$ 18.805	105	179,29	$ 25.055	129	194,84
Clase A USD de Distribución (D)	24.756	361	68,50	27.885	411	67,77	34.889	446	78,15
Clase A USD de Distribución (M)	1.248	15	82,95	1.375	17	82,01	2.271	24	94,27
Clase A USD de Distribución (M) Plus	1.669	24	68,90	1.290	18	69,82	2.424	30	81,29
Clase A EUR de Distribución (M) (cubierta)	1.385	19	66,93	1.403	20	67,53	1.414	16	79,66
Clase A HKD de Distribución (M) Plus	–	–	102,01	5	–	94,71	–	–	93,84
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	583	1.216	0,65	383	776	0,66	520	907	0,78
Clase B USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	338	2	192,79
Clase B USD de Distribución (D)	–	–	–	46	1	67,77	106	1	78,17
Clase C USD de Capitalización	4.321	24	183,63	4.132	24	170,27	3.170	17	185,96
Clase C USD de Distribución (D)	1.778	26	68,50	2.074	31	67,78	2.748	35	78,16
Clase E USD de Capitalización	2.662	15	173,13	3.404	21	160,70	3.837	22	175,71
Clase E USD de Distribución (D)	402	5	85,57	581	7	84,66	1.106	11	97,67
Clase E Euro de Capitalización (cubierta)	375	3	99,26	347	3	94,00	413	3	105,40
Clase F USD de Capitalización	3.121	17	179,36	4.327	26	164,83	7.467	42	178,39
Clase F USD de Distribución (D)	179	2	81,52	257	3	80,65	226	2	93,01
Clase Premier USD de Capitalización	20.612	110	187,18	35.228	205	171,58	101.736	549	185,21
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)	4	–	111,24	1	–	102,60	1	–	111,69
Clase S USD de Distribución (M)	1	–	89,40	1	–	88,37	–	–	–
Clase S EUR de Distribución (M) (cubierta)	30	–	85,40	28	–	86,14	–	–	–
Clase LM USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	45.730	232	197,50
Clase LM USD de Distribución (M)	15.675	207	75,89	21.415	285	75,02	23.015	267	86,21
Clase LM GBP de Capitalización (cubierta)	11	–	113,75	40	–	104,43	51	–	113,46
Clase A (G) USD de Capitalización	204	1	198,80	189	1	183,52	211	1	199,51
Clase A (G) USD de Distribución (D)	1.051	15	67,96	1.072	16	67,23	1.243	16	77,53
Clase L (G) USD de Capitalización	155	1	182,70	170	1	169,50	185	1	185,19
Clase L (G) USD de Distribución (D)	644	9	67,95	645	10	67,22	795	10	77,52
Clase GF USD de Capitalización	116	1	177,55	137	1	163,56	149	1	177,45
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund^									
Clase A USD de Capitalización	$ –	–	–	$ –	–	–	$ 5.371	32	170,12
Clase A USD de Distribución (D)	–	–	–	–	–	–	1.415	14	99,47
Clase A USD de Distribución (M)	–	–	–	–	–	–	908	10	89,94
Clase A USD de Distribución (M) Plus	–	–	–	–	–	–	10	–	67,72
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	219	2	127,14
Clase A EUR de Distribución (D) (cubierta)	–	–	–	–	–	–	293	4	67,99
Clase A GBP de Distribución (D) (cubierta)	–	–	–	–	–	–	44	–	84,50
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	–	–	–	–	–	–	9	17	0,70
Clase C USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	243	2	154,50
Clase C USD de Distribución (D)	–	–	–	–	–	–	1.023	10	99,42
Clase E USD de Distribución (D)	–	–	–	–	–	–	413	5	84,99
Clase E Euro de Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	10	–	88,88
Clase E EUR de Distribución (M) (cubierta)	–	–	–	–	–	–	15	–	75,92
Clase F USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	67	–	151,93
Clase X GBP de Distribución (D) (cubierta)	–	–	–	–	–	–	15	–	82,01
Clase Premier USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	93	1	93,44
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	2.097	15	123,82
Clase Premier GBP de Distribución (D) (cubierta)	–	–	–	–	–	–	79	1	73,50
Clase LM USD de Distribución (M) (cubierta)	–	–	–	–	–	–	25.470	288	88,50
Clase A (G) USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	494	3	178,03
Clase A (G) USD de Distribución (D)	–	–	–	–	–	–	814	9	89,17
Clase L (G) USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	1.125	7	165,24
Clase L (G) USD de Distribución (D)	–	–	–	–	–	–	891	10	89,14
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund^									
Clase A USD de Capitalización	$ –	–	–	$ –	–	–	$ 24	–	106,83
Clase A USD de Distribución (M)	–	–	–	–	–	–	1	–	90,49
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	5	–	89,98
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	1.928	18	94,23
Clase LM USD de Distribución (M)	–	–	–	–	–	–	25.890	286	90,51
FTGF Western Asset Global High Yield Fund									
Clase A USD de Capitalización	$ 5.296	30	176,21	$ 5.649	34	164,18	$ 8.812	49	178,94
Clase A USD de Distribución (D)	5.988	94	63,78	6.082	96	63,39	7.374	101	72,88
Clase A USD de Distribución (M)	7.148	101	70,83	8.467	120	70,35	11.065	137	80,65
Clase A USD de Distribución (M) Plus	4.468	72	62,40	5.245	83	63,52	10.681	145	73,86
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	4.216	91	71,08	5.294	107	73,48	7.679	122	86,67
Clase A EUR de Capitalización	1.840	15	116,18	2.233	19	110,61	2.029	16	113,76
Clase A EUR de Distribución (D) (cubierta)	121	2	62,53	120	2	63,37	65	1	74,80
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	1.739	3.966	0,59	1.724	3.810	0,61	2.177	4.140	0,71
Clase B USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	72	–	175,72
Clase B USD de Distribución (D)	30	–	63,65	30	–	63,26	201	3	72,72
Clase C USD de Capitalización	916	6	166,18	920	6	155,61	1.483	9	170,46
Clase C USD de Distribución (D)	1.760	28	63,49	2.429	38	63,11	2.962	41	72,56
Clase E USD de Capitalización	749	5	151,67	1.123	8	142,35	1.249	8	156,17
Clase E USD de Distribución (D)	166	2	78,18	165	2	77,70	207	2	89,34
Clase E EUR de Distribución (M) (cubierta)	52	1	62,22	14	–	63,06	18	–	74,28
Clase F USD de Capitalización	1.612	10	159,68	2.845	19	148,37	2.036	13	161,10
Clase F USD de Distribución (D)	488	7	74,20	543	7	73,75	965	11	84,81
Clase X USD de Distribución (D)	3.619	44	83,18	4.458	54	82,67	5.807	61	95,06
Clase X GBP de Distribución (D) (cubierta)	3.630	43	66,28	3.701	46	66,23	4.406	43	77,04
Clase Premier USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	6.086	29	212,96
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	1.491	11	120,34	2.244	19	113,78	1.770	12	126,57
Clase Premier GBP de Distribución (D) (cubierta)	28	–	72,07	27	–	72,01	35	–	83,77
Clase S USD de Distribución (M)	1	–	90,78	1	–	90,17	–	–	–
Clase S EUR de Distribución (M) (cubierta)	30	–	86,67	29	–	87,81	–	–	–
Clase A (G) USD de Capitalización	1.146	6	178,87	2.047	12	167,12	2.374	13	182,46
Clase A (G) USD de Distribución (D)	896	14	63,77	1.003	16	63,38	1.240	17	72,88
Clase L (G) USD de Capitalización	459	3	164,40	431	3	154,37	507	3	169,39
Clase L (G) USD de Distribución (D)	630	10	63,79	607	10	63,40	678	9	72,89

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de situación financiera *(continuación)*

	29 de febrero de 2024			28 de febrero de 2023			28 de febrero de 2022		
	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^									
Clase A USD de Capitalización	$ –	–	–	$ –	–	–	$ 3.549	23	155,66
Clase A USD de Distribución (A)	–	–	–	–	–	–	4.844	36	133,96
Clase B USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	28	–	108,80
Clase C USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	93	1	99,75
Clase C USD de Distribución (A)	–	–	–	–	–	–	843	6	130,28
Clase F USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	29	–	100,15
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	7.094	63	100,66
Clase LM USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	42.980	369	116,57
Clase A (G) USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	5	–	163,47
Clase A (G) USD de Distribución (A)	–	–	–	–	–	–	45	–	130,79
Clase L (G) USD de Distribución (A)	–	–	–	–	–	–	15	–	120,50
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund									
Clase A USD de Capitalización	$ 25.581	167	153,39	$ 29.246	196	149,02	$ 39.106	241	162,46
Clase A USD de Distribución (D)	4.953	51	96,59	5.574	58	96,54	6.592	61	108,04
Clase A USD de Distribución (M)	4.606	52	89,07	9.535	107	89,01	12.847	129	99,50
Clase A USD de Distribución (M) Plus	25.435	395	64,36	29.850	452	66,00	45.247	604	74,94
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	11.147	243	70,51	13.954	283	73,37	21.798	356	84,24
Clase A CHF de Capitalización (cubierta)	16	–	86,13	286	3	87,16	330	3	98,04
Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus	23.093	2.436	68,32	3.528	341	71,91	5.325	405	83,16
Clase A EUR de Capitalización	1.377	6	223,59	1.927	8	221,94	2.698	11	228,02
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	859	8	96,76	935	9	95,84	1.734	14	107,09
Clase A EUR de Distribución (A)	361	3	107,52	447	4	109,59	541	4	115,43
Clase A HKD de Distribución (M) Plus	5.412	546	77,67	6.684	657	79,85	10.989	951	90,29
Clase A SGD de Capitalización (cubierta)	591	568	1,40	672	656	1,38	1.296	1.162	1,51
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	1.441	2.946	0,66	1.394	2.739	0,69	2.389	4.143	0,78
Clase A SGD de Distribución (M) Plus	396	759	0,70	605	1.131	0,72	940	1.545	0,82
Clase B USD de Capitalización	56	–	147,41	54	–	143,57	62	–	156,90
Clase B USD de Distribución (D)	–	–	–	–	–	–	19	–	107,96
Clase C USD de Capitalización	1.253	9	141,40	1.433	10	138,07	1.697	11	151,27
Clase C USD de Distribución (D)	800	8	96,60	1.111	12	96,56	1.306	12	108,06
Clase E USD de Capitalización	483	4	121,83	590	5	119,08	704	5	130,59
Clase E USD de Distribución (D)	185	2	88,79	181	2	88,75	199	2	99,32
Clase F USD de Capitalización	1.082	8	141,15	2.326	17	136,58	2.699	18	148,29
Clase F USD de Distribución (D)	708	8	88,85	585	7	88,80	654	7	99,38
Clase X USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	221	2	110,48
Clase X USD de Distribución (M)	1.117	13	85,64	1.204	14	85,58	3.705	39	95,65
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	–	–	–	228	2	89,39	268	2	99,36
Clase Premier USD de Capitalización	55.334	327	169,46	83.254	509	163,56	72.450	409	177,15
Clase Premier USD de Distribución (M)	–	–	–	1.371	13	102,87	–	–	–
Clase Premier EUR de Capitalización	29.793	175	157,55	120.289	732	155,45	130.405	732	158,82
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	3.732	32	109,56	8.187	72	107,84	8.686	65	119,68
Clase Premier EUR de Distribución (A)	21.356	208	95,08	69.572	678	96,97	77.670	678	102,12
Clase Premier EUR de Distribución (M)	10.943	102	99,65	10.936	102	101,76	12.221	102	107,28
Clase Premier GBP de Distribución (M)	74	1	106,10	84	1	111,31	92	1	111,51
Clase LM USD de Capitalización	15.379	83	184,48	25.877	146	176,99	43.801	230	190,55
Clase LM USD de Distribución (M)	1.769	20	89,58	4.430	49	89,52	–	–	–
Clase LM Euro de Distribución (M) (cubierta)	1.296	15	82,67	1.358	15	84,23	1.103	10	96,42
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund									
Clase A USD de Capitalización	$ 32.186	253	126,97	$ 30.772	254	121,01	$ 22.239	176	126,60
Clase A USD de Distribución (M)	10.728	102	104,94	7.663	75	101,67	6.851	64	106,79
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	15.241	152	92,69	21.104	222	90,07	9.882	91	96,55
Clase A EUR de Distribución (M) (cubierta)	–	–	–	313	3	98,80	–	–	–
Clase A SEK de Capitalización (cubierta)	10.828	1.203	93,27	12.582	1.452	90,68	22.680	2.221	96,73
Clase A SEK de Distribución (M) (cubierta)	1	–	91,29	1	–	90,27	1	–	96,70
Clase B USD de Capitalización	–	–	–	52	1	99,51	–	–	–
Clase C USD de Capitalización	3.635	31	118,00	3.828	34	113,01	8.415	71	118,83
Clase C USD de Distribución (M)	3.832	37	103,78	3.761	37	100,53	519	5	105,71
Clase E USD de Capitalización	3.167	29	110,97	3.313	31	106,39	3.238	29	111,98
Clase E USD de Distribución (D)	1.163	12	99,53	4.856	50	96,49	4.983	49	101,56
Clase F USD de Capitalización	3.036	24	128,18	3.410	28	121,66	7.631	60	126,78
Clase F USD de Distribución (D)	215	2	95,81	1.287	14	92,86	1.596	16	97,66
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	20.039	197	93,97	8.345	87	90,78	9.247	85	96,86
Clase Premier USD de Capitalización	13.167	94	140,44	25.521	192	132,97	27.247	197	138,22
Clase Premier CHF de Distribución (M) (cubierta)	4.697	42	100,08	–	–	–	–	–	–
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	12.290	115	98,95	65.972	653	95,51	31.220	274	101,73
Clase Premier EUR de Distribución (M) (cubierta)	250	2	100,95	–	–	87,78	189	2	94,28
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)	191	1	130,91	565	4	124,65	2	–	130,72
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta)	61	–	98,73	13	–	96,15	1.278	9	101,92
Clase S USD de Distribución (M) Plus (e)	56.466	570	99,06	29.107	302	96,32	10.106	100	101,50
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	28	–	95,09	27	–	91,66	55	1	97,58
Clase S Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	12.489	133	87,18	6.422	70	86,37	3.050	29	93,27
Clase S GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	274.828	2.336	93,18	285.334	2.604	91,09	262.829	2.023	96,86
Clase LM AUD de Capitalización (cubierta)	–	–	–	9.722	155	93,22	10.991	155	97,63
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^									
Clase A USD de Distribución (A)	$ 17	–	93,66	$ 1	–	91,31	$ 1	–	102,91
Clase X USD de Capitalización	1.341	12	109,21	1.721	17	103,78	2.746	24	115,64
Clase Premier USD de Capitalización	25.994	175	148,60	25.147	178	141,02	42.779	273	156,86
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	22.399	207	100,29	20.636	201	97,14	39.201	315	110,84
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)	2	–	89,82	2	–	85,63	3	–	96,15
Clase Premier NZD de Capitalización (cubierta)	2.447	40	99,96	5.009	84	96,21	6.128	84	107,57
Clase S USD de Capitalización	1	–	96,73	1	–	91,67	–	–	–
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	29	–	92,43	28	–	89,44	–	–	–
Clase LM USD de Capitalización	3.823	36	104,98	4.099	41	99,25	4.122	37	109,96
Clase LM Euro de Capitalización (cubierta)	–	–	–	1.857	21	83,81	2.442	23	95,23
Clase LM CAD de Capitalización (cubierta)	73.367	927	107,37	88.202	1.177	102,26	105.526	1.177	113,65
FTGF Western Asset Global Credit Fund^									
Clase A USD de Capitalización	$ 795	6	132,56	$ 2.174	17	127,27	$ 3.171	22	142,04
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	252	2	111,18	321	3	108,91	408	3	124,74
Clase X USD de Capitalización	1	–	105,17	–	–	–	–	–	–
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	28	–	85,21	27	–	82,92	53	1	94,35
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)	20	–	87,90	18	–	84,38	63	1	94,58
Clase LM USD de Capitalización	25.451	159	160,20	39.438	259	152,29	69.126	411	168,26
Clase LM Euro de Capitalización (cubierta)	4.450	48	85,20	4.072	47	82,64	4.532	43	93,68
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^									
Clase A EUR de Distribución (D)	€ –	–	–	€ –	–	–	€ 48	–	96,68
Clase X GBP de Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	6	–	97,70
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	1	–	105,33
Clase LM EUR de Capitalización	–	–	–	–	–	–	37.393	205	182,42
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^									
Clase A USD de Capitalización	$ 255.880	1.992	128,45	$ 388.476	3.241	119,86	$ 788.243	5.937	132,77
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	101.377	1.328	76,32	124.647	1.627	76,61	200.496	2.254	88,97
Clase A USD de Distribución (S)	23.243	253	91,73	28.115	311	90,26	41.551	408	101,94
Clase A AUD de Capitalización (cubierta)	1.502	25	91,98	1.089	18	87,62	1.348	19	98,55

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de situación financiera *(continuación)*

	29 de febrero de 2024			28 de febrero de 2023			28 de febrero de 2022		
	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ (continuación)									
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	$ 12.151	259	72,26	$ 15.473	310	74,06	$ 25.043	395	87,37
Clase A CHF de Capitalización (cubierta)	3.865	35	99,03	5.462	53	96,71	17.146	142	110,87
Clase A CNH de Capitalización (cubierta)	930	51	132,11	1.006	55	126,70	1.234	55	141,25
Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	1.593	134	85,47	2.787	220	88,22	4.928	302	103,16
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	185.605	1.629	105,43	157.441	1.479	100,65	364.733	2.837	114,66
Clase A EUR de Distribución (A)	4.081	41	91,30	5.211	55	90,13	7.824	73	96,24
Clase A Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	4.234	56	69,55	5.789	77	71,44	8.555	89	85,34
Clase A EUR de Distribución (S) (cubierta)	5.823	68	79,62	6.023	71	80,16	7.304	70	93,13
Clase A GBP de Capitalización	161	1	146,50	385	2	143,47	508	3	142,50
Clase A GBP de Capitalización (cubierta)	3.722	26	113,84	5.757	45	107,22	22.692	141	120,28
Clase A GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	7.149	82	69,25	10.137	120	70,14	14.437	130	82,55
Clase A HKD de Distribución (M) Plus	–	–	–	69	7	75,21	80	7	86,91
Clase A HKD de Distribución (M) Plus	–	–	–	2	–	74,98	4	–	86,74
Clase A SEK de Capitalización (cubierta)	976	105	96,33	1.390	158	92,28	3.282	297	104,81
Clase A SGD de Capitalización (cubierta)	6.917	7.805	1,19	9.979	11.868	1,13	23.139	24.857	1,26
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	17.973	33.238	0,73	25.125	45.526	0,74	39.579	61.771	0,87
Clase A SGD de Distribución (M) Plus (e)	29	50	0,78	29	50	0,79	34	50	0,92
Clase B USD de Capitalización	–	–	–	91	1	107,65	126	1	119,54
Clase C USD de Capitalización	30.958	271	114,30	34.826	325	107,20	49.624	416	119,34
Clase C USD de Distribución (S)	3.922	43	90,81	4.194	47	89,36	5.973	59	100,90
Clase A JPY de Distribución (M) Plus (e)	253	4	10.003,12	154	2	9.123,43	179	2	8.945,99
Clase A NOK de Capitalización (cubierta)	4.442	532	88,61	6.043	740	84,75	7.423	687	95,32
Clase E USD de Capitalización	10.586	94	112,53	15.021	142	105,64	20.437	174	117,72
Clase E USD de Distribución (S)	983	11	90,58	1.410	16	89,13	2.115	21	100,63
Clase E Euro de Capitalización (cubierta)	2.521	25	93,47	2.721	29	89,78	4.390	38	102,88
Clase F USD de Capitalización	34.838	283	123,31	51.472	449	114,61	126.827	1.003	126,44
Clase F USD de Distribución (S)	3.090	33	92,91	6.629	73	91,43	11.450	111	103,26
Clase X USD de Capitalización	57.086	436	130,98	87.446	719	121,62	189.669	1.415	134,04
Clase X USD de Distribución (M) Plus (e)	3.014	37	81,50	16.104	198	81,40	37.367	397	94,07
Clase X USD de Distribución (S)	7.914	87	91,41	11.462	127	89,96	20.429	201	101,60
Clase X CHF de Capitalización (cubierta)	8.388	72	103,23	9.965	94	100,30	28.117	225	114,39
Clase X EUR de Capitalización	1.899	11	153,88	2.037	13	146,02	5.023	30	151,60
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	51.069	426	110,90	48.362	434	105,36	155.230	1.158	119,51
Clase X EUR de Distribución (A) (cubierta)	3.136	38	76,87	9.389	117	75,95	11.901	120	88,55
Clase X EUR de Distribución (M) (cubierta)	522	6	76,16	2.413	30	76,88	6.919	68	90,25
Clase X GBP de Capitalización	911	5	153,58	964	5	149,67	1.576	8	147,89
Clase X GBP de Capitalización (cubierta)	23.562	155	120,69	38.851	286	113,11	78.246	462	126,27
Clase X GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	1.358	14	74,59	1.878	21	75,17	6.852	58	88,04
Clase X SGD de Capitalización (cubierta)	2.243	2.410	1,25	4.358	4.958	1,19	5.057	5.222	1,31
Clase Premier USD de Capitalización	46.954	342	137,29	242.867	1.908	127,29	318.448	2.274	140,05
Clase Premier USD de Distribución (S)	14.313	157	91,20	23.154	258	89,75	55.952	552	101,36
Clase Premier AUD de Capitalización (cubierta)	836	13	98,05	850	14	92,81	2.277	30	103,71
Clase Premier AUD de Distribución (S) (cubierta)	983	17	86,86	2.742	47	87,39	44.269	608	100,20
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)	28.142	794	176,12	38.397	1.288	156,04	132.553	4.300	158,82
Clase Premier CHF de Capitalización (cubierta)	3.432	31	98,95	4.384	43	96,00	17.535	147	109,37
Clase Premier CHF de Distribución (S) (cubierta)	1.106	13	74,48	1.151	14	76,70	2.440	25	89,64
Clase Premier EUR de Capitalización	14.867	86	160,49	22.074	137	151,92	32.676	185	157,68
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	93.921	794	109,45	361.662	3.293	103,82	627.086	4.760	117,49
Clase Premier EUR de Distribución (S) (cubierta)	27.308	322	78,39	37.969	455	78,94	24.197	235	91,74
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)	4.217	29	113,89	6.545	51	106,58	86.494	543	118,83
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	17.316	187	73,20	19.336	218	73,65	145.729	1.261	86,13
Clase Premier JPY de Capitalización (cubierta)	46.942	712	9.886,79	52.479	733	9.751,61	76.911	797	11.091,23
Clase Premier JPY de Distribución (S) (cubierta)	–	–	–	–	–	–	7.912	100	9.096,56
Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)	1.945	74	104,43	1.116	52	96,27	1.546	63	102,28
Clase Premier SEK de Capitalización (cubierta)	27	3	101,75	25	3	96,83	50	4	109,26
Clase S USD de Capitalización	11	–	143,01	11	–	132,05	12.078	83	144,73
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	2.596	20	119,87	147.182	1.229	113,27	177.135	1.238	127,65
Clase LM AUD de Distribución (S) (cubierta)	9.507	176	82,92	19.202	342	83,45	70.133	1.008	95,77
Clase LM EUR de Capitalización	640	4	140,26	1.173	8	131,56	1.323	9	135,18
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^									
Clase A USD de Capitalización	$ 24	–	112,63	$ 45	–	105,94	$ 125	1	115,42
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	41	1	76,66	42	1	78,10	48	1	90,27
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	26	–	96,32	24	–	92,46	28	–	103,30
Clase C USD de Capitalización	1	–	111,66	1	–	105,15	1	–	114,76
Clase F USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	56	–	119,42
Clase X CHF de Distribución (M) (cubierta)	40	1	67,31	40	1	70,41	48	1	82,74
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	3.644	31	105,47
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	–	–	–	193	2	79,35	597	5	91,91
Clase S USD de Capitalización	1.397	14	98,47	1.443	16	91,70	1.777	18	98,92
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	17.967	171	97,16	19.433	199	92,33	21.698	190	102,11
Clase S GBP de Capitalización (cubierta)	39.226	306	101,40	31.373	274	95,04	35.151	253	103,53
Clase LM AUD de Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	101.230	1.230	113,36
Clase LM Euro de Capitalización (cubierta)	42.308	397	98,62	30.300	307	93,33	40.071	347	102,86
Clase LM GBP de Capitalización (cubierta)	230.783	1.459	125,34	150.891	1.072	117,01	146.379	860	126,95
Clase LM CAD de Capitalización (cubierta)	17.064	233	99,28	17.807	262	92,76	–	–	–
Clase S CHF de Distribución (A)	19.394	200	85,76	19.240	200	90,61	21.046	200	96,50
Clase S CHF de Distribución (A) (cubierta)	4.410	40	97,52	4.180	40	98,43	–	–	–
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^									
Clase D Euro de Capitalización (cubierta)	$ 994	10	94,69	$ 958	10	91,07	$ 645	6	98,36
Clase D EUR de Distribución (M) (cubierta)	–	–	–	348	5	73,01	423	5	83,76
Clase D USD de Capitalización	1.564	14	107,97	12.154	119	101,95	14.316	133	107,68
Clase D USD de Distribución (M)	737	9	78,16	1.461	18	80,39	1.638	18	90,09
Clase D USD de Distribución (M) Plus	211	3	71,98	219	3	74,86	247	3	84,29
Clase M CHF de Capitalización (cubierta)	71	1	94,12	299	3	91,94	1.415	13	99,34
Clase M GBP de Distribución (M) (cubierta)	–	–	–	–	–	–	697	6	86,63
Clase F USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	419	4	110,41
Clase M USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	643	7	98,42
Clase M USD de Distribución (M)	800	10	77,85	747	9	80,06	787	9	89,71
Clase M Euro de Capitalización (cubierta)	54	1	99,37	50	1	95,01	1.052	9	102,04
Clase Premier USD de Capitalización	72.263	523	138,14	78.484	606	129,48	263.425	1.941	135,74
Clase Premier USD de Distribución (Q)	8.801	110	80,01	8.643	105	82,24	10.212	112	91,28
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	576	4	118,91	4.182	35	113,55	153.236	1.121	121,86
Clase Premier EUR de Distribución (Q) (cubierta)	154	2	70,91	523	7	74,31	16.884	179	84,35
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	–	–	–	85	1	74,62	12.070	106	84,77
Clase Premier JPY de Capitalización (cubierta)	–	–	–	41.500	500	11.303,04	53.024	500	12.194,36
Clase LM USD de Capitalización	439.931	3.023	145,54	409.895	3.023	135,60	526.808	3.728	141,30
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^									
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	$ 9	–	73,19	$ 9	–	74,87	$ 10	–	86,27
Clase Premier USD de Capitalización	61.613	615	100,18	57.381	585	98,09	–	–	–
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	717	6	100,06
Clase LM USD de Capitalización	1.088.086	10.625	102,41	1.062.117	10.625	99,96	1.146.553	10.359	110,68
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^θ									
Clase A GBP de Capitalización	£ –	–	–	£ 1	–	97,14	£ 1	–	111,82
Clase Premier GBP de Capitalización	–	–	–	1	–	83,09	1	–	95,37
Clase LM GBP de Capitalización	–	–	–	–	–	–	73.631	637	115,68
Clase LM GBP de Distribución (M)	–	–	–	45.910	504	91,11	–	–	–

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de situación financiera *(continuación)*

	29 de febrero de 2024			28 de febrero de 2023			28 de febrero de 2022		
	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^µ									
Clase A USD de Capitalización	$ –	–	–	$ 102	1	108,03	$ 644	5	122,84
Clase Premier USD de Capitalización	–	–	–	16.144	164	98,52	19.025	171	111,27
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	870	7	111,34
Clase S USD de Capitalización	–	–	–	1	–	90,61	–	–	–
Clase LM GBP de Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	154.630	951	121,21
Clase LM GBP de Distribución (M) (cubierta)	–	–	–	78.528	704	92,75	–	–	–
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^									
Clase LM USD de Distribución (Q)	$ 18.396	254	72,41	$ 18.441	250	73,76	$ 21.958	244	90,04
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^¥									
Clase A USD de Capitalización	$ –	–	–	$ 9	–	85,86	$ 10	–	95,97
Clase F USD de Capitalización	–	–	–	9	–	86,26	10	–	96,01
Clase Premier USD de Capitalización	–	–	–	2.138	25	86,50	2.401	25	96,05
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)	–	–	–	2.540	140	94,89	2.664	142	96,96
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	–	–	–	39	–	84,26	47	–	95,97
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)	–	–	–	38	–	85,61	47	–	96,05
Clase S USD de Capitalización	–	–	–	4.183	48	86,60	4.640	48	96,06
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	–	–	–	39	–	84,36	47	–	95,98
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund									
Clase A USD de Capitalización	$ 7.846	64	122,99	$ 9.739	79	122,52	$ 12.568	87	144,07
Clase A USD de Distribución (M)	753	10	72,35	521	7	75,50	1.099	12	91,71
Clase A USD de Distribución (S)	14.513	162	89,80	17.976	192	93,73	22.007	196	112,29
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	174	5	52,13	381	10	56,40	526	10	69,92
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	567	8	67,44	717	10	68,79	1.075	11	83,44
Clase A Euro de Capitalización (cubierta) (IH)	13.441	96	130,11	14.676	107	130,10	25.053	152	146,74
Clase A EUR de Distribución (A) (cubierta)	117	2	55,76	305	5	58,95	583	7	72,27
Clase A EUR de Distribución (S)	37	–	73,87	41	–	78,82	49	–	89,08
Clase A EUR de Distribución (S) (cubierta) (IH)	4.861	54	82,53	5.444	60	86,44	7.052	63	99,31
Clase A GBP de Capitalización	87	1	87,90	87	1	91,89	102	1	96,89
Clase A GBP de Distribución (M) (cubierta)	86	1	59,42	204	3	62,54	254	2	77,41
Clase A GBP de Distribución (S) (cubierta) (IH)	2.649	23	92,67	3.053	27	95,78	4.647	32	108,33
Clase A SGD de Capitalización	63	101	0,84	60	97	0,84	68	93	0,99
Clase B USD de Capitalización	7	–	111,16	7	–	111,01	23	–	130,86
Clase B USD de Distribución (S)	44	–	89,76	63	1	93,69	107	1	112,23
Clase C USD de Capitalización	298	3	106,78	285	3	106,92	450	4	126,35
Clase C USD de Distribución (S)	750	8	89,40	833	9	93,31	1.099	10	111,77
Clase E USD de Capitalización	654	8	81,37	666	8	81,55	625	6	96,47
Clase E Euro de Capitalización (cubierta) (IH)	431	4	91,65	492	5	92,19	737	6	104,63
Clase F USD de Capitalización	174	2	88,07	182	2	87,39	1.023	10	102,33
Clase F USD de Distribución (S)	76	1	66,24	79	1	69,16	202	2	82,84
Clase R GBP de Distribución (S) (cubierta) (IH)	21	–	76,53	24	–	79,11	38	–	89,48
Clase X USD de Capitalización	2.374	27	88,48	2.545	29	87,70	3.321	32	102,61
Clase X USD de Distribución (S)	35	1	66,56	35	1	69,49	234	3	83,25
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	29	–	74,20	97	1	75,27	104	1	90,83
Clase X Euro de Capitalización (cubierta) (IH)	732	8	89,19	315	3	88,76	1.203	11	99,63
Clase X EUR de Distribución (S) (cubierta) (IH)	–	–	–	8	–	75,89	528	5	87,56
Clase X GBP de Capitalización	12.765	94	107,21	17.560	131	111,55	26.213	167	117,12
Clase X GBP de Capitalización (cubierta)	4.296	44	76,77	5.057	55	76,86	18.737	152	91,79
Clase X GBP de Capitalización (cubierta) (IH)	114	1	95,81	162	1	94,07	250	2	104,00
Clase X GBP de Distribución (S) (cubierta)	5.847	78	59,06	6.551	88	62,22	11.372	111	76,08
Clase X GBP de Distribución (S) (cubierta) (IH)	3.828	39	78,16	4.031	41	80,78	6.464	53	91,37
Clase Premier USD de Capitalización	21.414	208	103,09	21.695	213	102,03	26.070	219	119,20
Clase Premier USD de Distribución (S)	24	–	68,68	110	2	71,71	922	11	85,89
Clase Premier EUR de Capitalización	2.300	16	130,58	2.927	21	132,08	4.125	25	145,57
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	1.245	16	72,28	1.864	24	73,25	81	1	88,25
Clase Premier Euro de Capitalización (cubierta) (IH)	6.583	54	112,34	4.278	36	111,56	11.130	79	125,02
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)	3	–	78,49	3	–	78,48	4	–	93,51
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta)	54	1	58,87	99	1	62,01	270	3	76,76
Clase Premier GBP de Distribución (S) (cubierta) (IH)	345	3	84,20	672	6	87,04	1.663	13	98,46
Clase LM USD de Capitalización	2.860	32	89,08	3.149	36	87,64	3.162	31	101,78
Clase LM USD de Capitalización (cubierta) (IH)	32.588	290	112,52	35.016	322	108,78	20.395	173	118,09
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^									
Clase A USD de Capitalización	$ 599	5	116,57	$ 847	7	114,61	$ 938	8	119,84
Clase A USD de Distribución (A)	145	2	90,30	142	2	91,28	149	2	96,69
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	157	2	90,29	230	2	90,77	386	4	97,53
Clase A SEK de Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	–	–	94,46
Clase A SGD de Capitalización	1	2	0,99	1	1	0,97	–	–	–
Clase C USD de Capitalización	367	4	100,48	69	1	99,28	124	1	104,34
Clase E USD de Capitalización	–	–	–	71	1	98,39	172	2	103,51
Clase E USD de Distribución (A)	22	–	91,37	23	–	92,36	24	–	97,84
Clase F USD de Capitalización	28	–	108,20	519	5	105,96	807	7	110,36
Clase X USD de Capitalización	172	2	99,91	168	2	97,77	189	2	101,78
Clase X GBP de Capitalización (cubierta)	2.640	21	100,18	2.468	21	98,87	3.499	25	104,13
Clase X GBP de Distribución (M) (cubierta)	86	1	79,19	403	4	82,44	154	1	89,35
Clase Premier USD de Capitalización	121.526	1.078	112,78	226.102	2.052	110,21	85.918	750	114,56
Clase Premier USD de Distribución (A)	–	–	–	160	2	90,05	169	2	95,36
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	3.047	27	103,85	103.945	947	103,83	77.402	623	110,83
Clase Premier EUR de Distribución (A) (cubierta)	–	–	–	26.284	337	73,84	29.738	330	80,37
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta)	12.202	126	76,87	9.234	96	80,03	11.162	96	86,74
Clase LM USD de Capitalización	5.277	44	120,91	5.111	44	117,09	5.265	44	120,62
Clase LM AUD de Capitalización (cubierta)	–	–	–	163.494	1.698	143,13	536.622	4.944	149,45
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^									
Clase A USD de Capitalización	$ 2.744	21	128,99	$ 260	2	114,70	$ 207	2	121,94
Clase A USD de Distribución (D)	1.384	16	85,59	91	1	81,94	103	1	92,91
Clase F USD de Distribución (D)	75	1	100,28	–	–	–	–	–	–
Clase Premier USD de Capitalización	6.557	41	160,88	1	–	142,10	1	–	150,00
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta) (IH)	80	–	157,47	67	–	140,14	102	1	146,92
Clase S EUR de Distribución (A) (cubierta) (IH)	9.041	74	113,79	–	–	–	–	–	–
Clase S CAD de Capitalización (cubierta) (IH)	11.283	100	153,44	9.975	100	136,39	11.177	100	141,96
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund									
Clase A USD de Capitalización	$ 2.826	27	105,16	$ 3.169	31	102,90	$ 3.382	28	122,37
Clase A USD de Distribución (M)	512	6	85,59	583	7	87,66	702	7	106,98
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	6	–	73,54	1	–	73,48	1	–	90,11
Clase A SGD de Capitalización	14	21	0,88	23	36	0,87	51	67	1,04
Clase C USD de Capitalización	131	1	95,33	129	1	93,75	1.096	10	112,05
Clase E USD de Capitalización	290	3	93,18	281	3	91,73	347	3	109,74
Clase F USD de Capitalización	1.967	21	92,45	2.342	26	90,10	3.090	29	106,72
Clase F USD de Distribución (M)	220	3	73,37	231	3	75,15	280	3	91,69
Clase X USD de Capitalización	–	–	–	261	3	94,17	308	3	111,42
Clase X GBP de Distribución (M) (cubierta)	39	–	64,06	135	2	66,38	382	3	82,76
Clase X GBP de Distribución (M) (cubierta) (IH)	808	7	87,03	970	9	88,36	1.209	9	101,85
Clase Premier USD de Capitalización	183.751	1.636	112,30	175.727	1.610	109,17	207.613	1.610	128,99

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de situación financiera *(continuación)*

	29 de febrero de 2024			28 de febrero de 2023			28 de febrero de 2022		
	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund (continuación)									
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta) (IH)	$ 1.816	17	83,14	$ 1.835	18	84,39	$ 2.282	17	97,27
Clase Premier NZD de Capitalización (cubierta) (IH)	5.709	62	151,23	5.577	62	145,48	6.513	59	161,81
Clase LM EUR de Capitalización	1.621	14	109,57	3.990	35	108,20	5.010	37	119,82
Clase LM NZD de Capitalización (cubierta) (IH)	7.666	70	179,20	9.892	93	171,35	12.130	95	189,36
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund									
Clase A USD de Capitalización	$ 186.183	1.370	135,93	$ 184.162	1.434	128,45	$ 227.926	1.582	144,04
Clase A USD de Distribución (A)	1.619	18	87,86	1.913	22	86,14	2.423	24	99,14
Clase A USD de Distribución (D)	16.750	200	83,74	15.995	192	83,26	28.700	297	96,74
Clase A USD de Distribución (M) Plus	28.773	369	78,01	36.853	469	78,56	67.038	726	92,32
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	86.736	1.061	81,76	103.737	1.260	82,33	163.878	1.695	96,70
Clase A AUD de Capitalización (cubierta)	2.883	51	87,60	2.736	48	84,05	3.500	50	95,72
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	1.471	30	76,50	2.007	38	78,18	4.268	63	93,28
Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus	1.260	121	74,73	871	78	77,28	1.169	80	92,59
Clase A EUR de Capitalización	2	–	102,70	2	–	99,13	1	–	104,69
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	44.018	408	99,82	32.034	315	96,30	49.951	401	111,20
Clase A EUR de Distribución (A) (cubierta)	26.885	301	82,59	27.469	314	82,68	33.645	306	98,11
Clase A Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus	1.975	24	74,76	2.230	27	76,87	3.108	30	93,01
Clase A Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	30.592	413	68,53	33.044	443	70,47	38.905	407	85,23
Clase A GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus	2.024	21	77,11	2.189	23	78,20	3.289	26	93,28
Clase A GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	6.130	65	74,94	6.204	68	75,97	8.329	69	90,60
Clase A HKD de Capitalización	653	56	90,45	577	53	85,70	766	63	95,68
Clase A HKD de Distribución (M) Plus	8.043	800	78,76	9.913	978	79,53	17.554	1.474	93,06
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	33.994	54.979	0,83	37.208	58.904	0,85	49.398	66.538	1,01
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	23.558	41.347	0,77	24.225	41.619	0,78	3.914	5.723	0,93
Clase A SGD de Distribución (M) Plus	3.324	5.658	0,79	5.130	8.666	0,80	8.763	12.594	0,94
Clase C USD de Capitalización	16.481	175	94,08	22.302	250	89,35	39.688	394	100,69
Clase C USD de Distribución (D)	11.912	145	82,24	9.667	118	81,77	1.454	15	95,00
Clase A CZK de Capitalización (cubierta)	35	1	1.048,15	28	1	979,39	–	–	–
Clase E USD de Capitalización	35.624	350	101,77	30.426	314	96,75	35.222	323	109,15
Clase E USD de Distribución (D)	836	10	82,02	611	7	81,55	567	6	94,73
Clase E Euro de Capitalización (cubierta)	5.546	54	95,83	4.425	45	93,02	5.373	44	108,08
Clase F USD de Capitalización	20.610	213	96,71	25.037	275	90,98	40.863	402	101,56
Clase F USD de Distribución (D)	5.158	56	91,43	5.074	56	90,91	6.875	65	105,62
Clase X USD de Capitalización	4.666	48	98,12	9.584	104	92,12	14.895	145	102,71
Clase X USD de Distribución (D)	1	–	91,51	387	4	90,97	147	1	106,01
Clase X USD de Distribución (M) Plus (e)	14.868	172	86,24	17.624	204	86,27	25.931	257	100,74
Clase X CHF de Capitalización (cubierta)	–	–	–	88	1	82,57	1.173	11	95,30
Clase X CHF de Distribución (A) (cubierta)	–	–	–	396	5	80,59	3.019	29	95,94
Clase X EUR de Capitalización	1.012	9	103,52	972	9	99,36	1.281	11	104,50
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	8.687	92	87,36	15.314	173	83,73	36.681	340	96,16
Clase X Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	12.324	157	72,59	16.053	205	74,16	22.675	227	89,18
Clase X GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	2.973	30	79,52	5.206	54	80,09	9.746	76	94,97
Clase Premier USD de Capitalización	86.074	885	97,30	51.346	563	91,22	82.954	817	101,55
Clase Premier USD de Distribución (M) Plus (e)	15.699	178	88,40	19.197	217	88,30	21.157	205	102,96
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)	156	7	107,56	2.211	121	96,03	2.265	118	98,52
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	69.864	574	112,55	91.195	801	107,70	141.515	1.022	123,47
Clase Premier Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	42.042	527	73,85	41.888	526	75,35	42.876	423	90,45
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	339	3	80,35	6.824	70	80,81	2.311	18	95,62
Clase Premier SEK de Capitalización (cubierta)	2.473	227	112,78	2.027	196	107,98	3.339	256	123,61
Clase S USD de Capitalización	87.617	868	100,97	90.056	952	94,56	188.113	1.790	105,08
Clase S USD de Distribución (Q) Plus (e)	74	1	81,85	208	3	81,54	262	3	94,61
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	38.772	344	104,20	49.405	469	99,63	70.922	555	114,04
Clase S Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	4.483	50	83,51	5.144	57	85,09	6.325	55	101,98
Clase S GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	75	1	83,23	284	3	83,61	1.909	14	98,90
Clase LM USD de Capitalización	15.905	149	106,44	11.406	115	99,33	–	–	–
Clase LM USD de Distribución (M)	4.097	49	82,79	6.126	75	82,22	7.573	79	95,27
Clase LM USD de Distribución (M) Plus (e)	1	–	100,36	–	–	–	–	–	–
Clase LM EUR de Distribución (Q) (cubierta) Plus (e)	113.322	1.337	78,43	115.356	1.372	79,49	44.361	418	94,65
Clase LM GBP de Capitalización (cubierta)	22.781	187	96,55	25.939	238	90,69	30.076	220	101,96
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^									
Clase A USD de Capitalización	$ 371	3	112,79	$ 12.219	109	111,73	$ 12.217	108	113,34
Clase X USD de Distribución (M)	1	–	90,21	1	–	94,36	1	–	98,28
Clase Premier USD de Capitalización	12.037	100	120,11	30.650	259	118,21	36.297	305	119,13
Clase LM USD de Capitalización	3.994	30	133,95	3.886	30	130,32	3.871	30	129,83
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^α									
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	$ –	–	–	$ 75	1	75,72	$ 86	1	87,94
Clase S EUR de Distribución (A) (cubierta) (IH)	–	–	–	8.314	100	78,60	10.077	100	89,87
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^									
Clase A USD de Capitalización	$ 29	–	86,87	$ 27	–	82,04	$ 10	–	92,02
Clase A SGD de Capitalización (cubierta)	75	120	0,84	72	120	0,81	3.880	5.726	0,92
Clase X GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	4	–	60,49	4	–	61,32	6	–	73,57
Clase LM AUD de Capitalización (cubierta)	70.929	1.223	89,24	69.307	1.223	84,23	100.335	1.460	94,63
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^									
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	$ 101	1	96,21	$ 98	1	97,52	$ –	–	–
Clase S USD de Capitalización	15.597	148	105,56	14.581	148	98,69	–	–	–
Clase S Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	105	1	94,75	101	1	96,98	–	–	–
Clase S GBP de Capitalización (cubierta)	26	–	103,03	24	–	97,01	–	–	–
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^λ									
Clase A USD de Capitalización	$ 1	–	105,44	$ –	–	–	$ –	–	–
Clase S USD de Capitalización	31.698	300	105,66	–	–	–	–	–	–
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^α									
Clase A USD de Capitalización	$ –	–	–	$ 650	3	191,94	$ 141	1	196,64
Clase Premier USD de Capitalización	–	–	–	581	3	205,43	589	3	208,48
Clase Premier GBP de Capitalización	–	–	–	3	–	108,28	3	–	98,53
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	–	–	–	1.300	7	180,30	1.444	7	188,84
FTGF ClearBridge Value Fund									
Clase A USD de Capitalización	$ 121.992	663	183,96	$ 123.192	764	161,25	$ 121.303	732	165,63
Clase A USD de Distribución (A)	31.475	90	349,52	32.769	107	306,36	34.995	111	314,69
Clase A EUR de Capitalización	20.509	88	215,29	10.721	53	192,77	8.899	43	186,70
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	513	4	117,54	2.900	26	105,31	–	–	–
Clase A EUR de Distribución (A) (cubierta)	47	–	165,46	163	1	148,17	82	–	158,13
Clase A GBP de Distribución (A)	25	–	260,70	22	–	239,81	23	–	220,87
Clase A SGD de Capitalización	5.626	4.930	1,54	4.485	4.483	1,35	4.372	4.254	1,39
Clase A SGD de Capitalización (cubierta)	1.569	737	2,86	1.709	903	2,55	2.375	1.214	2,65
Clase C USD de Capitalización	9.640	52	184,40	11.911	73	162,44	9.512	57	167,70
Clase C USD de Distribución (A)	2.951	9	313,86	2.870	10	276,49	2.695	9	285,43
Clase E USD de Capitalización	3.173	27	116,15	4.195	41	102,58	2.907	27	106,16
Clase F USD de Capitalización	27.705	75	369,14	25.113	78	321,62	24.053	73	328,39
Clase F USD de Distribución (A)	367	2	203,38	385	2	177,83	2.818	16	181,76
Clase U USD de Capitalización	102.451	949	107,98	–	–	–	–	–	–
Clase X USD de Capitalización	1.773	15	120,27	110	1	104,72	–	–	–
Clase X USD de Distribución (A)	3.786	15	254,51	1.839	8	222,54	15.344	67	227,42

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de situación financiera *(continuación)*

	29 de febrero de 2024			28 de febrero de 2023			28 de febrero de 2022		
	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:
FTGF ClearBridge Value Fund (continuación)									
Clase X EUR de Capitalización	$ 5.778	38	142,09	$ 4.337	32	126,47	$ 5.094	37	121,64
Clase Premier USD de Capitalización	582.482	1.730	336,79	546.618	1.871	292,19	506.317	1.704	297,07
Clase Premier USD de Distribución (A)	75	–	227,57	2.347	12	198,95	482	2	203,29
Clase Premier EUR de Capitalización	116.174	376	286,04	87.612	327	253,64	105.810	388	243,25
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	110.865	917	111,92	57.089	544	99,13	31.343	267	104,79
Clase Premier GBP de Capitalización	1	–	103,51	–	–	–	–	–	–
Clase LM USD de Distribución (A)	8.649	73	118,00	9.339	91	103,12	13.814	132	104,99
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund									
Clase A USD de Capitalización	$ 37.093	104	358,09	$ 33.113	119	278,54	$ 38.354	126	303,63
Clase A USD de Distribución (A)	9.624	27	357,83	9.060	33	278,34	12.540	41	303,41
Clase A EUR de Capitalización	2.958	6	485,31	1.469	4	385,75	862	2	396,80
Clase B USD de Capitalización	26	–	321,46	20	–	251,30	55	–	275,31
Clase B USD de Distribución (A)	42	–	120,88	–	–	–	549	2	281,93
Clase C USD de Capitalización	15.586	48	321,41	13.742	55	251,27	16.457	60	275,27
Clase C USD de Distribución (A)	21.370	65	329,09	17.444	68	257,27	20.120	71	281,84
Clase E USD de Capitalización	18.472	50	371,80	18.769	64	291,41	22.561	70	320,04
Clase E USD de Distribución (A)	1.260	3	371,92	1.067	4	291,51	1.177	4	320,22
Clase F USD de Capitalización	20.011	59	338,74	20.872	80	261,94	26.406	93	283,88
Clase F USD de Distribución (A)	4.897	11	449,51	4.100	12	347,83	4.282	11	376,97
Clase X USD de Distribución (A)	1.390	5	290,70	1.480	7	224,94	1.684	7	243,72
Clase X EUR de Capitalización	16	–	374,84	12	–	296,11	286	1	302,61
Clase Premier USD de Capitalización	4.935	11	468,91	7.267	20	361,23	10.891	28	390,01
Clase Premier USD de Distribución (A)	1.968	4	544,32	2.119	5	421,23	3.421	8	455,60
Clase Premier EUR de Capitalización	29.057	49	544,06	20.884	46	428,10	12.422	25	435,74
Clase LM USD de Capitalización	27.678	107	259,79	24.655	124	198,89	25.866	121	213,40
Clase LM EUR de Capitalización	1.253	4	273,25	2.115	9	213,81	2.519	10	216,39
Clase A (G) USD de Capitalización	4.270	11	377,61	3.734	13	292,72	4.429	14	318,04
Clase B (G) USD de Capitalización	5	–	346,32	4	–	269,86	5	–	294,80
Clase L (G) USD de Capitalización	3.284	9	347,14	2.579	10	270,45	2.964	10	295,32
Clase GA USD de Capitalización	5.124	14	378,01	4.167	14	293,53	4.570	14	319,45
Clase GA EUR de Capitalización	426	1	502,92	368	1	398,98	401	1	409,60
Clase GA EUR de Distribución (A)	563	1	501,43	453	1	397,87	530	1	408,46
Clase GE USD de Capitalización	139	–	343,64	108	–	268,85	119	–	294,80
Clase GE EUR de Capitalización	9	–	456,83	9	–	365,13	10	–	377,75
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund									
Clase A USD de Capitalización	$ 291.603	544	535,90	$ 208.487	571	364,91	$ 275.982	640	431,31
Clase A USD de Distribución (A)	42.700	80	536,15	30.903	85	365,08	40.436	94	431,51
Clase A EUR de Capitalización	86.759	101	796,62	59.073	101	554,31	91.461	132	618,12
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	18.990	67	263,79	6.519	34	183,21	7.277	29	225,03
Clase A EUR de Distribución (A)	1	–	118,33	–	–	–	–	–	–
Clase B USD de Capitalización	6	–	485,30	66	–	332,11	182	–	394,51
Clase B USD de Distribución (A)	59	–	492,71	39	–	337,19	158	–	400,54
Clase C USD de Capitalización	27.399	56	485,46	21.984	66	332,22	27.505	70	394,65
Clase C USD de Distribución (A)	12.261	25	492,80	9.309	28	337,25	14.390	36	400,61
Clase E USD de Capitalización	11.555	40	286,71	9.229	47	196,70	13.185	56	234,24
Clase E USD de Distribución (A)	43	–	278,07	51	–	190,76	195	1	227,17
Clase F USD de Capitalización	98.806	335	294,85	129.606	649	199,57	152.031	648	234,47
Clase F USD de Distribución (A)	18.482	63	294,22	14.933	75	199,15	25.793	110	233,98
Clase U USD de Capitalización	239.721	1.069	224,20	197.273	1.306	151,03	283.702	1.606	176,60
Clase U USD de Distribución (Q)	9.379	83	112,91	–	–	–	–	–	–
Clase U EUR de Capitalización	112.184	407	255,24	15.490	83	175,64	89.392	411	193,77
Clase X USD de Capitalización	44.931	136	330,19	36.363	163	223,43	39.088	149	262,44
Clase X EUR de Capitalización	5.031	19	238,85	1.169	7	165,08	1.009	5	182,92
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	9.787	38	240,87	1.803	10	166,19	6.550	29	203,10
Clase X GBP de Capitalización	14.261	32	351,17	7.294	24	249,48	8.173	23	262,72
Clase Premier USD de Capitalización	404.984	1.156	350,29	191.353	810	236,21	269.653	975	276,47
Clase Premier USD de Distribución (A)	7.033	43	165,30	6.124	55	111,46	7.854	60	130,46
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)	30.321	576	261,50	22.607	704	168,22	52.354	1.465	184,08
Clase Premier EUR de Capitalización	111.362	337	305,37	71.935	323	210,40	122.774	471	232,38
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	62.598	215	269,94	21.337	109	185,58	24.290	96	225,88
Clase Premier EUR de Distribución (A)	6.968	39	165,25	3.771	31	113,87	3.905	28	125,70
Clase Premier GBP de Capitalización	116.480	258	358,00	59.348	195	253,36	87.385	245	265,81
Clase LM USD de Capitalización	61.484	188	327,89	80.119	365	219,73	103.953	407	255,58
Clase LM EUR de Capitalización	389	1	345,23	514	2	236,23	581	2	259,13
Clase A (G) USD de Capitalización	10.921	19	563,95	7.893	21	382,67	9.838	22	450,72
Clase L (G) USD de Capitalización	14.076	27	518,37	9.700	27	353,51	11.883	28	418,46
Clase GA USD de Capitalización	2.001	3	666,12	1.426	3	452,77	1.696	3	534,19
Clase GA EUR de Capitalización	25	–	786,38	17	–	546,16	20	–	607,83
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund									
Clase A USD de Capitalización	$ 59.251	238	248,53	$ 59.419	295	201,50	$ 82.146	347	236,91
Clase A USD de Distribución (A)	17.024	68	248,68	16.442	82	201,63	20.870	88	237,06
Clase A AUD de Capitalización (cubierta)	3.724	32	179,11	4.700	47	148,15	5.832	45	179,96
Clase A CHF de Capitalización (cubierta)	61	–	119,89	48	–	101,44	60	–	124,19
Clase A CNH de Capitalización (cubierta)	836	37	162,31	984	51	135,16	1.338	52	161,19
Clase A EUR de Capitalización	7.945	20	371,22	6.874	21	307,57	9.335	24	341,16
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	673	4	165,29	581	4	136,82	671	4	167,18
Clase A EUR de Distribución (A) (cubierta)	14	–	119,57	11	–	98,97	15	–	120,90
Clase A GBP de Capitalización	145	1	186,23	138	1	158,44	476	2	167,01
Clase A HKD de Capitalización	175	9	149,72	201	13	121,73	276	15	142,49
Clase A SEK de Capitalización (cubierta)	29	2	170,64	18	1	141,68	22	1	173,54
Clase A SGD de Capitalización (cubierta)	5.173	3.506	1,99	1.373	1.130	1,64	2.297	1.598	1,95
Clase B USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	267	1	229,61
Clase B USD de Distribución (A)	4	–	228,52	82	–	186,21	558	3	220,02
Clase C USD de Capitalización	6.422	27	238,39	6.110	31	194,26	9.131	40	229,54
Clase C USD de Distribución (A)	9.010	39	228,51	8.523	46	186,21	12.112	55	220,03
Clase E USD de Capitalización	4.964	21	235,38	5.324	28	192,28	11.574	51	227,78
Clase E USD de Distribución (A)	718	3	235,42	1.046	5	192,32	1.239	5	227,82
Clase E EUR de Capitalización	10	–	92,58	8	–	77,29	10	–	86,39
Clase E Euro de Capitalización (cubierta)	123	1	137,46	95	1	114,66	157	1	141,17
Clase F USD de Capitalización	8.560	30	281,40	8.708	38	226,80	11.191	42	265,05
Clase F USD de Distribución (A)	512	2	281,60	1.498	7	226,96	2.748	10	265,24
Clase X USD de Capitalización	3.127	15	202,12	3.219	20	162,82	5.160	27	190,19
Clase X USD de Distribución (A)	679	3	224,65	544	3	180,97	877	4	211,39
Clase X EUR de Capitalización	308	1	214,49	855	5	176,54	1.090	5	194,53
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	58	–	139,71	55	–	114,99	78	–	139,60
Clase X GBP de Capitalización	10.838	34	255,87	10.255	39	216,32	18.219	60	226,58
Clase Premier USD de Capitalización	4.629	14	338,89	20.680	76	272,04	238.793	754	316,67
Clase Premier EUR de Capitalización	2.437	6	366,91	2.505	8	301,00	3.121	8	330,46
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	90	1	120,14	–	–	–	–	–	–
Clase Premier EUR de Distribución (A)	–	–	–	–	–	–	12	–	311,48
Clase Premier GBP de Capitalización	265	1	141,42	215	1	119,13	303	2	124,41
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)	243	1	152,46	350	2	123,31	672	3	147,39
Clase Premier GBP de Distribución (A)	35.296	88	319,10	42.019	130	269,21	68.221	181	281,04
Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	1.142	33	146,83
Clase LM EUR de Capitalización	340	2	193,95	602	4	158,07	727	4	172,45
Clase A (G) USD de Capitalización	16.350	62	262,78	14.718	69	212,32	18.973	76	248,75
Clase B (G) USD de Capitalización	7	–	241,66	6	–	196,19	7	–	231,00

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de situación financiera *(continuación)*

	29 de febrero de 2024			28 de febrero de 2023			28 de febrero de 2022		
	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund (continuación)									
Clase L (G) USD de Capitalización	$ 7.012	29	241,53	$ 6.310	32	196,13	$ 8.113	35	230,95
Clase GA EUR de Capitalización	155	–	392,74	125	–	324,64	147	–	359,23
Clase GA EUR de Distribución (A)	70	–	391,27	59	–	323,42	70	–	357,88
Clase GE USD de Capitalización	72	–	301,10	59	–	245,41	69	–	290,04
Clase GE EUR de Capitalización	41	–	356,43	34	–	296,85	40	–	330,96
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund									
Clase A USD de Capitalización	$ 12.725	79	160,24	$ 13.397	97	138,55	$ 13.299	87	152,81
Clase A USD de Distribución (A)	99	1	122,86	86	1	107,55	95	1	119,93
Clase A USD de Distribución (M) Plus	1.499	17	89,07	2.262	28	80,14	2.042	22	92,06
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	1	–	109,31	113	1	97,14	128	1	110,21
Clase A USD de Distribución (Q)	1.251	10	121,80	1.092	10	106,31	1.216	10	118,47
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	744	14	79,19	859	18	72,55	1.166	19	85,71
Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus	65	5	85,94	60	5	79,42	124	8	93,35
Clase A EUR de Capitalización	160	1	146,52	141	1	129,46	150	1	134,68
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	493	4	118,29	502	5	104,45	1.262	9	119,24
Clase A Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	18	–	84,80	294	4	76,94	366	4	90,31
Clase A HKD de Distribución (M) Plus	122	11	89,70	151	15	80,92	790	67	92,60
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	223	357	0,84	599	1.052	0,77	483	735	0,89
Clase C USD de Capitalización	834	6	151,10	896	7	131,30	972	7	145,53
Clase C USD de Distribución (A)	121	1	122,38	106	1	107,11	246	2	119,46
Clase C USD de Distribución (Q)	84	1	112,99	73	1	98,62	81	1	109,98
Clase F USD de Capitalización	17.286	113	153,44	17.713	134	131,88	20.648	143	144,58
Clase F EUR de Capitalización	64	–	154,89	55	–	136,03	61	–	140,68
Clase F EUR de Distribución (A)	90	1	124,35	79	1	111,26	88	1	116,98
Clase X Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	57	1	103,79	50	1	93,55	62	1	109,21
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund									
Clase A USD de Capitalización	$ 50.323	297	169,20	$ 47.722	328	145,55	$ 48.817	304	160,43
Clase A USD de Distribución (A)	9.959	38	265,27	10.477	46	228,19	10.463	42	251,52
Clase A EUR de Capitalización	5.603	47	109,50	4.993	49	96,27	–	–	–
Clase A Euro de Capitalización (cubierta)	18.698	78	221,81	21.414	104	194,79	49.413	198	223,06
Clase A SEK de Capitalización	60.611	3.998	157,16	56.766	4.360	136,29	66.724	4.656	135,75
Clase F USD de Capitalización	3.388	20	173,12	5.947	40	148,03	6.403	39	162,19
Clase X USD de Capitalización	4.617	32	144,80	12.869	104	123,82	20.266	149	135,66
Clase X USD de Distribución (A)	343	1	278,75	857	4	238,35	1.622	6	261,15
Clase X EUR de Capitalización	7.021	51	126,38	708	6	110,40	927	7	114,04
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	7.064	28	233,57	2.811	13	203,85	1.823	7	231,69
Clase X GBP de Capitalización	277.252	696	315,54	478.725	1.405	283,28	237.295	635	278,51
Clase X GBP de Capitalización (cubierta)	852	5	146,50	2.318	15	126,11	2.436	13	141,45
Clase Premier USD de Capitalización	97.282	620	157,03	94.620	707	133,80	167.377	1.146	146,09
Clase Premier USD de Distribución (A)	6.015	21	281,62	33.164	138	240,49	35.826	136	262,86
Clase Premier EUR de Capitalización	1	–	116,19	1	–	101,11	–	–	–
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	2.870	11	240,74	5.531	25	209,43	2.203	8	237,15
Clase Premier GBP de Capitalización	22.333	52	342,96	11.173	30	306,82	4.987	12	300,59
Clase S USD de Capitalización	500.641	2.472	202,56	532.065	3.089	172,25	601.256	3.203	187,69
Clase S EUR de Capitalización	80.725	466	160,45	52.170	354	139,45	56.873	354	143,34
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	1.893	12	142,35	1.699	13	123,63	7.774	50	139,69
Clase S GBP de Capitalización	92.089	435	167,88	145.409	807	149,85	161.607	823	146,43
Clase S GBP de Capitalización (cubierta)	60.674	312	154,07	72.678	458	132,01	78.117	395	147,25
Clase S GBP de Distribución (Q)	16.831	81	164,24	10.539	59	147,32	15.238	79	144,37
Clase LM EUR de Capitalización	38.425	280	127,04	35.323	304	109,96	21.868	173	112,61
FTGF ClearBridge Global Growth Fund^									
Clase A USD de Capitalización	$ 861	5	172,21	$ 686	5	137,15	$ 754	5	150,84
Clase Premier USD de Capitalización	15.857	87	182,25	12.493	87	143,70	15.264	98	156,48
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^									
Clase A USD de Capitalización	€ 8.869	754	12,72	€ 22.713	1.980	12,13	€ 30.452	2.723	12,54
Clase A USD de Capitalización (cubierta)	32.739	2.248	15,74	54.425	3.812	15,10	49.791	3.885	14,37
Clase A USD de Distribución (M) (cubierta) Plus	34.959	3.575	10,57	44.093	4.340	10,75	47.028	4.911	10,74
Clase A USD de Distribución (M) Plus	4	–	9,96	–	–	–	–	–	–
Clase A USD de Distribución (Q)	2.347	179	14,17	2.915	226	13,62	3.039	242	14,09
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	2.402	399	10,00	2.473	382	10,18	5.707	853	10,33
Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus	26.118	19.835	10,26	23.313	16.311	10,51	7.660	5.083	10,67
Clase A EUR de Capitalización	124.782	8.513	14,66	145.537	10.186	14,29	73.628	5.290	13,92
Clase A Euro de Capitalización (cubierta) (PH)	3.123	265	11,78	6.339	554	11,43	5.029	436	11,54
Clase A EUR de Distribución (A)	428	45	9,60	418	45	9,36	–	–	–
Clase A Euro de Distribución (M) Plus	3.614	297	12,18	3.899	315	12,36	2.624	210	12,47
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	4.622	6.557	1,03	4.235	5.789	1,04	4.158	6.018	1,05
Clase C USD de Capitalización	1.311	117	12,14	3.347	304	11,64	3.683	342	12,08
Clase C USD de Capitalización (cubierta)	945	69	14,79	1.366	101	14,27	646	53	13,66
Clase E USD de Capitalización	4.305	330	14,11	6.399	499	13,56	8.126	646	14,10
Clase E USD de Capitalización (cubierta)	1.123	100	12,15	2.326	210	11,74	904	90	11,26
Clase E EUR de Capitalización	90	9	9,98	–	–	–	–	–	–
Clase E EUR de Distribución (A)	1	–	9,99	–	–	–	–	–	–
Clase F USD de Capitalización	4.669	385	13,12	4.659	397	12,43	1.537	135	12,77
Clase F USD de Capitalización (cubierta)	4.774	325	15,88	9.258	646	15,15	1.840	144	14,34
Clase U EUR de Capitalización	46.156	4.524	10,20	–	–	–	–	–	–
Clase X USD de Capitalización	251	21	12,87	1.495	130	12,17	67	6	12,46
Clase X USD de Distribución (A)	364	31	12,80	501	43	12,22	447	40	12,62
Clase X EUR de Capitalización	23.612	1.562	15,12	57.566	3.942	14,60	26.937	1.910	14,10
Clase X Euro de Capitalización (cubierta) (PH)	1.783	147	12,12	10.121	869	11,65	2.536	218	11,65
Clase X GBP de Distribución (Q)	1.800	125	12,34	2.493	176	12,45	1.489	108	11,53
Clase X GBP de Distribución (Q) (cubierta)	–	–	–	410	34	10,52	810	67	10,15
Clase Premier USD de Capitalización	38.426	2.467	16,84	74.451	4.958	15,88	11.876	820	16,23
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)	1.196	290	22,13	2.798	775	20,00	5.511	1.828	17,42
Clase Premier CAD de Distribución (Q) (cubierta) (PH) Plus (e)	42.027	5.220	11,81	46.777	5.861	11,52	51.721	6.384	11,51
Clase Premier CAD de Distribución (Q) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	6.322	811	11,08
Clase Premier EUR de Capitalización	333.314	13.624	24,46	432.296	18.330	23,58	207.952	9.151	22,73
Clase Premier Euro de Capitalización (cubierta) (PH)	7.864	609	12,91	4.026	325	12,40	7.393	596	12,40
Clase Premier GBP de Capitalización	119	6	16,81	405	21	16,65	6.622	363	15,25
Clase Premier GBP de Distribución (A) (cubierta) (PH) Plus (e)	4.434	174	21,88	14.897	618	21,18	21.555	844	21,34
Clase Premier GBP de Distribución (Q)	60.352	3.661	14,12	76.882	4.746	14,25	74.334	4.710	13,19
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^									
Clase A USD de Capitalización	$ –	–	–	$ –	–	–	$ 224	3	87,06
Clase A USD de Distribución (Q)	–	–	–	–	–	–	174	2	83,85
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	679	7	81,36
Clase X GBP de Distribución (Q)	–	–	–	–	–	–	730	7	79,04
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	858	9	82,16
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund									
Clase A USD de Capitalización	$ 19.511	203	96,21	$ 27.166	280	96,98	$ 17.858	169	105,90
Clase A USD de Distribución (M) Plus	44.714	522	85,66	61.518	674	91,28	28.785	274	104,96
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	45.099	517	87,17	61.812	670	92,22	74.314	707	105,12
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	5.774	111	79,69	8.133	139	86,78	5.538	75	102,34
Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus	1.489	133	80,49	1.325	104	88,26	315	19	103,79
Clase A EUR de Distribución (A) Plus (e)	99	1	80,98	67	1	85,09	–	–	–
Clase A Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus	7.044	83	78,50	8.022	89	85,54	3.929	34	101,92

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de situación financiera *(continuación)*

	29 de febrero de 2024			28 de febrero de 2023			28 de febrero de 2022		
	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund (continuación)									
Clase A GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus	$ 4.675	46	80,15	$ 5.016	48	86,10	$ 136	1	101,30
Clase A HKD de Distribución (M) Plus	702	63	86,86	1.385	117	92,80	1.827	135	106,10
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	50.922	84.124	0,81	63.459	96.802	0,88	27.834	36.826	1,02
Clase U USD de Capitalización	10.229	108	94,68	4.556	48	94,25	–	–	–
Clase U USD de Distribución (Q) Plus (e)	4.918	48	101,66	–	–	–	–	–	–
Clase U EUR de Capitalización	3.218	31	95,14	8.777	86	96,85	–	–	–
Clase U EUR de Distribución (Q) Plus (e)	8	–	97,80	67	1	97,29	–	–	–
Clase U GBP de Capitalización	3.453	30	92,34	3.127	27	96,41	–	–	–
Clase U GBP de Capitalización (cubierta)	315	2	99,87	–	–	–	–	–	–
Clase U GBP de Distribución (Q) (cubierta) Plus (e)	219	2	100,84	–	–	–	–	–	–
Clase U GBP de Distribución (Q) Plus (e)	643	6	91,32	–	–	–	–	–	–
Clase X USD de Distribución (M) Plus (e)	1.120	13	89,03	17.277	185	93,47	322	3	105,76
Clase X EUR de Distribución (M) (cubierta)	275	3	79,26	376	4	84,08	–	–	–
Clase X EUR de Distribución (Q) (cubierta) Plus (e)	813	9	83,64	2.323	24	90,22	645	5	105,94
Clase X GBP de Distribución (Q) (cubierta) Plus (e)	213	2	82,10	651	6	87,29	160	1	100,27
Clase Premier USD de Capitalización	1.960	23	86,30	2.352	27	86,03	4.720	46	102,52
Clase Premier USD de Distribución (M) Plus	61.976	718	86,28	59.725	657	90,93	4.994	48	103,28
Clase Premier EUR de Distribución (M) (cubierta)	27.600	298	85,67	32.976	343	90,86	155	1	105,08
Clase S USD de Capitalización	29.372	292	100,48	28.020	281	99,82	263	2	107,42
Clase S USD de Distribución (M) Plus	5.448	62	87,89	7.918	86	92,31	1.599	15	104,48
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^η									
Clase A USD de Capitalización	$ 11	–	112,17	$ –	–	–	$ –	–	–
Clase A SGD de Capitalización (cubierta)	11	14	1,11	–	–	–	–	–	–
Clase Premier USD de Capitalización	11	–	112,65	–	–	–	–	–	–
Clase S USD de Capitalización	5.585	50	112,82	–	–	–	–	–	–
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	11	–	111,80	–	–	–	–	–	–
Clase S GBP de Capitalización (cubierta)	12	–	112,40	–	–	–	–	–	–
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund									
Clase A USD de Capitalización	$ 141.806	466	304,22	$ 136.340	481	283,21	$ 179.306	607	295,45
Clase A USD de Distribución (A)	28.296	31	923,89	30.404	35	860,08	35.534	40	897,28
Clase A AUD de Capitalización (cubierta)	5.382	37	224,42	5.856	41	213,77	7.110	43	230,14
Clase A CNH de Capitalización (cubierta)	3.238	117	199,58	2.411	88	190,89	2.416	76	201,78
Clase A EUR de Capitalización	29.710	75	368,07	32.297	87	350,21	46.391	120	344,60
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	8.088	34	218,83	14.136	64	208,42	14.213	56	225,70
Clase A EUR de Distribución (A) (cubierta)	184	1	166,42	172	1	158,47	385	2	171,75
Clase A GBP de Capitalización (cubierta)	143	1	183,61	460	2	172,42	1.070	4	184,68
Clase A GBP de Distribución (A)	595	1	380,55	727	2	371,81	778	2	347,78
Clase A SEK de Capitalización (cubierta)	64	3	213,92	80	4	204,46	88	4	222,22
Clase A SGD de Capitalización	5.678	2.559	2,99	10.567	5.109	2,79	11.147	5.166	2,93
Clase A SGD de Capitalización (cubierta)	36.958	17.608	2,82	26.220	13.193	2,68	26.201	12.563	2,83
Clase B USD de Capitalización	17	–	312,65	119	–	292,49	127	–	306,67
Clase B USD de Distribución (A)	14	–	836,05	21	–	782,27	22	–	820,22
Clase C USD de Capitalización	9.883	32	313,17	11.432	39	293,00	13.207	43	307,21
Clase C USD de Distribución (A)	5.516	7	830,66	5.195	7	777,17	5.656	7	814,85
Clase E USD de Capitalización	10.942	39	279,09	9.939	38	261,78	11.386	41	275,16
Clase E USD de Distribución (A)	636	2	279,05	502	2	261,74	528	2	275,11
Clase E EUR de Capitalización	2.933	7	370,44	1.582	4	355,11	1.274	3	351,98
Clase E Euro de Capitalización (cubierta)	2.886	15	173,49	1.111	6	166,43	1.109	5	181,52
Clase F USD de Capitalización	11.899	36	332,82	15.873	52	307,98	26.949	84	319,38
Clase F USD de Distribución (A)	295	1	333,18	267	1	308,31	244	1	319,72
Clase R USD de Capitalización	–	–	–	1	–	110,12	–	–	113,60
Clase R EUR de Capitalización	321	1	290,18	302	1	274,66	307	1	268,95
Clase X USD de Capitalización	57.413	194	295,58	47.508	174	273,10	33.276	118	282,78
Clase X USD de Distribución (A)	1.193	6	204,93	1.177	6	189,35	1.492	8	196,06
Clase X EUR de Capitalización	10.914	54	186,75	5.887	32	176,23	13.906	72	172,19
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	13.486	64	196,18	11.488	59	185,38	22.708	102	199,32
Clase X GBP de Capitalización	36.189	75	380,13	39.715	90	368,64	42.807	93	342,20
Clase X GBP de Distribución (A)	2.614	6	348,01	3.082	8	337,47	4.309	10	313,21
Clase Premier USD de Capitalización	170.380	436	391,20	220.211	611	360,19	257.090	692	371,66
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)	5.565	143	194,04	6.630	203	170,82	17.351	541	165,25
Clase Premier EUR de Capitalización	39.297	69	523,29	46.669	90	492,39	63.706	119	479,41
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	13.882	60	213,51	5.193	24	200,98	960	4	215,21
Clase Premier GBP de Capitalización	30.462	67	362,88	44.274	105	350,66	67.856	156	324,40
Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)	8.011	203	157,42	3.681	114	144,10	5.300	152	146,12
FTGF Royce US Smaller Companies Fund									
Clase A USD de Capitalización	$ 34.706	135	256,17	$ 31.063	134	231,96	$ 35.531	154	231,37
Clase A USD de Distribución (A)	9.278	21	433,55	9.540	24	392,74	11.155	28	391,87
Clase A EUR de Capitalización	1.340	3	413,38	2.035	5	382,78	1.975	5	360,17
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	188	1	172,53	98	1	159,80	174	1	165,50
Clase A EUR de Distribución (A)	229	1	292,77	124	–	271,21	111	–	255,46
Clase A GBP de Distribución (A)	59	–	405,71	54	–	385,69	123	–	345,13
Clase A SEK de Capitalización (cubierta)	3	–	173,53	2	–	161,28	1	–	167,25
Clase C USD de Capitalización	3.180	13	247,28	2.964	13	225,03	3.094	14	225,58
Clase C USD de Distribución (A)	2.725	7	390,60	2.765	8	355,62	2.999	8	356,61
Clase E USD de Capitalización	866	3	264,13	721	3	241,07	750	3	242,35
Clase E USD de Distribución (A)	8	–	155,41	7	–	141,84	8	–	142,67
Clase E EUR de Capitalización	9	–	170,42	9	–	158,95	8	–	150,73
Clase F USD de Capitalización	15.526	49	319,35	11.194	39	287,56	10.813	38	285,20
Clase F USD de Distribución (A)	546	2	341,62	532	2	307,61	543	2	305,10
Clase R USD de Capitalización	–	–	–	109	1	168,67	212	1	167,46
Clase X USD de Capitalización	19	–	231,43	53	–	208,08	333	2	206,08
Clase X USD de Distribución (A)	2	–	106,26	1	–	95,46	–	–	94,37
Clase Premier USD de Capitalización	10.847	31	352,30	600	2	315,65	966	3	311,50
Clase Premier USD de Distribución (A)	12.258	50	245,06	12.361	56	219,68	14.320	66	216,79
Clase Premier GBP de Distribución (A)	2.049	5	311,23	1.473	4	292,99	1.769	5	259,24
Clase LM EUR de Capitalización	327	1	248,09	702	3	225,37	854	4	208,25
Clase A (G) USD de Capitalización	941	3	289,01	941	4	260,24	1.022	4	258,11
Clase L (G) USD de Capitalización	829	3	265,50	750	3	240,27	1.174	5	239,50
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^									
Clase A USD de Capitalización	$ 9	–	85,46	$ 8	–	83,66	$ 9	–	90,44
Clase X USD de Capitalización	9	–	86,92	9	–	84,44	9	–	90,61
Clase X GBP de Capitalización	6	–	96,54	14	–	98,60	–	–	–
Clase Premier USD de Capitalización	4.362	50	87,60	4.223	50	84,81	4.516	50	90,69
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^									
Clase A USD de Capitalización	€ –	–	–	€ –	–	–	€ 608	7	100,59
Clase A USD de Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	1.157	9	144,30
Clase A USD de Distribución (A)	–	–	–	–	–	–	762	5	183,06
Clase A USD de Distribución (M) (cubierta) Plus	–	–	–	–	–	–	4.140	48	97,65
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	–	–	–	–	–	–	1.402	23	92,61
Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus	–	–	–	–	–	–	158	11	102,33
Clase A EUR de Capitalización	–	–	–	–	–	–	333	2	195,74
Clase A EUR de Distribución (A)	–	–	–	–	–	–	84	1	166,20
Clase A Euro de Distribución (M) Plus	–	–	–	–	–	–	430	4	97,95
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	–	–	–	–	–	–	224	390	0,87

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de situación financiera *(continuación)*

	29 de febrero de 2024			28 de febrero de 2023			28 de febrero de 2022		
	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^ (continuación)									
Clase B USD de Capitalización	$ –	–	–	$ –	–	–	$ 14	–	93,06
Clase B USD de Distribución (A)	–	–	–	–	–	–	56	–	180,51
Clase C USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	144	2	94,91
Clase C USD de Distribución (A)	–	–	–	–	–	–	1.236	8	180,39
Clase E USD de Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	123	1	102,25
Clase F USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	290	3	124,53
Clase X EUR de Capitalización	–	–	–	–	–	–	1	–	104,43
Clase Premier EUR de Capitalización	–	–	–	–	–	–	53	–	144,35
Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)	–	–	–	–	–	–	480	18	127,46
Clase LM EUR de Capitalización	–	–	–	–	–	–	2.034	15	137,11
Clase A (G) USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	958	10	104,34
Clase B (G) USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	1	–	96,33
Clase L (G) USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	95	1	96,85
Clase GA USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	870	5	178,58
Clase GA EUR de Capitalización	–	–	–	–	–	–	12.539	62	201,63
Clase GA EUR de Distribución (A)	–	–	–	–	–	–	101	1	158,26
Clase GE USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	44	–	163,28
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^δ									
Clase A USD de Capitalización	$ –	–	–	$ 1.708	12	143,40	$ 2.058	13	156,45
Clase A USD de Distribución (A)	–	–	–	2.930	13	229,91	3.344	13	258,01
Clase A USD de Distribución (M) Plus	–	–	–	3.235	38	84,93	3.851	40	97,45
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	–	–	–	2.539	45	83,03	2.093	30	97,46
Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus	–	–	–	173	16	74,97	223	16	87,97
Clase A EUR de Capitalización	–	–	–	134	1	137,11	249	2	141,19
Clase A HKD de Distribución (M) Plus	–	–	–	1.518	139	85,63	2.075	166	97,83
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	–	–	–	32	48	0,91	33	42	1,05
Clase B USD de Distribución (A)	–	–	–	13	–	223,94	43	–	251,36
Clase C USD de Capitalización	–	–	–	100	1	98,15	109	1	107,62
Clase C USD de Distribución (A)	–	–	–	1.236	6	222,72	1.632	7	250,00
Clase E USD de Capitalización	–	–	–	14	–	133,58	16	–	147,17
Clase E USD de Distribución (A)	–	–	–	10	–	94,16	11	–	105,87
Clase F USD de Capitalización	–	–	–	298	2	128,31	29	–	139,46
Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)	–	–	–	35	1	138,86	2.281	66	145,76
Clase GA USD de Capitalización	–	–	–	6.520	45	143,98	7.183	46	157,32
Clase GA EUR de Capitalización	–	–	–	124	1	173,18	135	1	178,49
Clase GA EUR de Distribución (A)	–	–	–	2	–	143,83	2	–	152,37
Clase GE USD de Capitalización	–	–	–	469	4	131,10	516	4	144,31
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^									
Clase A USD de Capitalización	$ –	–	–	$ –	–	–	$ 2.462	12	198,91
Clase A USD de Distribución (M) Plus	–	–	–	–	–	–	352	3	104,25
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	–	–	–	–	–	–	457	6	98,09
Clase A HKD de Distribución (M) Plus	–	–	–	–	–	–	173	13	104,77
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	–	–	–	–	–	–	53	68	1,06
Clase X USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	1	–	104,34
Clase Premier USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	2.811	25	110,91
Clase GA USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	3.958	20	202,76
Clase GA EUR de Capitalización	–	–	–	–	–	–	1.589	5	259,07
Clase GA EUR de Distribución (A)	–	–	–	–	–	–	342	1	220,29
Clase GE USD de Capitalización	–	–	–	–	–	–	49	–	187,12
Clase GE EUR de Capitalización	–	–	–	–	–	–	296	1	238,91
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^β									
Clase A USD de Capitalización	$ –	–	–	$ 88	1	115,41	$ 22	–	133,46
Clase M GBP de Distribución (A)	–	–	–	1.692	85	16,64	2.262	98	17,20
Clase F USD de Capitalización	–	–	–	1	–	120,20	1	–	138,19
Clase M USD de Distribución (A)	–	–	–	320	26	12,52	367	25	14,43
Clase M EUR de Distribución (A)	–	–	–	62	4	15,35	72	4	16,69
Clase Premier USD de Capitalización	–	–	–	1.362	15	89,46	13.357	131	102,18
Clase Premier GBP de Capitalización	–	–	–	13	–	102,96	37	–	105,44
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^									
Clase A USD de Capitalización	$ 4.955	24	203,06	$ 4.707	29	163,21	$ 6.471	34	190,12
Clase A EUR de Capitalización	5.474	24	207,83	6.205	34	170,77	3.973	19	187,53
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	16.784	165	94,05	13.539	165	77,46	22.933	217	94,30
Clase C USD de Capitalización	192	2	86,03	181	3	69,49	212	3	81,36
Clase E USD de Capitalización	2.144	16	133,00	2.560	24	107,70	4.240	34	126,41
Clase F USD de Capitalización	155	2	87,97	215	3	70,28	249	3	81,38
Clase X USD de Capitalización	114	1	100,06	91	1	79,83	105	1	92,29
Clase X EUR de Capitalización	247	1	220,00	192	1	179,33	104	–	195,54
Clase X GBP de Capitalización	1.557	6	224,16	1.283	6	187,66	1.631	6	194,52
Clase X GBP de Capitalización (cubierta)	3.054	13	189,03	2.167	12	152,41	1.876	8	181,95
Clase Premier USD de Capitalización	14.030	64	220,60	14.049	80	175,37	37.745	187	202,05
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)	23	–	131,95	433	3	106,02	568	3	126,13
Clase S USD de Capitalización	–	–	–	5.827	63	92,64	7.523	71	106,36
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	58.905	553	98,52	73.491	869	79,99	58.847	547	95,95
Clase S GBP de Capitalización	16.387	54	239,25	16.109	67	198,75	22.904	83	204,70
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund									
Clase A USD de Distribución (M) Plus	$ 1	–	102,33	$ –	–	–	$ –	–	–
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	4.472	54	83,34	5.748	66	87,21	6.166	63	98,23
Clase A AUD de Distribución (M) Plus	448	7	95,96	454	7	97,11	487	7	101,33
Clase A Euro de Distribución (M) Plus (e)	454	5	85,20	457	5	91,10	490	5	96,80
Clase A SGD de Distribución (M) Plus	43	71	0,82	45	70	0,86	54	75	0,98
Clase D AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	21	–	90,80	375	6	96,94	684	8	111,38
Clase D CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus	1	–	92,05	1	–	98,76	1	–	113,18
Clase D HKD de Distribución (M) Plus	1	–	98,04	1	–	102,55	1	–	114,51
Clase D SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	227	325	0,94	307	414	1,00	1.016	1.221	1,13
Clase D USD de Distribución (M) Plus	42	–	96,98	1.014	10	101,21	856	8	113,52
Clase D USD de Capitalización	4.158	36	116,92	5.511	48	115,20	5.888	48	123,07
Clase X AUD de Capitalización	199	2	135,41	312	4	128,43	350	4	126,73
Clase X USD de Capitalización	5.843	45	128,70	5.801	46	126,36	6.077	45	134,52
Clase S GBP de Capitalización	500	3	143,09	487	3	146,47	515	3	138,89
Clase S GBP de Distribución (M) Plus (e)	491	4	98,12	487	4	106,24	515	4	105,80
Clase LM AUD de Capitalización	4.243	47	139,35	4.121	47	130,72	4.834	52	127,51
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^									
Clase A USD de Capitalización	$ 4.368	49	89,74	$ 4.789	54	88,85	$ 7.343	68	108,56
Clase E USD de Capitalización	203	2	99,06	352	4	98,83	402	3	121,66
Clase F USD de Capitalización	14.174	124	114,36	14.837	132	112,56	11.843	87	136,70
Clase X USD de Capitalización	2	–	98,01	2	–	96,38	656	6	116,89
Clase Premier USD de Capitalización	1.886	19	100,24	3.812	39	98,17	6.709	57	118,63
Clase S USD de Capitalización	233	2	122,08	347	3	119,33	2.252	16	143,91
Clase S EUR de Capitalización	10.781	94	105,90	10.563	94	105,77	18.633	138	120,24

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de situación financiera *(continuación)*

	29 de febrero de 2024			28 de febrero de 2023			28 de febrero de 2022		
	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:	Total NAV (en miles)	N.º de acciones (en miles)	Valor liquidativo/ Acción:
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^									
Clase A USD de Capitalización (cubierta)	€ 31	–	96,69	€ 26	–	80,63	€ 39	1	86,53
Clase A EUR de Capitalización	1.873	12	160,37	1.770	13	136,40	7.094	47	151,56
Clase E USD de Capitalización (cubierta)	30	–	94,98	26	–	79,81	38	1	86,29
Clase X EUR de Capitalización	683	4	166,86	528	4	140,86	1.877	12	155,36
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)	768	33	123,89	1.342	76	97,67	3.184	191	96,48
Clase Premier EUR de Capitalización	991	6	169,99	850	6	143,00	26.577	169	157,16
Clase S USD de Capitalización	1	–	132,29	1	–	108,31	–	–	–
Clase S EUR de Capitalización	84.273	564	149,33	76.234	609	125,11	145.601	1.063	136,96
Clase S GBP de Capitalización	100.228	982	87,35	108.320	1.267	75,17	119.180	1.273	78,23
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^γ									
Clase A USD de Capitalización	$ 97	1	97,47	$ –	–	–	$ –	–	–
Clase X GBP de Capitalización	1	–	113,48	–	–	–	–	–	–
Clase X GBP de Capitalización (cubierta)	851	7	99,05	–	–	–	–	–	–
Clase S USD de Capitalización	4.640	47	98,72	–	–	–	–	–	–
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	96	1	97,23	–	–	–	–	–	–
Clase S GBP de Capitalización	2	–	113,84	–	–	–	–	–	–
Clase S GBP de Capitalización (cubierta)	499	4	98,16	–	–	–	–	–	–
Franklin Responsible Income 2028 Fund^									
Clase A EUR de Capitalización	€ 10.087	97	104,08	€ 98	1	98,13	€ –	–	–
Clase A EUR de Distribución (A)	44.990	432	104,14	5.022	51	98,18	–	–	–
Clase A EUR de Distribución (A) Plus	–	–	–	98	1	98,13	–	–	–
Clase D EUR de Capitalización	1.157	11	103,46	98	1	98,08	–	–	–
Clase D EUR de Distribución (A)	210	2	103,45	98	1	98,08	–	–	–
Clase K EUR de Capitalización	–	–	–	98	1	98,11	–	–	–
Clase K EUR de Distribución (A)	–	–	–	98	1	98,11	–	–	–
Clase X EUR de Capitalización	491	5	104,52	9.474	97	98,17	–	–	–
Clase X EUR de Distribución (A)	30.769	294	104,60	21.739	221	98,22	–	–	–

Los importes que se indican con "–" equivalen a 0 $/€/£ o son inferiores a 1.000 $/€/£.

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^ y FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ dejaron de operar.*

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

γ *A partir del 20 de junio de 2023, FTGF Martin Currie Improving Society Fund^ comenzó a operar.*

δ *El 17 de julio de 2023, FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^ dejó de cotizar en bolsa.*

η *A partir del 22 de septiembre de 2023, FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^ comenzó a operar.*

θ *A partir del 23 de octubre de 2023, FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^ dejó de operar.*

λ *A partir del 6 de noviembre de 2023, FTGF Brandywine Global - US Fixed Income Fund^ comenzó a operar.*

μ *A partir del 10 de noviembre de 2023, FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^ dejó de operar.*

¥ *A partir del 5 de diciembre de 2023, FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^ dejó de operar.*

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

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de ingresos globales

(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	
	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
INGRESOS POR INVERSIONES:								
Ingresos brutos de dividendos e intereses de bonos (Nota 2)	$ 51.509	$ 19.590	$ 7.578	$ 5.896	$ 47.157	$ 49.800	€ 2.261	€ 2.399
Interés (Nota 2)	–	–	1	–	36	6	14	1
Compensación (Nota 2)	–	–	–	–	(1)	(1)	–	–
Otros ingresos	–	–	–	–	–	–	–	–
Ganancia/(pérdida) neta sobre activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados (Nota 2):								
Ganancia/(pérdida) neta realizada sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	2	–	(2.958)	(23.862)	(103.623)	(121.262)	(12.108)	(6.318)
Ganancia/(pérdida) neta latente sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	–	–	1.756	(6.884)	96.548	(109.818)	16.188	(18.592)
Total Ingresos/(Pérdidas) por inversiones	51.511	19.590	6.377	(24.850)	40.117	(181.275)	6.355	(22.510)
GASTOS:								
Comisiones de gestión (Nota 4)	5.621	4.894	1.152	1.200	5.500	7.092	35	35
Comisiones de Administrador y Depositario (Nota 4)	254	223	139	129	761	944	77	103
Comisiones de servicios a los accionistas (Nota 4)	–	–	113	149	269	309	2	2
Honorarios judiciales	28	3	5	5	36	38	4	3
Comisiones de auditoría (Nota 4)	23	17	46	35	46	35	28	24
Gastos de impresión	10	54	–	15	–	87	5	9
Gastos por intereses	–	–	1	–	27	12	–	7
Honorarios de los Consejeros y gastos (Nota 4)	11	7	2	1	13	10	2	1
Ajuste de los gastos devengados y otros pasivos	–	–	–	–	–	–	–	–
Otros gastos	126	85	38	148	191	520	40	29
Total de gastos	6.073	5.283	1.496	1.682	6.843	9.047	193	213
Exenciones de gastos y reembolsos/deducciones (Nota 4)	–	(645)	(64)	(51)	(3)	(15)	–	–
Gastos netos totales	6.073	4.638	1.432	1.631	6.840	9.032	193	213
Ganancia/(pérdida) neta antes de costes financieros	**45.438**	**14.952**	**4.945**	**(26.481)**	**33.277**	**(190.307)**	**6.162**	**(22.723)**
COSTES FINANCIEROS:								
Distribuciones a los tenedores de acciones participativas rescatables (Nota 5)	(36.140)	(11.932)	(1.973)	(1.859)	(2.990)	(2.917)	(18)	(8)
Ganancia/(pérdida) del ejercicio financiero	**9.298**	**3.020**	**2.972**	**(28.340)**	**30.287**	**(193.224)**	**6.144**	**(22.731)**
Retención fiscal en origen/(impuestos) sobre ingresos por dividendos e intereses	–	–	(2)	4	(86)	(236)	5	2
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	**$ 9.298**	**$ 3.020**	**$ 2.970**	**$ (28.336)**	**$ 30.201**	**$ (193.460)**	**€ 6.149**	**€ (22.729)**

(en miles)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund^		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund^		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^	
	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
INGRESOS POR INVERSIONES:								
Ingresos brutos de dividendos e intereses de bonos (Nota 2)	$ 3.691	$ 4.211	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –	$ 1.736
Interés (Nota 2)	2	1	–	–	–	–	–	–
Compensación (Nota 2)	(1)	–	–	–	–	–	–	–
Otros ingresos	–	–	–	–	–	–	–	–
Ganancia/(pérdida) neta sobre activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados (Nota 2):								
Ganancia/(pérdida) neta realizada sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	(7.210)	(4.968)	–	–	–	–	–	(3.715)
Ganancia/(pérdida) neta latente sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	7.415	(6.290)	–	–	–	–	–	(1.106)
Total Ingresos/(Pérdidas) por inversiones	3.897	(7.046)	–	–	–	–	–	(3.085)
GASTOS:								
Comisiones de gestión (Nota 4)	468	604	–	–	–	–	–	76
Comisiones de Administrador y Depositario (Nota 4)	46	52	–	–	–	–	–	18
Comisiones de servicios a los accionistas (Nota 4)	65	80	–	–	–	–	–	10
Honorarios judiciales	2	1	–	–	–	–	–	1
Comisiones de auditoría (Nota 4)	30	22	–	–	–	–	–	13
Gastos de impresión	3	6	–	–	–	–	–	4
Gastos por intereses	–	1	–	–	–	–	–	–
Honorarios de los Consejeros y gastos (Nota 4)	1	–	–	–	–	–	–	–
Ajuste de los gastos devengados y otros pasivos	–	–	–	–	–	–	–	–
Otros gastos	57	43	–	–	–	–	–	35
Total de gastos	672	809	–	–	–	–	–	157
Exenciones de gastos y reembolsos/deducciones (Nota 4)	(43)	(21)	–	–	–	–	–	(32)
Gastos netos totales	629	788	–	–	–	–	–	125
Ganancia/(pérdida) neta antes de costes financieros	**3.268**	**(7.834)**	**–**	**–**	**–**	**–**	**–**	**(3.210)**
COSTES FINANCIEROS:								
Distribuciones a los tenedores de acciones participativas rescatables (Nota 5)	(2.600)	(2.507)	–	–	–	–	–	(153)
Ganancia/(pérdida) del ejercicio financiero	**668**	**(10.341)**	**–**	**–**	**–**	**–**	**–**	**(3.363)**
Retención fiscal en origen/(impuestos) sobre ingresos por dividendos e intereses	10	(40)	–	–	–	–	–	2
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	**$ 678**	**$ (10.381)**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ (3.361)**

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^	
Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
$ –	$ 2.290	$ 13.206	$ 12.184	$ 8.798	$ 12.690	$ –	$ 1.115	$ –	$ 357
–	–	14	3	–	–	–	–	–	–
–	–	7	(1)	1	–	–	–	–	–
18	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	(5.513)	(21.878)	(18.028)	(9.725)	(26.636)	–	(9.246)	(1)	(5.081)
–	1.341	23.817	(29.851)	10.243	(8.685)	–	4.275	1	2.932
18	(1.882)	15.166	(35.693)	9.317	(22.631)	–	(3.856)	–	(1.792)
–	418	1.139	1.174	755	1.053	–	121	–	2
–	34	179	175	89	132	–	20	–	7
–	46	74	79	85	103	–	8	–	–
–	1	7	7	4	6	–	–	–	–
–	11	46	35	30	22	–	12	–	10
–	4	–	19	–	14	–	3	–	1
–	–	3	3	1	3	–	–	–	–
–	–	3	1	1	1	–	–	–	–
18	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	27	72	80	41	72	–	25	–	10
18	541	1.523	1.573	1.006	1.406	–	189	–	30
–	(24)	(4)	(1)	(7)	(10)	–	(14)	–	(17)
18	517	1.519	1.572	999	1.396	–	175	–	13
–	**(2.399)**	**13.647**	**(37.265)**	**8.318**	**(24.027)**	**–**	**(4.031)**	**–**	**(1.805)**
–	(533)	(5.048)	(4.900)	(4.062)	(3.795)	–	(826)	–	(319)
–	**(2.932)**	**8.599**	**(42.165)**	**4.256**	**(27.822)**	**–**	**(4.857)**	**–**	**(2.124)**
–	(1)	(129)	(183)	5	(77)	–	1	–	10
$ –	**$ (2.933)**	**$ 8.470**	**$ (42.348)**	**$ 4.261**	**$ (27.899)**	**$ –**	**$ (4.856)**	**$ –**	**$ (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^	
Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
$ 17.114	$ 18.250	$ 13.849	$ 6.684	$ 5.375	$ 4.665	$ 1.345	$ 1.973	€ –	€ 404
2	4	23	2	6	1	2	–	–	–
(1.227)	(6)	(2)	13	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
(39.035)	(11.414)	(7.417)	(14.415)	(7.922)	(18.099)	(4.996)	(4.202)	–	(3.794)
36.019	(45.874)	34.383	(41.738)	10.643	(13.755)	5.288	(6.019)	–	992
12.873	(39.040)	40.836	(49.454)	8.102	(27.188)	1.639	(8.248)	–	(2.398)
2.796	3.084	1.904	1.557	239	239	20	23	–	–
308	321	379	290	117	118	33	49	–	8
161	187	160	107	2	3	3	4	–	–
14	12	16	12	5	4	2	1	–	–
46	35	31	23	31	23	31	23	–	12
1	30	22	27	7	13	2	5	–	2
1	1	5	6	1	2	–	1	–	14
5	4	6	3	2	1	–	1	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
105	122	132	77	91	60	34	21	–	2
3.437	3.796	2.655	2.102	495	463	125	128	–	38
–	–	(2)	–	(10)	–	–	–	–	(11)
3.437	3.796	2.653	2.102	485	463	125	128	–	27
9.436	**(42.836)**	**38.183**	**(51.556)**	**7.617**	**(27.651)**	**1.514**	**(8.376)**	**–**	**(2.425)**
(6.491)	(6.139)	(9.370)	(3.697)	–	–	–	–	–	(1)
2.945	**(48.975)**	**28.813**	**(55.253)**	**7.617**	**(27.651)**	**1.514**	**(8.376)**	**–**	**(2.426)**
(442)	(449)	22	(4)	(49)	(34)	(1)	(3)	–	–
$ 2.503	**$ (49.424)**	**$ 28.835**	**$ (55.257)**	**$ 7.568**	**$ (27.685)**	**$ 1.513**	**$ (8.379)**	**€ –**	**€ (2.426)**

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de ingresos globales *(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^	
	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
INGRESOS POR INVERSIONES:								
Ingresos brutos de dividendos e intereses de bonos (Nota 2)	$ 100.114	$ 119.538	$ –	$ –	$ 24.593	$ 17.639	$ –	$ –
Interés (Nota 2)	53	193	–	–	6	1	–	–
Compensación (Nota 2)	(523)	366	–	–	–	14	–	–
Otros ingresos	–	–	–	–	–	–	–	–
Ganancia/(pérdida) neta sobre activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados (Nota 2):								
Ganancia/(pérdida) neta realizada sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	(187.391)	(808.592)	–	–	(11.557)	(67.965)	–	–
Ganancia/(pérdida) neta latente sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	235.632	213.028	–	–	20.147	(7.496)	–	–
Total Ingresos/(Pérdidas) por inversiones	147.885	(475.467)	–	–	33.189	(57.807)	–	–
GASTOS:								
Comisiones de gestión (Nota 4)	19.179	30.787	–	–	320	310	–	–
Comisiones de Administrador y Depositario (Nota 4)	1.170	1.815	–	–	239	205	–	–
Comisiones de servicios a los accionistas (Nota 4)	1.444	2.121	–	–	–	–	–	–
Honorarios judiciales	28	90	–	–	9	14	–	–
Comisiones de auditoría (Nota 4)	46	35	–	–	31	24	–	–
Gastos de impresión	–	213	–	–	16	38	–	–
Gastos por intereses	32	112	–	–	–	4	–	–
Honorarios de los Consejeros y gastos (Nota 4)	20	23	–	–	3	2	–	–
Ajuste de los gastos devengados y otros pasivos	–	–	–	–	–	–	–	–
Otros gastos	58	536	–	–	78	92	–	–
Total de gastos	21.977	35.732	–	–	696	689	–	–
Exenciones de gastos y reembolsos/deducciones (Nota 4)	–	–	–	–	–	(1)	–	–
Gastos netos totales	21.977	35.732	–	–	696	688	–	–
Ganancia/(pérdida) neta antes de costes financieros	**125.908**	**(511.199)**	**–**	**–**	**32.493**	**(58.495)**	**–**	**–**
COSTES FINANCIEROS:								
Distribuciones a los tenedores de acciones participativas rescatables (Nota 5)	(22.344)	(18.470)	–	–	(1.343)	(309)	–	–
Ganancia/(pérdida) del ejercicio financiero	**103.564**	**(529.669)**	**–**	**–**	**31.150**	**(58.804)**	**–**	**–**
Retención fiscal en origen/(impuestos) sobre ingresos por dividendos e intereses	(4.103)	(5.966)	–	–	(71)	(110)	–	–
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	**$ 99.461**	**$ (535.635)**	**$ –**	**$ –**	**$ 31.079**	**$ (58.914)**	**$ –**	**$ –**

(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^	
	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
INGRESOS POR INVERSIONES:								
Ingresos brutos de dividendos e intereses de bonos (Nota 2)	$ 221	$ 245	$ 9.475	$ 8.345	$ 21.603	$ 25.709	$ 2.106	$ 794
Interés (Nota 2)	1	–	1	1	1	2	1	–
Compensación (Nota 2)	–	–	(60)	(39)	–	–	7	–
Otros ingresos	–	–	–	–	–	–	–	–
Ganancia/(pérdida) neta sobre activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados (Nota 2):								
Ganancia/(pérdida) neta realizada sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	(1.504)	447	(31.189)	(33.243)	(29.812)	(104.216)	248	(2.007)
Ganancia/(pérdida) neta latente sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	1.690	(1.476)	26.431	(8.855)	24.190	(9.919)	999	40
Total Ingresos/(Pérdidas) por inversiones	408	(784)	4.658	(33.791)	15.982	(88.424)	3.361	(1.173)
GASTOS:								
Comisiones de gestión (Nota 4)	21	28	985	1.242	2.363	2.452	97	47
Comisiones de Administrador y Depositario (Nota 4)	17	19	127	143	258	427	24	13
Comisiones de servicios a los accionistas (Nota 4)	–	–	129	177	7	8	2	–
Honorarios judiciales	8	5	4	4	15	15	–	–
Comisiones de auditoría (Nota 4)	14	16	46	35	31	23	31	23
Gastos de impresión	–	1	–	1	–	41	1	2
Gastos por intereses	–	–	1	3	2	25	1	–
Honorarios de los Consejeros y gastos (Nota 4)	–	–	2	1	5	5	–	–
Ajuste de los gastos devengados y otros pasivos	–	–	–	–	–	–	–	–
Otros gastos	25	22	67	20	99	112	41	13
Total de gastos	85	91	1.361	1.626	2.780	3.108	197	98
Exenciones de gastos y reembolsos/deducciones (Nota 4)	(53)	(50)	–	–	–	–	(59)	(36)
Gastos netos totales	32	41	1.361	1.626	2.780	3.108	138	62
Ganancia/(pérdida) neta antes de costes financieros	**376**	**(825)**	**3.297**	**(35.417)**	**13.202**	**(91.532)**	**3.223**	**(1.235)**
COSTES FINANCIEROS:								
Distribuciones a los tenedores de acciones participativas rescatables (Nota 5)	–	–	(1.877)	(1.003)	(1.543)	(877)	(22)	(6)
Ganancia/(pérdida) del ejercicio financiero	**376**	**(825)**	**1.420**	**(36.420)**	**11.659**	**(92.409)**	**3.201**	**(1.241)**
Retención fiscal en origen/(impuestos) sobre ingresos por dividendos e intereses	–	–	(85)	372	(980)	(520)	–	(2)
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	**$ 376**	**$ (825)**	**$ 1.335**	**$ (36.048)**	**$ 10.679**	**$ (92.929)**	**$ 3.201**	**$ (1.243)**

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^θ		FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^μ		Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^	
Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
$ 39.224	$ 37.779	$ 40.198	$ 32.881	£ 1.027	£ 1.738	$ 2.674	$ 5.142	$ 787	$ 629
1	1	7	–	13	2	3	1	–	–
12	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
(18.167)	(25.905)	(28.926)	(47.722)	(8.874)	(6.233)	(14.154)	(41.235)	(585)	(3.160)
13.059	(63.132)	17.340	(96.912)	7.173	(6.171)	11.748	(4.223)	380	(792)
34.129	(51.257)	28.619	(111.753)	(661)	(10.664)	271	(40.315)	582	(3.323)
700	1.351	179	97	–	–	30	61	–	–
408	475	864	780	24	46	45	95	19	19
10	28	–	–	–	–	–	1	–	–
66	35	35	29	1	2	2	4	1	1
46	35	30	23	9	15	16	23	24	23
–	57	50	61	1	4	3	10	1	1
1	2	8	1	–	–	1	1	–	–
6	6	13	8	–	1	1	1	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
50	130	167	144	10	15	31	33	21	32
1.287	2.119	1.346	1.143	45	83	129	229	66	76
–	–	–	–	–	–	(9)	–	(66)	(76)
1.287	2.119	1.346	1.143	45	83	120	229	–	–
32.842	**(53.376)**	**27.273**	**(112.896)**	**(706)**	**(10.747)**	**151**	**(40.544)**	**582**	**(3.323)**
(962)	(945)	–	–	(1.026)	(757)	(2.350)	(2.031)	(949)	(686)
31.880	**(54.321)**	**27.273**	**(112.896)**	**(1.732)**	**(11.504)**	**(2.199)**	**(42.575)**	**(367)**	**(4.009)**
17	–	–	–	5	1	(4)	(53)	(3)	(2)
$ 31.897	**$ (54.321)**	**$ 27.273**	**$ (112.896)**	**£ (1.727)**	**£ (11.503)**	**$ (2.203)**	**$ (42.628)**	**$ (370)**	**$ (4.011)**

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	
Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
$ 12.627	$ 8.940	$ –	$ –	$ 75.076	$ 55.299	$ 2.327	$ 2.445	$ 50	$ 613
1	–	–	–	4	9	4	1	–	–
–	–	–	–	27	18	–	–	–	–
–	–	–	1.930	–	–	–	–	–	–
(31.650)	(30.719)	–	–	(109.856)	(176.578)	(3.447)	(1.815)	(420)	(1.880)
26.247	(13.662)	–	–	118.577	(69.518)	1.357	(433)	452	128
7.225	(35.441)	–	1.930	83.828	(190.770)	241	198	82	(1.139)
1.318	1.293	–	–	8.827	9.957	330	592	2	34
166	162	–	–	909	917	32	52	1	11
10	8	–	–	966	1.089	5	18	–	–
6	6	–	–	39	43	2	1	–	–
31	22	–	–	46	49	31	23	–	34
10	15	–	–	52	80	2	4	–	2
–	3	–	–	6	14	4	1	–	–
2	1	–	–	15	13	–	–	–	–
–	–	–	1.930	–	–	–	–	–	–
71	26	–	–	347	312	49	26	–	30
1.614	1.536	–	1.930	11.207	12.474	455	717	3	111
–	–	–	–	–	–	(72)	(33)	–	(65)
1.614	1.536	–	1.930	11.207	12.474	383	684	3	46
5.611	**(36.977)**	**–**	**–**	**72.621**	**(203.244)**	**(142)**	**(486)**	**79**	**(1.185)**
(186)	(121)	–	–	(31.359)	(24.709)	–	–	(576)	(588)
5.425	**(37.098)**	**–**	**–**	**41.262**	**(227.953)**	**(142)**	**(486)**	**(497)**	**(1.773)**
(132)	(162)	–	–	(871)	(847)	(6)	17	–	(2)
$ 5.293	**$ (37.260)**	**$ –**	**$ –**	**$ 40.391**	**$ (228.800)**	**$ (148)**	**$ (469)**	**$ (497)**	**$ (1.775)**

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de ingresos globales *(continuación)*

(en miles)	Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund^ Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund^ Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^λ Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^λ Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
INGRESOS POR INVERSIONES:								
Ingresos brutos de dividendos e intereses de bonos (Nota 2)	$ –	$ –	$ 5.130	$ 4.421	$ 1.062	$ 226	$ 536	$ –
Interés (Nota 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Compensación (Nota 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Otros ingresos	–	–	–	–	–	–	–	–
Ganancia/(pérdida) neta sobre activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados (Nota 2):								
Ganancia/(pérdida) neta realizada sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	–	–	(11.759)	(19.601)	(499)	(254)	877	–
Ganancia/(pérdida) neta latente sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	–	–	8.515	(1.726)	550	(139)	426	–
Total Ingresos/(Pérdidas) por inversiones	–	–	1.886	(16.906)	1.113	(167)	1.839	–
GASTOS:								
Comisiones de gestión (Nota 4)	–	–	2	3	55	17	21	–
Comisiones de Administrador y Depositario (Nota 4)	–	–	59	59	17	6	10	–
Comisiones de servicios a los accionistas (Nota 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Honorarios judiciales	–	–	2	2	1	–	–	–
Comisiones de auditoría (Nota 4)	–	–	31	23	21	16	19	–
Gastos de impresión	–	–	3	8	1	–	–	–
Gastos por intereses	–	–	–	–	–	–	–	–
Honorarios de los Consejeros y gastos (Nota 4)	–	–	1	1	–	–	–	–
Ajuste de los gastos devengados y otros pasivos	–	–	–	–	–	–	–	–
Otros gastos	–	–	36	38	45	15	7	–
Total de gastos	–	–	134	134	140	54	57	–
Exenciones de gastos y reembolsos/deducciones (Nota 4)	–	–	(27)	(24)	(70)	(32)	(20)	–
Gastos netos totales	–	–	107	110	70	22	37	–
Ganancia/(pérdida) neta antes de costes financieros	**–**	**–**	**1.779**	**(17.016)**	**1.043**	**(189)**	**1.802**	**–**
COSTES FINANCIEROS:								
Distribuciones a los tenedores de acciones participativas rescatables (Nota 5)	–	–	–	–	(14)	(2)	–	–
Ganancia/(pérdida) del ejercicio financiero	**–**	**–**	**1.779**	**(17.016)**	**1.029**	**(191)**	**1.802**	**–**
Retención fiscal en origen/(impuestos) sobre ingresos por dividendos e intereses	–	–	(152)	(186)	(13)	(9)	–	–
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	**$ –**	**$ –**	**$ 1.627**	**$ (17.202)**	**$ 1.016**	**$ (200)**	**$ 1.802**	**$ –**

(en miles)	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
INGRESOS POR INVERSIONES:								
Ingresos brutos de dividendos e intereses de bonos (Nota 2)	$ 11.107	$ 10.386	$ 2.178	$ 4.300	$ 1.207	$ 1.556	$ 21.822	$ 19.216
Interés (Nota 2)	1	–	–	–	–	–	–	–
Compensación (Nota 2)	–	–	(7)	(12)	(1)	–	(97)	(2)
Otros ingresos	–	–	–	–	–	–	–	–
Ganancia/(pérdida) neta sobre activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados (Nota 2):								
Ganancia/(pérdida) neta realizada sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	60.195	119.361	18.539	38.275	4.239	(49)	(28.473)	(40.931)
Ganancia/(pérdida) neta latente sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	558.734	(379.934)	27.833	(119.909)	641	(4.889)	242.843	(118.836)
Total Ingresos/(Pérdidas) por inversiones	630.037	(250.187)	48.543	(77.346)	6.086	(3.382)	236.095	(140.553)
GASTOS:								
Comisiones de gestión (Nota 4)	12.450	10.827	2.430	3.723	409	464	8.141	8.276
Comisiones de Administrador y Depositario (Nota 4)	1.212	998	179	280	35	37	1.194	1.111
Comisiones de servicios a los accionistas (Nota 4)	1.614	1.464	436	502	65	76	1.906	1.780
Honorarios judiciales	43	42	7	9	2	1	51	43
Comisiones de auditoría (Nota 4)	46	35	46	35	31	23	31	30
Gastos de impresión	–	100	14	–	2	3	77	81
Gastos por intereses	1	1	3	–	–	–	38	10
Honorarios de los Consejeros y gastos (Nota 4)	16	10	2	3	–	–	20	13
Ajuste de los gastos devengados y otros pasivos	–	–	–	–	–	–	–	–
Otros gastos	217	315	59	58	61	35	381	250
Total de gastos	15.599	13.792	3.176	4.610	605	639	11.839	11.594
Exenciones de gastos y reembolsos/deducciones (Nota 4)	–	–	(2)	–	(79)	(40)	(96)	(89)
Gastos netos totales	15.599	13.792	3.174	4.610	526	599	11.743	11.505
Ganancia/(pérdida) neta antes de costes financieros	**614.438**	**(263.979)**	**45.369**	**(81.956)**	**5.560**	**(3.981)**	**224.352**	**(152.058)**
COSTES FINANCIEROS:								
Distribuciones a los tenedores de acciones participativas rescatables (Nota 5)	–	–	(57)	–	(148)	(226)	(130)	(86)
Ganancia/(pérdida) del ejercicio financiero	**614.438**	**(263.979)**	**45.312**	**(81.956)**	**5.412**	**(4.207)**	**224.222**	**(152.144)**
Retención fiscal en origen/(impuestos) sobre ingresos por dividendos e intereses	(2.863)	(2.801)	(431)	(851)	(298)	(370)	(5.738)	(5.143)
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	**$ 611.575**	**$ (266.780)**	**$ 44.881**	**$ (82.807)**	**$ 5.114**	**$ (4.577)**	**$ 218.484**	**$ (157.287)**

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^α		FTGF ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Growth Fund^		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^		FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	
Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
$ 7	$ 52	$ 20.597	$ 18.832	$ –	$ –	$ –	$ –	$ 3.336	$ 3.244
–	–	1	–	–	–	–	–	–	–
–	–	(16)	(37)	–	–	–	–	(2)	(1)
–	–	–	–	–	–	4	–	–	–
(109)	79	30.591	27.825	–	–	–	–	21.869	10.875
(63)	(213)	100.238	(53.148)	–	–	–	–	29.885	(27.103)
(165)	(82)	151.411	(6.528)	–	–	4	–	55.088	(12.985)
1	12	7.868	7.465	–	–	–	–	2.202	2.177
–	7	763	655	–	–	–	–	164	146
–	1	677	689	–	–	–	–	349	359
–	–	29	23	–	–	–	–	6	5
–	34	23	17	–	–	–	–	31	23
–	–	39	46	–	–	–	–	9	13
–	–	6	–	–	–	–	–	–	–
–	–	11	6	–	–	–	–	2	1
–	–	–	–	–	–	4	–	–	–
–	20	205	169	–	–	–	–	86	104
1	74	9.621	9.070	–	–	4	–	2.849	2.828
–	(58)	–	–	–	–	–	–	(7)	(15)
1	16	9.621	9.070	–	–	4	–	2.842	2.813
(166)	**(98)**	**141.790**	**(15.598)**	**–**	**–**	**–**	**–**	**52.246**	**(15.798)**
–	–	(153)	(136)	–	–	–	–	(14)	(6)
(166)	**(98)**	**141.637**	**(15.734)**	**–**	**–**	**–**	**–**	**52.232**	**(15.804)**
(2)	(14)	(5.445)	(5.023)	–	–	–	–	(940)	(921)
$ (168)	**$ (112)**	**$ 136.192**	**$ (20.757)**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ 51.292**	**$ (16.725)**

FTGF ClearBridge Global Growth Fund^		FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^η	
Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
$ 174	$ 181	€ 30.153	€ 24.238	$ –	$ 73	$ 21.485	$ 16.804	$ 46	$ –
–	–	139	15	–	–	–	–	1	–
–	–	(138)	(147)	–	–	(22)	(18)	–	–
–	–	–	–	2	–	–	–	–	–
362	(164)	(10.859)	97.667	–	(446)	(29.689)	(20.310)	(64)	–
3.143	(1.038)	24.626	(99.004)	–	12	14.685	(33.358)	676	–
3.679	(1.021)	43.921	22.769	2	(361)	6.459	(36.882)	659	–
100	89	9.203	10.180	–	19	4.266	4.260	7	–
17	15	744	739	–	3	293	255	4	–
3	2	1.104	1.277	–	3	774	885	–	–
–	–	32	25	–	–	17	7	–	–
15	11	27	24	–	10	18	16	12	–
1	1	45	45	–	–	24	11	–	–
–	–	–	164	–	–	–	1	1	–
–	–	13	7	–	–	5	2	–	–
–	–	–	–	2	–	–	–	–	–
31	19	231	140	–	30	121	79	17	–
167	137	11.399	12.601	2	65	5.518	5.516	41	–
(43)	(26)	–	–	–	(40)	(2)	–	(30)	–
124	111	11.399	12.601	2	25	5.516	5.516	11	–
3.555	**(1.132)**	**32.522**	**10.168**	**–**	**(386)**	**943**	**(42.398)**	**648**	**–**
–	–	(6.882)	(6.157)	–	(16)	(15.910)	(14.505)	–	–
3.555	**(1.132)**	**25.640**	**4.011**	**–**	**(402)**	**(14.967)**	**(56.903)**	**648**	**–**
(28)	(30)	(4.291)	(4.301)	–	–	(2.583)	(2.061)	(7)	–
$ 3.527	**$ (1.162)**	**€ 21.349**	**€ (290)**	**$ –**	**$ (402)**	**$ (17.550)**	**$ (58.964)**	**$ 641**	**$ –**

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de ingresos globales *(continuación)*

(en miles)	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		FTGF Royce US Smaller Companies Fund		FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^		Legg Mason US Equity Fund^	
	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
INGRESOS POR INVERSIONES:								
Ingresos brutos de dividendos e intereses de bonos (Nota 2)	$ 8.146	$ 9.694	$ 1.254	$ 1.009	$ 75	$ 71	$ –	$ –
Interés (Nota 2)	1	–	–	–	–	–	–	–
Compensación (Nota 2)	–	–	(2)	–	–	–	–	–
Otros ingresos	–	–	–	–	–	–	–	–
Ganancia/(pérdida) neta sobre activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados (Nota 2):								
Ganancia/(pérdida) neta realizada sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	10.605	(26.757)	2.336	3.014	(263)	(330)	–	–
Ganancia/(pérdida) neta latente sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	33.108	(23.159)	6.549	(2.696)	377	14	–	–
Total Ingresos/(Pérdidas) por inversiones	51.860	(40.222)	10.137	1.327	189	(245)	–	–
GASTOS:								
Comisiones de gestión (Nota 4)	7.093	7.773	1.120	1.052	31	31	–	–
Comisiones de Administrador y Depositario (Nota 4)	529	538	74	64	9	8	–	–
Comisiones de servicios a los accionistas (Nota 4)	1.257	1.310	175	174	–	–	–	–
Honorarios judiciales	21	20	3	3	–	2	–	–
Comisiones de auditoría (Nota 4)	46	35	31	23	16	10	–	–
Gastos de impresión	–	56	4	6	–	–	–	–
Gastos por intereses	1	–	–	–	–	–	–	–
Honorarios de los Consejeros y gastos (Nota 4)	8	5	1	–	–	–	–	–
Ajuste de los gastos devengados y otros pasivos	–	–	–	–	–	–	–	–
Otros gastos	187	178	49	43	53	14	–	–
Total de gastos	9.142	9.915	1.457	1.365	109	65	–	–
Exenciones de gastos y reembolsos/deducciones (Nota 4)	–	–	(16)	(11)	(72)	(28)	–	–
Gastos netos totales	9.142	9.915	1.441	1.354	37	37	–	–
Ganancia/(pérdida) neta antes de costes financieros	**42.718**	**(50.137)**	**8.696**	**(27)**	**152**	**(282)**	**–**	**–**
COSTES FINANCIEROS:								
Distribuciones a los tenedores de acciones participativas rescatables (Nota 5)	–	–	(8)	–	–	–	–	–
Ganancia/(pérdida) del ejercicio financiero	**42.718**	**(50.137)**	**8.688**	**(27)**	**152**	**(282)**	**–**	**–**
Retención fiscal en origen/(impuestos) sobre ingresos por dividendos e intereses	(1.729)	(1.694)	(303)	(238)	(12)	(12)	–	–
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	**$ 40.989**	**$ (51.831)**	**$ 8.385**	**$ (265)**	**$ 140**	**$ (294)**	**$ –**	**$ –**

(en miles)	Legg Mason Japan Equity Fund^		FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^β		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund^		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^	
	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
INGRESOS POR INVERSIONES:								
Ingresos brutos de dividendos e intereses de bonos (Nota 2)	¥ –	¥ –	$ 4	$ 347	$ –	$ –	€ –	€ –
Interés (Nota 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Compensación (Nota 2)	–	–	–	(1)	–	–	–	–
Otros ingresos	–	–	–	–	–	–	22	–
Ganancia/(pérdida) neta sobre activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados (Nota 2):								
Ganancia/(pérdida) neta realizada sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	–	–	(414)	(1.890)	–	–	–	–
Ganancia/(pérdida) neta latente sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	–	–	565	717	–	–	–	–
Total Ingresos/(Pérdidas) por inversiones	–	–	155	(827)	–	–	22	–
GASTOS:								
Comisiones de gestión (Nota 4)	–	–	4	96	–	–	–	–
Comisiones de Administrador y Depositario (Nota 4)	–	–	1	17	–	–	–	–
Comisiones de servicios a los accionistas (Nota 4)	–	–	1	8	–	–	–	–
Honorarios judiciales	–	–	–	1	–	–	–	–
Comisiones de auditoría (Nota 4)	–	–	6	11	–	–	–	–
Gastos de impresión	–	–	–	4	–	–	–	–
Gastos por intereses	–	–	–	–	–	–	–	–
Honorarios de los Consejeros y gastos (Nota 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ajuste de los gastos devengados y otros pasivos	–	–	–	–	–	–	22	–
Otros gastos	–	–	11	21	–	–	–	–
Total de gastos	–	–	23	158	–	–	22	–
Exenciones de gastos y reembolsos/deducciones (Nota 4)	–	–	(17)	(43)	–	–	–	–
Gastos netos totales	–	–	6	115	–	–	22	–
Ganancia/(pérdida) neta antes de costes financieros	**–**	**–**	**149**	**(942)**	**–**	**–**	**–**	**–**
COSTES FINANCIEROS:								
Distribuciones a los tenedores de acciones participativas rescatables (Nota 5)	–	–	(23)	(12)	–	–	–	–
Ganancia/(pérdida) del ejercicio financiero	**–**	**–**	**126**	**(954)**	**–**	**–**	**–**	**–**
Retención fiscal en origen/(impuestos) sobre ingresos por dividendos e intereses	–	–	1	(26)	–	–	–	–
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	**¥ –**	**¥ –**	**$ 127**	**$ (980)**	**$ –**	**$ –**	**€ –**	**€ –**

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

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^	
Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
€ –	€ 793	$ 750	$ 1.344	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –	$ 95
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	(11)	–	–	–	–	–	–
205	–	–	–	2	–	–	–	12	–
1	(726)	(2.395)	(825)	–	–	(30)	–	–	1.626
(1)	(522)	2.918	(2.521)	–	–	30	–	–	(1.497)
205	(455)	1.273	(2.013)	2	–	–	–	12	224
–	125	115	321	–	–	–	–	–	24
–	8	6	22	–	–	–	–	–	2
–	12	17	50	–	–	–	–	–	2
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	12	10	17	–	–	–	–	–	13
–	–	–	3	–	–	–	–	–	–
–	2	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
205	–	–	–	2	–	–	–	12	–
–	–	34	36	–	–	–	–	–	19
205	159	182	449	2	–	–	–	12	60
–	(9)	(41)	(31)	–	–	–	–	–	(33)
205	150	141	418	2	–	–	–	12	27
–	**(605)**	**1.132**	**(2.431)**	**–**	**–**	**–**	**–**	**–**	**197**
–	(120)	(324)	(523)	–	–	–	–	–	(12)
–	**(725)**	**808**	**(2.954)**	**–**	**–**	**–**	**–**	**–**	**185**
–	(206)	4	(137)	–	–	–	–	–	(19)
€ –	**€ (931)**	**$ 812**	**$ (3.091)**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ 166**

Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund^		Legg Mason Martin Currie Greater China 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^	
Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
$ –	$ –	$ –	$ –	$ 1.447	$ 1.449	$ 1.328	$ 1.445	$ 703	$ 749
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	(16.931)	(28.509)	(175)	372	(1.652)	(2.480)
–	–	–	–	40.823	(7.103)	(290)	(3.071)	2.019	(6.311)
–	–	–	–	25.339	(34.163)	863	(1.254)	1.070	(8.042)
–	–	–	–	930	994	195	237	337	368
–	–	–	–	114	109	23	24	33	34
–	–	–	–	110	110	60	72	16	18
–	–	–	–	5	4	1	1	1	1
–	–	–	–	23	17	23	17	15	11
–	–	–	–	6	9	1	2	2	4
–	–	–	–	1	1	–	–	1	–
–	–	–	–	2	1	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	63	40	49	34	57	46
–	–	–	–	1.254	1.285	352	387	462	482
–	–	–	–	(27)	–	(65)	(40)	(59)	(41)
–	–	–	–	1.227	1.285	287	347	403	441
–	**–**	**–**	**–**	**24.112**	**(35.448)**	**576**	**(1.601)**	**667**	**(8.483)**
–	–	–	–	–	–	(402)	(452)	–	–
–	**–**	**–**	**–**	**24.112**	**(35.448)**	**174**	**(2.053)**	**667**	**(8.483)**
–	–	–	–	(99)	(113)	(230)	(114)	(81)	(80)
$ –	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ 24.013**	**$ (35.561)**	**$ (56)**	**$ (2.167)**	**$ 586**	**$ (8.563)**

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de ingresos globales *(continuación)*

(en miles)	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^		FTGF Martin Currie Improving Society Fund^γ		Franklin Responsible Income 2028 Fund^		Franklin Templeton Global Funds Plc	
	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
INGRESOS POR INVERSIONES:								
Ingresos brutos de dividendos e intereses de bonos (Nota 2)	€ 2.344	€ 3.040	$ 32	$ –	€ 3.591	€ 122	$ 645.956	$ 587.213
Interés (Nota 2)	7	–	–	–	6	–	369	245
Compensación (Nota 2)	–	–	–	–	–	–	(2.057)	129
Otros ingresos	–	–	–	–	–	–	284	1.930
Ganancia/(pérdida) neta sobre activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados (Nota 2):								
Ganancia/(pérdida) neta realizada sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	(6.961)	(22.697)	(2)	–	(287)	(16)	(659.861)	(1.491.020)
Ganancia/(pérdida) neta latente sobre instrumentos financieros mantenidos a efectos de negociación	37.661	(7.891)	(3)	–	2.192	(738)	1.894.830	(1.248.346)
Total Ingresos/(Pérdidas) por inversiones	33.051	(27.548)	27	–	5.502	(632)	1.879.521	(2.149.849)
GASTOS:								
Comisiones de gestión (Nota 4)	682	857	4	–	358	7	112.861	129.714
Comisiones de Administrador y Depositario (Nota 4)	158	178	7	–	65	3	12.488	13.176
Comisiones de servicios a los accionistas (Nota 4)	8	15	2	–	–	–	12.174	13.404
Honorarios judiciales	6	7	–	–	2	–	572	541
Comisiones de auditoría (Nota 4)	21	24	13	–	19	16	1.404	1.266
Gastos de impresión	8	15	–	–	3	–	430	1.234
Gastos por intereses	–	7	–	–	–	–	147	410
Honorarios de los Consejeros y gastos (Nota 4)	2	2	–	–	–	–	198	143
Ajuste de los gastos devengados y otros pasivos	–	–	–	–	–	–	284	1.930
Otros gastos	39	43	61	–	35	6	4.207	4.664
Total de gastos	924	1.148	87	–	482	32	144.765	166.482
Exenciones de gastos y reembolsos/deducciones (Nota 4)	(2)	(11)	(76)	–	(10)	(20)	(1.154)	(1.695)
Gastos netos totales	922	1.137	11	–	472	12	143.611	164.787
Ganancia/(pérdida) neta antes de costes financieros	**32.129**	**(28.685)**	**16**	**–**	**5.030**	**(644)**	**1.735.910**	**(2.314.636)**
COSTES FINANCIEROS:								
Distribuciones a los tenedores de acciones participativas rescatables (Nota 5)	–	–	–	–	–	–	(158.128)	(112.586)
Ganancia/(pérdida) del ejercicio financiero	**32.129**	**(28.685)**	**16**	**–**	**5.030**	**(644)**	**1.577.782**	**(2.427.222)**
Retención fiscal en origen/(impuestos) sobre ingresos por dividendos e intereses	(168)	(266)	(4)	–	(20)	–	(32.704)	(33.107)
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	**€ 31.961**	**€ (28.951)**	**$ 12**	**$ –**	**€ 5.010**	**€ (644)**	**$ 1.545.078**	**$ (2.460.329)**

Los importes que se indican con "–" equivalen a cero USD/EUR/JPY/GBP o son inferiores a 1.000 USD/EUR/JPY/GBP.

Las pérdidas y ganancias proceden únicamente de operaciones continuadas, excepto en el caso del FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^, el FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^, el FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^, el FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^, el FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^, el FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^ y el FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained 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 para 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 para el ejercicio cerrado el 29 de febrero de 2024 utilizando el tipo medio USD/EUR de 0,9232 (28 de febrero de 2023: 0,9590).

Las cifras en libras esterlinas de FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund han sido convertidas a dólares estadounidenses en la cifra total de Franklin Templeton Global Funds Plc para el ejercicio cerrado el 29 de febrero de 2024 utilizando el tipo medio USD/GBP de 0,7988 (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 operar.*

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

γ *A partir del 20 de junio de 2023, FTGF Martin Currie Improving Society Fund^ comenzó a operar.*

δ *El 17 de julio de 2023, FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^ dejó de cotizar en bolsa.*

η *A partir del 22 de septiembre de 2023, FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^ comenzó a operar.*

θ *A partir del 23 de octubre de 2023, FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^ dejó de operar.*

λ *A partir del 6 de noviembre de 2023, FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^ comenzó a operar.*

μ *A partir del 10 de noviembre de 2023, FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^ dejó de operar.*

¥ *A partir del 5 de diciembre de 2023, FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^ dejó de operar.*

^ *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]

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	
	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	**$ 9.298**	**$ 3.020**	**$ 2.970**	**$ (28.336)**	**$ 30.201**	**$ (193.460)**	**€ 6.149**	**€ (22.729)**
OPERACIONES CON PARTICIPACIONES REEMBOLSABLES								
Ingresos netos de la venta de acciones	2.012.301	1.682.979	105.441	38.164	258.516	631.688	1.802	8.626
Ingresos netos de distribuciones reinvertidas	34.623	9.839	1.254	941	1.082	943	8	4
Coste de las acciones readquiridas	(1.775.419)	(1.781.547)	(56.124)	(111.756)	(623.244)	(778.561)	(90.597)	(2.820)
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto de operaciones con Acciones reembolsables	**271.505**	**(88.729)**	**50.571**	**(72.651)**	**(363.646)**	**(145.930)**	**(88.787)**	**5.810**
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables	280.803	(85.709)	53.541	(100.987)	(333.445)	(339.390)	(82.638)	(16.919)
PATRIMONIO NETO ATRIBUIBLE A LOS TENEDORES DE ACCIONES PARTICIPATIVAS RESCATABLES								
Inicio de ejercicio	833.615	919.324	131.919	232.906	1.148.700	1.488.090	132.467	149.386
Conversión de divisas	–	–	–	–	–	–	–	–
Cierre de ejercicio	**$ 1.114.418**	**$ 833.615**	**$ 185.460**	**$ 131.919**	**$ 815.255**	**$1.148.700**	**€ 49.829**	**€ 132.467**

(en miles)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund^		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund^		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^	
	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	**$ 678**	**$ (10.381)**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ (3.361)**
OPERACIONES CON PARTICIPACIONES REEMBOLSABLES								
Ingresos netos de la venta de acciones	4.202	7.829	–	–	–	–	–	6.133
Ingresos netos de distribuciones reinvertidas	272	235	–	–	–	–	–	45
Coste de las acciones readquiridas	(14.064)	(22.230)	–	–	–	–	–	(62.342)
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto de operaciones con Acciones reembolsables	**(9.590)**	**(14.166)**	**–**	**–**	**–**	**–**	**–**	**(56.164)**
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables	(8.912)	(24.547)	–	–	–	–	–	(59.525)
PATRIMONIO NETO ATRIBUIBLE A LOS TENEDORES DE ACCIONES PARTICIPATIVAS RESCATABLES								
Inicio de ejercicio	57.431	81.978	–	–	–	–	–	59.525
Conversión de divisas	–	–	–	–	–	–	–	–
Cierre de ejercicio	**$ 48.519**	**$ 57.431**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**

(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^	
	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	**$ 99.461**	**$ (535.635)**	**$ –**	**$ –**	**$ 31.079**	**$ (58.914)**	**$ –**	**$ –**
OPERACIONES CON PARTICIPACIONES REEMBOLSABLES								
Ingresos netos de la venta de acciones	367.209	594.445	–	–	104.145	97.245	–	–
Ingresos netos de distribuciones reinvertidas	752	572	–	–	–	–	–	–
Coste de las acciones readquiridas	(1.394.954)	(2.110.715)	–	–	(37.555)	(135.218)	–	–
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto de operaciones con Acciones reembolsables	**(1.026.993)**	**(1.515.698)**	**–**	**–**	**66.590**	**(37.973)**	**–**	**–**
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables	(927.532)	(2.051.333)	–	–	97.669	(96.887)	–	–
PATRIMONIO NETO ATRIBUIBLE A LOS TENEDORES DE ACCIONES PARTICIPATIVAS RESCATABLES								
Inicio de ejercicio	2.132.501	4.183.834	–	–	275.012	371.899	–	–
Conversión de divisas	–	–	–	–	–	–	–	–
Cierre de ejercicio	**$ 1.204.969**	**$ 2.132.501**	**$ –**	**$ –**	**$ 372.681**	**$ 275.012**	**$ –**	**$ –**

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^	
Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
$ –	**$ (2.933)**	**$ 8.470**	**$ (42.348)**	**$ 4.261**	**$ (27.899)**	**$ –**	**$ (4.856)**	**$ –**	**$ (2.114)**
–	5.974	35.895	116.601	14.197	80.773	–	9.398	–	1
–	336	542	524	2.702	2.460	–	790	–	319
–	(56.369)	(31.322)	(150.391)	(49.522)	(189.194)	–	(46.450)	–	(26.054)
–	**(50.059)**	**5.115**	**(33.266)**	**(32.623)**	**(105.961)**	**–**	**(36.262)**	**–**	**(25.734)**
–	(52.992)	13.585	(75.614)	(28.362)	(133.860)	–	(41.118)	–	(27.848)
–	52.992	227.355	302.969	125.240	259.100	–	41.118	–	27.848
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
$ –	**$ –**	**$ 240.940**	**$ 227.355**	**$ 96.878**	**$ 125.240**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^		FTGF Western Asset Global Credit Fund^		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^	
Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
$ 2.503	**$ (49.424)**	**$ 28.835**	**$ (55.257)**	**$ 7.568**	**$ (27.685)**	**$ 1.513**	**$ (8.379)**	**€ –**	**€ (2.426)**
61.423	59.409	270.177	309.635	39.375	20.632	562	669	–	4
115	101	43	18	–	–	–	–	–	–
(251.120)	(82.173)	(344.487)	(174.675)	(64.226)	(49.192)	(17.128)	(23.593)	–	(35.026)
(189.582)	**(22.663)**	**(74.267)**	**134.978**	**(24.851)**	**(28.560)**	**(16.566)**	**(22.924)**	**–**	**(35.022)**
(187.079)	(72.087)	(45.432)	79.721	(17.283)	(56.245)	(15.053)	(31.303)	–	(37.448)
437.707	509.794	523.970	444.249	146.703	202.948	46.050	77.353	–	37.448
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
$ 250.628	**$ 437.707**	**$ 478.538**	**$ 523.970**	**$ 129.420**	**$ 146.703**	**$ 30.997**	**$ 46.050**	**€ –**	**€ –**

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^		FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^		FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^θ		FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^μ		Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^	
Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
$ 31.897	**$ (54.321)**	**$ 27.273**	**$ (112.896)**	**£ (1.727)**	**£ (11.503)**	**$ (2.203)**	**$ (42.628)**	**$ (370)**	**$ (4.011)**
4.387	10.281	2.928	87.515	–	69.541	41	134.961	183	330
–	–	–	–	–	396	–	–	685	655
(69.676)	(454.353)	–	(2.392)	(44.185)	(86.155)	(92.613)	(172.727)	(543)	(491)
(65.289)	**(444.072)**	**2.928**	**85.123**	**(44.185)**	**(16.218)**	**(92.572)**	**(37.766)**	**325**	**494**
(33.392)	(498.393)	30.201	(27.773)	(45.912)	(27.721)	(94.775)	(80.394)	(45)	(3.517)
559.548	1.057.941	1.119.507	1.147.280	45.912	73.633	94.775	175.169	18.441	21.958
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
$ 526.156	**$ 559.548**	**$1.149.708**	**$1.119.507**	**£ –**	**£ 45.912**	**$ –**	**$ 94.775**	**$ 18.396**	**$ 18.441**

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(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^	
	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	**$ 376**	**$ (825)**	**$ 1.335**	**$ (36.048)**	**$ 10.679**	**$ (92.929)**	**$ 3.201**	**$ (1.243)**
OPERACIONES CON PARTICIPACIONES REEMBOLSABLES								
Ingresos netos de la venta de acciones	–	–	21.189	60.682	50.459	236.790	24.952	67
Ingresos netos de distribuciones reinvertidas	–	–	617	270	9	5	3	1
Coste de las acciones readquiridas	(9.371)	(46)	(40.065)	(78.530)	(454.149)	(357.313)	(7.386)	(21)
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto de operaciones con Acciones reembolsables	**(9.371)**	**(46)**	**(18.259)**	**(17.578)**	**(403.681)**	**(120.518)**	**17.569**	**47**
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables	(8.995)	(871)	(16.924)	(53.626)	(393.002)	(213.447)	20.770	(1.196)
PATRIMONIO NETO ATRIBUIBLE A LOS TENEDORES DE ACCIONES PARTICIPATIVAS RESCATABLES								
Inicio de ejercicio	8.995	9.866	162.009	215.635	539.271	752.718	10.394	11.590
Conversión de divisas	–	–	–	–	–	–	–	–
Cierre de ejercicio	**$ –**	**$ 8.995**	**$ 145.085**	**$ 162.009**	**$ 146.269**	**$ 539.271**	**$ 31.164**	**$ 10.394**

(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 – US Fixed Income Fund^λ	
	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	**$ –**	**$ –**	**$ 1.627**	**$ (17.202)**	**$ 1.016**	**$ (200)**	**$ 1.802**	**$ –**
OPERACIONES CON PARTICIPACIONES REEMBOLSABLES								
Ingresos netos de la venta de acciones	–	–	–	112	5	15.028	32.000	–
Ingresos netos de distribuciones reinvertidas	–	–	–	–	4	1	–	–
Coste de las acciones readquiridas	–	–	–	(17.731)	–	(25)	(2.103)	–
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto de operaciones con Acciones reembolsables	**–**	**–**	**–**	**(17.619)**	**9**	**15.004**	**29.897**	**–**
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables	–	–	1.627	(34.821)	1.025	14.804	31.699	–
PATRIMONIO NETO ATRIBUIBLE A LOS TENEDORES DE ACCIONES PARTICIPATIVAS RESCATABLES								
Inicio de ejercicio	–	–	69.410	104.231	14.804	–	–	–
Conversión de divisas	–	–	–	–	–	–	–	–
Cierre de ejercicio	**$ –**	**$ –**	**$ 71.037**	**$ 69.410**	**$ 15.829**	**$ 14.804**	**$ 31.699**	**$ –**

(en miles)	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	
	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	**$ 611.575**	**$ (266.780)**	**$ 44.881**	**$ (82.807)**	**$ 5.114**	**$ (4.577)**	**$ 218.484**	**$ (157.287)**
OPERACIONES CON PARTICIPACIONES REEMBOLSABLES								
Ingresos netos de la venta de acciones	682.765	375.752	14.386	21.160	945	5.178	524.057	954.316
Ingresos netos de distribuciones reinvertidas	–	–	–	–	7	4	–	–
Coste de las acciones readquiridas	(647.475)	(655.932)	(76.670)	(251.719)	(8.658)	(5.356)	(1.017.010)	(756.365)
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto de operaciones con Acciones reembolsables	**35.290**	**(280.180)**	**(62.284)**	**(230.559)**	**(7.706)**	**(174)**	**(492.953)**	**197.951**
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables	646.865	(546.960)	(17.403)	(313.366)	(2.592)	(4.751)	(274.469)	40.664
PATRIMONIO NETO ATRIBUIBLE A LOS TENEDORES DE ACCIONES PARTICIPATIVAS RESCATABLES								
Inicio de ejercicio	1.225.735	1.772.695	224.793	538.159	38.528	43.279	1.639.979	1.599.315
Conversión de divisas	–	–	–	–	–	–	–	–
Cierre de ejercicio	**$1.872.600**	**$1.225.735**	**$ 207.390**	**$ 224.793**	**$ 35.936**	**$ 38.528**	**$ 1.365.510**	**$1.639.979**

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

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	
Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
$ 5.293	**$ (37.260)**	**$ –**	**$ –**	**$ 40.391**	**$ (228.800)**	**$ (148)**	**$ (469)**	**$ (497)**	**$ (1.775)**
39.013	8.297	–	–	265.947	382.317	3.404	1.851	–	–
16	9	–	–	500	353	–	–	–	1
(42.092)	(10.296)	–	–	(365.763)	(551.638)	(33.609)	(7.012)	(7.892)	–
(3.063)	**(1.990)**	**–**	**–**	**(99.316)**	**(168.968)**	**(30.205)**	**(5.161)**	**(7.892)**	**1**
2.230	(39.250)	–	–	(58.925)	(397.768)	(30.353)	(5.630)	(8.389)	(1.774)
205.146	244.396	–	–	1.210.305	1.608.073	46.756	52.386	8.389	10.163
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
$ 207.376	**$ 205.146**	**$ –**	**$ –**	**$1.151.380**	**$1.210.305**	**$ 16.403**	**$ 46.756**	**$ –**	**$ 8.389**

FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^α		FTGF ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Growth Fund^		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^		FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	
Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
$ (168)	**$ (112)**	**$ 136.192**	**$ (20.757)**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ 51.292**	**$ (16.725)**
–	480	472.996	283.185	–	–	–	–	31.681	27.366
–	–	1	4	–	–	–	–	3	–
(2.366)	(11)	(381.289)	(224.944)	–	–	–	–	(61.130)	(34.511)
(2.366)	**469**	**91.708**	**58.245**	**–**	**–**	**–**	**–**	**(29.446)**	**(7.145)**
(2.534)	357	227.900	37.488	–	–	–	–	21.846	(23.870)
2.534	2.177	929.726	892.238	–	–	–	–	189.610	213.480
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
$ –	**$ 2.534**	**$1.157.626**	**$ 929.726**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ 211.456**	**$ 189.610**

FTGF ClearBridge Global Growth Fund^		FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^η	
Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
$ 3.527	**$ (1.162)**	**€ 21.349**	**€ (290)**	**$ –**	**$ (402)**	**$ (17.550)**	**$ (58.964)**	**$ 641**	**$ –**
1.002	211	391.958	933.315	–	19	64.682	446.097	5.000	–
–	–	25	24	–	3	2.357	1.541	–	–
(990)	(1.888)	(653.242)	(541.640)	–	(2.285)	(123.728)	(156.020)	–	–
12	**(1.677)**	**(261.259)**	**391.699**	**–**	**(2.263)**	**(56.689)**	**291.618**	**5.000**	**–**
3.539	(2.839)	(239.910)	391.409	–	(2.665)	(74.239)	232.654	5.641	–
13.179	16.018	1.062.833	671.424	–	2.665	406.048	173.394	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
$ 16.718	**$ 13.179**	**€ 822.923**	**€1.062.833**	**$ –**	**$ –**	**$ 331.809**	**$ 406.048**	**$ 5.641**	**$ –**

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

(en miles)	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		FTGF Royce US Smaller Companies Fund		FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^		Legg Mason US Equity Fund^	
	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	**$ 40.989**	**$ (51.831)**	**$ 8.385**	**$ (265)**	**$ 140**	**$ (294)**	**$ –**	**$ –**
OPERACIONES CON PARTICIPACIONES REEMBOLSABLES								
Ingresos netos de la venta de acciones	276.127	238.901	30.088	7.259	11	14	–	–
Ingresos netos de distribuciones reinvertidas	–	–	–	–	–	–	–	–
Coste de las acciones readquiridas	(363.755)	(361.750)	(20.636)	(16.831)	(19)	–	–	–
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto de operaciones con Acciones reembolsables	**(87.628)**	**(122.849)**	**9.452**	**(9.572)**	**(8)**	**14**	**–**	**–**
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables	(46.639)	(174.680)	17.837	(9.837)	132	(280)	–	–
PATRIMONIO NETO ATRIBUIBLE A LOS TENEDORES DE ACCIONES PARTICIPATIVAS RESCATABLES								
Inicio de ejercicio	741.529	916.209	78.098	87.935	4.254	4.534	–	–
Conversión de divisas	–	–	–	–	–	–	–	–
Cierre de ejercicio	**$ 694.890**	**$ 741.529**	**$ 95.935**	**$ 78.098**	**$ 4.386**	**$ 4.254**	**$ –**	**$ –**

(en miles)	Legg Mason Japan Equity Fund^		FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^β		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund^		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^	
	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	**¥ –**	**¥ –**	**$ 127**	**$ (980)**	**$ –**	**$ –**	**€ –**	**€ –**
OPERACIONES CON PARTICIPACIONES REEMBOLSABLES								
Ingresos netos de la venta de acciones	–	–	12	2.028	–	–	–	–
Ingresos netos de distribuciones reinvertidas	–	–	3	2	–	–	–	–
Coste de las acciones readquiridas	–	–	(3.680)	(13.630)	–	–	–	–
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto de operaciones con Acciones reembolsables	**–**	**–**	**(3.665)**	**(11.600)**	**–**	**–**	**–**	**–**
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables	–	–	(3.538)	(12.580)	–	–	–	–
PATRIMONIO NETO ATRIBUIBLE A LOS TENEDORES DE ACCIONES PARTICIPATIVAS RESCATABLES								
Inicio de ejercicio	–	–	3.538	16.118	–	–	–	–
Conversión de divisas	–	–	–	–	–	–	–	–
Cierre de ejercicio	**¥ –**	**¥ –**	**$ –**	**$ 3.538**	**$ –**	**$ –**	**€ –**	**€ –**

(en miles)	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^		FTGF Martin Currie Improving Society Fund^γ		Franklin Responsible Income 2028 Fund^		Franklin Templeton Global Funds Plc	
	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
(Disminución)/aumento en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables procedentes de operaciones	**€ 31.961**	**€ (28.951)**	**$ 12**	**$ –**	**€ 5.010**	**€ (644)**	**$ 1.545.078**	**$ (2.460.329)**
OPERACIONES CON PARTICIPACIONES REEMBOLSABLES								
Ingresos netos de la venta de acciones	12.962	29.019	6.174	–	71.613	37.528	6.373.287	8.183.142
Ingresos netos de distribuciones reinvertidas	–	–	–	–	–	–	45.932	20.855
Coste de las acciones readquiridas	(45.142)	(114.561)	–	–	(25.742)	(61)	(9.527.821)	(10.861.926)
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto de operaciones con Acciones reembolsables	**(32.180)**	**(85.542)**	**6.174**	**–**	**45.871**	**37.467**	**(3.108.602)**	**(2.657.929)**
Aumento/(disminución) en el patrimonio neto atribuible a los tenedores de participaciones reembolsables	(219)	(114.493)	6.186	–	50.881	36.823	(1.563.524)	(5.118.258)
PATRIMONIO NETO ATRIBUIBLE A LOS TENEDORES DE ACCIONES PARTICIPATIVAS RESCATABLES								
Inicio de ejercicio	189.097	303.590	–	–	36.823	–	17.428.030	22.628.678
Conversión de divisas	–	–	–	–	–	–	35.801	(82.390)
Cierre de ejercicio	**€ 188.878**	**€ 189.097**	**$ 6.186**	**$ –**	**€ 87.704**	**€ 36.823**	**$ 15.900.307**	**$ 17.428.030**

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^		FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^δ		Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund^		Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^	
Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
€ –	**€ (931)**	**$ 812**	**$ (3.091)**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ 166**
–	305	53	2.902	–	–	–	–	–	–
–	–	98	88	–	–	–	–	–	–
–	(27.711)	(22.053)	(4.692)	–	–	–	–	–	(12.709)
–	**(27.406)**	**(21.902)**	**(1.702)**	**–**	**–**	**–**	**–**	**–**	**(12.709)**
–	(28.337)	(21.090)	(4.793)	–	–	–	–	–	(12.543)
–	28.337	21.090	25.883	–	–	–	–	–	12.543
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
€ –	**€ –**	**$ –**	**$ 21.090**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ –**

Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund^		Legg Mason Martin Currie Greater China 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^	
Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
$ –	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ 24.013**	**$ (35.561)**	**$ (56)**	**$ (2.167)**	**$ 586**	**$ (8.563)**
–	–	–	–	23.348	65.616	81	853	3.711	14.408
–	–	–	–	–	–	208	285	–	–
–	–	–	–	(64.389)	(58.387)	(4.210)	(1.784)	(7.352)	(18.981)
–	**–**	**–**	**–**	**(41.041)**	**7.229**	**(3.921)**	**(646)**	**(3.641)**	**(4.573)**
–	–	–	–	(17.028)	(28.332)	(3.977)	(2.813)	(3.055)	(13.136)
–	–	–	–	141.049	169.381	25.121	27.934	34.702	47.838
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
$ –	**$ –**	**$ –**	**$ –**	**$ 124.021**	**$ 141.049**	**$ 21.144**	**$ 25.121**	**$ 31.647**	**$ 34.702**

Los importes que se indican con "–" equivalen a cero USD/EUR/JPY/GBP o son inferiores a 1.000 USD/EUR/JPY/GBP.

Todas las cifras en euros, excepto los activos netos atribuibles a los titulares de acciones participantes rescatables, para el fondo de bonos Euro Core Plus de FTGF Western Asset, 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 para el ejercicio cerrado el 29 de febrero de 2024, utilizando el tipo medio USD/EUR de 0,9232 (28 de febrero de 2023: 0,9590).

Los activos netos atribuibles a los titulares de acciones participantes rescatables para el fondo 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 utilizando el tipo de cierre en USD/EUR al 28 de febrero de 2023 de 0,9454 (28 de febrero de 2022: 0,8919).

Todas las cifras en libras esterlinas, excepto los activos netos atribuibles a titulares de acciones participantes rescatables, correspondientes a FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund han sido convertidas a dólares estadounidenses en la cifra total de Franklin Templeton Global Funds Plc correspondiente al ejercicio cerrado el 29 de febrero de 2024, utilizando el tipo medio USD/GBP de 0,7988 (28 de febrero de 2023: 0,8252).

Los activos netos atribuibles a los titulares de acciones participantes rescatables para FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund han sido convertidos a dólares estadounidenses en la cifra total utilizando el tipo de cierre en USD/GBP al 28 de febrero de 2023 de 0,8314 (28 de febrero de 2022: 0,7454).

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 operar.*

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

γ *A partir del 20 de junio de 2023, FTGF Martin Currie Improving Society Fund^ comenzó a operar.*

δ *El 17 de julio de 2023, FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^ dejó de cotizar en bolsa.*

η *A partir del 22 de septiembre de 2023, FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^ comenzó a operar.*

θ *A partir del 23 de octubre de 2023, FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^ dejó de operar.*

λ *A partir del 6 de noviembre de 2023, FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^ comenzó a operar.*

μ *A partir del 10 de noviembre de 2023, FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^ dejó de operar.*

¥ *A partir del 5 de diciembre de 2023, FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^ dejó de operar.*

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

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	3.012	2.520
Redimido	(2.409)	(2.240)
Aumento neto	603	280
Clase A USD de Distribución (D)		
Vendidos	1.210.701	888.333
Redimido	(999.630)	(1.002.262)
Disminución/(aumento) neto	211.071	(113.929)
Clase B USD de Capitalización		
Redimido	(1)	–
Disminución neta	(1)	–
Clase B USD de Distribución (D)		
Vendidos	–	218
Redimido	(44)	–
Aumento/(disminución) neto	(44)	218
Clase C USD de Capitalización		
Vendidos	1	–
Redimido	–	(50)
Disminución/(aumento) neto	1	(50)
Clase C USD de Distribución (D)		
Vendidos	–	1
Redimido	(134)	(7)
Disminución neta	(134)	(6)
Clase X USD de Distribución (D)		
Vendidos	500.516	541.654
Redimido	(508.670)	(542.008)
Disminución neta	(8.154)	(354)
Clase A (G) USD de Distribución (D)		
Vendidos	8	73
Redimido	(38)	(107)
Disminución neta	(30)	(34)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	89	63
Redimido	(95)	(78)
Disminución neta	(6)	(15)
Clase A USD de Distribución (D)		
Vendidos	85	172
Redimido	(62)	(556)
Disminución/(aumento) neto	23	(384)
Clase C USD de Capitalización		
Vendidos	7	18
Redimido	(22)	(35)
Disminución neta	(15)	(17)
Clase C USD de Distribución (D)		
Vendidos	6	3
Redimido	(6)	(9)
Disminución neta	–	(6)
Clase E USD de Capitalización		
Vendidos	4	5
Redimido	(2)	(18)
Disminución/(aumento) neto	2	(13)
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	889	156
Redimido	(406)	(329)
Disminución/(aumento) neto	483	(173)
Clase F USD de Distribución (D)		
Vendidos	85	40
Redimido	(37)	(48)
Disminución/(aumento) neto	48	(8)
Clase X USD de Capitalización		
Vendidos	24	2
Redimido	(31)	(2)
Disminución neta	(7)	–
Clase X USD de Distribución (D)		
Vendidos	–	1
Redimido	(1)	(1)
Disminución neta	(1)	–
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	–	16
Redimido	(85)	(104)
Disminución neta	(85)	(88)

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	1
Redimido	–	(23)
Disminución neta	–	(22)
Clase LM USD de Capitalización		
Vendidos	3	5
Redimido	(9)	–
Aumento/(disminución) neto	(6)	5
Clase GA USD de Capitalización		
Vendidos	2	–
Redimido	(2)	(1)
Disminución neta	–	(1)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	167	276
Redimido	(255)	(294)
Disminución neta	(88)	(18)
Clase A USD de Distribución (D)		
Vendidos	98	138
Redimido	(84)	(255)
Disminución/(aumento) neto	14	(117)
Clase A USD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	3	10
Redimido	(9)	(37)
Disminución neta	(6)	(27)
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	17	59
Redimido	(117)	(37)
Aumento/(disminución) neto	(100)	22
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	2	9
Redimido	(3)	(13)
Disminución neta	(1)	(4)
Clase B USD de Distribución (D)		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase C USD de Capitalización		
Vendidos	29	24
Redimido	(28)	(54)
Disminución/(aumento) neto	1	(30)
Clase C USD de Distribución (D)		
Vendidos	11	6
Redimido	(8)	(19)
Disminución/(aumento) neto	3	(13)
Clase E USD de Capitalización		
Vendidos	15	39
Redimido	(36)	(89)
Disminución neta	(21)	(50)
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	1.383	2.966
Redimido	(2.478)	(3.556)
Disminución neta	(1.095)	(590)
Clase F USD de Distribución (D)		
Vendidos	79	28
Redimido	(78)	(45)
Disminución/(aumento) neto	1	(17)
Clase X USD de Capitalización		
Vendidos	13	11
Redimido	(14)	(54)
Disminución neta	(1)	(43)
Clase X USD de Distribución (D)		
Vendidos	1	8
Redimido	(3)	(24)
Disminución neta	(2)	(16)
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	4
Redimido	(2)	(27)
Disminución neta	(2)	(23)
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	602	1.800
Redimido	(1.927)	(2.219)
Disminución neta	(1.325)	(419)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund (continuación)		
Clase Premier USD de Distribución (M)		
Vendidos	22	5
Redimido	(4)	(1)
Aumento neto	18	4
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	61	277
Redimido	(377)	(146)
Aumento/(disminución) neto	(316)	131
Clase LM USD de Distribución (M)		
Vendidos	20	42
Redimido	(91)	(78)
Disminución neta	(71)	(36)
Clase LM EUR de Capitalización		
Redimido	(8)	(1)
Disminución neta	(8)	(1)
Clase A (G) USD de Distribución (D)		
Vendidos	1	–
Redimido	(2)	(1)
Disminución neta	(1)	(1)
Clase L (G) USD de Distribución (D)		
Vendidos	2	–
Redimido	(3)	–
Disminución neta	(1)	–
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		
Clase A USD de Distribución (D)		
Vendidos	13	–
Aumento neto	13	–
Clase A EUR de Distribución (D)		
Redimido	–	(2)
Disminución neta	–	(2)
Clase Premier EUR de Capitalización		
Vendidos	7	88
Redimido	(34)	(24)
Aumento/(disminución) neto	(27)	64
Clase LM EUR de Capitalización		
Redimido	(895)	(3)
Disminución neta	(895)	(3)
Clase GA EUR de Capitalización		
Redimido	(2)	–
Disminución neta	(2)	–
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund^		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	–	9
Redimido	–	(153)
Disminución neta	–	(144)
Clase A USD de Distribución (D)		
Vendidos	–	9
Redimido	–	(99)
Disminución neta	–	(90)
Clase A USD de Distribución (M) Plus		
Redimido	–	(2)
Disminución neta	–	(2)
Clase A USD de Distribución (M)		
Redimido	–	(3)
Disminución neta	–	(3)
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	1
Redimido	–	(10)
Disminución neta	–	(9)
Clase A HKD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	–	7
Redimido	–	(45)
Disminución neta	–	(38)
Clase B USD de Distribución (D)		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase C USD de Capitalización		
Vendidos	–	10
Redimido	–	(57)
Disminución neta	–	(47)

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)
Clase C USD de Distribución (D)		
Vendidos	–	2
Redimido	–	(48)
Disminución neta	–	(46)
Clase F USD de Capitalización		
Redimido	–	(29)
Disminución neta	–	(29)
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	23
Redimido	–	(23)
Aumento neto	–	–
Clase A (G) USD de Capitalización		
Redimido	–	(5)
Disminución neta	–	(5)
Clase A (G) USD de Distribución (D)		
Vendidos	–	1
Redimido	–	(38)
Disminución neta	–	(37)
Clase L (G) USD de Capitalización		
Redimido	–	(6)
Disminución neta	–	(6)
Clase L (G) USD de Distribución (D)		
Redimido	–	(2)
Disminución neta	–	(2)
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	28	25
Redimido	(21)	(38)
Disminución/(aumento) neto	7	(13)
Clase A USD de Distribución (D)		
Vendidos	10	12
Redimido	(33)	(17)
Disminución neta	(23)	(5)
Clase A USD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	23	1
Redimido	(14)	(2)
Disminución/(aumento) neto	9	(1)
Clase A USD de Distribución (M)		
Vendidos	10	16
Redimido	(12)	(22)
Disminución neta	(2)	(6)
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	2	3
Redimido	(2)	(1)
Aumento neto	–	2
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	3	8
Redimido	(14)	(12)
Disminución neta	(11)	(4)
Clase A Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	1	–
Aumento neto	1	–
Clase A EUR de Distribución (M) (cubierta)		
Vendidos	5	8
Redimido	(21)	(10)
Disminución neta	(16)	(2)
Clase A GBP de Distribución (M) (cubierta)		
Vendidos	–	1
Redimido	(1)	(1)
Disminución neta	(1)	–
Clase A HKD de Distribución (M) Plus		
Redimido	–	(5)
Disminución neta	–	(5)
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	129	116
Redimido	(157)	(53)
Aumento/(disminución) neto	(28)	63
Clase B USD de Distribución (D)		
Redimido	(1)	(2)
Disminución neta	(1)	(2)
Clase C USD de Capitalización		
Vendidos	3	11
Redimido	(10)	(11)
Disminución neta	(7)	–

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund (continuación)		
Clase C USD de Distribución (D)		
Vendidos	10	14
Redimido	(17)	(27)
Disminución neta	(7)	(13)
Clase A ZAR de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	320	7
Redimido	(100)	(7)
Aumento neto	220	–
Clase E USD de Capitalización		
Vendidos	–	3
Redimido	(1)	(4)
Disminución neta	(1)	(1)
Clase E USD de Distribución (D)		
Redimido	(2)	–
Disminución neta	(2)	–
Clase E EUR de Distribución (M) (cubierta)		
Vendidos	1	–
Aumento neto	1	–
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	25	31
Redimido	(19)	(45)
Disminución/(aumento) neto	6	(14)
Clase F USD de Distribución (D)		
Redimido	(8)	–
Disminución neta	(8)	–
Clase X USD de Distribución (D)		
Vendidos	1	–
Redimido	(1)	(7)
Disminución neta	–	(7)
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	2	–
Aumento neto	2	–
Clase X GBP de Distribución (D) (cubierta)		
Redimido	(1)	–
Disminución neta	(1)	–
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	52	256
Redimido	(57)	(298)
Disminución neta	(5)	(42)
Clase Premier USD de Distribución (M)		
Vendidos	–	27
Redimido	(1)	(129)
Disminución neta	(1)	(102)
Clase Premier CHF de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	522
Redimido	–	(28)
Aumento neto	–	494
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	1
Redimido	(5)	(21)
Disminución neta	(5)	(20)
Clase Premier EUR de Distribución (M) (cubierta)		
Redimido	(1)	–
Disminución neta	(1)	–
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)		
Redimido	–	(266)
Disminución neta	–	(266)
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	2	–
Redimido	(2)	–
Aumento neto	–	–
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta)		
Vendidos	1	–
Redimido	(7)	(15)
Disminución neta	(6)	(15)
Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	11	1
Redimido	(26)	(27)
Disminución neta	(15)	(26)
Clase LM AUD de Distribución (M) (cubierta)		
Vendidos	81	72
Redimido	–	(350)
Disminución/(aumento) neto	81	(278)

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
Clase LM GBP de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	1	1
Redimido	(1)	(1)
Aumento neto	–	–
FTGF Western Asset US High Yield Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	16	32
Redimido	(39)	(56)
Disminución neta	(23)	(24)
Clase A USD de Distribución (D)		
Vendidos	77	108
Redimido	(127)	(143)
Disminución neta	(50)	(35)
Clase A USD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	17	2
Redimido	(11)	(14)
Disminución/(aumento) neto	6	(12)
Clase A USD de Distribución (M)		
Vendidos	2	5
Redimido	(4)	(12)
Disminución neta	(2)	(7)
Clase A EUR de Distribución (M) (cubierta)		
Vendidos	–	4
Redimido	(1)	–
Aumento/(disminución) neto	(1)	4
Clase A HKD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	3	2
Redimido	(3)	(2)
Aumento neto	–	–
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	1.044	22
Redimido	(604)	(153)
Disminución/(aumento) neto	440	(131)
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		
Vendidos	2	9
Redimido	(2)	(2)
Aumento neto	–	7
Clase C USD de Distribución (D)		
Vendidos	3	3
Redimido	(8)	(7)
Disminución neta	(5)	(4)
Clase E USD de Capitalización		
Vendidos	3	7
Redimido	(9)	(8)
Disminución neta	(6)	(1)
Clase E USD de Distribución (D)		
Vendidos	–	1
Redimido	(2)	(5)
Disminución neta	(2)	(4)
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	1	18
Redimido	(10)	(34)
Disminución neta	(9)	(16)
Clase F USD de Distribución (D)		
Vendidos	1	2
Redimido	(2)	(1)
Aumento/(disminución) neto	(1)	1
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	54	405
Redimido	(149)	(749)
Disminución neta	(95)	(344)
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	5	–
Redimido	(5)	–
Aumento neto	–	–
Clase LM USD de Capitalización		
Redimido	–	(232)
Disminución neta	–	(232)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
FTGF Western Asset US High Yield Fund (continuación)		
Clase LM USD de Distribución (M)		
Vendidos	23	18
Redimido	(101)	–
Aumento/(disminución) neto	(78)	18
Clase A (G) USD de Distribución (D)		
Vendidos	–	1
Redimido	(1)	(1)
Disminución neta	(1)	–
Clase L (G) USD de Distribución (D)		
Vendidos	–	1
Redimido	(1)	(1)
Disminución neta	(1)	–
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund^		
Clase A USD de Capitalización		
Redimido	–	(32)
Disminución neta	–	(32)
Clase A USD de Distribución (D)		
Redimido	–	(14)
Disminución neta	–	(14)
Clase A USD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	–	19
Redimido	–	(19)
Aumento neto	–	–
Clase A USD de Distribución (M)		
Redimido	–	(10)
Disminución neta	–	(10)
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)		
Redimido	–	(2)
Disminución neta	–	(2)
Clase A EUR de Distribución (D) (cubierta)		
Redimido	–	(4)
Disminución neta	–	(4)
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	–	112
Redimido	–	(129)
Disminución neta	–	(17)
Clase C USD de Capitalización		
Redimido	–	(2)
Disminución neta	–	(2)
Clase C USD de Distribución (D)		
Redimido	–	(10)
Disminución neta	–	(10)
Clase E USD de Distribución (D)		
Redimido	–	(5)
Disminución neta	–	(5)
Clase Premier USD de Capitalización		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Redimido	–	(15)
Disminución neta	–	(15)
Clase Premier GBP de Distribución (D) (cubierta)		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase LM USD de Distribución (M) (cubierta)		
Vendidos	–	105
Redimido	–	(393)
Disminución neta	–	(288)
Clase A (G) USD de Capitalización		
Redimido	–	(3)
Disminución neta	–	(3)
Clase A (G) USD de Distribución (D)		
Redimido	–	(9)
Disminución neta	–	(9)
Clase L (G) USD de Capitalización		
Redimido	–	(7)
Disminución neta	–	(7)
Clase L (G) USD de Distribución (D)		
Redimido	–	(10)
Disminución neta	–	(10)

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund^		
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Redimido	–	(18)
Disminución neta	–	(18)
Clase LM USD de Distribución (M)		
Vendidos	–	4
Redimido	–	(290)
Disminución neta	–	(286)
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	5	10
Redimido	(9)	(25)
Disminución neta	(4)	(15)
Clase A USD de Distribución (D)		
Vendidos	4	17
Redimido	(6)	(22)
Disminución neta	(2)	(5)
Clase A USD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	7	11
Redimido	(18)	(73)
Disminución neta	(11)	(62)
Clase A USD de Distribución (M)		
Vendidos	5	58
Redimido	(24)	(75)
Disminución neta	(19)	(17)
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	13	55
Redimido	(29)	(70)
Disminución neta	(16)	(15)
Clase A EUR de Capitalización		
Vendidos	–	5
Redimido	(4)	(2)
Aumento/(disminución) neto	(4)	3
Clase A EUR de Distribución (D) (cubierta)		
Vendidos	–	1
Aumento neto	–	1
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	2.541	525
Redimido	(2.385)	(855)
Disminución/(aumento) neto	156	(330)
Clase B USD de Distribución (D)		
Redimido	–	(3)
Disminución neta	–	(3)
Clase C USD de Capitalización		
Vendidos	–	1
Redimido	–	(4)
Disminución neta	–	(3)
Clase C USD de Distribución (D)		
Vendidos	2	–
Redimido	(12)	(3)
Disminución neta	(10)	(3)
Clase E USD de Capitalización		
Vendidos	–	1
Redimido	(3)	(1)
Disminución neta	(3)	–
Clase E EUR de Distribución (M) (cubierta)		
Vendidos	1	–
Aumento neto	1	–
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	8	13
Redimido	(17)	(7)
Aumento/(disminución) neto	(9)	6
Clase F USD de Distribución (D)		
Vendidos	1	2
Redimido	(1)	(6)
Disminución neta	–	(4)
Clase X USD de Distribución (D)		
Vendidos	52	5
Redimido	(62)	(12)
Disminución neta	(10)	(7)
Clase X GBP de Distribución (D) (cubierta)		
Vendidos	46	10
Redimido	(49)	(7)
Aumento/(disminución) neto	(3)	3

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)
FTGF Western Asset Global High Yield Fund (continuación)		
Clase Premier USD de Capitalización		
Redimido	–	(29)
Disminución neta	–	(29)
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	8	8
Redimido	(16)	(1)
Aumento/(disminución) neto	(8)	7
Clase A (G) USD de Capitalización		
Redimido	(6)	(1)
Disminución neta	(6)	(1)
Clase A (G) USD de Distribución (D)		
Vendidos	–	1
Redimido	(2)	(2)
Disminución neta	(2)	(1)
Clase L (G) USD de Distribución (D)		
Vendidos	5	1
Redimido	(5)	–
Aumento neto	–	1
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	–	18
Redimido	–	(41)
Disminución neta	–	(23)
Clase A USD de Distribución (A)		
Vendidos	–	7
Redimido	–	(43)
Disminución neta	–	(36)
Clase C USD de Capitalización		
Vendidos	–	1
Redimido	–	(2)
Disminución neta	–	(1)
Clase C USD de Distribución (A)		
Redimido	–	(6)
Disminución neta	–	(6)
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	–	11
Redimido	–	(11)
Aumento neto	–	–
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	12
Redimido	–	(75)
Disminución neta	–	(63)
Clase LM USD de Capitalización		
Redimido	–	(369)
Disminución neta	–	(369)
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	40	57
Redimido	(69)	(102)
Disminución neta	(29)	(45)
Clase A USD de Distribución (D)		
Vendidos	1	6
Redimido	(8)	(9)
Disminución neta	(7)	(3)
Clase A USD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	92	89
Redimido	(149)	(241)
Disminución neta	(57)	(152)
Clase A USD de Distribución (M)		
Vendidos	8	28
Redimido	(63)	(50)
Disminución neta	(55)	(22)
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	31	127
Redimido	(71)	(200)
Disminución neta	(40)	(73)
Clase A CHF de Capitalización (cubierta)		
Redimido	(3)	–
Disminución neta	(3)	–
Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	2.257	53
Redimido	(162)	(117)
Disminución/(aumento) neto	2.095	(64)

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	5
Redimido	(1)	(10)
Disminución neta	(1)	(5)
Clase A EUR de Capitalización		
Vendidos	1	2
Redimido	(3)	(5)
Disminución neta	(2)	(3)
Clase A EUR de Distribución (A)		
Redimido	(1)	–
Disminución neta	(1)	–
Clase A HKD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	6	64
Redimido	(117)	(358)
Disminución neta	(111)	(294)
Clase A SGD de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	468	34
Redimido	(556)	(540)
Disminución neta	(88)	(506)
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	9.697	254
Redimido	(9.490)	(1.658)
Disminución/(aumento) neto	207	(1.404)
Clase A SGD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	49	603
Redimido	(421)	(1.017)
Disminución neta	(372)	(414)
Clase C USD de Capitalización		
Vendidos	1	–
Redimido	(2)	(1)
Disminución neta	(1)	(1)
Clase C USD de Distribución (D)		
Redimido	(4)	–
Disminución neta	(4)	–
Clase E USD de Capitalización		
Vendidos	1	1
Redimido	(2)	(1)
Disminución neta	(1)	–
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	–	6
Redimido	(9)	(7)
Disminución neta	(9)	(1)
Clase F USD de Distribución (D)		
Vendidos	1	–
Aumento neto	1	–
Clase X USD de Capitalización		
Redimido	–	(2)
Disminución neta	–	(2)
Clase X USD de Distribución (M)		
Vendidos	–	1
Redimido	(1)	(26)
Disminución neta	(1)	(25)
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)		
Redimido	(2)	–
Disminución neta	(2)	–
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	85	156
Redimido	(267)	(56)
Aumento/(disminución) neto	(182)	100
Clase Premier USD de Distribución (M)		
Vendidos	36	39
Redimido	(49)	(26)
Aumento/(disminución) neto	(13)	13
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	53	51
Redimido	(93)	(44)
Aumento/(disminución) neto	(40)	7
Clase Premier EUR de Capitalización		
Redimido	(557)	–
Disminución neta	(557)	–
Clase Premier EUR de Distribución (A)		
Redimido	(470)	–
Disminución neta	(470)	–
Clase LM USD de Capitalización		
Redimido	(63)	(84)
Disminución neta	(63)	(84)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund (continuación)		
Clase LM USD de Distribución (M)		
Vendidos	3	59
Redimido	(32)	(10)
Aumento/(disminución) neto	(29)	49
Clase LM Euro de Distribución (M) (cubierta)		
Vendidos	19	15
Redimido	(19)	(10)
Aumento neto	–	5
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	133	225
Redimido	(134)	(147)
Aumento/(disminución) neto	(1)	78
Clase A USD de Distribución (M)		
Vendidos	61	30
Redimido	(34)	(19)
Aumento neto	27	11
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	100	197
Redimido	(170)	(66)
Aumento/(disminución) neto	(70)	131
Clase A EUR de Distribución (M) (cubierta)		
Vendidos	–	3
Redimido	(3)	–
Aumento/(disminución) neto	(3)	3
Clase A SEK de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	857	1.454
Redimido	(1.106)	(2.223)
Disminución neta	(249)	(769)
Clase B USD de Capitalización		
Vendidos	–	1
Redimido	(1)	–
Aumento/(disminución) neto	(1)	1
Clase C USD de Capitalización		
Vendidos	17	12
Redimido	(20)	(49)
Disminución neta	(3)	(37)
Clase C USD de Distribución (M)		
Vendidos	8	37
Redimido	(8)	(5)
Aumento neto	–	32
Clase E USD de Capitalización		
Vendidos	8	19
Redimido	(7)	(17)
Aumento neto	1	2
Clase E USD de Distribución (D)		
Vendidos	–	1
Redimido	(38)	–
Aumento/(disminución) neto	(38)	1
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	1	12
Redimido	(5)	(44)
Disminución neta	(4)	(32)
Clase F USD de Distribución (D)		
Vendidos	1	1
Redimido	(12)	(3)
Disminución neta	(11)	(2)
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	255	48
Redimido	(145)	(46)
Aumento neto	110	2
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	72	334
Redimido	(170)	(339)
Disminución neta	(98)	(5)
Clase Premier CHF de Distribución (M) (cubierta)		
Vendidos	42	–
Aumento neto	42	–
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	353	666
Redimido	(891)	(287)
Aumento/(disminución) neto	(538)	379

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)
Clase Premier EUR de Distribución (M) (cubierta)		
Vendidos	2	2
Redimido	–	(4)
Disminución/(aumento) neto	2	(2)
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	1	4
Redimido	(4)	–
Aumento/(disminución) neto	(3)	4
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta)		
Vendidos	1	1
Redimido	(1)	(10)
Disminución neta	–	(9)
Clase S USD de Distribución (M) Plus (e)		
Vendidos	335	272
Redimido	(67)	(70)
Aumento neto	268	202
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase S Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	108	49
Redimido	(45)	(8)
Aumento neto	63	41
Clase S GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	1.325	1.035
Redimido	(1.593)	(454)
Aumento/(disminución) neto	(268)	581
Clase LM AUD de Capitalización (cubierta)		
Redimido	(155)	–
Disminución neta	(155)	–
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^		
Clase X USD de Capitalización		
Redimido	(5)	(7)
Disminución neta	(5)	(7)
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	137	84
Redimido	(125)	(179)
Disminución/(aumento) neto	12	(95)
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	160	124
Redimido	(154)	(238)
Disminución/(aumento) neto	6	(114)
Clase Premier NZD de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	66	–
Redimido	(110)	–
Disminución neta	(44)	–
Clase LM USD de Capitalización		
Vendidos	3	6
Redimido	(8)	(2)
Aumento/(disminución) neto	(5)	4
Clase LM Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	25
Redimido	(21)	(27)
Disminución neta	(21)	(2)
Clase LM CAD de Capitalización (cubierta)		
Redimido	(250)	–
Disminución neta	(250)	–
FTGF Western Asset Global Credit Fund^		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	1	1
Redimido	(12)	(6)
Disminución neta	(11)	(5)
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	2
Redimido	(1)	(2)
Disminución neta	(1)	–
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)
FTGF Western Asset Global Credit Fund^ (continuación)		
Clase LM USD de Capitalización		
Vendidos	7	–
Redimido	(107)	(152)
Disminución neta	(100)	(152)
Clase LM Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	54	6
Redimido	(53)	(2)
Aumento neto	1	4
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^		
Clase LM EUR de Capitalización		
Redimido	–	(205)
Disminución neta	–	(205)
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	313	422
Redimido	(1.562)	(3.118)
Disminución neta	(1.249)	(2.696)
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)		
Vendidos	173	432
Redimido	(472)	(1.059)
Disminución neta	(299)	(627)
Clase A USD de Distribución (S)		
Vendidos	67	43
Redimido	(125)	(140)
Disminución neta	(58)	(97)
Clase A AUD de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	9	1
Redimido	(2)	(2)
Disminución/(aumento) neto	7	(1)
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	43	18
Redimido	(94)	(103)
Disminución neta	(51)	(85)
Clase A CHF de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	4	7
Redimido	(22)	(96)
Disminución neta	(18)	(89)
Clase A CNH de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	7
Redimido	(4)	(7)
Disminución neta	(4)	–
Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Redimido	(86)	(82)
Disminución neta	(86)	(82)
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	1.410	779
Redimido	(1.260)	(2.137)
Disminución/(aumento) neto	150	(1.358)
Clase A EUR de Distribución (A)		
Vendidos	8	6
Redimido	(22)	(24)
Disminución neta	(14)	(18)
Clase A Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	1	6
Redimido	(22)	(18)
Disminución neta	(21)	(12)
Clase A EUR de Distribución (S) (cubierta)		
Vendidos	8	10
Redimido	(11)	(9)
Aumento/(disminución) neto	(3)	1
Clase A GBP de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	7	2
Redimido	(26)	(98)
Disminución neta	(19)	(96)
Clase A GBP de Capitalización		
Vendidos	1	–
Redimido	(2)	(1)
Disminución neta	(1)	(1)
Clase A GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	35	5
Redimido	(73)	(15)
Disminución neta	(38)	(10)

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)
Clase A HKD de Distribución (M) Plus		
Redimido	(7)	–
Disminución neta	(7)	–
Clase A SEK de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	14	33
Redimido	(67)	(172)
Disminución neta	(53)	(139)
Clase A SGD de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	6.079	–
Redimido	(10.142)	(12.989)
Disminución neta	(4.063)	(12.989)
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	1.611	2.598
Redimido	(13.899)	(18.843)
Disminución neta	(12.288)	(16.245)
Clase B USD de Capitalización		
Redimido	(1)	–
Disminución neta	(1)	–
Clase C USD de Capitalización		
Vendidos	16	36
Redimido	(70)	(127)
Disminución neta	(54)	(91)
Clase C USD de Distribución (S)		
Vendidos	4	1
Redimido	(8)	(13)
Disminución neta	(4)	(12)
Clase A JPY de Distribución (M) Plus (e)		
Vendidos	2	2
Redimido	–	(2)
Aumento neto	2	–
Clase A NOK de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	346	379
Redimido	(554)	(326)
Aumento/(disminución) neto	(208)	53
Clase E USD de Capitalización		
Vendidos	11	18
Redimido	(59)	(50)
Disminución neta	(48)	(32)
Clase E USD de Distribución (S)		
Vendidos	–	2
Redimido	(5)	(7)
Disminución neta	(5)	(5)
Clase E Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	2	1
Redimido	(6)	(10)
Disminución neta	(4)	(9)
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	34	157
Redimido	(200)	(711)
Disminución neta	(166)	(554)
Clase F USD de Distribución (S)		
Vendidos	13	5
Redimido	(53)	(43)
Disminución neta	(40)	(38)
Clase X USD de Capitalización		
Vendidos	91	113
Redimido	(374)	(809)
Disminución neta	(283)	(696)
Clase X USD de Distribución (M) Plus (e)		
Vendidos	57	24
Redimido	(218)	(223)
Disminución neta	(161)	(199)
Clase X USD de Distribución (S)		
Vendidos	4	9
Redimido	(44)	(83)
Disminución neta	(40)	(74)
Clase X CHF de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	2	49
Redimido	(24)	(180)
Disminución neta	(22)	(131)
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	569	1.583
Redimido	(577)	(2.307)
Disminución neta	(8)	(724)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ (continuación)		
Clase X EUR de Capitalización		
Vendidos	1	1
Redimido	(3)	(18)
Disminución neta	(2)	(17)
Clase X EUR de Distribución (A) (cubierta)		
Vendidos	2	39
Redimido	(81)	(42)
Disminución neta	(79)	(3)
Clase X EUR de Distribución (M) (cubierta)		
Redimido	(24)	(38)
Disminución neta	(24)	(38)
Clase X GBP de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	19	56
Redimido	(150)	(232)
Disminución neta	(131)	(176)
Clase X GBP de Capitalización		
Redimido	–	(3)
Disminución neta	–	(3)
Clase X GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	5	3
Redimido	(12)	(40)
Disminución neta	(7)	(37)
Clase X SGD de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	676	1.105
Redimido	(3.224)	(1.369)
Disminución neta	(2.548)	(264)
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	107	984
Redimido	(1.673)	(1.350)
Disminución neta	(1.566)	(366)
Clase Premier USD de Distribución (S)		
Vendidos	9	10
Redimido	(110)	(304)
Disminución neta	(101)	(294)
Clase Premier AUD de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	1
Redimido	(1)	(17)
Disminución neta	(1)	(16)
Clase Premier AUD de Distribución (S) (cubierta)		
Vendidos	7	13
Redimido	(37)	(574)
Disminución neta	(30)	(561)
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	19	92
Redimido	(513)	(3.104)
Disminución neta	(494)	(3.012)
Clase Premier CHF de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	1	8
Redimido	(13)	(112)
Disminución neta	(12)	(104)
Clase Premier CHF de Distribución (S) (cubierta)		
Vendidos	–	9
Redimido	(1)	(20)
Disminución neta	(1)	(11)
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	483	1.114
Redimido	(2.982)	(2.581)
Disminución neta	(2.499)	(1.467)
Clase Premier EUR de Capitalización		
Vendidos	217	12
Redimido	(268)	(60)
Disminución neta	(51)	(48)
Clase Premier EUR de Distribución (S) (cubierta)		
Vendidos	223	318
Redimido	(356)	(98)
Aumento/(disminución) neto	(133)	220
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	11	21
Redimido	(33)	(513)
Disminución neta	(22)	(492)
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	131	71
Redimido	(162)	(1.114)
Disminución neta	(31)	(1.043)
Clase Premier JPY de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	3	101
Redimido	(24)	(165)
Disminución neta	(21)	(64)
Clase Premier JPY de Distribución (S) (cubierta)		
Redimido	–	(100)
Disminución neta	–	(100)
Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	37	24
Redimido	(15)	(35)
Disminución/(aumento) neto	22	(11)
Clase Premier SEK de Capitalización (cubierta)		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase S USD de Capitalización		
Vendidos	9	–
Redimido	(9)	(83)
Disminución neta	–	(83)
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	3	–
Redimido	(1.212)	(9)
Disminución neta	(1.209)	(9)
Clase LM AUD de Distribución (S) (cubierta)		
Vendidos	68	72
Redimido	(234)	(738)
Disminución neta	(166)	(666)
Clase LM EUR de Capitalización		
Vendidos	1	1
Redimido	(5)	(2)
Disminución neta	(4)	(1)
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^		
Clase A USD de Capitalización		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	19
Redimido	–	(50)
Disminución neta	–	(31)
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Redimido	(2)	(3)
Disminución neta	(2)	(3)
Clase S USD de Capitalización		
Vendidos	16	1
Redimido	(18)	(3)
Disminución neta	(2)	(2)
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	80	40
Redimido	(108)	(31)
Aumento/(disminución) neto	(28)	9
Clase S GBP de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	59	50
Redimido	(27)	(29)
Aumento neto	32	21
Clase LM AUD de Capitalización (cubierta)		
Redimido	–	(1.230)
Disminución neta	–	(1.230)
Clase LM Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	175	25
Redimido	(85)	(65)
Disminución/(aumento) neto	90	(40)
Clase LM GBP de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	515	418
Redimido	(128)	(206)
Aumento neto	387	212
Clase LM CAD de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	7	271
Redimido	(36)	(9)
Aumento/(disminución) neto	(29)	262
Clase S CHF de Distribución (A) (cubierta)		
Vendidos	–	40
Aumento neto	–	40

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^		
Clase D Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	9	14
Redimido	(9)	(10)
Aumento neto	–	4
Clase D EUR de Distribución (M) (cubierta)		
Redimido	(5)	–
Disminución neta	(5)	–
Clase D USD de Capitalización		
Vendidos	5	3
Redimido	(110)	(17)
Disminución neta	(105)	(14)
Clase D USD de Distribución (M)		
Vendidos	–	2
Redimido	(9)	(2)
Disminución neta	(9)	–
Clase M CHF de Capitalización (cubierta)		
Redimido	(2)	(10)
Disminución neta	(2)	(10)
Clase M GBP de Distribución (M) (cubierta)		
Redimido	–	(6)
Disminución neta	–	(6)
Clase F USD de Capitalización		
Redimido	–	(4)
Disminución neta	–	(4)
Clase M USD de Capitalización		
Redimido	–	(7)
Disminución neta	–	(7)
Clase M USD de Distribución (M)		
Vendidos	2	1
Redimido	(1)	(1)
Aumento neto	1	–
Clase M Euro de Capitalización (cubierta)		
Redimido	–	(8)
Disminución neta	–	(8)
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	84	82
Redimido	(167)	(1.417)
Disminución neta	(83)	(1.335)
Clase Premier USD de Distribución (Q)		
Vendidos	19	–
Redimido	(14)	(7)
Disminución/(aumento) neto	5	(7)
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	1	8
Redimido	(32)	(1.094)
Disminución neta	(31)	(1.086)
Clase Premier EUR de Distribución (Q) (cubierta)		
Vendidos	1	3
Redimido	(6)	(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	–	(705)
Disminución neta	–	(705)
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^		
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	30	585
Aumento neto	30	585
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	19
Redimido	–	(25)
Disminución neta	–	(6)
Clase LM USD de Capitalización		
Vendidos	–	266
Aumento neto	–	266

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^θ		
Clase LM GBP de Capitalización		
Redimido	–	(637)
Disminución neta	–	(637)
Clase LM GBP de Distribución (M)		
Vendidos	–	700
Redimido	(504)	(196)
Aumento/(disminución) neto	(504)	504
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^μ		
Clase A USD de Capitalización		
Redimido	(1)	(4)
Disminución neta	(1)	(4)
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	–	7
Redimido	(164)	(14)
Disminución neta	(164)	(7)
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	31
Redimido	–	(38)
Disminución neta	–	(7)
Clase LM GBP de Capitalización (cubierta)		
Redimido	–	(951)
Disminución neta	–	(951)
Clase LM GBP de Distribución (M) (cubierta)		
Vendidos	–	1.075
Redimido	(704)	(371)
Aumento/(disminución) neto	(704)	704
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^		
Clase LM USD de Distribución (Q)		
Vendidos	12	12
Redimido	(8)	(6)
Aumento neto	4	6
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^¥		
Clase Premier USD de Capitalización		
Redimido	(25)	–
Disminución neta	(25)	–
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)		
Redimido	(140)	(2)
Disminución neta	(140)	(2)
Clase S USD de Capitalización		
Redimido	(48)	–
Disminución neta	(48)	–
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	19	8
Redimido	(34)	(16)
Disminución neta	(15)	(8)
Clase A USD de Distribución (M)		
Vendidos	13	12
Redimido	(10)	(17)
Disminución/(aumento) neto	3	(5)
Clase A USD de Distribución (S)		
Vendidos	29	35
Redimido	(59)	(39)
Disminución neta	(30)	(4)
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Redimido	(5)	–
Disminución neta	(5)	–
Clase A Euro de Capitalización (cubierta) (IH)		
Vendidos	37	9
Redimido	(48)	(54)
Disminución neta	(11)	(45)
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	1	5
Redimido	(3)	(6)
Disminución neta	(2)	(1)
Clase A EUR de Distribución (A) (cubierta)		
Redimido	(3)	(2)
Disminución neta	(3)	(2)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund (continuación)		
Clase A EUR de Distribución (S) (cubierta) (IH)		
Vendidos	4	2
Redimido	(10)	(5)
Disminución neta	(6)	(3)
Clase A GBP de Distribución (M) (cubierta)		
Vendidos	–	1
Redimido	(2)	–
Aumento/(disminución) neto	(2)	1
Clase A GBP de Distribución (S) (cubierta) (IH)		
Vendidos	3	5
Redimido	(7)	(10)
Disminución neta	(4)	(5)
Clase A SGD de Capitalización		
Vendidos	1.858	5
Redimido	(1.854)	(1)
Aumento neto	4	4
Clase B USD de Distribución (S)		
Redimido	(1)	–
Disminución neta	(1)	–
Clase C USD de Capitalización		
Vendidos	1	–
Redimido	(1)	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase C USD de Distribución (S)		
Redimido	(1)	(1)
Disminución neta	(1)	(1)
Clase E USD de Capitalización		
Vendidos	4	3
Redimido	(4)	(1)
Aumento neto	–	2
Clase E Euro de Capitalización (cubierta) (IH)		
Redimido	(1)	(1)
Disminución neta	(1)	(1)
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	1	2
Redimido	(1)	(10)
Disminución neta	–	(8)
Clase F USD de Distribución (S)		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase X USD de Capitalización		
Vendidos	1	59
Redimido	(3)	(62)
Disminución neta	(2)	(3)
Clase X USD de Distribución (S)		
Redimido	–	(2)
Disminución neta	–	(2)
Clase X Euro de Capitalización (cubierta) (IH)		
Vendidos	7	–
Redimido	(2)	(8)
Disminución/(aumento) neto	5	(8)
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	1
Redimido	(1)	(1)
Disminución neta	(1)	–
Clase X EUR de Distribución (S) (cubierta) (IH)		
Redimido	–	(5)
Disminución neta	–	(5)
Clase X GBP de Capitalización (cubierta) (IH)		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase X GBP de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	19	33
Redimido	(30)	(130)
Disminución neta	(11)	(97)
Clase X GBP de Capitalización		
Vendidos	30	142
Redimido	(67)	(178)
Disminución neta	(37)	(36)
Clase X GBP de Distribución (S) (cubierta) (IH)		
Vendidos	20	9
Redimido	(22)	(21)
Disminución neta	(2)	(12)
Clase X GBP de Distribución (S) (cubierta)		
Vendidos	70	15
Redimido	(80)	(38)
Disminución neta	(10)	(23)
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	6	–
Redimido	(11)	(6)
Disminución neta	(5)	(6)
Clase Premier USD de Distribución (S)		
Vendidos	–	1
Redimido	(2)	(10)
Disminución neta	(2)	(9)
Clase Premier Euro de Capitalización (cubierta) (IH)		
Vendidos	25	20
Redimido	(7)	(63)
Disminución/(aumento) neto	18	(43)
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	43
Redimido	(8)	(20)
Aumento/(disminución) neto	(8)	23
Clase Premier EUR de Capitalización		
Vendidos	–	2
Redimido	(5)	(6)
Disminución neta	(5)	(4)
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta)		
Redimido	–	(2)
Disminución neta	–	(2)
Clase Premier GBP de Distribución (S) (cubierta) (IH)		
Vendidos	2	–
Redimido	(5)	(7)
Disminución neta	(3)	(7)
Clase LM USD de Capitalización (cubierta) (IH)		
Vendidos	22	187
Redimido	(54)	(38)
Aumento/(disminución) neto	(32)	149
Clase LM USD de Capitalización		
Vendidos	2	5
Redimido	(6)	–
Aumento/(disminución) neto	(4)	5
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	–	2
Redimido	(2)	(3)
Disminución neta	(2)	(1)
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	1
Redimido	–	(3)
Disminución neta	–	(2)
Clase A SGD de Capitalización		
Vendidos	3.319	11.942
Redimido	(3.318)	(11.941)
Aumento neto	1	1
Clase C USD de Capitalización		
Vendidos	5	–
Redimido	(2)	–
Aumento neto	3	–
Clase E USD de Capitalización		
Redimido	(1)	(1)
Disminución neta	(1)	(1)
Clase F USD de Capitalización		
Redimido	(5)	(2)
Disminución neta	(5)	(2)
Clase X GBP de Capitalización (cubierta)		
Redimido	–	(4)
Disminución neta	–	(4)
Clase X GBP de Distribución (M) (cubierta)		
Vendidos	–	4
Redimido	(3)	(1)
Aumento/(disminución) neto	(3)	3
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	305	1.645
Redimido	(1.279)	(343)
Aumento/(disminución) neto	(974)	1.302

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ (continuación)		
Clase Premier USD de Distribución (A)		
Redimido	(2)	–
Disminución neta	(2)	–
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	26	592
Redimido	(946)	(268)
Aumento/(disminución) neto	(920)	324
Clase Premier EUR de Distribución (A) (cubierta)		
Vendidos	11	7
Redimido	(348)	–
Aumento/(disminución) neto	(337)	7
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta)		
Vendidos	113	–
Redimido	(83)	–
Aumento neto	30	–
Clase LM AUD de Capitalización (cubierta)		
Redimido	(1.698)	(3.246)
Disminución neta	(1.698)	(3.246)
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	20	–
Redimido	(1)	–
Aumento neto	19	–
Clase A USD de Distribución (D)		
Vendidos	22	–
Redimido	(7)	–
Aumento neto	15	–
Clase F USD de Distribución (D)		
Vendidos	1	–
Aumento neto	1	–
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	89	–
Redimido	(48)	–
Aumento neto	41	–
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta) (IH)		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase S EUR de Distribución (A) (cubierta) (IH)		
Vendidos	74	–
Aumento neto	74	–
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	28	11
Redimido	(32)	(8)
Aumento/(disminución) neto	(4)	3
Clase A USD de Distribución (M)		
Vendidos	1	1
Redimido	(2)	(1)
Disminución neta	(1)	–
Clase A SGD de Capitalización		
Vendidos	6.758	10
Redimido	(6.773)	(41)
Disminución neta	(15)	(31)
Clase C USD de Capitalización		
Redimido	–	(9)
Disminución neta	–	(9)
Clase F USD de Capitalización		
Redimido	(5)	(3)
Disminución neta	(5)	(3)
Clase X USD de Capitalización		
Redimido	(3)	–
Disminución neta	(3)	–
Clase X GBP de Distribución (M) (cubierta) (IH)		
Redimido	(2)	–
Disminución neta	(2)	–
Clase X GBP de Distribución (M) (cubierta)		
Vendidos	–	2
Redimido	(2)	(3)
Disminución neta	(2)	(1)
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	290	56
Redimido	(264)	(56)
Aumento neto	26	–

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta) (IH)		
Vendidos	1	1
Redimido	(2)	–
Aumento/(disminución) neto	(1)	1
Clase Premier NZD de Capitalización (cubierta) (IH)		
Vendidos	–	3
Aumento neto	–	3
Clase LM EUR de Capitalización		
Vendidos	1	1
Redimido	(22)	(3)
Disminución neta	(21)	(2)
Clase LM NZD de Capitalización (cubierta) (IH)		
Vendidos	7	4
Redimido	(30)	(6)
Disminución neta	(23)	(2)
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	390	418
Redimido	(454)	(566)
Disminución neta	(64)	(148)
Clase A USD de Distribución (A)		
Vendidos	3	9
Redimido	(7)	(11)
Disminución neta	(4)	(2)
Clase A USD de Distribución (D)		
Vendidos	45	58
Redimido	(37)	(163)
Disminución/(aumento) neto	8	(105)
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)		
Vendidos	153	133
Redimido	(352)	(568)
Disminución neta	(199)	(435)
Clase A USD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	102	232
Redimido	(202)	(489)
Disminución neta	(100)	(257)
Clase A AUD de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	3	–
Redimido	–	(2)
Disminución/(aumento) neto	3	(2)
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	28	4
Redimido	(36)	(29)
Disminución neta	(8)	(25)
Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	58	21
Redimido	(15)	(23)
Disminución/(aumento) neto	43	(2)
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	195	115
Redimido	(102)	(201)
Disminución/(aumento) neto	93	(86)
Clase A EUR de Distribución (A) (cubierta)		
Vendidos	179	67
Redimido	(192)	(59)
Aumento/(disminución) neto	(13)	8
Clase A Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	79	125
Redimido	(109)	(89)
Aumento/(disminución) neto	(30)	36
Clase A Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	3	3
Redimido	(6)	(6)
Disminución neta	(3)	(3)
Clase A GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	10	13
Redimido	(13)	(14)
Disminución neta	(3)	(1)
Clase A GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	4	11
Redimido	(6)	(14)
Disminución neta	(2)	(3)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund (continuación)		
Clase A HKD de Capitalización		
Vendidos	12	4
Redimido	(9)	(14)
Disminución/(aumento) neto	3	(10)
Clase A HKD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	64	21
Redimido	(242)	(517)
Disminución neta	(178)	(496)
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	9.353	50.704
Redimido	(9.625)	(14.808)
Aumento/(disminución) neto	(272)	35.896
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	3.406	45.172
Redimido	(7.331)	(52.806)
Disminución neta	(3.925)	(7.634)
Clase A SGD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	132	10.980
Redimido	(3.140)	(14.908)
Disminución neta	(3.008)	(3.928)
Clase C USD de Capitalización		
Vendidos	69	121
Redimido	(144)	(265)
Disminución neta	(75)	(144)
Clase C USD de Distribución (D)		
Vendidos	31	107
Redimido	(4)	(4)
Aumento neto	27	103
Clase A CZK de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	1
Aumento neto	–	1
Clase E USD de Capitalización		
Vendidos	178	69
Redimido	(142)	(78)
Disminución/(aumento) neto	36	(9)
Clase E USD de Distribución (D)		
Vendidos	5	4
Redimido	(2)	(3)
Aumento neto	3	1
Clase E Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	20	10
Redimido	(11)	(9)
Aumento neto	9	1
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	62	78
Redimido	(124)	(205)
Disminución neta	(62)	(127)
Clase F USD de Distribución (D)		
Vendidos	11	12
Redimido	(11)	(21)
Disminución neta	–	(9)
Clase X USD de Capitalización		
Vendidos	19	19
Redimido	(75)	(60)
Disminución neta	(56)	(41)
Clase X USD de Distribución (D)		
Vendidos	–	4
Redimido	(4)	(1)
Aumento/(disminución) neto	(4)	3
Clase X USD de Distribución (M) Plus (e)		
Vendidos	4	43
Redimido	(36)	(96)
Disminución neta	(32)	(53)
Clase X CHF de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	1
Redimido	(1)	(11)
Disminución neta	(1)	(10)
Clase X CHF de Distribución (A) (cubierta)		
Redimido	(5)	(24)
Disminución neta	(5)	(24)
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	12	59
Redimido	(93)	(226)
Disminución neta	(81)	(167)
Clase X EUR de Capitalización		
Vendidos	2	–
Redimido	(2)	(2)
Disminución neta	–	(2)
Clase X Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	16	11
Redimido	(64)	(33)
Disminución neta	(48)	(22)
Clase X GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	1	13
Redimido	(25)	(35)
Disminución neta	(24)	(22)
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	654	121
Redimido	(332)	(375)
Disminución/(aumento) neto	322	(254)
Clase Premier USD de Distribución (M) Plus (e)		
Vendidos	7	91
Redimido	(46)	(79)
Aumento/(disminución) neto	(39)	12
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	1	4
Redimido	(115)	(1)
Aumento/(disminución) neto	(114)	3
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	172	495
Redimido	(399)	(716)
Disminución neta	(227)	(221)
Clase Premier Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	308	310
Redimido	(307)	(207)
Aumento neto	1	103
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	5	67
Redimido	(72)	(15)
Aumento/(disminución) neto	(67)	52
Clase Premier SEK de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	53	1
Redimido	(22)	(61)
Disminución/(aumento) neto	31	(60)
Clase S USD de Capitalización		
Vendidos	213	193
Redimido	(297)	(1.031)
Disminución neta	(84)	(838)
Clase S USD de Distribución (Q) Plus (e)		
Redimido	(2)	–
Disminución neta	(2)	–
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	67	178
Redimido	(192)	(264)
Disminución neta	(125)	(86)
Clase S Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	2	5
Redimido	(9)	(3)
Aumento/(disminución) neto	(7)	2
Clase S GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	2	2
Redimido	(4)	(13)
Disminución neta	(2)	(11)
Clase LM USD de Capitalización		
Vendidos	84	215
Redimido	(50)	(100)
Aumento neto	34	115
Clase LM USD de Distribución (M)		
Vendidos	8	15
Redimido	(34)	(19)
Disminución neta	(26)	(4)
Clase LM EUR de Distribución (Q) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	269	1.038
Redimido	(304)	(84)
Aumento/(disminución) neto	(35)	954
Clase LM GBP de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	12	169
Redimido	(63)	(151)
Aumento/(disminución) neto	(51)	18

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	–	1
Redimido	(106)	–
Aumento/(disminución) neto	(106)	1
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	34	17
Redimido	(193)	(63)
Disminución neta	(159)	(46)
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^α		
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)		
Redimido	(1)	–
Disminución neta	(1)	–
Clase S EUR de Distribución (A) (cubierta) (IH)		
Redimido	(100)	–
Disminución neta	(100)	–
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^		
Clase A SGD de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	104
Redimido	–	(5.710)
Disminución neta	–	(5.606)
Clase LM AUD de Capitalización (cubierta)		
Redimido	–	(237)
Disminución neta	–	(237)
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^		
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)		
Vendidos	–	1
Aumento neto	–	1
Clase S USD de Capitalización		
Vendidos	–	148
Aumento neto	–	148
Clase S Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	–	1
Aumento neto	–	1
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^λ		
Clase S USD de Capitalización		
Vendidos	320	–
Redimido	(20)	–
Aumento neto	300	–
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^α		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	–	2
Redimido	(3)	–
Aumento/(disminución) neto	(3)	2
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		
Vendidos	170	402
Redimido	(271)	(370)
Aumento/(disminución) neto	(101)	32
Clase A USD de Distribución (A)		
Vendidos	14	19
Redimido	(31)	(23)
Disminución neta	(17)	(4)
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	3	55
Redimido	(25)	(29)
Aumento/(disminución) neto	(22)	26
Clase A EUR de Capitalización		
Vendidos	79	54
Redimido	(44)	(44)
Aumento neto	35	10

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
Clase A EUR de Distribución (A) (cubierta)		
Vendidos	–	1
Redimido	(1)	–
Aumento/(disminución) neto	(1)	1
Clase A SGD de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	270	262
Redimido	(436)	(573)
Disminución neta	(166)	(311)
Clase A SGD de Capitalización		
Vendidos	1.138	1.549
Redimido	(691)	(1.320)
Aumento neto	447	229
Clase C USD de Capitalización		
Vendidos	7	43
Redimido	(28)	(27)
Aumento/(disminución) neto	(21)	16
Clase C USD de Distribución (A)		
Vendidos	1	3
Redimido	(2)	(2)
Aumento/(disminución) neto	(1)	1
Clase E USD de Capitalización		
Vendidos	7	32
Redimido	(21)	(18)
Aumento/(disminución) neto	(14)	14
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	24	40
Redimido	(27)	(35)
Aumento/(disminución) neto	(3)	5
Clase F USD de Distribución (A)		
Vendidos	1	–
Redimido	(1)	(14)
Disminución neta	–	(14)
Clase U USD de Capitalización		
Vendidos	991	–
Redimido	(42)	–
Aumento neto	949	–
Clase X USD de Capitalización		
Vendidos	15	5
Redimido	(1)	(4)
Aumento neto	14	1
Clase X USD de Distribución (A)		
Vendidos	34	19
Redimido	(27)	(78)
Disminución/(aumento) neto	7	(59)
Clase X EUR de Capitalización		
Vendidos	37	89
Redimido	(31)	(94)
Disminución/(aumento) neto	6	(5)
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	305	370
Redimido	(446)	(203)
Aumento/(disminución) neto	(141)	167
Clase Premier USD de Distribución (A)		
Vendidos	–	11
Redimido	(12)	(1)
Aumento/(disminución) neto	(12)	10
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	1.060	508
Redimido	(687)	(231)
Aumento neto	373	277
Clase Premier EUR de Capitalización		
Vendidos	376	124
Redimido	(327)	(185)
Disminución/(aumento) neto	49	(61)
Clase LM USD de Distribución (A)		
Vendidos	9	7
Redimido	(27)	(48)
Disminución neta	(18)	(41)
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	26	19
Redimido	(41)	(26)
Disminución neta	(15)	(7)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund (continuación)		
Clase A USD de Distribución (A)		
Vendidos	12	3
Redimido	(18)	(11)
Disminución neta	(6)	(8)
Clase A EUR de Capitalización		
Vendidos	4	2
Redimido	(2)	–
Aumento neto	2	2
Clase B USD de Distribución (A)		
Redimido	–	(2)
Disminución neta	–	(2)
Clase C USD de Capitalización		
Vendidos	2	3
Redimido	(9)	(8)
Disminución neta	(7)	(5)
Clase C USD de Distribución (A)		
Vendidos	–	3
Redimido	(3)	(6)
Disminución neta	(3)	(3)
Clase E USD de Capitalización		
Vendidos	3	5
Redimido	(17)	(11)
Disminución neta	(14)	(6)
Clase E USD de Distribución (A)		
Redimido	(1)	–
Disminución neta	(1)	–
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	9	15
Redimido	(30)	(28)
Disminución neta	(21)	(13)
Clase F USD de Distribución (A)		
Vendidos	2	3
Redimido	(3)	(2)
Aumento/(disminución) neto	(1)	1
Clase X USD de Distribución (A)		
Redimido	(2)	–
Disminución neta	(2)	–
Clase X EUR de Capitalización		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	6	18
Redimido	(15)	(26)
Disminución neta	(9)	(8)
Clase Premier USD de Distribución (A)		
Redimido	(1)	(3)
Disminución neta	(1)	(3)
Clase Premier EUR de Capitalización		
Vendidos	37	23
Redimido	(34)	(2)
Aumento neto	3	21
Clase LM USD de Capitalización		
Vendidos	7	11
Redimido	(24)	(8)
Aumento/(disminución) neto	(17)	3
Clase LM EUR de Capitalización		
Vendidos	1	1
Redimido	(6)	(2)
Disminución neta	(5)	(1)
Clase A (G) USD de Capitalización		
Vendidos	–	3
Redimido	(2)	(4)
Disminución neta	(2)	(1)
Clase L (G) USD de Capitalización		
Vendidos	1	–
Redimido	(2)	–
Disminución neta	(1)	–
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	157	104
Redimido	(184)	(173)
Disminución neta	(27)	(69)
Clase A USD de Distribución (A)		
Vendidos	25	23
Redimido	(30)	(32)
Disminución neta	(5)	(9)
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	54	33
Redimido	(21)	(28)
Aumento neto	33	5
Clase A EUR de Capitalización		
Vendidos	23	24
Redimido	(23)	(55)
Disminución neta	–	(31)
Clase C USD de Capitalización		
Vendidos	12	5
Redimido	(22)	(9)
Disminución neta	(10)	(4)
Clase C USD de Distribución (A)		
Vendidos	1	1
Redimido	(4)	(9)
Disminución neta	(3)	(8)
Clase E USD de Capitalización		
Vendidos	7	9
Redimido	(14)	(18)
Disminución neta	(7)	(9)
Clase E USD de Distribución (A)		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	102	210
Redimido	(416)	(209)
Aumento/(disminución) neto	(314)	1
Clase F USD de Distribución (A)		
Vendidos	27	5
Redimido	(39)	(40)
Disminución neta	(12)	(35)
Clase U USD de Capitalización		
Vendidos	338	442
Redimido	(575)	(742)
Disminución neta	(237)	(300)
Clase U USD de Distribución (Q)		
Vendidos	83	–
Aumento neto	83	–
Clase U EUR de Capitalización		
Vendidos	564	22
Redimido	(240)	(350)
Disminución/(aumento) neto	324	(328)
Clase X USD de Capitalización		
Vendidos	54	54
Redimido	(81)	(40)
Aumento/(disminución) neto	(27)	14
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	37	8
Redimido	(9)	(27)
Disminución/(aumento) neto	28	(19)
Clase X EUR de Capitalización		
Vendidos	15	4
Redimido	(3)	(2)
Aumento neto	12	2
Clase X GBP de Capitalización		
Vendidos	30	15
Redimido	(22)	(14)
Aumento neto	8	1
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	785	645
Redimido	(439)	(810)
Disminución/(aumento) neto	346	(165)
Clase Premier USD de Distribución (A)		
Vendidos	2	13
Redimido	(14)	(18)
Disminución neta	(12)	(5)
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	144	–
Redimido	(272)	(761)
Disminución neta	(128)	(761)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund (continuación)		
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	401	107
Redimido	(295)	(94)
Aumento neto	106	13
Clase Premier EUR de Capitalización		
Vendidos	86	29
Redimido	(72)	(177)
Disminución/(aumento) neto	14	(148)
Clase Premier EUR de Distribución (A)		
Vendidos	13	5
Redimido	(5)	(2)
Aumento neto	8	3
Clase Premier GBP de Capitalización		
Vendidos	157	58
Redimido	(94)	(108)
Disminución/(aumento) neto	63	(50)
Clase LM USD de Capitalización		
Vendidos	34	430
Redimido	(211)	(472)
Disminución neta	(177)	(42)
Clase LM EUR de Capitalización		
Redimido	(1)	–
Disminución neta	(1)	–
Clase A (G) USD de Capitalización		
Vendidos	–	1
Redimido	(2)	(2)
Disminución neta	(2)	(1)
Clase L (G) USD de Capitalización		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	36	51
Redimido	(93)	(103)
Disminución neta	(57)	(52)
Clase A USD de Distribución (A)		
Vendidos	5	6
Redimido	(19)	(12)
Disminución neta	(14)	(6)
Clase A AUD de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	6	35
Redimido	(21)	(33)
Aumento/(disminución) neto	(15)	2
Clase A CNH de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	80	43
Redimido	(94)	(44)
Disminución neta	(14)	(1)
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	1
Redimido	–	(1)
Aumento neto	–	–
Clase A EUR de Capitalización		
Vendidos	4	2
Redimido	(5)	(5)
Disminución neta	(1)	(3)
Clase A GBP de Capitalización		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase A HKD de Capitalización		
Redimido	(4)	(2)
Disminución neta	(4)	(2)
Clase A SEK de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	4	1
Redimido	(3)	(1)
Aumento neto	1	–
Clase A SGD de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	3.216	83
Redimido	(840)	(551)
Disminución/(aumento) neto	2.376	(468)
Clase B USD de Capitalización		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
Clase B USD de Distribución (A)		
Redimido	–	(3)
Disminución neta	–	(3)
Clase C USD de Capitalización		
Vendidos	3	1
Redimido	(7)	(10)
Disminución neta	(4)	(9)
Clase C USD de Distribución (A)		
Vendidos	1	1
Redimido	(8)	(10)
Disminución neta	(7)	(9)
Clase E USD de Capitalización		
Vendidos	–	2
Redimido	(7)	(25)
Disminución neta	(7)	(23)
Clase E USD de Distribución (A)		
Redimido	(2)	–
Disminución neta	(2)	–
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	3	6
Redimido	(11)	(10)
Disminución neta	(8)	(4)
Clase F USD de Distribución (A)		
Vendidos	–	1
Redimido	(5)	(4)
Disminución neta	(5)	(3)
Clase X USD de Capitalización		
Vendidos	1	8
Redimido	(6)	(15)
Disminución neta	(5)	(7)
Clase X USD de Distribución (A)		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase X EUR de Capitalización		
Vendidos	–	4
Redimido	(4)	(4)
Disminución neta	(4)	–
Clase X GBP de Capitalización		
Vendidos	13	3
Redimido	(18)	(24)
Disminución neta	(5)	(21)
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	8	40
Redimido	(70)	(718)
Disminución neta	(62)	(678)
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	1	–
Aumento neto	1	–
Clase Premier EUR de Capitalización		
Vendidos	–	1
Redimido	(2)	(1)
Disminución neta	(2)	–
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	1	–
Redimido	(2)	(1)
Disminución neta	(1)	(1)
Clase Premier GBP de Capitalización		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase Premier GBP de Distribución (A)		
Vendidos	10	5
Redimido	(52)	(56)
Disminución neta	(42)	(51)
Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)		
Redimido	–	(33)
Disminución neta	–	(33)
Clase LM EUR de Capitalización		
Redimido	(2)	–
Disminución neta	(2)	–
Clase A (G) USD de Capitalización		
Vendidos	1	6
Redimido	(8)	(13)
Disminución neta	(7)	(7)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund (continuación)		
Clase L (G) USD de Capitalización		
Redimido	(3)	(3)
Disminución neta	(3)	(3)
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	4	21
Redimido	(22)	(11)
Aumento/(disminución) neto	(18)	10
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)		
Redimido	(1)	–
Disminución neta	(1)	–
Clase A USD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	3	15
Redimido	(14)	(9)
Aumento/(disminución) neto	(11)	6
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	–	15
Redimido	(4)	(16)
Disminución neta	(4)	(1)
Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	1	1
Redimido	(1)	(4)
Disminución neta	–	(3)
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	1	1
Redimido	(2)	(5)
Disminución neta	(1)	(4)
Clase A Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	–	3
Redimido	(4)	(3)
Disminución neta	(4)	–
Clase A HKD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	1	3
Redimido	(5)	(55)
Disminución neta	(4)	(52)
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	324	1.444
Redimido	(1.019)	(1.127)
Aumento/(disminución) neto	(695)	317
Clase C USD de Capitalización		
Vendidos	–	1
Redimido	(1)	(1)
Disminución neta	(1)	–
Clase C USD de Distribución (A)		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	16	6
Redimido	(37)	(15)
Disminución neta	(21)	(9)
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	135	96
Redimido	(166)	(72)
Aumento/(disminución) neto	(31)	24
Clase A USD de Distribución (A)		
Vendidos	17	27
Redimido	(25)	(23)
Aumento/(disminución) neto	(8)	4
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	39	66
Redimido	(65)	(160)
Disminución neta	(26)	(94)
Clase A EUR de Capitalización		
Vendidos	12	50
Redimido	(14)	(1)
Aumento/(disminución) neto	(2)	49
Clase A SEK de Capitalización		
Vendidos	88	120
Redimido	(450)	(416)
Disminución neta	(362)	(296)

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	–	16
Redimido	(20)	(15)
Aumento/(disminución) neto	(20)	1
Clase X USD de Capitalización		
Vendidos	25	55
Redimido	(97)	(100)
Disminución neta	(72)	(45)
Clase X USD de Distribución (A)		
Vendidos	1	2
Redimido	(4)	(4)
Disminución neta	(3)	(2)
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	38	17
Redimido	(23)	(11)
Aumento neto	15	6
Clase X EUR de Capitalización		
Vendidos	53	–
Redimido	(8)	(1)
Disminución/(aumento) neto	45	(1)
Clase X GBP de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	4	14
Redimido	(14)	(12)
Aumento/(disminución) neto	(10)	2
Clase X GBP de Capitalización		
Vendidos	536	1.317
Redimido	(1.245)	(547)
Aumento/(disminución) neto	(709)	770
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	224	342
Redimido	(311)	(781)
Disminución neta	(87)	(439)
Clase Premier USD de Distribución (A)		
Vendidos	–	8
Redimido	(117)	(6)
Aumento/(disminución) neto	(117)	2
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	2	31
Redimido	(16)	(14)
Aumento/(disminución) neto	(14)	17
Clase Premier GBP de Capitalización		
Vendidos	64	73
Redimido	(42)	(55)
Aumento neto	22	18
Clase S USD de Capitalización		
Vendidos	1.582	2.151
Redimido	(2.199)	(2.265)
Disminución neta	(617)	(114)
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	4	6
Redimido	(5)	(43)
Disminución neta	(1)	(37)
Clase S EUR de Capitalización		
Vendidos	187	–
Redimido	(75)	–
Aumento neto	112	–
Clase S GBP de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	40	118
Redimido	(186)	(55)
Aumento/(disminución) neto	(146)	63
Clase S GBP de Capitalización		
Vendidos	144	339
Redimido	(516)	(355)
Disminución neta	(372)	(16)
Clase S GBP de Distribución (Q)		
Vendidos	49	24
Redimido	(27)	(44)
Disminución/(aumento) neto	22	(20)
Clase LM EUR de Capitalización		
Vendidos	37	138
Redimido	(61)	(7)
Aumento/(disminución) neto	(24)	131

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
FTGF ClearBridge Global Growth Fund^		
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	14	16
Redimido	(14)	(27)
Disminución neta	–	(11)
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^		
Clase A USD de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	1.469	9.720
Redimido	(3.033)	(9.793)
Disminución neta	(1.564)	(73)
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	206	3.013
Redimido	(1.432)	(3.756)
Disminución neta	(1.226)	(743)
Clase A USD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	1.143	4.500
Redimido	(1.908)	(5.071)
Disminución neta	(765)	(571)
Clase A USD de Distribución (Q)		
Vendidos	42	95
Redimido	(89)	(111)
Disminución neta	(47)	(16)
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	128	711
Redimido	(111)	(1.182)
Disminución/(aumento) neto	17	(471)
Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	10.144	16.667
Redimido	(6.620)	(5.439)
Aumento neto	3.524	11.228
Clase A Euro de Capitalización (cubierta) (PH)		
Vendidos	71	406
Redimido	(360)	(288)
Aumento/(disminución) neto	(289)	118
Clase A EUR de Capitalización		
Vendidos	4.494	7.976
Redimido	(6.167)	(3.080)
Aumento/(disminución) neto	(1.673)	4.896
Clase A EUR de Distribución (A)		
Vendidos	17	45
Redimido	(17)	–
Aumento neto	–	45
Clase A Euro de Distribución (M) Plus		
Vendidos	150	290
Redimido	(168)	(185)
Aumento/(disminución) neto	(18)	105
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	2.945	8.620
Redimido	(2.177)	(8.849)
Disminución/(aumento) neto	768	(229)
Clase C USD de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	36	64
Redimido	(68)	(16)
Aumento/(disminución) neto	(32)	48
Clase C USD de Capitalización		
Vendidos	140	57
Redimido	(327)	(95)
Disminución neta	(187)	(38)
Clase E USD de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	14	213
Redimido	(124)	(93)
Aumento/(disminución) neto	(110)	120
Clase E USD de Capitalización		
Vendidos	53	228
Redimido	(222)	(375)
Disminución neta	(169)	(147)
Clase E EUR de Capitalización		
Vendidos	12	–
Redimido	(3)	–
Aumento neto	9	–

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
Clase F USD de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	50	556
Redimido	(371)	(54)
Aumento/(disminución) neto	(321)	502
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	182	448
Redimido	(194)	(186)
Aumento/(disminución) neto	(12)	262
Clase U EUR de Capitalización		
Vendidos	7.090	–
Redimido	(2.566)	–
Aumento neto	4.524	–
Clase X USD de Capitalización		
Vendidos	28	128
Redimido	(137)	(4)
Aumento/(disminución) neto	(109)	124
Clase X USD de Distribución (A)		
Vendidos	42	8
Redimido	(54)	(5)
Aumento/(disminución) neto	(12)	3
Clase X Euro de Capitalización (cubierta) (PH)		
Vendidos	641	969
Redimido	(1.363)	(318)
Aumento/(disminución) neto	(722)	651
Clase X EUR de Capitalización		
Vendidos	1.200	3.299
Redimido	(3.580)	(1.267)
Aumento/(disminución) neto	(2.380)	2.032
Clase X GBP de Distribución (Q) (cubierta)		
Vendidos	–	42
Redimido	(34)	(75)
Disminución neta	(34)	(33)
Clase X GBP de Distribución (Q)		
Vendidos	69	89
Redimido	(120)	(21)
Aumento/(disminución) neto	(51)	68
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	718	9.228
Redimido	(3.209)	(5.090)
Aumento/(disminución) neto	(2.491)	4.138
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	567
Redimido	(485)	(1.620)
Disminución neta	(485)	(1.053)
Clase Premier CAD de Distribución (Q) (cubierta) (PH) Plus (e)		
Vendidos	169	133
Redimido	(810)	(656)
Disminución neta	(641)	(523)
Clase Premier CAD de Distribución (Q) Plus (e)		
Vendidos	–	14
Redimido	–	(825)
Disminución neta	–	(811)
Clase Premier Euro de Capitalización (cubierta) (PH)		
Vendidos	926	26
Redimido	(642)	(297)
Disminución/(aumento) neto	284	(271)
Clase Premier EUR de Capitalización		
Vendidos	7.787	12.764
Redimido	(12.493)	(3.585)
Aumento/(disminución) neto	(4.706)	9.179
Clase Premier GBP de Capitalización		
Vendidos	12	13
Redimido	(27)	(355)
Disminución neta	(15)	(342)
Clase Premier GBP de Distribución (A) (cubierta) (PH) Plus (e)		
Vendidos	14	360
Redimido	(458)	(586)
Disminución neta	(444)	(226)
Clase Premier GBP de Distribución (Q)		
Vendidos	1.501	2.346
Redimido	(2.586)	(2.310)
Aumento/(disminución) neto	(1.085)	36

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^		
Clase A USD de Capitalización		
Redimido	–	(3)
Disminución neta	–	(3)
Clase A USD de Distribución (Q)		
Redimido	–	(2)
Disminución neta	–	(2)
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)		
Redimido	–	(7)
Disminución neta	–	(7)
Clase X GBP de Distribución (Q)		
Redimido	–	(7)
Disminución neta	–	(7)
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Redimido	–	(9)
Disminución neta	–	(9)
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	15	203
Redimido	(92)	(92)
Aumento/(disminución) neto	(77)	111
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)		
Vendidos	48	187
Redimido	(201)	(224)
Disminución neta	(153)	(37)
Clase A USD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	48	543
Redimido	(200)	(143)
Aumento/(disminución) neto	(152)	400
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	8	100
Redimido	(36)	(36)
Aumento/(disminución) neto	(28)	64
Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	58	97
Redimido	(29)	(12)
Aumento neto	29	85
Clase A EUR de Distribución (A) Plus (e)		
Vendidos	–	1
Aumento neto	–	1
Clase A Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	12	64
Redimido	(18)	(9)
Aumento/(disminución) neto	(6)	55
Clase A GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	4	50
Redimido	(6)	(3)
Aumento/(disminución) neto	(2)	47
Clase A HKD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	–	63
Redimido	(54)	(81)
Disminución neta	(54)	(18)
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	11.949	98.637
Redimido	(24.627)	(38.661)
Aumento/(disminución) neto	(12.678)	59.976
Clase U USD de Capitalización		
Vendidos	128	48
Redimido	(68)	–
Aumento neto	60	48
Clase U USD de Distribución (Q) Plus (e)		
Vendidos	61	–
Redimido	(13)	–
Aumento neto	48	–
Clase U EUR de Capitalización		
Vendidos	12	86
Redimido	(67)	–
Aumento/(disminución) neto	(55)	86
Clase U EUR de Distribución (Q) Plus (e)		
Vendidos	1	1
Redimido	(2)	–
Aumento/(disminución) neto	(1)	1
Clase U GBP de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	2	–
Aumento neto	2	–
Clase U GBP de Capitalización		
Vendidos	10	27
Redimido	(7)	–
Aumento neto	3	27
Clase U GBP de Distribución (Q) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	4	–
Redimido	(2)	–
Aumento neto	2	–
Clase U GBP de Distribución (Q) Plus (e)		
Vendidos	7	–
Redimido	(1)	–
Aumento neto	6	–
Clase X USD de Distribución (M) Plus (e)		
Vendidos	65	577
Redimido	(237)	(395)
Aumento/(disminución) neto	(172)	182
Clase X EUR de Distribución (M) (cubierta)		
Vendidos	–	5
Redimido	(1)	(1)
Aumento/(disminución) neto	(1)	4
Clase X EUR de Distribución (Q) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	7	23
Redimido	(22)	(4)
Aumento/(disminución) neto	(15)	19
Clase X GBP de Distribución (Q) (cubierta) Plus (e)		
Vendidos	1	9
Redimido	(5)	(4)
Aumento/(disminución) neto	(4)	5
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	5	97
Redimido	(9)	(116)
Disminución neta	(4)	(19)
Clase Premier USD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	216	1.047
Redimido	(155)	(438)
Aumento neto	61	609
Clase Premier EUR de Distribución (M) (cubierta)		
Vendidos	61	367
Redimido	(106)	(25)
Aumento/(disminución) neto	(45)	342
Clase S USD de Capitalización		
Vendidos	67	322
Redimido	(56)	(43)
Aumento neto	11	279
Clase S USD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	9	101
Redimido	(33)	(30)
Aumento/(disminución) neto	(24)	71
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^η		
Clase A SGD de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	14	–
Aumento neto	14	–
Clase S USD de Capitalización		
Vendidos	50	–
Aumento neto	50	–
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	161	118
Redimido	(176)	(244)
Disminución neta	(15)	(126)
Clase A USD de Distribución (A)		
Vendidos	5	5
Redimido	(9)	(10)
Disminución neta	(4)	(5)
Clase A AUD de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	24	34
Redimido	(28)	(36)
Disminución neta	(4)	(2)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund (continuación)		
Clase A CNH de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	158	54
Redimido	(129)	(42)
Aumento neto	29	12
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	30	61
Redimido	(60)	(53)
Aumento/(disminución) neto	(30)	8
Clase A EUR de Capitalización		
Vendidos	39	41
Redimido	(51)	(74)
Disminución neta	(12)	(33)
Clase A EUR de Distribución (A) (cubierta)		
Vendidos	1	5
Redimido	(1)	(6)
Disminución neta	–	(1)
Clase A GBP de Capitalización (cubierta)		
Redimido	(1)	(2)
Disminución neta	(1)	(2)
Clase A GBP de Distribución (A)		
Redimido	(1)	–
Disminución neta	(1)	–
Clase A SEK de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	2	15
Redimido	(3)	(15)
Disminución neta	(1)	–
Clase A SGD de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	8.696	3.936
Redimido	(4.281)	(3.306)
Aumento neto	4.415	630
Clase A SGD de Capitalización		
Vendidos	1.913	857
Redimido	(4.463)	(914)
Disminución neta	(2.550)	(57)
Clase C USD de Capitalización		
Vendidos	10	9
Redimido	(17)	(13)
Disminución neta	(7)	(4)
Clase C USD de Distribución (A)		
Vendidos	2	1
Redimido	(2)	(1)
Aumento neto	–	–
Clase E USD de Capitalización		
Vendidos	24	13
Redimido	(23)	(16)
Disminución/(aumento) neto	1	(3)
Clase E Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	12	2
Redimido	(3)	(1)
Aumento neto	9	1
Clase E EUR de Capitalización		
Vendidos	5	3
Redimido	(2)	(2)
Aumento neto	3	1
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	2	5
Redimido	(18)	(37)
Disminución neta	(16)	(32)
Clase R EUR de Capitalización		
Vendidos	1	–
Redimido	(1)	–
Aumento neto	–	–
Clase X USD de Capitalización		
Vendidos	123	149
Redimido	(103)	(93)
Aumento neto	20	56
Clase X USD de Distribución (A)		
Redimido	–	(2)
Disminución neta	–	(2)
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	57	87
Redimido	(52)	(130)
Disminución/(aumento) neto	5	(43)
Clase X EUR de Capitalización		
Vendidos	40	14
Redimido	(18)	(54)
Disminución/(aumento) neto	22	(40)
Clase X GBP de Capitalización		
Vendidos	17	34
Redimido	(32)	(37)
Disminución neta	(15)	(3)
Clase X GBP de Distribución (A)		
Vendidos	1	3
Redimido	(3)	(5)
Disminución neta	(2)	(2)
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	244	172
Redimido	(419)	(253)
Disminución neta	(175)	(81)
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)		
Redimido	(60)	(338)
Disminución neta	(60)	(338)
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)		
Vendidos	58	27
Redimido	(22)	(7)
Aumento neto	36	20
Clase Premier EUR de Capitalización		
Vendidos	38	68
Redimido	(59)	(97)
Disminución neta	(21)	(29)
Clase Premier GBP de Capitalización		
Vendidos	56	22
Redimido	(94)	(73)
Disminución neta	(38)	(51)
Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	97	10
Redimido	(8)	(48)
Disminución/(aumento) neto	89	(38)
FTGF Royce US Smaller Companies Fund		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	43	13
Redimido	(42)	(33)
Disminución/(aumento) neto	1	(20)
Clase A USD de Distribución (A)		
Vendidos	4	3
Redimido	(7)	(7)
Disminución neta	(3)	(4)
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	1
Redimido	–	(1)
Aumento neto	–	–
Clase A EUR de Capitalización		
Vendidos	2	2
Redimido	(4)	(2)
Disminución neta	(2)	–
Clase A EUR de Distribución (A)		
Vendidos	1	–
Aumento neto	1	–
Clase A SEK de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	1	5
Redimido	(1)	(5)
Aumento neto	–	–
Clase C USD de Capitalización		
Vendidos	1	1
Redimido	(1)	(2)
Disminución neta	–	(1)
Clase C USD de Distribución (A)		
Redimido	(1)	–
Disminución neta	(1)	–
Clase E USD de Capitalización		
Vendidos	1	–
Redimido	(1)	–
Aumento neto	–	–
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	15	7
Redimido	(5)	(6)
Aumento neto	10	1

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
FTGF Royce US Smaller Companies Fund (continuación)		
Clase F USD de Distribución (A)		
Vendidos	1	–
Redimido	(1)	–
Aumento neto	–	–
Clase R USD de Capitalización		
Redimido	(1)	–
Disminución neta	(1)	–
Clase X USD de Capitalización		
Redimido	–	(2)
Disminución neta	–	(2)
Clase X USD de Distribución (A)		
Vendidos	1	–
Redimido	(1)	–
Aumento neto	–	–
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	37	–
Redimido	(8)	(1)
Disminución/(aumento) neto	29	(1)
Clase Premier USD de Distribución (A)		
Vendidos	4	4
Redimido	(10)	(14)
Disminución neta	(6)	(10)
Clase Premier GBP de Distribución (A)		
Vendidos	2	–
Redimido	(1)	(1)
Disminución/(aumento) neto	1	(1)
Clase LM EUR de Capitalización		
Redimido	(2)	(1)
Disminución neta	(2)	(1)
Clase A (G) USD de Capitalización		
Vendidos	–	1
Redimido	(1)	(1)
Disminución neta	(1)	–
Clase L (G) USD de Capitalización		
Redimido	–	(2)
Disminución neta	–	(2)
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^		
Clase A USD de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	1
Redimido	–	(10)
Disminución neta	–	(9)
Clase A USD de Capitalización		
Redimido	–	(7)
Disminución neta	–	(7)
Clase A USD de Distribución (A)		
Redimido	–	(5)
Disminución neta	–	(5)
Clase A USD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Redimido	–	(48)
Disminución neta	–	(48)
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Redimido	–	(23)
Disminución neta	–	(23)
Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Redimido	–	(11)
Disminución neta	–	(11)
Clase A EUR de Capitalización		
Redimido	–	(2)
Disminución neta	–	(2)
Clase A EUR de Distribución (A)		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase A Euro de Distribución (M) Plus		
Redimido	–	(4)
Disminución neta	–	(4)
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	–	41
Redimido	–	(431)
Disminución neta	–	(390)
Clase C USD de Capitalización		
Redimido	–	(2)
Disminución neta	–	(2)
Clase C USD de Distribución (A)		
Redimido	–	(8)
Disminución neta	–	(8)
Clase E USD de Capitalización (cubierta)		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase F USD de Capitalización		
Redimido	–	(3)
Disminución neta	–	(3)
Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)		
Redimido	–	(18)
Disminución neta	–	(18)
Clase LM EUR de Capitalización		
Redimido	–	(15)
Disminución neta	–	(15)
Clase A (G) USD de Capitalización		
Redimido	–	(10)
Disminución neta	–	(10)
Clase L (G) USD de Capitalización		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase GA USD de Capitalización		
Redimido	–	(5)
Disminución neta	–	(5)
Clase GA EUR de Capitalización		
Redimido	–	(62)
Disminución neta	–	(62)
Clase GA EUR de Distribución (A)		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^δ		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	–	5
Redimido	(12)	(6)
Disminución neta	(12)	(1)
Clase A USD de Distribución (A)		
Vendidos	–	2
Redimido	(13)	(2)
Disminución neta	(13)	–
Clase A USD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	–	4
Redimido	(38)	(6)
Disminución neta	(38)	(2)
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	–	54
Redimido	(45)	(39)
Aumento/(disminución) neto	(45)	15
Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	–	16
Redimido	(16)	(16)
Disminución neta	(16)	–
Clase A EUR de Capitalización		
Vendidos	–	2
Redimido	(1)	(3)
Disminución neta	(1)	(1)
Clase A HKD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	–	2
Redimido	(139)	(29)
Disminución neta	(139)	(27)
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	–	21
Redimido	(48)	(15)
Aumento/(disminución) neto	(48)	6
Clase C USD de Capitalización		
Redimido	(1)	–
Disminución neta	(1)	–

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^δ (continuación)		
Clase C USD de Distribución (A)		
Vendidos	–	1
Redimido	(6)	(2)
Disminución neta	(6)	(1)
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	–	2
Redimido	(2)	–
Aumento/(disminución) neto	(2)	2
Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	–	1
Redimido	(1)	(66)
Disminución neta	(1)	(65)
Clase GA USD de Capitalización		
Redimido	(45)	(1)
Disminución neta	(45)	(1)
Clase GA EUR de Capitalización		
Redimido	(1)	–
Disminución neta	(1)	–
Clase GE USD de Capitalización		
Redimido	(4)	–
Disminución neta	(4)	–
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^		
Clase A USD de Capitalización		
Redimido	–	(12)
Disminución neta	–	(12)
Clase A USD de Distribución (M) Plus		
Redimido	–	(3)
Disminución neta	–	(3)
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Redimido	–	(6)
Disminución neta	–	(6)
Clase A HKD de Distribución (M) Plus		
Redimido	–	(13)
Disminución neta	–	(13)
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Vendidos	–	1
Redimido	–	(69)
Disminución neta	–	(68)
Clase Premier USD de Capitalización		
Redimido	–	(25)
Disminución neta	–	(25)
Clase GA USD de Capitalización		
Redimido	–	(20)
Disminución neta	–	(20)
Clase GA EUR de Capitalización		
Redimido	–	(5)
Disminución neta	–	(5)
Clase GA EUR de Distribución (A)		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase GE EUR de Capitalización		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^β		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	–	4
Redimido	(1)	(3)
Aumento/(disminución) neto	(1)	1
Clase M GBP de Distribución (A)		
Vendidos	–	3
Redimido	(85)	(16)
Disminución neta	(85)	(13)
Clase M USD de Distribución (A)		
Vendidos	–	1
Redimido	(26)	–
Aumento/(disminución) neto	(26)	1
Clase M EUR de Distribución (A)		
Redimido	(4)	–
Disminución neta	(4)	–

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	–	15
Redimido	(15)	(131)
Disminución neta	(15)	(116)
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	5	8
Redimido	(10)	(13)
Disminución neta	(5)	(5)
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	1	–
Redimido	(1)	(52)
Disminución neta	–	(52)
Clase A EUR de Capitalización		
Vendidos	1	26
Redimido	(11)	(11)
Aumento/(disminución) neto	(10)	15
Clase C USD de Capitalización		
Redimido	(1)	–
Disminución neta	(1)	–
Clase E USD de Capitalización		
Vendidos	5	1
Redimido	(13)	(11)
Disminución neta	(8)	(10)
Clase F USD de Capitalización		
Redimido	(1)	–
Disminución neta	(1)	–
Clase X USD de Capitalización		
Vendidos	–	1
Redimido	–	(1)
Aumento neto	–	–
Clase X EUR de Capitalización		
Vendidos	–	1
Aumento neto	–	1
Clase X GBP de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	5	6
Redimido	(4)	(2)
Aumento neto	1	4
Clase X GBP de Capitalización		
Vendidos	5	1
Redimido	(5)	(1)
Aumento neto	–	–
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	5	54
Redimido	(21)	(161)
Disminución neta	(16)	(107)
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)		
Redimido	(3)	–
Disminución neta	(3)	–
Clase S USD de Capitalización		
Redimido	(63)	(8)
Disminución neta	(63)	(8)
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	207	616
Redimido	(523)	(294)
Aumento/(disminución) neto	(316)	322
Clase S GBP de Capitalización		
Vendidos	54	2
Redimido	(67)	(18)
Disminución neta	(13)	(16)
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund		
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)		
Vendidos	3	3
Redimido	(15)	–
Aumento/(disminución) neto	(12)	3
Clase A SGD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	19	48
Redimido	(18)	(53)
Disminución/(aumento) neto	1	(5)
Clase D AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Redimido	(6)	(2)
Disminución neta	(6)	(2)

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund (continuación)		
Clase D SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus		
Redimido	(89)	(807)
Disminución neta	(89)	(807)
Clase D USD de Distribución (M) Plus		
Vendidos	–	2
Redimido	(10)	–
Aumento/(disminución) neto	(10)	2
Clase D USD de Capitalización		
Redimido	(12)	–
Disminución neta	(12)	–
Clase X AUD de Capitalización		
Vendidos	–	1
Redimido	(2)	(1)
Disminución neta	(2)	–
Clase X USD de Capitalización		
Vendidos	–	3
Redimido	(1)	(2)
Aumento/(disminución) neto	(1)	1
Clase LM AUD de Capitalización		
Redimido	–	(5)
Disminución neta	–	(5)
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	15	21
Redimido	(20)	(35)
Disminución neta	(5)	(14)
Clase E USD de Capitalización		
Vendidos	–	2
Redimido	(2)	(1)
Aumento/(disminución) neto	(2)	1
Clase F USD de Capitalización		
Vendidos	21	81
Redimido	(29)	(36)
Aumento/(disminución) neto	(8)	45
Clase X USD de Capitalización		
Redimido	–	(6)
Disminución neta	–	(6)
Clase Premier USD de Capitalización		
Vendidos	–	26
Redimido	(20)	(44)
Disminución neta	(20)	(18)
Clase S USD de Capitalización		
Vendidos	1	1
Redimido	(2)	(14)
Disminución neta	(1)	(13)
Clase S EUR de Capitalización		
Vendidos	–	1
Redimido	–	(45)
Disminución neta	–	(44)
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^		
Clase A USD de Capitalización (cubierta)		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase A EUR de Capitalización		
Vendidos	2	10
Redimido	(3)	(44)
Disminución neta	(1)	(34)
Clase E USD de Capitalización (cubierta)		
Redimido	–	(1)
Disminución neta	–	(1)
Clase X EUR de Capitalización		
Vendidos	3	3
Redimido	(3)	(11)
Disminución neta	–	(8)
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	15	–
Redimido	(58)	(115)
Disminución neta	(43)	(115)
Clase Premier EUR de Capitalización		
Vendidos	1	7
Redimido	(1)	(170)
Disminución neta	–	(163)

	Para el ejercicio cerrado a	
	29 de febrero de 2024 Acciones (en miles)	**28 de febrero de 2023 Acciones (en miles)**
Clase S USD de Capitalización		
Vendidos	–	5
Redimido	–	(5)
Aumento neto	–	–
Clase S EUR de Capitalización		
Vendidos	40	113
Redimido	(85)	(567)
Disminución neta	(45)	(454)
Clase S GBP de Capitalización		
Vendidos	76	136
Redimido	(361)	(142)
Disminución neta	(285)	(6)
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^γ		
Clase A USD de Capitalización		
Vendidos	1	–
Aumento neto	1	–
Clase X GBP de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	10	–
Redimido	(3)	–
Aumento neto	7	–
Clase S USD de Capitalización		
Vendidos	47	–
Aumento neto	47	–
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	1	–
Aumento neto	1	–
Clase S GBP de Capitalización (cubierta)		
Vendidos	4	–
Aumento neto	4	–
Franklin Responsible Income 2028 Fund^		
Clase A EUR de Capitalización		
Vendidos	123	1
Redimido	(27)	–
Aumento neto	96	1
Clase A EUR de Distribución (A) Plus		
Vendidos	–	1
Redimido	(1)	–
Aumento/(disminución) neto	(1)	1
Clase A EUR de Distribución (A)		
Vendidos	413	52
Redimido	(32)	(1)
Aumento neto	381	51
Clase D EUR de Capitalización		
Vendidos	15	1
Redimido	(5)	–
Aumento neto	10	1
Clase D EUR de Distribución (A)		
Vendidos	2	1
Redimido	(1)	–
Aumento neto	1	1
Clase K EUR de Capitalización		
Vendidos	–	1
Redimido	(1)	–
Aumento/(disminución) neto	(1)	1
Clase K EUR de Distribución (A)		
Vendidos	–	1
Redimido	(1)	–
Aumento/(disminución) neto	(1)	1
Clase X EUR de Capitalización		
Vendidos	5	97
Redimido	(97)	–
Aumento/(disminución) neto	(92)	97
Clase X EUR de Distribución (A)		
Vendidos	201	221
Redimido	(128)	–
Aumento neto	73	221

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los Accionistas con participación reembolsable *(continuación)*

– *Los importes que se indican con "–" equivalen a 0 o son inferiores a 1.000. 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^ y FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ dejaron de operar.*

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

γ *A partir del 20 de junio de 2023, FTGF Martin Currie Improving Society Fund^ comenzó a operar.*

δ *El 17 de julio de 2023, FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^ dejó de cotizar en bolsa.*

η *A partir del 22 de septiembre de 2023, FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^ comenzó a operar.*

θ *A partir del 23 de octubre de 2023, FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^ dejó de operar.*

λ *A partir del 6 de noviembre de 2023, FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^ comenzó a operar.*

μ *A partir del 10 de noviembre de 2023, FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^ dejó de operar.*

¥ *A partir del 5 de diciembre de 2023, FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^ dejó de operar.*

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

Las notas adjuntas forman parte integral de los Estados financieros

Notas relativas a los estados financieros

1. Generalidades

Franklin Templeton Global Funds plc (la "Sociedad") es una sociedad de inversión abierta de capital variable constituida de acuerdo con la legislación irlandesa como sociedad anónima con arreglo a la Ley de Sociedades de 2014, el Reglamento de las Comunidades Europeas de 2011 (Organismos de Inversión Colectiva en Valores Mobiliarios) (con sus modificaciones) (el "Reglamento sobre OICVM") y el Reglamento sobre OICVM del Banco Central. Se constituyó el 13 de enero de 1998 con el número de registro 278601.

Su objeto social, tal y como se recoge en sus documentos de constitución, es la inversión colectiva en valores mobiliarios y en otros activos financieros líquidos con capital obtenido del público y que se utilizan sobre el principio de la diversificación de riesgos. La Sociedad está constituida bajo la forma de un fondo paraguas. Los documentos constitutivos de la Sociedad establecen que la Sociedad puede ofrecer clases separadas de acciones, cada una de las cuales representa intereses en un subfondo (el "Fondo" o los "Fondos" colectivamente) que comprende una cartera de inversiones diferenciada. No se mantendrá una cartera de activos separada para una clase. Los Fondos establecidos por la Sociedad se incluyen en el apartado de Información general de este informe. El principal objetivo de inversión y las políticas de todos los Fondos se establecen en el suplemento al Folleto del Fondo correspondiente.

2. Políticas contables relevantes

Las políticas contables relevantes y las técnicas de estimación adoptadas por la Sociedad en la elaboración de los estados financieros son las siguientes.

Declaración de conformidad

Los estados financieros correspondientes al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024 se han preparado de acuerdo con las normas contables generalmente aceptadas en Irlanda, incluida la Norma de Información Financiera ("NIF") 102: "La Norma de Información Financiera aplicable en el Reino Unido y la República de Irlanda" ("NIF 102") y el Estatuto irlandés que comprende la Ley de Sociedades de 2014, el Reglamento sobre OICVM y el Reglamento sobre OICVM del Banco Central. Estas políticas son compatibles con las políticas aplicadas en los estados financieros correspondientes al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023.

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 reevaluación de los activos y pasivos financieros reconocidos a valor razonable en la cuenta de resultados. Los estados financieros 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^, FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^, FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^, FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate 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 Enhanced Absolute Return 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^, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^, Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund^, Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^, Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund^ y Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^ han sido preparados sobre la base de que no son una empresa en funcionamiento, ya que estos Fondos se cerraron durante el ejercicio en curso y el anterior, o con posterioridad a la fecha del Estado de Situación Financiera.

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 el patrimonio neto atribuible a los accionistas con participación reembolsable.

(a) Inversiones a valor razonable

La Sociedad clasificó todos los instrumentos financieros, incluidas sus inversiones en valores de deuda y de renta variable, y los valores vendidos en corto, así como los derivados relacionados, como activos financieros o pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados. Estos activos y pasivos financieros se clasifican como mantenidos con fines de negociación a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias. Los activos o pasivos financieros mantenidos con fines de negociación se adquieren con el fin de venderlos o recomprarlos a corto plazo. Los derivados también se clasifican como mantenidos para negociar, ya que la Sociedad no clasifica ningún derivado como cobertura en una relación de cobertura.

Los activos y pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias se contabilizan inicialmente al valor razonable. Los costes de transacción se contabilizan como gastos en el Estado de resultado global. Posteriormente a la contabilización inicial, todos los activos y pasivos financieros expresados a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias se miden al valor razonable. Las pérdidas y ganancias procedentes de cambios en el valor razonable de los activos o pasivos financieros a valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias se incluyen en el Estado de resultado global del ejercicio financiero en el que se producen.

El valor razonable de los instrumentos financieros negociados en mercados activos (como derivados negociados públicamente y valores negociables) se basa en precios de cotización de mercado referidos en la fecha del Estado de situación financiera. Los instrumentos financieros (incluidos los bonos) mantenidos por los Fondos, que cotizan o se negocian en un mercado regulado, se valoran sobre la base del último precio medio disponible en el día de la operación. El valor razonable de los organismos de inversión colectiva se basa en el valor neto de los activos negociado del fondo en cuestión en la fecha del Estado de la Situación Financiera, según lo dispuesto por el administrador del fondo.

La Sociedad podrá invertir en cualquier momento en instrumentos financieros que no se negocien en un mercado activo (por ejemplo, en derivados extrabursátiles). El valor razonable se determina utilizando técnicas de valoración. La Sociedad utiliza distintos métodos y realiza suposiciones que se basan en las condiciones del mercado existentes en cada fecha del Estado de la Situación Financiera. Las técnicas de valoración utilizadas incluyen el uso de transacciones comparables recientes en condiciones de plena competencia, análisis de flujos de efectivo descontados y otras técnicas de valoración utilizadas habitualmente por los participantes en el mercado. Los valores asignados a estos instrumentos se basan en la mejor información disponible y, debido a la incertidumbre de la valoración, estos valores pueden diferir significativamente de los valores que se habrían materializado si hubiera existido un mercado preparado para estos instrumentos y las diferencias podrían ser significativas. La celebración de estos contratos implica, en diversos grados, elementos de riesgo de crédito, legal, de mercado y de documentación que superen los importes reconocidos en el Estado de ingresos globales. Estos riesgos implican la posibilidad de que no haya un mercado líquido para estos acuerdos, que las contrapartes de los acuerdos puedan incumplir sus obligaciones de cumplir o discrepar en cuanto al significado de los términos contractuales en los acuerdos, o que pueda haber cambios desfavorables en los tipos de interés o en el precio del índice o valor subyacente a estas transacciones. Los precios utilizados al final del ejercicio que se han obtenido de una única fuente de intermediación o basados en técnicas de valoración son la mejor estimación del valor razonable a la fecha de cierre del ejercicio. Sin embargo, existe cierta incertidumbre con respecto a estos precios. Puede que no siempre sea posible cerrar las posiciones al valor de mercado declarado con la contraparte correspondiente.

(b) Contabilización/cancelación

Las compras y las ventas de inversiones por vía regular se contabilizan en la fecha de negociación más uno, que es la fecha en la que la Sociedad se compromete a efectuar la compra o la venta del activo. Las inversiones se contabilizan inicialmente a su valor razonable y los costes de transacción de todos los activos asentados a su valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias se imputan en cuando se producen. Las inversiones se dejan de contabilizar cuando los derechos para recibir flujos de efectivo procedentes de las inversiones han expirado o bien cuando la Sociedad ha transferido prácticamente todos los riesgos y los beneficios de los derechos de propiedad.

(c) Precios de un único agente

Los precios utilizados al final del ejercicio que se han obtenido de una fuente de un único agente son la mejor estimación del valor razonable a la fecha de cierre del ejercicio. Sin embargo, existe cierta incertidumbre con respecto a estos precios. Puede que no siempre sea posible cerrar las posiciones al valor de mercado declarado con la contraparte correspondiente. Los valores de los valores de cada Fondo que se han cotizado utilizando fuentes de un único agente a 29 de febrero de 2024 y a 28 de febrero de 2023 se declaran en la Nota 12.1 (d).

(d) Contabilización de inversiones

Las transacciones de valores se contabilizan en el día siguiente a la fecha de negociación. Las inversiones se contabilizan inicialmente a su valor razonable y los costes de transacción de todos los activos asentados a su valor razonable en la cuenta de pérdidas y ganancias se imputan en cuanto se producen. Las ganancias o pérdidas sobre la venta de títulos se calculan usando el método de primero en entrar, primero en salir (FIFO, por sus siglas en inglés).

(e) Ingresos de inversiones

Los ingresos y gastos de intereses se contabilizan en el Estado de resultado global para todos los instrumentos de deuda utilizando el método de interés efectivo. Los Gestores y los Subgestores de Inversiones controlan los ingresos por intereses a cobrar por los importes de intereses devengados por mora. Se han revisado los intereses devengados por mora de las cuentas y, a 29 de junio de 2024 y a 28 de junio de 2023, todos los importes se consideraban recuperables.

Los dividendos se registran en el Estado de ingresos globales en las fechas en las que los títulos relevantes cotizan como "ex dividendo". Los ingresos por dividendos se muestran brutos, sin retenciones impositivas no recuperables, que se indican de forma independiente en el Estado del resultado global.

(f) Instrumentos financieros compensatorios

Los activos y pasivos financieros se compensan y el importe neto se indica en el Estado de situación financiera cuando hay un derecho exigible por ley de compensar los importes contabilizados y el propósito es realizar una liquidación neta o realizar el activo y liquidar el pasivo simultáneamente. No hubo instrumentos financieros compensatorios a 29 de junio de 2024 ni a 28 de junio de 2023.

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

2. Políticas contables relevantes (continuación)

(g) Estimaciones y supuestos contables fundamentales

La dirección realiza estimaciones y establece supuestos relativos al futuro. Por definición, las estimaciones contables resultantes rara vez coincidirán con los resultados reales correspondientes. Las estimaciones y supuestos que conllevan un riesgo significativo de causar un ajuste material en los importes de los activos y pasivos que se trasladan al siguiente ejercicio financiero se detallan a continuación.

Valor razonable de instrumentos financieros derivados

La Sociedad podrá, en cualquier momento, mantener instrumentos financieros que no coticen en mercados activos, como los derivados extrabursátiles. Los valores razonables de dichos instrumentos se determinan utilizando técnicas de valoración como se explica en la Nota 2(a). Cuando se utilizan técnicas de valoración (por ejemplo, modelos) para determinar los valores razonables, se validan y revisan periódicamente y se comparan con el precio proporcionado por un proveedor de servicios de fijación de precios independiente, si está disponible.

Los modelos utilizan datos observables, en la medida de lo posible. Sin embargo, áreas como el riesgo de crédito (propio y contraparte), las volatilidades y las correlaciones requieren que la dirección haga estimaciones. Los cambios en las suposiciones sobre estos factores podrían afectar al valor razonable declarado de los instrumentos financieros.

Los valores asignados a estos instrumentos se basan en la mejor información disponible y, debido a la incertidumbre de la valoración, estos valores pueden diferir significativamente de los valores que se habrían materializado si hubiera existido un mercado preparado para estos instrumentos y las diferencias podrían ser significativas. La celebración de estos contratos implica, en distintos grados, elementos de riesgo de crédito, legal, de mercado y de documentación que excedan de los importes reconocidos en el Estado de ingresos globales Estos riesgos implican la posibilidad de que no haya un mercado líquido para estos acuerdos, que las contrapartes de los acuerdos puedan incumplir sus obligaciones de cumplir o discrepar en cuanto al significado de los términos contractuales en los acuerdos, o que pueda haber cambios desfavorables en los tipos de interés o en el precio del índice o valor subyacente a estas transacciones.

(h) Préstamo de valores

Ciertos Fondos pueden prestar valores a agentes, intermediarios y otras organizaciones financieras para obtener ingresos adicionales. Cada préstamo de garantía está garantizado con activos de garantía por un importe igual o superior al valor actual de mercado de los valores prestados. Existe el riesgo de demora en la recepción de la garantía o en la recuperación de los valores prestados, o incluso de pérdida de derechos sobre la garantía si el prestatario fracasa financieramente.

A 29 de febrero de 2024 y 28 de febrero de 2023, ningún Fondo se dedicaba al préstamo de valores.

(i) Compensación

Se mantiene una cuenta de compensación a fin de que la cantidad distribuida sea igual para todas las acciones del mismo tipo, independientemente de sus fechas de emisión. Los ingresos y gastos por compensación se registran en el Estado de resultado global.

Ingresos de compensación

Son una suma igual a la parte del precio de emisión de una acción que refleja el ingreso acumulado y no distribuido hasta la fecha de emisión se considerará como pago de compensación y se tratará como pagado de nuevo por los accionistas en el primer dividendo al que tenía derecho el accionista en el mismo periodo contable de emisión de las acciones.

Gastos de compensación

Son una suma igual a la parte del precio de emisión de una acción que refleja el gasto acumulado y no distribuido hasta la fecha de emisión se considerará como cobro de compensación y se tratará como pagado de nuevo a los accionistas en el primer dividendo al que tenía derecho el accionista en el mismo periodo contable de emisión de las acciones.

(j) Gastos

Los gastos se contabilizan conforme al principio de devengo. Algunos gastos son específicamente imputables a las Clases de Acciones y se cargan directamente a cada Clase. Los gastos generales de los Fondos se asignan sobre la base del valor neto de los activos relativo.

(k) Costes de transacción

Los costes de transacción son costes incrementales directamente atribuibles a la adquisición, emisión o enajenación de un activo o pasivo financiero. Un coste incremental es aquel en el que no se habría incurrido si la entidad no hubiese adquirido, emitido o enajenado el instrumento financiero. Al reconocer inicialmente un activo financiero o un pasivo financiero, la entidad los valorará a su valor razonable, contabilizándose los costes de transacción de dichos instrumentos directamente en el Estado de resultado global.

Los costes de transacción cobrados por el Depositario por la liquidación de las compras y ventas de inversiones se indican dentro de las comisiones del administrador y del depositario en el Estado de resultado global para cada Fondo.

Los costes de transacción por las compras y ventas de valores de renta variable y planes de inversión colectiva se declaran en la Nota 4 para cada Fondo.

Los costes de transacción por la compra y venta de valores de renta fija y otros instrumentos derivados se incluyen en el precio de compra y venta de la inversión. Dichos costes no pueden calcularse de forma práctica o fiable, ya que están integrados en el coste de la inversión y no pueden comprobarse o indicarse separadamente.

(l) Conversión de divisas

(a) Moneda funcional y de presentación: Las partidas incluidas en los estados financieros de la Sociedad se calculan utilizando la moneda del entorno económico principal en el que opera (la "moneda funcional"). Esto es dólares estadounidenses (dólares estadounidenses) para todos los fondos excepto 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 y Income Fund^, Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^, FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^ y Franklin Responsible Income 2028 Fund^ for which the functional currency is Euro, FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^ for which the functional currency is Pound Sterling (British Pound), y Legg Mason Japan Equity Fund^ cuya moneda funcional es el yen japonés. La Sociedad ha adoptado la moneda funcional de cada Fondo como moneda de presentación para estos estados financieros. Los estados financieros de la Sociedad se presentan en dólares estadounidenses (USD).

(b) Las compras y ventas de valores, y los ingresos y gastos se convierten utilizando el tipo de cambio cotizado en la fecha en la que se registraron dichas operaciones. Los activos y pasivos se convierten al tipo de cambio existente al finalizar el ejercicio financiero. Las diferencias entre los importes de ingresos y gastos registrados y cobrados o pagados se registran como ganancias/pérdidas por tipo de cambio en el Estado de ingresos globales, como ganancia/(pérdida) neta de activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en la cuenta de resultados.

(m) Contratos de divisas a plazo y al contado

Un contrato de divisas a plazo o término ("contrato a plazo") es un compromiso para comprar o vender una divisa en una fecha futura, a un tipo negociado. Los contratos a plazo se utilizan para gestionar los riesgos cambiarios y modificar de forma táctica el riesgo de las divisas de la cartera. Por lo general, los contratos a plazo se celebran como protección en el momento de la compra o la venta de un título denominado en una divisa. El Fondo realizará ganancias o pérdidas en el momento del cierre o la liquidación de la operación a plazo. En el Estado de situación financiera y el Estado de resultado global se indica la apreciación o la depreciación latentes de los contratos a plazo. Las ganancias y pérdidas realizadas se presentan con todas las demás ganancias y pérdidas cambiarias en el Estado de resultado global. Los riesgos relacionados con los contratos a plazo incluyen la posible imposibilidad de la contraparte para cumplir con los términos del contrato y los cambios imprevistos del valor de una divisa en relación con la moneda base del Fondo. Los contratos de divisas a plazo los valora razonablemente una fuente de precios independiente con referencia al precio al cual se podría celebrar un nuevo contrato a plazo del mismo monto y vencimiento. Para cada Fondo correspondiente, las ganancias o pérdidas de los contratos abiertos de divisas al contado se incluyen en efectivo en el Estado de situación financiera.

(n) Contratos de futuros

Los depósitos de margen iniciales se realizan al celebrar contratos de futuros y generalmente se realizan en efectivo. Los contratos de futuros se valoran equitativamente sobre la base de sus precios de liquidación diarios cotizados. Los cambios en el valor de los contratos de futuros abiertos se reconocen como ganancias o pérdidas latentes en los contratos de futuros hasta que se resuelven los contratos, momento en el cual las ganancias y pérdidas materializadas se reconocen como ganancias o pérdidas materializadas, y se incluyen en las ganancias/(pérdidas) netas de activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en la cuenta de resultados en el Estado de ingresos globales. La apreciación o depreciación latente de los contratos de futuros se muestra en el Estado de Situación Financiera. Las ganancias y pérdidas materializadas, pero aún no entregadas se muestran dentro de las cuentas de margen y el efectivo restringido en el Estado de la Situación Financiera.

(o) Contratos de opciones

La prima sobre las opciones de venta adquiridas ejercidas se resta del producto de la venta del título subyacente o de la divisa extranjera al determinar la ganancia o pérdida materializada. La prima de las opciones de compra adquiridas se suma al coste de los valores o de la divisa extranjera comprados. Las primas pagadas por la compra de opciones, que expiren sin ejercitarse, se tratan como pérdidas materializadas. Las pérdidas o ganancias latentes en posiciones de opciones abiertas se calculan y registran como el valor razonable de la opción menos la prima pagada sobre dicha opción. Las ganancias o pérdidas latentes en posiciones de opciones abiertas se reflejan como activos o pasivos en el Estado de la Situación Financiera.

La prima de las opciones de compra emitidas ejercidas se añade al producto de la venta del valor subyacente o de la divisa para determinar la ganancia o pérdida materializada. La prima sobre las opciones de venta por escrito ejercidas se resta del coste de los valores o monedas extranjeras compradas. Las primas recibidas de opciones suscritas, que expiran sin ejercitarse, se tratan como ganancias materializadas.

(p) Instrumentos de swap

Los Instrumentos de swap se reconocen a su valor razonable en la fecha en que se celebra el contrato de derivados y posteriormente se vuelven a valorar a su valor razonable. Los valores razonables se obtienen a partir de precios de mercado cotizados en mercados activos, incluidas transacciones de mercado recientes, y técnicas de valoración, incluidos modelos de flujos de efectivo descontados y modelos

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

2. Políticas contables relevantes (continuación)

(p) Instrumentos de swap (continuación)

de precios de opciones, según corresponda. Todos los derivados se contabilizan como activos cuando el valor razonable sea positivo y como pasivos cuando el valor razonable sea negativo. El movimiento en el valor razonable de los instrumentos de swap y los intereses pagados y devengados de los instrumentos de swap se reconocen en el Estado de ingresos globales como ganancias/(pérdidas) netas sobre activos y pasivos financieros a valor razonable con cambios en resultados.

Swaps de incumplimiento crediticio

Cada Fondo de Renta Fija (Fondo de Renta Fija según se define en la página 15), excepto FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, podrá celebrar contratos de swap de incumplimiento crediticio, siempre que (i) el contrato de swap de incumplimiento crediticio esté sujeto a valoración diaria por parte de los Fondos y verificado de forma independiente al menos semanalmente, y (ii) los riesgos asociados al swap de incumplimiento crediticio se evalúen de forma independiente semestralmente y el informe se presente a los Consejeros para su revisión. Un Fondo puede ser el comprador o el vendedor en una transacción swap de incumplimiento crediticio. El "comprador" en un contrato de incumplimiento crediticio está obligado a pagar a la contraparte un flujo periódico de pagos a lo largo de la vigencia del contrato, siempre que no se haya producido ningún caso de incumplimiento de una obligación de referencia subyacente. Si un Fondo es un comprador y no se produce ningún incumplimiento, el Fondo perderá su inversión y no recuperará nada. Por otro lado, si el Fondo es un comprador y se produce un caso de incumplimiento, el Fondo (el comprador) recibirá el valor teórico completo de la obligación de referencia que puede tener poco o ningún valor. Por el contrario, si el Fondo es un vendedor y se produce un supuesto de incumplimiento, el Fondo (el vendedor) deberá pagar a la contraparte el valor teórico completo, o "valor nominal", de la obligación de referencia a cambio de la obligación de referencia. Como vendedor, un Fondo recibe una tasa fija de ingresos durante toda la vigencia del contrato, que normalmente es de entre seis meses y tres años, siempre que no haya un evento de incumplimiento.

Los Fondos compran contratos de swap de incumplimiento crediticio con el fin de cubrir el riesgo de una caída del precio de capital, o de impago, de los títulos de deuda que poseen. Los Fondos venden contratos de swap por incumplimiento crediticio con el fin de exponerse al aumento del precio del capital, y el riesgo de incumplimiento se transfiere del comprador de contratos de incumplimiento crediticio al Fondo como vendedor del contrato swap por incumplimiento crediticio. Esto implica el riesgo de que la permuta financiera expire sin valor y el riesgo de crédito de que el vendedor no cumpla sus obligaciones de pago con los Fondos en caso de incumplimiento. Los Fondos solo podrán realizar tales transacciones con contrapartes con una calificación A- o superior.

Swaps de tipos de interés

Un swap de tipo de interés o swap de tipo de interés cruzado implica el intercambio por parte de un Fondo con otra parte de sus respectivos compromisos de pagar o recibir flujos de efectivo, por ejemplo, un intercambio de pagos a tipo variable por pagos a tipo fijo en divisas base o extranjeras. La compra de una opción cap da derecho al comprador, en la medida en que un índice especificado supere un valor predeterminado, a recibir pagos sobre un importe teórico del principal de la parte que vende la opción cap. La compra de una opción floor da derecho al comprador, en la medida en que un índice específico caiga por debajo de un valor predeterminado, a recibir pagos sobre un monto de capital teórico de la parte que vende la opción floor. Una opción collar combina elementos de comprar una opción cap y vender una opción floor. Los bloqueos de diferenciales son contratos que garantizan la capacidad de celebrar un swap de tipos de interés a un tipo predeterminado superior a algún tipo de referencia.

Swaps de acciones

Los swaps de acciones son acuerdos entre un Fondo y terceros que permiten a los Fondos adquirir una exposición al movimiento de precios de valores específicos sin comprar realmente los valores. Los cambios en los valores del contrato se registran como ganancias o pérdidas latentes y los Fondos reconocen una ganancia o pérdida materializada cuando se cierra el contrato.

Swaps de rendimiento total

Algunos de los Fondos pueden invertir en swaps de rentabilidad total para reducir su exposición a largo plazo al riesgo de mercado y al riesgo de crédito. Los swaps de rentabilidad total son contratos en los que un Fondo paga o recibe una serie de flujos de efectivo basados en la rentabilidad total de un activo especificado a cambio de pagar o recibir, respectivamente, un tipo de interés fijo o variable basado en ese mismo activo especificado. Los swaps de rentabilidad total son valorados equitativamente por un proveedor de precios independiente. Si el precio no está disponible, el Comité de Valoración de Global de Franklin Templeton (el "Comité de valoración") los valora equitativamente. Estas posiciones se concilian mensualmente con el precio de la contraparte.

Swaps de divisas cruzadas

Los swaps cruzados de divisas implican el cambio de dos divisas diferentes con un acuerdo para revertir el cambio en una fecha posterior a tipos de cambio específicos. El cambio de divisas en la fecha de inicio del contrato tiene lugar al tipo de cambio al contado actual. La reconversión al vencimiento puede tener lugar al mismo tipo de cambio, un tipo especificado o el tipo al contado vigente en ese momento. Los pagos de intereses, si procede, se efectúan entre las partes sobre la base de los tipos de interés disponibles en las dos monedas al inicio del contrato.

Swaps de inflación

Los swaps de inflación implican un intercambio de un tipo fijo sobre un importe teórico de capital y un tipo variable vinculado a un índice de inflación. La parte que paga la tasa flotante paga la tasa ajustada por inflación multiplicada por el monto teórico del capital.

Swaps de índices

Un swap de índice se refiere a un contrato de cobertura en el que una parte intercambia un flujo de efectivo predeterminado con una contraparte en una fecha específica. Una deuda, capital u otro índice de precios se utiliza como el intercambio acordado para una parte de este swap. Un swap de índice a un día aplica un índice de tasa a un día como los fondos federales o las tasas de la Tasa de Oferta Interbancaria de Londres (LIBOR). El swap de índices a un día denota un swap de tipos de interés que implica que el tipo a un día se intercambia por un tipo de interés fijo.

(q) Contratos por diferencia

Un contrato por diferencia es un acuerdo entre dos partes para intercambiar la diferencia entre el precio de apertura y el precio de cierre de un contrato. En contratos en largo para contrato por diferencia, la contraparte acepta pagar al Fondo el importe, si lo hubiera, por el que el importe teórico del contrato habría aumentado de valor si se hubiera invertido en el valor subyacente o valores, más los dividendos que se habrían recibido por esas acciones. En un contrato en corto para un contrato por diferencia, la contraparte acepta pagar al Fondo el importe, si lo hubiera, por el que el importe teórico del contrato habría disminuido en valor si se hubiera invertido en el o los valores subyacentes. El Fondo también debe pagar a la contraparte el valor de los dividendos que se habrían recibido por esas acciones.

(r) Títulos adquiridos siguiendo la norma "se anunciará"

Los Fondos pueden negociar valores sobre la base de "se anunciará" ("TBA"). En una transacción TBA, un Fondo se compromete a comprar o vender valores cuya información específica aún no se conoce en el momento de la operación. Los valores adquiridos sobre la base de una TBA no se liquidan hasta que se entregan a o desde el Fondo en cuestión, normalmente entre 15 y 45 días después. Estas operaciones están sujetas a las fluctuaciones del mercado y su valor actual se determina del mismo modo que el de otros títulos.

(s) Inversiones a corto plazo

Los certificados de depósito, depósitos a plazo y otras inversiones a corto plazo mantenidos con instituciones financieras se valoran a su valor nominal con intereses devengados, según corresponda.

(t) Acuerdos de recompra y de recompra inversa

Acuerdo de recompra significa cualquier acuerdo en virtud del cual un Fondo transfiere valores, o cualquier derecho relacionado con un título o garantía, a una contraparte sujeto al compromiso de recomprarlos a un precio especificado en una fecha futura especificada o por especificar. Contrato de recompra inversa significa cualquier contrato en virtud del cual un Fondo recibe valores, o cualquier derecho relacionado con un título o valor, de una contraparte sujeto al compromiso de venderlos a un precio específico en una fecha futura especificada o por especificar.

Los valores comprados en virtud de acuerdos de reventa se valoran equitativamente a su valor nominal y se ajustan por cualquier movimiento en los tipos de cambio de divisas. Los tipos de interés varían para cada acuerdo y se fijan al inicio del mismo. Es política de la Sociedad tomar la custodia de los valores comprados en virtud de acuerdos de recompra inversa y valorar los valores diariamente para proteger a la Sociedad en caso de que los valores no sean recomprados por la contraparte. La Sociedad generalmente obtendrá una garantía adicional si el valor de mercado de los valores subyacentes es inferior al valor nominal del acuerdo de recompra inversa más los intereses devengados. En caso de incumplimiento de la obligación de recompra, la Sociedad tiene derecho a liquidar la garantía real y aplicar el producto en el cumplimiento de la obligación. En caso de incumplimiento o quiebra por parte de la contraparte del acuerdo, la materialización y/o retención de la garantía o el producto puede estar sujeta a procedimientos legales. Los contratos de recompra inversa se han utilizado durante el ejercicio con el fin de gestionar eficazmente la cartera.

(u) Fondos cotizados

Los Fondos pueden invertir en fondos negociados en bolsa ("ETF"). Los Fondos pueden invertir en ETF, que son títulos que replican un índice, una materia prima o una cesta de activos como un fondo de índices, pero se negocian como títulos en una bolsa. Estos títulos están sujetos a las fluctuaciones del mercado y su valor actual se determina del mismo modo que el de los demás títulos.

(v) Acciones en planes de inversión colectiva

El valor razonable de las inversiones en fondos de inversión de capital variable se basa en el valor neto de los activos no auditado por acción suministrado por el administrador de los fondos respectivos.

(w) Swapciones

Algunos de los Fondos pueden invertir en swapciones con el fin de cubrir las variaciones adversas de los tipos de interés. Estos instrumentos combinan las características de otros dos instrumentos financieros, a saber, una opción y un swap de tipos de interés. Los Fondos registran una ganancia/(pérdida) latente (valor razonable) por el importe que se espera recibir o pagar en virtud del contrato si dicho importe se rescinde en el momento de la valoración. Markit, como proveedor, proporciona diariamente el valor razonable. Las ganancias/(pérdidas) latentes se reflejan como activo financiero o pasivo financiero en el Estado de la Situación Financiera.

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

2. Políticas contables relevantes (continuación)

(x) Obligaciones del Tesoro sobre índices de inflación (TIPS)

Algunos de los Fondos pueden invertir en valores indexados. Los valores indexados son valores cuyos precios están indexados a los precios de índices de valores, divisas u otras estadísticas financieras. Los títulos indexados suelen ser títulos de deuda o depósitos cuyo valor al vencimiento y/o tipo de cupón se determina por referencia a un instrumento o estadística específicos. El rendimiento de los valores indexados fluctúa (directa o inversamente, dependiendo del instrumento) con el rendimiento del índice, el valor o la divisa. Los valores son objeto de un valor razonable diario por parte del vendedor correspondiente y los Fondos registran el cambio en el valor razonable como una ganancia o pérdida latente.

(y) Pagarés de préstamo y participaciones en préstamos

Los pagarés de préstamo y las participaciones de préstamo son préstamos a tipo fijo y a tipo variable formalizados mediante negociaciones privadas entre una sociedad u otro tipo de entidad y una o más entidades financieras. Se espera que dichas inversiones se realicen en forma de participaciones o cesión de los préstamos, que pueden o no ser titulizados. Los pagarés de préstamo y las participaciones de préstamo se clasifican por la Sociedad como activos financieros a valor razonable con cambios en la cuenta de resultados, y se reconocen inicialmente a valor razonable. Las ganancias y pérdidas derivadas de los cambios en el valor razonable de los activos financieros se presentan en el Estado de ingresos globales, en el ejercicio en que se producen.

(z) Sociedad colectiva comanditaria

Ciertos Fondos pueden invertir en sociedades colectivas comanditarias (MLP, por sus siglas en inglés) comprando unidades emitidas a socios comanditarios del MLP que se negocian públicamente en mercados regulados. Los MLP son sociedades colectivas comanditarias o sociedades de responsabilidad limitada que normalmente obtienen ingresos y ganancias de la exploración, el desarrollo, el almacenamiento, la recolección, la minería, la producción, el procesamiento, el refinado, el transporte (incluidos los gasoductos que transportan gas, petróleo o productos de estos) o la comercialización de cualquier recurso mineral o natural. Los MLP generalmente tienen dos clases de propietarios: el socio general y los socios limitados. Los socios comanditarios son propietarios del resto de la sociedad, a través de la propiedad de unidades comunes, y tienen un papel limitado en las operaciones y la administración.

El valor razonable de una inversión en MLP se determina de la misma manera que para otros valores. Los cambios en el valor razonable se registran como una ganancia o pérdida latente.

(aa) Ingresos por intereses y gastos por intereses

Los ingresos de intereses y los gastos de intereses incluyen los ingresos de intereses y los gastos de intereses sobre efectivo, equivalentes de efectivo, depósitos a plazo y efectivo de margen. Los ingresos y gastos por compensación se declaran en el Estado de ingresos globales.

(ab) Cuentas de margen y efectivo restringido

Las "Cuentas de margen y efectivo restringido" en el Estado de la situación financiera representan depósitos de margen, garantías reales en efectivo, y ganancias y pérdidas materializadas en contratos de futuros aún no entregados.

Los depósitos de margen se mantienen o pignoran con/a agentes con respecto a contratos de derivados abiertos negociados en bolsa y extrabursátiles. La garantía en efectivo proporcionada o recibida por los Fondos para la negociación de derivados también se identifica en el Estado de la situación financiera dentro de las cuentas de margen y el efectivo restringido, y no se incluye como componente de efectivo y equivalentes de efectivo. Los saldos de garantía en efectivo son importes relacionados con operaciones con derivados y se mantienen al final del ejercicio con agentes. Los saldos de garantía en efectivo recibidos en relación con operaciones con derivados se mantienen en The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch y cualquier subcustodio y son pagaderos a los agentes al cierre del ejercicio.

(ac) Cuentas por cobrar de inversiones/participaciones reembolsables vendidas y cuentas por pagar de inversiones compradas/participaciones reembolsables readquiridas

Las cuentas por cobrar de inversiones/acciones participativas rescatables vendidas representan cuentas por cobrar por valores/acciones participativas rescatables que se han contratado, pero que aún no se han liquidado o entregado en la fecha del Estado de situación financiera. Estas cantidades se reconocen inicialmente al valor razonable y posteriormente se miden a coste amortizado.

Las cuentas por pagar de inversiones compradas/acciones participativas rescatables readquiridas representan cuentas por pagar derivadas de compras de títulos/acciones participativas rescatables readquiridas que se han contratado, pero que aún no se han liquidado o entregado en la fecha del Estado de situación financiera. Estas cantidades se reconocen inicialmente al valor razonable y posteriormente se miden a coste amortizado.

(ad) Distribuciones a los tenedores de participaciones reembolsables

Las distribuciones a titulares de acciones participantes rescatables se reconocen en una fecha ex dividendo y se presentan como "costes financieros" en el Estado de ingresos globales.

(ae) Valores vendidos en corto

Ciertos Fondos de la Sociedad pueden dedicarse a la venta de valores en corto. La Sociedad realiza ventas en corto en las que se vende un título prestado en previsión de una disminución en el valor de mercado de dicho título, o puede utilizar las ventas en corto para varias transacciones de arbitraje. Las ventas en corto se mantienen para negociar y, en consecuencia, se clasifican como pasivos financieros a valor razonable con cambios en la cuenta de resultados.

3. Gestión eficaz de carteras

Sujeto a las condiciones y dentro de los límites que en cada momento establezca 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 los Gestores de Subinversiones podrán emplear técnicas e instrumentos de inversión como futuros, opciones, contratos de divisas a plazo y otros derivados con fines de gestión eficiente de carteras. Además, se pueden desarrollar nuevas técnicas e instrumentos que puedan ser utilizados por un Fondo en el futuro y un Fondo puede utilizar dichas técnicas e instrumentos sujetos a la aprobación previa del Banco Central y a cualquier restricción impuesta por este.

Para los OICVM que hayan utilizado técnicas de gestión eficiente de la cartera, se exige ofrecer información en virtud del Reglamento sobre OICVM. Un OICVM está obligado a declaran los ingresos derivados de los acuerdos de recompra y las operaciones de préstamo de valores correspondientes a la totalidad del ejercicio del informe, junto con las comisiones y costes operativos directos e indirectos incurridos. Consulte la tabla siguiente.

Los detalles de los instrumentos financieros derivados abiertos al cierre del ejercicio figuran en la Cartera de inversiones de los Fondos. Todas las ganancias y pérdidas materializadas 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 de ingresos globales.

Durante el ejercicio se suscribieron contratos de recompra inversa con el fin de gestionar eficazmente la cartera. Los detalles de todos los acuerdos de recompra inversa al cierre del ejercicio se recogen en la Cartera de Inversiones.

Acuerdos de recompra inversa

Una parte de los activos de cada Fondo podrá mantenerse en activos líquidos complementarios. A los fines de una gestión eficiente de la cartera, cada Fondo podrá celebrar acuerdos de recompra y acuerdos de recompra inversa.

La siguiente tabla muestra los ingresos obtenidos por pactos de recompra inversa durante los ejercicios cerrados el 29 de febrero de 2024 y el 28 de febrero de 2023:

Nombre del Fondo	29 de febrero de 2024 (en miles)	28 de febrero de 2023 (en miles)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	14.616 $	5.725 $

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

Operaciones de préstamo de valores

Algunos Fondos también pueden utilizar acuerdos de préstamo de valores para fines de gestión eficiente de la cartera según lo descrito anteriormente. En tales transacciones, el Fondo podrá transferir temporalmente sus valores a un prestatario, con el acuerdo del prestatario de devolver valores equivalentes al Fondo en un momento previamente acordado. Al realizar tales transacciones, el Fondo se esforzará por aumentar la rentabilidad de su cartera de valores mediante la percepción de una comisión por poner sus valores a disposición del prestatario. No se han realizado operaciones de acaparamiento de ninguno de los Fondos en los ejercicios terminados el 29 de febrero de 2024 y el 28 de febrero de 2023.

4. 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.

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

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

La comisión de gestión máxima para cada clase de acciones (expresada como porcentaje del valor neto de los activos del Fondo correspondiente atribuible a dicha clase) al cierre del ejercicio es la siguiente:

Denominación del Fondo	Máximo de gestión de inversiones
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	
Clase A	0,800 %
Clase B	1,050 %
Clase C	1,300 %
Clase E	1,400 %
Clase X	0,600 %
Clase Premier	0,300 %
Clase LM	Ninguna
Clase A (G)	0,800 %
Clase L(G)	0,800 %
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	
Clase A	0,800 %
Clase B	1,050 %
Clase C	1,300 %
Clase E	1,400 %
Clase F	0,550 %[1]
Clase R	0,550 %
Clase T	0,800 %
Clase X	0,300 %
Clase Premier	0,300 %
Clase S	0,200 %
Clase LM	Ninguna
Clase GA	0,820 %
Clase GE	1,420 %
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	
Clase A	1,000 %
Clase B	1,250 %
Clase C	1,500 %
Clase E	1,600 %
Clase F	0,550 %
Clase R	0,600 %
Clase T	1,000 %
Clase X	0,300 %
Clase Premier	0,300 %
Clase LM	Ninguna
Clase A (G)	1,150 %
Clase B (G)	1,650 %
Clase L(G)	1,650 %
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	
Clase A	0,800 %
Clase B	1,050 %
Clase C	1,300 %
Clase E	1,400 %
Clase F	0,550 %
Clase R	0,400 %
Clase T	0,800 %
Clase X	0,300 %
Clase Premier	0,300 %
Clase S	0,200 %
Clase LM	Ninguna
Clase GA	0,820 %
Clase GE	1,420 %
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	
Clase A	1,100 %
Clase B	1,350 %
Clase C	1,600 %
Clase E	1,700 %
Clase F	0,650 %
Clase R	0,700 %
Clase T	1,100 %
Clase X	0,550 %
Clase Premier	0,400 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Western Asset US High Yield Fund	
Clase A	0,950 %
Clase B	1,200 %
Clase C	1,450 %
Clase E	1,550 %
Clase F	0,700 %
Clase R	0,550 %
Clase T	0,950 %
Clase X	0,450 %
Clase Premier	0,450 %
Clase S	0,300 %
Clase LM	Ninguna
Clase A (G)	1,150 %
Clase L(G)	1,650 %
Clase GF	0,950 %

[1] Cargo máximo de administración para Clase F de Distribución (D): 0,400 %.

Denominación del Fondo	Máximo de gestión de inversiones
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	
Clase A	0,950 %
Clase B	1,250 %
Clase C	1,450 %
Clase E	1,550 %
Clase F	0,700 %
Clase R	0,850 %
Clase T	0,950 %
Clase X	0,450 %
Clase Premier	0,450 %
Clase S	0,300 %
Clase LM	Ninguna
Clase A (G)	1,250 %
Clase L(G)	1,750 %
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	
Clase A	1,100 %
Clase B	1,350 %
Clase C	1,600 %
Clase E	1,700 %
Clase F	0,850 %
Clase R	0,700 %
Clase T	1,100 %
Clase X	0,600 %
Clase Premier	0,600 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	
Clase A	0,850 %
Clase B	1,100 %
Clase C	1,350 %
Clase E	1,450 %
Clase F	0,600 %
Clase R	0,450 %
Clase T	0,850 %
Clase X	0,350 %
Clase Premier	0,350 %
Clase S	0,250 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	
Clase A	0,900 %
Clase B	1,150 %
Clase C	1,400 %
Clase E	1,500 %
Clase F	0,650 %
Clase R	0,500 %
Clase T	0,900 %
Clase X	0,400 %
Clase Premier	0,400 %
Clase S	0,300 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Western Asset Global Credit Fund^	
Clase A	0,850 %
Clase B	1,100 %
Clase C	1,350 %
Clase E	1,450 %
Clase F	0,600 %
Clase R	0,650 %
Clase T	0,850 %
Clase X	0,350 %
Clase Premier	0,350 %
Clase S	0,250 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	
Clase A	1,500 %
Clase B	1,750 %
Clase C	2,000 %
Clase E	2,100 %
Clase F	1,250 %
Clase R	1,100 %
Clase T	1,500 %
Clase X	1,000 %
Clase Y	1,000 %
Clase Premier	1,000 %
Clase S	0,600 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	
Clase A	1,250 %
Clase B	1,500 %
Clase C	1,750 %
Clase E	1,850 %
Clase F	0,800 %
Clase R	0,750 %
Clase T	1,250 %
Clase X	0,625 %
Clase Premier	0,600 %
Clase S	0,400 %
Clase LM	Ninguna

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

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

Denominación del Fondo	Máximo de gestión de inversiones
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^	
Clase D	1,200 %
Clase F	1,200 %
Clase M	0,600 %
Clase Premier	0,600 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	
Clase A	1,000 %
Clase B	1,250 %
Clase C	1,500 %
Clase E	1,600 %
Clase F	0,550 %
Clase R	0,600 %
Clase X	0,500 %
Clase Premier	0,300 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^	
Clase A	0,800 %
Clase R	0,500 %
Clase T	0,800 %
Clase X	0,400 %
Clase Premier	0,300 %
Clase S	0,200 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^	
Clase A	0,800 %
Clase F	0,550 %
Clase R	0,500 %
Clase T	0,800 %
Clase X	0,300 %
Clase Premier	0,300 %
Clase S	0,200 %
Clase LM	Ninguna
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^	
Clase LM	Ninguna
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^	
Clase A	0,850 %
Clase B	1,100 %
Clase C	1,350 %
Clase E	1,450 %
Clase F	0,600 %
Clase R	0,650 %
Clase T	0,850 %
Clase X	0,350 %
Clase Premier	0,350 %
Clase S	0,250 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	
Clase A	1,100 %
Clase B	1,350 %
Clase C	1,600 %
Clase E	1,700 %
Clase F	0,850 %
Clase R	0,700 %
Clase T	1,100 %
Clase X	0,600 %
Clase Premier	0,600 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	
Clase A	1,350 %
Clase B	1,600 %
Clase C	1,850 %
Clase E	1,950 %
Clase F	1,100 %
Clase J	0,900 %
Clase R	0,950 %
Clase X	0,900 %
Clase Premier	0,900 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^	
Clase A	1,100 %
Clase F	0,750 %
Clase T	1,100 %
Clase X	0,550 %
Clase Premier	0,550 %
Clase S	0,450 %
Clase LM	Ninguna

Denominación del Fondo	Máximo de gestión de inversiones
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	
Clase A	1,150 %
Clase B	1,400 %
Clase C	1,650 %
Clase E	1,750 %
Clase F	0,900 %
Clase R	0,750 %
Clase T	1,150 %
Clase X	0,650 %
Clase Premier	0,650 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	
Clase A	1,100 %
Clase B	1,350 %
Clase C	1,600 %
Clase E	1,700 %
Clase F	0,800 %
Clase J	0,450 %
Clase R	0,700 %
Clase T	1,100 %
Clase X	0,450 %
Clase Premier	0,450 %
Clase S	0,350 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	
Clase A	1,650 %
Clase B	1,900 %
Clase C	2,150 %
Clase E	2,250 %
Clase F	1,300 %
Clase J	0,750 %
Clase R	1,250 %
Clase T	1,650 %
Clase X	1,150 %
Clase Premier	1,150 %
Clase S	0,750 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	
Clase A	1,050 %
Clase B	1,300 %
Clase C	1,550 %
Clase E	1,650 %
Clase F	0,700 %
Clase T	1,050 %
Clase X	0,525 %
Clase Premier	0,525 %
Clase S	0,400 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^	
Clase A	2,000 %
Clase T	2,000 %
Clase U	1,000 %
Clase X	1,150 %
Clase Premier	1,150 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^	
Clase A	1,100 %
Clase B	1,350 %
Clase C	1,600 %
Clase E	1,700 %
Clase F	0,800 %
Clase J	0,450 %
Clase R	0,700 %
Clase T	1,100 %
Clase X	0,550 %
Clase Premier	0,550 %
Clase S	0,450 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^	
Clase A	0,800 %
Clase B	1,050 %
Clase C	1,300 %
Clase E	1,400 %
Clase F	0,550 %
Clase R	0,600 %
Clase T	0,800 %
Clase X	0,300 %
Clase Premier	0,300 %
Clase S	0,200 %
Clase LM	Ninguna

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

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

Denominación del Fondo	Máximo de gestión de inversiones
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	
Clase A	1,200 %
Clase E	1,950 %
Clase F	0,950 %
Clase R	0,700 %
Clase T	1,200 %
Clase X	0,600 %
Clase Premier	0,600 %
Clase S	0,500 %
Clase LM	Ninguna
FTGF ClearBridge Value Fund	
Clase A	1,350 %
Clase B	1,850 %
Clase C	1,850 %
Clase E	2,100 %
Clase F	1,100 %
Clase R	0,850 %
Clase T	1,350 %
Clase X	0,675 %
Clase Premier	0,675 %
Clase LM	Ninguna
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	
Clase A	1,250 %
Clase B	1,750 %
Clase C	1,750 %
Clase E	2,000 %
Clase F	1,000 %
Clase R	0,750 %
Clase T	1,250 %
Clase X	0,625 %
Clase Premier	0,625 %
Clase LM	Ninguna
Clase A (G)	1,250 %
Clase B (G)	1,750 %
Clase L(G)	1,750 %
Clase GA	1,420 %
Clase GE	2,170 %
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
Clase A	1,250 %
Clase B	1,750 %
Clase C	1,750 %
Clase E	2,000 %
Clase F	1,000 %
Clase R	0,750 %
Clase T	1,250 %
Clase U	0,525 %
Clase X	0,625 %
Clase Premier	0,625 %
Clase LM	Ninguna
Clase A (G)	1,250 %
Clase L(G)	1,750 %
Clase GA	1,420 %
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	
Clase A	1,300 %
Clase B	1,800 %
Clase C	1,800 %
Clase E	2,050 %
Clase F	1,050 %
Clase R	0,800 %
Clase T	1,300 %
Clase X	0,650 %
Clase Premier	0,650 %
Clase LM	Ninguna
Clase A (G)	1,300 %
Clase B (G)	1,800 %
Clase L(G)	1,800 %
Clase GA	1,420 %
Clase GE	2,170 %
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	
Clase A	1,250 %
Clase B	1,750 %
Clase C	1,750 %
Clase E	2,000 %
Clase F	1,000 %
Clase R	0,800 %
Clase T	1,250 %
Clase X	0,625 %
Clase Premier	0,625 %
Clase LM	Ninguna

Denominación del Fondo	Máximo de gestión de inversiones
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^	
Clase A	1,200 %
Clase B	1,700 %
Clase C	1,700 %
Clase E	1,950 %
Clase F	0,950 %
Clase R	0,700 %
Clase T	1,200 %
Clase X	0,600 %
Clase Premier	0,600 %
Clase S	0,400 %
Clase LM	Ninguna
FTGF ClearBridge Global Growth Fund^	
Clase A	1,300 %
Clase B	1,800 %
Clase C	1,800 %
Clase E	2,050 %
Clase F	1,050 %
Clase R	0,800 %
Clase T	1,300 %
Clase X	0,650 %
Clase Premier	0,650 %
Clase S	0,550 %
Clase LM	Ninguna
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^	
Clase A	1,500 %
Clase B	2,000 %
Clase C	2,000 %
Clase E	2,250 %
Clase F	1,250 %
Clase R	1,000 %
Clase T	1,500 %
Clase U	0,650 %
Clase X	0,750 %
Clase Premier	0,750 %
Clase LM	Ninguna
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	
Clase A	1,500 %
Clase B	2,000 %
Clase C	2,000 %
Clase E	2,250 %
Clase F	1,250 %
Clase R	1,000 %
Clase T	1,500 %
Clase U	0,600 %
Clase X	0,750 %
Clase Premier	0,750 %
Clase S	0,400 %
Clase LM	Ninguna
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^	
Clase A	1,300 %
Clase B	1,800 %
Clase C	1,800 %
Clase E	2,050 %
Clase F	1,050 %
Clase R	0,800 %
Clase T	1,300 %
Clase X	0,650 %
Clase Premier	0,650 %
Clase S	0,300 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	
Clase A	1,500 %
Clase B	2,000 %
Clase C	2,000 %
Clase E	2,250 %
Clase F	1,250 %
Clase R	1,000 %
Clase T	1,500 %
Clase X	0,750 %
Clase Premier	0,750 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	
Clase A	1,500 %
Clase B	2,000 %
Clase C	2,000 %
Clase E	2,250 %
Clase F	1,250 %
Clase R	1,000 %
Clase T	1,500 %
Clase X	0,750 %
Clase Premier	0,750 %
Clase LM	Ninguna
Clase A (G)	1,250 %
Clase L(G)	1,750 %

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

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

Denominación del Fondo	Máximo de gestión de inversiones
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^	
Clase A	1,500 %
Clase B	2,000 %
Clase C	2,000 %
Clase E	2,250 %
Clase F	1,250 %
Clase R	1,000 %
Clase T	1,500 %
Clase X	0,750 %
Clase Premier	0,750 %
Clase S	0,550 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^	
Clase A	1,350 %
Clase B	1,850 %
Clase C	1,850 %
Clase E	2,100 %
Clase F	1,100 %
Clase R	0,850 %
Clase T	1,350 %
Clase X	0,675 %
Clase Premier	0,675 %
Clase S	0,500 %
Clase LM	Ninguna
Clase GA	1,620 %
Clase GE	2,370 %
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
FTGF Martin Currie Global 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 R	1,000 %
Clase T	1,500 %
Clase X	0,750 %
Clase Premier	0,750 %
Clase S	0,650 %
Clase LM	Ninguna

Denominación del Fondo	Máximo de gestión de inversiones
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	
Clase A	1,500 %
Clase B	2,000 %
Clase C	2,000 %
Clase D	1,100 %
Clase E	2,250 %
Clase F	1,250 %
Clase R	1,000 %
Clase T	1,500 %
Clase X	0,750 %
Clase Premier	0,750 %
Clase S	0,440 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	
Clase A	1,500 %
Clase B	2,000 %
Clase C	2,000 %
Clase E	2,250 %
Clase F	1,250 %
Clase J	0,650 %
Clase R	1,000 %
Clase T	1,500 %
Clase X	0,750 %
Clase Premier	0,750 %
Clase S	0,650 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^	
Clase A	1,500 %
Clase B	2,000 %
Clase C	2,000 %
Clase E	2,250 %
Clase F	1,250 %
Clase R	1,000 %
Clase X	0,750 %
Clase Premier	0,750 %
Clase S	0,650 %
Clase LM	Ninguna
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^	
Clase A	1,500 %
Clase B	2,000 %
Clase C	2,000 %
Clase E	2,250 %
Clase F	1,250 %
Clase R	1,000 %
Clase T	1,500 %
Clase X	0,750 %
Clase Premier	0,750 %
Clase S	0,650 %
Clase LM	Ninguna
Franklin Responsible Income 2028 Fund^	
Clase A	0,60 %
Clase D	1,15 %
Clase K	0,60 %
Clase X	0,20 %

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 son ofrecidas por cada Fondo y no todas las clases de acciones estaban en circulación al cierre del ejercicio actual 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, el Gestor será responsable de pagar las comisiones y los gastos menores del Gestor 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 renuncias voluntarias y/o los reembolsos de gastos en cualquier momento.

En los ejercicios fiscales finalizados el 29 de febrero de 2024 y el 28 de febrero de 2023, las Comisiones de Gestión a las que se renunciaron y fueron reembolsadas y otros gastos recuperados fueron los siguientes:

	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024 (en miles)		Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023 (en miles)	
Nombre del Fondo	Renuncia a Comisiones de Gestión	Reembolso de Comisiones de Gestión y otros gastos recuperados	Renuncia a Comisiones de Gestión	Reembolso de Comisiones de Gestión y otros gastos recuperados
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	– $	– $	622 $	23 $
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	– $	56 $	9 $	– $
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	– $	– $	3 $	– $
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund^	– $	– $	3 $	– $
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	2 $	1 $	– $	1 $
FTGF Western Asset US High Yield Fund	1 $	1 $	2 $	2 $
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund^	– $	– $	– $	10 $
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund^	– $	– $	– $	17 $
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	8 $	– $	– $	– $
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^	– $	– $	14 $	13 $
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	2 $	– $	– $	– $
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	10 $	– $	– $	– $
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^	– €	– €	– €	11 €
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	– $	– $	1 $	– $
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^	– $	9 $	– $	– $

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

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

	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024 (en miles)		Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023 (en miles)	
Nombre del Fondo	Renuncia a Comisiones de Gestión	Reembolso de Comisiones de Gestión y otros gastos recuperados	Renuncia a Comisiones de Gestión	Reembolso de Comisiones de Gestión y otros gastos recuperados
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^	– $	66 $	– $	76 $
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^	20 $	33 $	28 $	22 $
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^	49 $	8 $	35 $	– $
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	57 $	11 $	22 $	3 $
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	– $	– $	32 $	33 $
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^	– $	27 $	– $	24 $
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^	54 $	16 $	17 $	15 $
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^	19 $	1 $	– $	– $
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	– $	– $	10 $	47 $
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	46 $	– $	19 $	– $
FTGF ClearBridge Global Growth Fund^	41 $	– $	25 $	– $
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^	– $	– $	14 $	24 $
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^	7 $	23 $	– $	– $
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^	31 $	41 $	26 $	2 $
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^	– €	– €	1 €	7 €
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^	1 $	38 $	1 $	– $
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^	– $	– $	– $	33 $
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	1 $	15 $	35 $	– $
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	19 $	– $	– $	– $
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	11 $	13 $	2 $	7 $
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	52 $	– $	36 $	– $
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^	2 €	– €	6 €	5 €
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^	4 $	71 $	– $	– $
Franklin Responsible Income 2028 Fund^	10 €	– €	6 €	14 €

Los importes que se indican con "–" equivalen a cero USD/EUR o son inferiores a 1.000 USD/EUR.

De conformidad con cada Contrato de Gestión de Inversiones, cada Gestor de Inversiones tiene derecho a recibir una comisión de gestión de inversiones y cada Gestor de Inversiones será responsable de pagar las comisiones y los gastos menores de cualquier Subgestor de Inversiones con cargo a su propia Comisión de Gestión de Inversiones (que puede incluir "comisiones de rendimiento").

De conformidad con lo dispuesto en el Contrato Marco de Distribución entre el Gestor, la Sociedad y Franklin Distributors, LLC (el "Distribuidor Principal"), el Distribuidor Principal está autorizado a comercializar, promover, ofrecer y disponer la venta y el rescate de Acciones de la Sociedad (colectivamente, "servicios de distribución"). Además, el Distribuidor Principal está autorizado, a sus expensas, a contratar a uno o más distribuidores con el fin de ayudarle a desempeñar sus funciones y responsabilidades, siempre que los nombramientos de dichas otras empresas se realicen de conformidad con los requisitos de las Reglas del Banco Central. De conformidad con lo dispuesto en el Contrato Marco de Distribución entre el Gestor, la Sociedad y el Distribuidor Principal, el Distribuidor Principal en tales casos seguirá siendo responsable ante el Gestor del cumplimiento de sus obligaciones derivadas de dicho contrato. El Distribuidor Principal, de conformidad con los requisitos del Banco Central, ha designado a Franklin Templeton Investments (Asia) Limited ("FTIA") y a Templeton Asset Management Ltd. ("TAM") como Distribuidores adicionales de los Fondos. El Gestor también se ha designado a sí mismo 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 recién nombrado 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 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 a los accionistas 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 "Comisiones de Servicios a los Accionistas"). Las Comisiones de Servicios a los Accionistas se pagarán mensualmente a mes vencido y se devengarán en cada día de negociación. En virtud del Acuerdo Principal de Servicio al Accionista entre el Administrador, 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 recibir del Administrador un cargo por servicios al accionista de algunas de las clases de acciones por sus servicios como Agente de Servicios a los Accionistas.

De conformidad con lo dispuesto en el Contrato de Agente Principal de Servicios a los Accionistas, el Agente Principal de Servicios a los Accionistas está autorizado, a sus expensas, a contratar a una o más partes con el fin de ayudarle a desempeñar las funciones previstas en el contrato, siempre que el Agente Principal de Servicios a los Accionistas siga siendo responsable ante el Gestor del cumplimiento de sus obligaciones derivadas de dicho contrato. De conformidad con lo anterior, el Agente Principal de Servicios a los Accionistas ha designado a FTIA y TAM como Agentes adicionales de Servicios a los Accionistas de la Sociedad. El Gestor ha autorizado a Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc a prestar servicios a los accionistas en relación con Taiwán.

El importe total de las Comisiones de Servicios a los Accionistas pagados por cada clase de acciones será o ha sido equivalente a lo siguiente:

(i) 0,15 % anual del valor neto de los activos de FTGF Western Asset US Core Bond Fund, FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund, FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund, FTGF Western Asset US High Yield Fund, FTGF Western Asset Global High Yield Fund, FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund, FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund, FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^, FTGF Western Asset Global Credit 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^, FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ y FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^; y

(ii) 0,35 % anual del valor neto de los activos 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^, FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^, FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund, FTGF Royce US Smaller Companies Fund, FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^, FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth e 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 a los Accionistas son pagaderas en todas las clases excepto las Clases de Acciones F, las Clases de Acciones J, las Clases de Acciones U, las Clases de Acciones Y, las Clases de Acciones Premier, las Clases de Acciones S, las Clases de Acciones LM, las Clases de Acciones con derechos adquiridos y las Clases de Acciones Galeon (cada una según se define en el Folleto). Tampoco son pagaderas en todas las clases de acciones ofrecidas por FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, Western Asset OICVM SMASh Series Core Plus Completion Fund^ y Franklin Responsible Income 2028 Fund^.

Durante los ejercicios finalizados el 29 de febrero de 2024 y el 28 de febrero de 2023, las Comisiones de Servicios a los Accionistas a las que se renunciaron fueron las siguientes:

	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024 (en miles)	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023 (en miles)
Nombre del Fondo	Renuncia a Comisiones de Servicios a los Accionistas	Renuncia a Comisiones de Servicios a los Accionistas
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	8 $	42 $
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	3 $	12 $
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund^	– $	21 $
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	1 $	– $
FTGF Western Asset US High Yield Fund	5 $	6 $
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund^	– $	4 $

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

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

Nombre del Fondo	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024 (en miles) Renuncia a Comisiones de Servicios a los Accionistas	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023 (en miles) Renuncia a Comisiones de Servicios a los Accionistas
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	35 $	21 $
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^	– $	5 $
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^	2 $	1 $
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	4 $	8 $
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	– $	1 $
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	7 $	15 $
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	2 $	– $
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	33 $	21 $
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	96 $	89 $
FTGF ClearBridge Global Growth Fund^	2 $	1 $
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^	– $	2 $
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	2 $	– $
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	16 $	11 $
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^	– €	1 €
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^	2 $	30 $
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	1 $	8 $
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	8 $	– $
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	41 $	31 $
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	7 $	5 $
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^	1 $	– $

Los importes que se indican con "–" equivalen a cero USD/EUR o son inferiores a 1.000 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 cerrado a 29 de febrero de 2024, estos gastos ascendieron a 1.037.845 $ (28 de febrero de 2023: 1.313.151 $).

Partes vinculadas

Jane Trust (hasta la fecha de su dimisión), Jaspal Sagger, William Jackson (hasta la fecha de su dimisión), Craig Tyle y Elinor Murray han sido Consejeros de la Sociedad y también han sido consejeros y/o ejecutivos de ciertas filiales del Gestor, los Gestores de Inversiones, los Distribuidores y los Agentes de Servicios a los Accionistas. William Jackson y Jane Trust han sido Consejeros de FTIS (hasta las fechas de sus respectivas renuncias). 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 29 de febrero de 2024 y 28 de febrero de 2023, los Fondos en la tabla que figura a continuación mantenían inversiones en planes de inversión colectiva que han designado al mismo Gestor, Gestor de inversiones, o Subgestor de inversiones que el Fondo, o que han designado a una parte vinculada de ese Gestor, Gestor de inversiones o Subgestor 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	29 de febrero de 2024 %	29 de febrero de 2024 Valor (en miles)	28 de febrero de 2023 %	28 de febrero de 2023 Valor (en miles)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,12 %	3.108 $	0,07 %	1.741 $
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,03 %	782 €	0,03 %	654 €
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro Accumulating	–	–	12,62 %	1.117 $
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – Clase LM USD de Capitalización	10,61 %	3.139 $	21,75 %	2.899 $
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,02 %	577 $	0,07 %	1.661 $
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro Accumulating	–	–	1,50 %	133 $
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,22 %	5.476 $	0,17 %	3.862 $
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,04 %	1.097 $	0,73 %	17.040 $
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Clase LM	2,92 %	10.594 $	3,14 %	10.921 $
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – Clase LM USD de Capitalización	4,37 %	1.292 $	2,22 %	296 $
FTGF Western Asset Global Credit Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,00 %	69 $	0,02 %	559 $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro Accumulating	–	–	24,65 %	2.181 $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	1,57 %	39.783 $	0,70 %	16.369 $
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro Accumulating	–	–	5,73 %	507 $
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,85 %	21.501 $	0,74 %	17.212 $
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,69 %	17.502 $	0,05 %	1.154 $
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,01 %	133 $	0,06 %	1.342 $
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	–	–	0,00 %	30 $
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,10 %	2.596 $	–	–
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,32 %	8.090 $	–	–
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,03 %	718 $	–	–
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,14 %	3.580 $	–	–
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,81 %	20.461 $	–	–

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

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

Fondo	Planes de inversión colectiva subyacentes	29 de febrero de 2024 %	29 de febrero de 2024 Valor (en miles)	28 de febrero de 2023 %	28 de febrero de 2023 Valor (en miles)
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,05 %	1.264 $	–	–
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,02 %	579 $	–	–
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,04 %	1.040 $	–	–
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,69 %	17.542 $	1,39 %	32.545 $
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,07 %	1.681 $	0,05 %	1.100 $
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,01 %	209 $	0,01 %	180 $
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,06 %	1.620 $	–	–
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,01 %	142 $	–	–
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	0,02 %	420 $	–	–

Los objetivos de inversión de los Fondos se declaran en la Nota 13 de los estados financieros.

Costes de transacción

Los costes de transacción de las compras y ventas de acciones y planes de inversión colectiva para los ejercicios fiscales finalizados el 29 de febrero de 2024 y el 28 de febrero de 2023 se detallan en la siguiente tabla:

Nombre del Fondo	29 de febrero de 2024 (en miles)	28 de febrero de 2023 (en miles)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	31 $	32 $
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	192 $	248 $
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	8 €	10 €
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	5 $	9 $
FTGF Western Asset US High Yield Fund	1 $	6 $
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	– $	1 $
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	8 $	5 $
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	18 $	14 $
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	12 $	14 $
FTGF Western Asset Global Credit Fund^	3 $	3 $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	6.442 $	9.768 $
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	25 $	32 $
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^	8 $	23 $
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	38 $	51 $
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^	– £	1 £
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^	– $	7 $
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^	10 $	11 $
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^	– $	– $
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	15 $	2 $
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	8 $	90 $
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^	1 $	– $
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	15 $	– $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	74 $	41 $
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	2 $	16 $
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	– $	– $
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^	8 $	4 $
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^	1 $	– $
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^	2 $	– $
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	– $	1 $
FTGF ClearBridge Value Fund	350 $	260 $
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	6 $	4 $
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	31 $	57 $
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	11 $	36 $
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	5 $	3 $
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	111 $	81 $
FTGF ClearBridge Global Growth Fund^	9 $	7 $
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^	777 €	1.247 €
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	453 $	904 $
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^	11 $	– $
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	1.161 $	1.128 $
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	94 $	91 $
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^	4 $	5 $
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^	– $	11 $
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	– $	32 $
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	99 $	181 $
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	18 $	13 €
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	22 $	40 $
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^	81 €	153 €
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^	8 $	– $

Los importes que se indican con "–" equivalen a 0 $/€/£ o son inferiores a 1.000 $/€/£.

Comisión de rentabilidad

Además de las Comisiones de Gestión de Inversiones descritas anteriormente, el Gestor de Inversiones podrá tener derecho a recibir una comisión (una "Comisión de Rendimiento") en función del rendimiento de las Clases de Acciones PF (Clases de Comisión de Rendimiento, según se indique en "(PF)" en el nombre de la clase de acciones).

No se han cobrado comisiones de rendimiento durante los ejercicios cerrados el 29 de febrero de 2024 y el 28 de febrero de 2023, ya que no se han emitido clases de acciones activas (PF).

Comisión anual de administración y depositario

The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch, actúa como depositario (el "Depositario") y BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company actúa como administrador (el "Administrador") de la Sociedad. Para los servicios de administración, contabilidad, accionistas, fideicomisarios y depositarios, reciben colectivamente de los Fondos una comisión de hasta el 0,15 % del valor neto de los activos de cada Fondo.

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

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

Remuneración de los consejeros

Los honorarios de los consejeros y los gastos varios cargados en la cuenta de resultados dentro del Estado de ingresos globales y pertenecientes al ejercicio fiscal finalizado el 29 de junio de 2024 ascendieron a 198.000 $ (28 de junio de 2023: 143.000 $).

Los honorarios de los consejeros no se abonan o no se han abonado a Jane Trust, Jaspal Sagger, William Jackson (hasta la fecha de su dimisión) y Craig Tyle, que son empleados del Gestor, de los Gestores de Inversiones o de sus filiales.

Remuneración de los auditores

Los honorarios pagados a los auditores, PricewaterhouseCoopers por importe de 1.017.115 € (IVA excluido), correspondientes al ejercicio, corresponden a la auditoría legal de los estados financieros de la Sociedad (28 de febrero de 2023: 1.064.363 € (sin IVA)). Los honorarios totales de auditoría de la Sociedad según se detalla en el Estado de ingresos globales en la página 223 incluyen el IVA al 23 % y se presentan en la moneda de presentación de la Sociedad (dólar estadounidense).

Para el ejercicio cerrado el 29 de febrero de 2024, los gastos menores pagados a los auditores ascendieron a 12.100 € (28 de febrero de 2023: 11.804 €).

Otras operaciones con partes vinculadas

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

Fondo	% de posiciones a 29 de febrero de 2024	% de posiciones a 28 de febrero de 2023
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	75,72	71,16
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	–	21,10
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	21,36	–
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	82,67	92,89
FTGF Western Asset US High Yield Fund	30,69	34,32
FTGF Western Asset US High Yield Fund	20,49	–
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	34,37	29,86
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	23,37	21,21
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	23,69	–
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	26,95	29,89
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	25,55	26,15
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	22,55	–
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	66,32	68,41
FTGF Western Asset Global Credit Fund^	70,85	77,47
FTGF Western Asset Global Credit Fund^	25,18	–
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	31,37	35,78
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^	83,11	68,68
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	94,53	94,78
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^	–	100,00
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^	–	81,03
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^	97,99	95,79
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^	–	65,31
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^	–	23,18
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	56,37	32,53
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	–	23,04
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^	39,29	96,36
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^	28,61	–
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	52,74	51,35
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	–	21,00
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	29,66	31,26
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	28,30	27,49
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	45,98	40,60
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	22,36	26,66
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	–	99,01
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^	91,03	91,03
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^	100,00	100,00
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^	100,00	–
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	–	75,02
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	31,30	32,03
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	36,64	–
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	26,41	–
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	27,17	45,87
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	39,28	34,53
FTGF ClearBridge Global Growth Fund^	54,35	54,38
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^	28,64	21,50
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	28,16	27,65
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	22,33	21,57
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^	100,00	–
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	44,03	40,84
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^	99,91	99,79
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^	–	41,38
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	–	22,30
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	–	21,52
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	57,00	60,68
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	20,19	–
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	54,30	58,97
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	25,32	23,93
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	31,20	27,69
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	25,70	26,36
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^	25,22	26,85
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^	24,33	20,92
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^	20,19	–
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^	83,18	–
Franklin Responsible Income 2028 Fund^	36,32	53,20
Franklin Responsible Income 2028 Fund^	–	24,34

Los importes que se indican con "–" equivalen a 0.

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

5. 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 particular de declaraciones de dividendos y pagos de dividendos, tal y como se detalla en la tabla siguiente.

Distribución de la designación de clase de acciones	Frecuencia de declaraciones de dividendo	Frecuencia de declaraciones de dividendo
(D)	Diaria	Mensual
(M)	Mensual	Mensual
(Q)	Trimestral	Trimestral (marzo, junio, septiembre, diciembre)
(S)	Semestral	Semestral (marzo, septiembre)
(A)	Anual	Anualmente (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 por inversiones, 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 una parte de, los ingresos netos por inversiones, si los hubiera, se declararán como dividendos. Para cada Accionista de cada Clase de Acción de Distribución, las distribuciones se realizarán en la moneda en la que el Accionista suscribió las acciones, a menos que el Accionista solicite otra cosa.

Para cada Clase de Acciones de Distribución de cada Fondo de Multiactivos (Fondo de Multiactivos según se define en la página 15), en el momento de cada declaración de dividendos, todos o parte de los ingresos netos por inversiones, si los hubiera, se declararán como dividendos. Para cada Accionista de cada Clase de Acción de Distribución, las distribuciones se realizarán en la moneda en la que el Accionista suscribió las acciones, a menos que el Accionista solicite otra cosa.

Las Clases de Acciones de Distribución Plus pueden declarar y pagar distribuciones de capital. Los inversores en estas clases de acciones deben ser conscientes de que el pago de dividendos de capital equivale a una rentabilidad o retirada de parte de la inversión original de un inversor o de ganancias de capital atribuibles a esa inversión original, y dichas distribuciones darán lugar a una disminución inmediata correspondiente en el valor neto de los activos por acción de la clase de acciones. En consecuencia, el pago de distribuciones con cargo al capital dará lugar a una erosión del capital y podrá lograrse renunciando al potencial de crecimiento futuro del capital.

Durante el ejercicio, los siguientes Fondos han pagado distribuciones de capital en las Clases de Acciones de Distribución Plus:

	Distribuciones sin capital para el ejercicio finalizado 29 de febrero de 2024 (en miles)	Distribuciones sin capital para el ejercicio finalizado 28 de febrero de 2023 (en miles)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – Clase A USD de Distribución (M) Plus	47 $	51 $
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	9 $	67 $
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund^ – Clase A USD de Distribución (M) Plus	– $	1 $
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund^ – Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	– $	– $
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund^ – Clase A HKD de Distribución (M) Plus	– $	2 $
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Clase A USD de Distribución (M) Plus	19 $	9 $
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	3 $	1 $
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Clase A HKD de Distribución (M) Plus	1 $	1 $
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	16 $	11 $
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Clase A ZAR de Distribución (M) (cubierta) Plus	152 $	28 $
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Clase A USD de Distribución (M) Plus	29 $	20 $
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Clase A HKD de Distribución (M) Plus	– $	– $
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	9 $	6 $
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund^ – Clase A USD de Distribución (M) Plus	– $	2 $
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund^ – Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	– $	– $
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Clase A USD de Distribución (M) Plus	109 $	101 $
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	108 $	91 $
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	42 $	28 $
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Clase A USD de Distribución (M) Plus	742 $	552 $
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Clase A AUD de distribución (M) (cubierta) Plus	325 $	252 $
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Clase A CNH de distribución (M) (cubierta) Plus	273 $	112 $
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Clase A HKD de distribución (M) Plus	159 $	135 $
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	61 $	29 $
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Clase A SGD de Distribución (M) Plus	11 $	13 $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Clase A HKD de Distribución (M) Plus	– $	1 $
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^ – Clase D USD de Distribución (M) Plus	3 $	1 $
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	3 $	1 $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase A USD de Distribución (M) Plus	434 $	644 $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	482 $	578 $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase A SGD de Distribución (M) Plus	55 $	95 $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase A CNH de Distribución (Mensual) Cubierta Plus	16 $	24 $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase A HKD de Distribución (M) Plus	125 $	169 $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase A GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus	29 $	33 $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase A EUR de Distribución (M) (cubierta) Plus	20 $	34 $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	22 $	41 $
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Clase A USD de Distribución (M) Plus	60 $	69 $
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	22 $	29 $
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus	2 $	3 $
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Clase A HKD de Distribución (M) Plus	4 $	14 $
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	8 $	24 $
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Clase A USD de Distribución (M) (cubierta) Plus	1.909 €	2.309 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus	867 €	762 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	91 €	149 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Clase A Euro de Distribución (M) Plus	121 €	127 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	156 €	256 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Clase A USD Distribución (M) Plus	– €	– €
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Clase Premier USD de Distribución (M) Plus	965 $	1.079 $
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Clase A USD de Distribución (M) Plus	1.335 $	1.580 $
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	160 $	228 $
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus	38 $	28 $
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Clase A EUR de Distribución (M) (cubierta) Plus	173 $	190 $
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Clase A GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus	122 $	88 $
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Clase A HKD de Distribución (M) Plus	26 $	57 $
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	1.363 $	1.531 $
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Clase S USD de Distribución (M) Plus	71 $	116 $
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^ – Clase A USD de Distribución (M) (cubierta) Plus	– €	3 €
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^ – Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus	– €	1 €
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Clase A USD con Distribución (M) Plus	7 $	56 $

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

5. Distribuciones a los tenedores de acciones participativas rescatables (continuación)

	Distribuciones sin capital para el ejercicio finalizado 29 de febrero de 2024 (en miles)	Distribuciones sin capital para el ejercicio finalizado 28 de febrero de 2023 (en miles)
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Clase A AUD con Distribución (M) (cubierta) Plus	5 $	45 $
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Clase A CNH con Distribución (M) (cubierta) Plus	– $	5 $
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Clase A HKD con Distribución (M) Plus	4 $	28 $
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Clase A SGD con Distribución (M) (cubierta) Plus	– $	1 $
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Clase A AUD de Distribución (M) Plus	8 $	7 $
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Clase A SGD de Distribución (M) Plus	1 $	1 $
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Clase A USD de Distribución (M) Plus	– $	– $
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Clase D USD de Distribución (M) Plus	5 $	14 $
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Clase D HKD de Distribución (M) Plus	– $	– $
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Clase D CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus	– $	– $
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Clase D AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	2 $	7 $
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Clase D SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	4 $	3 $

Los importes que se indican con "–" equivalen a cero USD/EUR o son inferiores a 1.000 USD/EUR.

Las Clases de Distribución Plus (e) y de Distribución Plus (u) ofrecidas por algunos de los Fondos pueden cobrar ciertos cargos y gastos al capital en lugar de a los ingresos. Cobrar la totalidad o parte de los honorarios 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 Distribución Plus (u) tienen disponible para inversión en el futuro, y el crecimiento del capital, puede reducirse. Los accionistas deben tener en cuenta que existe un mayor riesgo de que, al rescatar acciones de las Clases de Acciones de Distribución Plus (e) y de Distribución Plus (u), los accionistas no reciban el importe total invertido. Para los inversores en las clases de acciones de Distribución Plus (e) y de Distribución Plus (u), esto puede causar la erosión de la inversión de capital de los inversores a pesar del rendimiento del Fondo relevante, o ganancias de capital atribuibles a esa inversión original, que probablemente disminuirán el valor de los rendimientos futuros. El aumento en el pago de dividendos como resultado del cobro de comisiones y gastos al capital equivale efectivamente a un rendimiento o retirada de la inversión de capital original de un inversor o de ganancias de capital atribuibles a esa inversión original. El mayor nivel de pago de dividendos en virtud de este mecanismo de cobro dará lugar a una disminución inmediata correspondiente del valor neto de los activos 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 de capital. Todos los gastos de las Clases de acciones Distribución Plus (e) se han cargado al capital.

Durante el ejercicio, los siguientes Fondos han cargado comisiones y gastos al capital en las Clases de Distribución Plus (e):

	Honorarios y gastos con cargo al capital para el ejercicio finalizado 29 de febrero de 2024 (en miles)	Honorarios y gastos con cargo al capital para el ejercicio finalizado 28 de febrero de 2023 (en miles)
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Clase A EUR de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	3 $	3 $
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	1 $	1 $
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – Clase S USD de Distribución (M) Plus (e)	138 $	44 $
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – Clase S EUR de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	24 $	13 $
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – Clase S GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	520 $	834 $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	1.965 $	2.562 $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	221 $	307 $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	31 $	56 $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Clase A GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	136 $	192 $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Clase A JPY Distributing (M) Plus (e)	2 $	3 $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	374 $	497 $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Clase A SGD de Distribución (M) Plus (e)	– $	1 $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Clase X GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	19 $	42 $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Clase X USD de Distribución (M) Plus (e)	87 $	– $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Clase A EUR de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	81 $	110 $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Clase A HKD de Distribución (M) Plus (e)	– $	– $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ – Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	201 $	274 $
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ – Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	1 $	1 $
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ – Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	– $	2 $
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^ – Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	– $	6 $
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^ – Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	– $	– $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	1.265 $	1.657 $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase A EUR de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	436 $	446 $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase A GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	82 $	88 $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase X USD de Distribución (M) Plus (e)	113 $	157 $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase X EUR de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	99 $	137 $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase X GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	29 $	52 $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase Premier USD de Distribución (M) Plus (e)	103 $	104 $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase Premier EUR de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	226 $	215 $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	17 $	11 $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase S EUR de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	22 $	25 $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase S GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	1 $	2 $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	231 $	327 $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase S USD de Distribución (Q) Plus (e)	1 $	1 $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase LM USD de Distribución (M) Plus (e)	– $	– $
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Clase LM EUR de Distribución (Q) (cubierta) Plus (e)	125 $	108 $
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^ – Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	– $	1 $
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ – Clase X GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	– $	– $
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ – Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	1 $	– $
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ – Clase S EUR de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	– $	– $
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	– $	2 $
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Clase A EUR de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	– $	5 $
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Clase X EUR de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	1 $	– $
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Clase Premier GBP de Distribución (A) (cubierta) (PH) Plus (e)	37 €	133 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Clase Premier CAD de Distribución (Q) Plus (e)	– €	38 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Clase Premier CAD de Distribución (Q) (cubierta) (PH) Plus (e)	383 €	453 €
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	1.068 $	1.433 $
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Clase A EUR de Distribución (A) Plus (e)	2 $	– $
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Clase U EUR de Distribución (Q) Plus (e)	– $	– $
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Clase U GBP de Distribución (Q) Plus (e)	3 $	– $
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Clase U GBP de Distribución (Q) (cubierta) Plus (e)	1 $	– $
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Clase U USD de Distribución (Q) Plus (e)	17 $	– $
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Clase X USD de Distribución (M) Plus (e)	69 $	298 $
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Clase X EUR de Distribución (Q) (cubierta) Plus (e)	14 $	18 $
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Clase X GBP de Distribución (Q) (cubierta) Plus (e)	3 $	7 $
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	90 $	117 $

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

5. Distribuciones a los tenedores de acciones participativas rescatables (continuación)

	Honorarios y gastos con cargo al capital para el ejercicio finalizado 29 de febrero de 2024 (en miles)	Honorarios y gastos con cargo al capital para el ejercicio finalizado 28 de febrero de 2023 (en miles)
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Clase A Euro de Distribución (M) Plus (e)	8 $	9 $
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Clase S GBP de Distribución (M) Plus (e)	3 $	3 $

Los importes que se indican con "–" equivalen a cero USD/EUR o son inferiores a 1.000 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 neto y ganancia neta atribuible a cada Clase de Acciones de Capitalización se acumule diariamente en el valor neto de los activos por acción de la correspondiente clase de acciones.

6. Capital accionario y participaciones reembolsables

Capital accionario

La Sociedad se constituyó con un capital accionario inicial de 39.000 € representado por 39.000 acciones suscritas sin valor nominal. Todas las acciones suscritas, excepto tres, han sido recompradas por la Sociedad. Los accionistas de las acciones suscritas tienen derecho de asistencia y voto en todas las juntas de la Sociedad, pero no tienen derecho a participar en los dividendos o en los activos netos de ningún Fondo ni 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 en la Sociedad al valor neto de los activos por acción en las condiciones que consideren convenientes. 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 tiene diferentes clases de acciones ofrecidas según se indica en el Folleto de la Sociedad. Estas diferentes clases de acciones difieren principalmente en términos de sus cargos de venta, honorarios, tasas de gastos, política de distribución y denominación de la moneda. Por lo tanto, los inversores pueden elegir la clase de acciones que mejor se adapte a sus necesidades de inversión, teniendo en cuenta la cantidad de inversión y el período de tenencia previsto.

Cada clase de acciones se designa como una Clase de Acciones de Distribución o una Clase de Acciones de Capitalización. Las Clases de Acciones de Capitalización no distribuyen ingresos netos, ganancias netas de capital materializadas o latentes, mientras que las Clases de Acciones de Distribución distribuirán a determinados intervalos, que variarán dependiendo de la letra entre paréntesis al final del nombre de la Clase de Acciones de Distribución, tal y como se explica en la Nota 5 – Distribuciones a los tenedores de participaciones reembolsables Además, la Sociedad tiene acciones suscritas en circulación. Las acciones suscritas no dan derecho a los titulares a participar en los activos de ningún Fondo.

Cada Fondo podrá ofrecer clases de acciones designadas en monedas distintas de la moneda base del Fondo. Para cada una de dichas clases de acciones, a menos que se indique mediante "(cubierta)" en el nombre de la clase de acciones, el Gestor de Inversiones y el Gestor de Subinversiones pertinentes no emplearán ninguna técnica para cubrir la exposición de la clase de acciones a las variaciones en los tipos de cambio entre la divisa base del Fondo y la divisa de la clase de acciones.

Las Acciones de Clase A están disponibles para todos los inversores. Los distribuidores pueden realizar pagos de comisiones/descuentos a intermediarios u otros inversores que tengan un acuerdo con un distribuidor con respecto a dichas acciones. Las Acciones Clase 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 realizar pagos de comisiones a intermediarios u otros inversores que tengan un acuerdo con un distribuidor con respecto a dichas acciones. Las Acciones Clase F están a disposición de inversores profesionales e inversores con un acuerdo de inversión discrecional con un intermediario designado por el distribuidor con respecto a dichas acciones. Los distribuidores pueden realizar pagos de comisiones/descuentos 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 japonesa, a discreción de los Administradores o distribuidores. Las Acciones de Clase M están disponibles para inversores profesionales e inversores con un acuerdo de inversión discrecional con un intermediario 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 Clase T son para distribución taiwanesa, a discreción de los Directores o Distribuidores. Las Acciones de Clase X están disponibles para intermediarios, administradores de cartera o plataformas que, de acuerdo con los requisitos reglamentarios o sobre la base de acuerdos de honorarios con sus clientes, no están autorizados a aceptar y retener comisiones de seguimiento; e inversores institucionales (para los inversores en la Unión Europea, esto significa "Contrapartes Elegibles", según se define en MIFID II) que invierten por su propia cuenta. Las Acciones Clase U, Y así como S están a disposición de inversores institucionales a discreción de los Administradores o distribuidores. Las Clases de Acciones BW LM están disponibles a discreción de los Administradores o distribuidores para inversores cualificados que sean miembros del grupo Franklin Templeton o clientes de dichos miembros. Las Clases de acciones de LM están disponibles a discreción de los Directores o distribuidores para inversores cualificados que sean miembros 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 con sede en la Unión Europea, las Clases de Acciones BW Premier están disponibles a discreción de los Directores o distribuidores para las "Contrapartes Elegibles", según se define en MIFID II; para los inversores con sede fuera de la Unión Europea, las Clases de Acciones BW Premier están disponibles para inversores institucionales a discreción de los Directores o distribuidores o para los inversores elegibles que sean miembros del grupo Franklin Templeton o clientes de dichos miembros. Para los inversores establecidos en la Unión Europea, las Clases de Acciones Premier están disponibles para las "Contrapartes Elegibles" según se define en la MIFID II; para los inversores establecidos fuera de la Unión Europea, las Clases de Acciones Premier están disponibles para inversores institucionales.

Para las clases de acciones que incluyan "(Cubiertas)" en su nombre después de la denominación de la divisa, se pretende que dichas clases de acciones se cubran contra movimientos en los tipos de cambio entre la divisa de la clase de acciones y la divisa base del Fondo en cuestión. Ciertas clases de acciones en Fondos administrados 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 acciones. Los Fondos administrados por Brandywine Global Investment Management, LLC y el TGF ClearBridge Infrastructure Value Fund administrado 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 acciones. Ciertos Fondos ofrecen clases de acciones que pueden pagar una comisión de rentabilidad, según lo indicado por "(PF)" en el nombre de la clase de acciones.

Ciertos Fondos también han emitido Clases de Acciones con derechos adquiridos, según lo indicado por la inclusión de "GA", "GE", "GP" o "(G)" en el nombre de la clase de acciones. Las Clases de Acciones con derechos adquiridos están disponibles únicamente para los titulares únicos de los fondos afiliados. Las Clases de Acciones con derechos adquiridos están cerradas a cualquier suscripción posterior, tanto por accionistas existentes de la clase de acciones como por nuevos inversores, excepto que las acciones pueden seguir adquiriéndose a través de (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) intercambios de acciones de una Clase de Acciones Protegidas con la misma designación de letra. Sin perjuicio de lo anterior, tal y como se indica en los Suplementos de los Fondos, determinadas Clases de Acciones con derechos adquiridos para determinados Fondos pueden ponerse a disposición de suscripciones posteriores por parte de los accionistas existentes en la clase de acciones a exclusivo criterio de los Administradores.

7. 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 sobre la Sociedad con respecto a hechos imponibles cuando:

(i) un accionista que no sea ni residente en Irlanda ni residente habitual en este país 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.

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

8. 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. Las "Cuentas de margen y efectivo restringido" en el Estado de la situación financiera representan depósitos de margen, garantías reales en efectivo, y ganancias y pérdidas materializadas en contratos de futuros aún no entregados. A 29 de febrero de 2024 y 28 de febrero de 2023, los depósitos de margen y las garantías en efectivo, mantenidos en relación con operaciones OTC y operaciones con derivados negociados en bolsa, se mantenían con los siguientes agentes: Bank of America Merrill Lynch, BNP Paribas, BNY Mellon, Citi, Goldman Sachs, HSBC, JP Morgan, Morgan Stanley y UBS.

9. Compromisos y responsabilidades contingentes

No se registraron compromisos ni responsabilidades condicionales significativas a 29 de febrero de 2024 ni a 28 de febrero de 2023.

10. 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 al ejecutar decisiones para negociar en nombre de esos Fondos en el contexto de la gestión de las carteras de los Fondos. A estos efectos, deberán adoptarse todas las medidas razonables para obtener el mejor resultado posible para los Fondos, teniendo en cuenta el precio, los costes, la velocidad, la probabilidad de ejecución y liquidación, el tamaño y la naturaleza de la orden, o cualquier otra contraprestación pertinente para la ejecución de la orden. El Gestor de Inversiones, el Subgestor de Inversiones o cualquiera de sus personas vinculadas no conservará los reembolsos en efectivo recibidos de un agente o intermediario como contraprestación por operaciones de corretaje del Fondo dirigidas a ese agente o intermediario. La Sociedad no asumirá los costes de la investigación externa obtenida por los Gestores de Inversiones y los Gestores de Subinversiones. Estos costes serán asumidos por el Gestor de Inversiones o el Gestor de Subinversiones correspondiente. La información sobre las políticas de ejecución de los Fondos está a disposición de los Accionistas sin cargo alguno, previa solicitud.

Durante los ejercicios financieros cerrados el 29 de febrero de 2024 y el 28 de febrero de 2023, Royce & Associates, LP ("Royce") celebró acuerdos de comisiones blandas con agentes, pero reembolsó los Fondos pertinentes por los costes de investigación incurridos como parte de dichos acuerdos.

11. Tipos de cambio

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

	Moneda	Tipos de cambio a 29 de febrero de 2024	Tipos de cambio a 28 de febrero de 2023
Fondos denominados en USD	Peso argentino	1.059,2180*	366,3138
	Dólar australiano	1,5385	1,4861
	Real brasileño	4,9711	5,2355
	Libra británica	0,7922	0,8314
	Dólar canadiense	1,3572	1,3645
	Renminbi chino (CNH)	7,2064	6,9499
	Renminbi chino (CNY)	7,1933	6,9394
	Peso colombiano	3.925,0000	4.859,4300
	Corona checa	23,4451	22,2152
	Corona danesa	6,8965	7,0371
	Peso dominicano	58,6500	s/d
	Libra egipcia	42,2500	30,6300
	Euro	0,9252	0,9454
	Dólar de Hong Kong	7,8295	7,8494
	Forinto húngaro	363,2263	s/d
	Rupia india	82,9163	82,6675
	Rupia indonesia	15.715,0000	15.250,0000
	Shekel israelí	s/d	3,6534
	Dólar jamaicano	155,9966	s/d
	Yen japonés	149,9200	136,1550
	Ringgit malasio	4,7455	4,4875
	Peso mexicano	17,0443	18,2965
	Dólar neozelandés	1,6424	1,6173
	Corona noruega	10,6213	10,3848
	Rupia pakistaní	s/d	261,5000
	Nuevo sol peruano	s/d	3,7949
	Peso filipino	56,2150	55,3500
	Zloty polaco	3,9931	4,4486
	Rublo ruso	91,5000	75,0500
	Rial saudí	3,7503	3,7527
	Dólar de Singapur	1,3456	1,3485
	Rand sudafricano	19,1800	18,3650
	Won surcoreano	1.331,6000	1.323,2500
	Corona sueca	10,3664	10,4680
	Franco suizo	0,8844	0,9419
	Dólar taiwanés	31,6095	30,4695
	Bat tailandés	35,8650	35,3413
	Lira turca	31,2315	18,8850
	Dírham de los Emiratos Árabes Unidos	3,6730	s/d
	Peso uruguayo	39,1450	s/d

	Moneda	Tipos de cambio a 29 de febrero de 2024	Tipos de cambio a 28 de febrero de 2023
Fondos denominados en EUR	Dólar australiano	1,6628	1,5719
	Real brasileño	5,3728	5,5375
	Libra británica	0,8562	0,8793
	Dólar canadiense	1,4668	1,4432
	Corona danesa	7,4537	7,4431
	Yen japonés	162,0336	144,0112
	Corona noruega	11,4795	s/d
	Zloty polaco	4,3157	4,7052
	Rand sudafricano	20,7298	19,4247
	Corona sueca	11,2040	11,0720
	Franco suizo	0,9558	0,9962
	Dólar estadounidense	1,0808	1,0577

	Moneda	Tipos de cambio a 29 de febrero de 2024	Tipos de cambio a 28 de febrero de 2023
Fondos denominados en GBP	Euro	s/d	1,1372
	Yen japonés	s/d	163,7741
	Dólar estadounidense	1,2623	1,2029

* Tarifa diaria con descuento, basada en el índice ARS Eqy EqWgt Impli (UNOFFICIAL), según las instrucciones de FTIS.

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo

Tras su nombramiento como sociedad gestora de OICVM de la Sociedad, con la responsabilidad de gestionar la Sociedad y de determinadas funciones de gestión, administración y distribución de inversiones con respecto a la Sociedad, tal y como se establece en el Reglamento sobre OICVM, FTIS (la "Gestor") ha tomado la decisión de delegar algunas, pero no todas, las actividades de gestión de inversiones a los Gestores de Inversiones y/o Subgestores de Inversiones pertinentes, siempre que el Gestor siga siendo responsable ante los Fondos del cumplimiento de sus obligaciones acordadas (consulte en las páginas de Información General la relación de Gestores de Inversiones y Subgestores de Inversiones de cada Fondo, según proceda, de acuerdo con el Folleto).

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

La Sociedad, junto con el Gestor y los Gestores de Inversiones, ha determinado que algunos de sus riesgos importantes son el riesgo de mercado, el riesgo de crédito y el riesgo de liquidez. Con respecto al uso de instrumentos financieros derivados, los riesgos son el riesgo de contraparte, el riesgo de crédito, el aumento de los márgenes de garantía y el riesgo ilimitado de pérdida. A continuación, se especifican más detalles de estos y otros riesgos, así como en el Folleto de la Sociedad bajo "Factores de Riesgo".

El riesgo de mercado incluye el riesgo de precios de mercado, el riesgo de tipo de cambio, el riesgo de tipo de interés y otros riesgos de precios.

El riesgo de precios de mercado es el riesgo de que el valor razonable o los futuros flujos de efectivo de un instrumento financiero fluctúe debido a cambios en los precios de mercado. El riesgo de precios máximo que conlleva la propiedad de instrumentos financieros, excluyendo derivados, viene determinado por el valor razonable de los instrumentos financieros. Los Gestores o Subgestores de Inversiones pueden considerar la asignación de activos de las carteras con el fin de minimizar el riesgo asociado a determinados países, sectores industriales o valores, sin dejar de seguir el objetivo de inversión de cada Fondo, tal y como se indica en el suplemento del Fondo aplicable del Folleto. El riesgo es gestionado por cada Gestor de Inversiones o Subgestor de Inversiones, según proceda, mediante una cuidadosa selección de valores y otros instrumentos financieros dentro de los límites y mandatos de inversión especificados. Los detalles de las políticas de inversión de cada Fondo se describen en el suplemento aplicable al Folleto del Fondo correspondiente. Los detalles de los activos y pasivos financieros de los Fondos se recogen en el Estado de la situación financiera.

El riesgo de tipo de cambio es el riesgo de que el valor de los futuros flujos de efectivo de un instrumento financiero fluctúe debido a variaciones del tipo de cambio entre la divisa en que están denominados los activos o pasivos financieros, y la moneda funcional de los Fondos. El valor de las inversiones de un Fondo denominados en otra divisa distinta de la moneda funcional puede aumentar y disminuir debido a las fluctuaciones del tipo de cambio en relación con las divisas correspondientes. Existe un riesgo de que unas grandes fluctuaciones de tipo de cambio puedan tener un impacto significativo sobre el comportamiento de los Fondos.

Cuando un Fondo mantenga inversiones en una moneda distinta de la moneda funcional de dicho Fondo, el Gestor de Inversiones o el Gestor de Subinversiones pertinente podrán gestionar el riesgo de tipo de cambio cubriendo la moneda extranjera en la moneda funcional del Fondo o, alternativamente, diversificando las inversiones entre múltiples monedas utilizando una red de negociación de divisas multibancaria.

El riesgo de tipo de interés es el riesgo de que el valor de un instrumento financiero fluctúe debido a variaciones en el tipo de interés de mercado. Los Fondos que mantienen títulos de deuda a tipo de interés fijo y posiciones de descubierto están expuestos al riesgo de tipo de interés cuando el valor de estos títulos o préstamos puede fluctuar como resultado de un cambio en los tipos de interés. Las tenencias de valores con tipos de interés flotante y variable pueden también estar sujetas al riesgo de tipo de interés, si bien en menor medida. Los activos en efectivo mantenidos a través del Depositario tienen el potencial de producir ingresos por intereses, cuyo nivel fluctuará según el nivel prevaleciente de los tipos de interés del mercado.

Por lo general, los Fondos de Renta Variable no invierten en ningún valor que devengue intereses, salvo los saldos en efectivo mantenidos con el Depositario. Los activos líquidos producen ingresos por intereses, cuyo nivel fluctuará en función del nivel vigente de los tipos de interés del mercado. Como resultado, los fondos de capital no están sujetos a cantidades significativas de riesgo debido a las fluctuaciones en los niveles predominantes de los tipos de interés de mercado en sus activos financieros y pasivos financieros.

Los Fondos de Renta Fija y los Fondos Multiactivos invierten en activos financieros y pasivos financieros que devengan intereses, lo que les expone a riesgos asociados a los efectos de las fluctuaciones de los niveles vigentes de los tipos de interés de mercado sobre sus posiciones financieras y flujos de tesorería. El valor de las inversiones en títulos con tipos de interés fijo podría estar sujeto a la volatilidad de precios debido a los cambios en los tipos de interés. Las fluctuaciones de los tipos de interés de mercado afectarán al nivel de los intereses percibidos por un Fondo.

Un aumento en los tipos de interés reducirá, normalmente, el valor de los títulos de deuda que están emitidos y en circulación, mientras que una reducción de los tipos de interés aumentará el valor de los títulos de deuda emitidos y en circulación. El alcance de estas fluctuaciones de precios será mayor cuando el plazo de vencimiento de los títulos en circulación sea más largo. Los cambios que se producen en el valor de los títulos mantenidos por un Fondo cuando varían los tipos de interés, implican que el valor liquidativo por acción de un Fondo puede aumentar o disminuir en función del efecto sobre los títulos de deuda de la cartera del Fondo.

El Administrador de cada Fondo de Renta Fija supervisa el entorno de los tipos de interés y evalúa los riesgos en las principales estrategias. El riesgo de tipo de interés se controla mediante la supervisión de los vencimientos y la duración en relación con los criterios de referencia de los Fondos. Se utilizan técnicas como la medición de la duración del tipo de referencia para evaluar las exposiciones de las curvas de cartera.

Los detalles del rendimiento medio ponderado de cada Fondo de renta fija, los años medios ponderados hasta su vencimiento y un análisis de los valores fijos y que no devengan intereses figuran en las Notas 12.1(b) y 12.1(c) siguientes.

Los riesgos que implica invertir en fondos de renta variable incluyen cambios en las condiciones económicas, las condiciones de la industria y la empresa y la selección de valores. Los fondos de renta fija y los fondos multiactivos también están sujetos al riesgo de tipo de interés, riesgo de crédito, riesgo de vencimiento y riesgo de mercado. Los valores internacionales están sujetos a fluctuaciones en los tipos de cambio, mercados menos líquidos, e inestabilidad política y económica dependiendo del país. Los mercados en desarrollo también están expuestos a estos mismos riesgos, si bien en mayor medida. A efectos de una gestión eficiente de la cartera, los Fondos podrán suscribir derivados negociados o extrabursátiles ("OTC", por sus siglas en inglés), incluidos, entre otros, futuros, swaps, contratos a plazo, opciones y warrants, y podrán celebrar contratos de préstamo de acciones.

El Comité de Gestión de Inversiones y Supervisión de Carteras ("IMPOC" o el "Comité") se ha creado en Franklin Templeton para supervisar la delegación de responsabilidades de gestión de inversiones para todos los Fondos. El Comité está compuesto de miembros que, como grupo, tienen experiencia y conocimientos especializados en áreas como gestión de inversiones, análisis de inversiones y elaboración de informes; gestión del riesgo, y cumplimiento normativo. El Comité es responsable, por cuenta del Gestor, de supervisar que los Fondos se gestionen con arreglo a las pautas de inversión y los límites establecidos en el Folleto Informativo y el Reglamento, así como las propias pautas de inversión y límites internos de los Gestores o de los Subgestores de Inversiones. El Comité se reúne generalmente una vez al mes a fin de supervisar una correcta gestión de los Fondos con arreglo a estos límites y exigencias de regulación. Los respectivos Gestores de Inversiones y/o Gestores de Subinversiones, según proceda, informan al Comité de los asuntos que surjan en relación con el seguimiento de determinados riesgos significativos derivados de las inversiones de un Fondo en instrumentos financieros.

12.1 Riesgo de mercado

Los Fondos que utilizan instrumentos financieros derivados ("IED") busca limitar el riesgo de mercado y el apalancamiento creados mediante el uso de derivados utilizando el enfoque de compromiso o utilizando una sofisticada técnica de medición del riesgo conocida como "valor en riesgo" (el "enfoque VaR"). Los Fondos que utilizan IED (salvo FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^, FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^, FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^, Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^, FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^, FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund^, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^, FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ y FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^) utilizan el enfoque de compromiso. FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^, FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^, FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^, Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^, FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^, FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund^, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^, FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ y FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ utilizan el enfoque VaR.

El Gestor emplea un proceso de gestión de riesgos que le permite medir, supervisar y gestionar con precisión los riesgos asociados a las posiciones de IED.

El enfoque de compromiso calcula el apalancamiento midiendo el valor de mercado de las exposiciones subyacentes de los derivados en relación con el Valor Neto de los Activos del fondo en cuestión. VaR es una metodología estadística que busca predecir, utilizando datos históricos, la pérdida máxima probable que podría sufrir un Fondo, calculada para un nivel de confianza específico (por ejemplo, "una cola" 99 por ciento). FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^, FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^, FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^, Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^, FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^, FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^, FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ y FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ utilizan un modelo de VaR "absoluto" en el que la medición del VaR es relativa al Valor Neto de los Activos del Fondo. Un modelo de VaR tiene ciertas limitaciones inherentes y no se puede confiar en él para predecir o garantizar que el tamaño o la frecuencia de las pérdidas incurridas por un Fondo se limitarán en ninguna medida. Dado que el modelo de VaR se basa en los datos históricos del mercado como una de sus principales aportaciones, si las condiciones actuales del mercado difieren de las del período histórico de observación, la eficacia del modelo de VaR en la predicción del VaR de un Fondo puede verse afectada significativamente. Los inversores pueden sufrir graves consecuencias financieras en condiciones de mercado anormales.

La eficacia del modelo VaR podría verse afectada de manera similar si otras suposiciones o componentes incluidos en el modelo VaR resultan ser inadecuados o incorrectos.

Western Asset Management Company Limited y Western Asset Management Company, LLC ("Western Asset") calculan el VaR a un nivel de confianza del 99 % para un horizonte temporal de 1 día utilizando una muestra apropiada de datos históricos. En la tabla siguiente se indica el valor de riesgo absoluto de los Fondos:

Fondo	A 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	2,36 %	2,48 %
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	1,10 %	1,38 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^	0,81 %	0,62 %
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^	1,47 %	1,64 %

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

Brandywine Global Investment Management, LLC ("Brandywine") calcula el VaR a un nivel de confianza del 95 % para un horizonte temporal de 1 día utilizando 2 años de datos históricos. En la tabla siguiente se indica el valor de riesgo absoluto de los Fondos:

Fondo	A 29 de febrero de 2024	A 28 de febrero de 2023
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	0,77 %	1,06 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	0,62 %	1,11 %
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	0,50 %	0,47 %
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^	1,23 %	1,68 %
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^	0,61 %	1,11 %

Where FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^, FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^, FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^, Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^, FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^, FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^, FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ y FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ utilizan un modelo de VaR absoluto, de acuerdo con los requisitos del Banco Central, cada uno de estos Fondos está sujeto a un límite de VaR absoluto del 20 % del Valor Neto de los Activos del Fondo. Sin embargo, cada uno de estos Fondos puede experimentar ocasionalmente un cambio en el Valor Neto de los Activos a lo largo de un período de posesión de 20 días superior al 20 % del Valor Neto de los Activos.

Además de utilizar el enfoque VaR, el Gestor de FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^, FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^, FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^, Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^, FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^, FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^, FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ y FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ supervisa diariamente los niveles de apalancamiento para controlar los cambios debidos a los movimientos del mercado. Además, los respectivos Gestores de Inversiones y/o Gestores de Subinversiones de cada uno de estos Fondos llevarán a cabo pruebas previas a la comercialización para considerar el impacto que el comercio tendría en el apalancamiento general del Fondo en cuestión y para considerar los niveles de riesgo/recompensa del comercio.

A continuación, se muestran los niveles más bajos, medios y altos de VaR, con un nivel de confianza del 99 % para un horizonte temporal de 20 días, para los Fondos Western Asset y Brandywine relevantes:

Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024

Fondo	Mínimo	Promedio	Máximo
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	7,65 %	12,29 %	19,71 %
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	4,88 %	5,71 %	7,25 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^	2,52 %	3,25 %	5,16 %
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^	4,55 %	7,71 %	9,37 %
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	4,77 %	5,59 %	7,45 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	3,87 %	5,10 %	5,84 %
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	2,11 %	4,52 %	8,80 %
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^	7,64 %	8,23 %	8,83 %
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^	3,39 %	4,51 %	5,24 %

Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023

Fondo	Mínimo	Promedio	Máximo
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	5,88 %	9,42 %	13,64 %
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	3,67 %	5,96 %	10,72 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^	2,19 %	3,38 %	4,80 %
Western Asset SMASh Series Core Plus Completion Fund^	5,02 %	8,46 %	13,23 %
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	1,70 %	3,78 %	6,70 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	1,93 %	4,17 %	6,99 %
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	1,77 %	3,20 %	5,69 %
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^	6,67 %	8,75 %	10,62 %
FTGF Global Multi-Sector Impact Fund^	1,59 %	4,30 %	5,04 %

En el caso de los Fondos que utilizan el VaR, el apalancamiento se calcula como la suma de las notas de los derivados utilizados.

Los niveles medios de apalancamiento empleados fueron los siguientes:

Fondo	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	1.522,96 %	1.555,99 %
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	95,37 %	132,04 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^	24,33 %	34,70 %
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^	415,50 %	415,50 %
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	191,10 %	216,30 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	64,20 %	107,40 %
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	72,85 %	98,80 %
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^	130,53 %	222,50 %
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^	74,62 %	87,00 %

Las pruebas de resistencia son el examen de los posibles efectos sobre la situación financiera de un Fondo de una serie de cambios específicos en los factores de riesgo, relacionados con acontecimientos excepcionales, pero posibles. Western Asset adopta un enfoque conservador al aplicar pruebas de resistencia que exceden el rango de ocurrencias razonablemente probables. Western Asset espera (aunque no hay garantías) que, si FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund es capaz de soportar pruebas de resistencia que exceden el rango de sucesos razonablemente probables, el Valor Neto del Activo por acción (o cualquier clase particular de acción) de este Fondo se mantenga estable en caso de eventos de mercado negativos razonables.

Puede utilizarse una prueba de estrés basada en escenarios para cumplir el requisito de análisis de sensibilidad de la FRS 102. La FRS 102 no prescribe un movimiento específico de puntos básicos o de porcentaje para los análisis de sensibilidad. Por consiguiente, a efectos del presente informe anual, se muestra el impacto monetario en el FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund de un aumento instantáneo de 25 puntos básicos en los tipos de interés a corto plazo:

	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund
A 29 de febrero de 2024	(223.701 $)
A 28 de febrero de 2023	(62.727 $)

(a) Riesgo de precio del mercado

El precio de mercado de los siguientes Fondos es objeto de seguimiento respecto de un índice, pero no se gestiona. Los índices a 29 de febrero de 2024 y 28 de febrero de 2023 se describen a continuación.

Las siguientes tablas establecen el índice para cada Fondo, excepto para FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^, FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^, FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^, Western Asset OICVM SMASh Series Core Plus Completion Fund^, FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^, FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund^, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^, FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ y FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^, y cuantifican el impacto probable sobre el valor del activo neto de cada Fondo en función de movimientos positivos y negativos en el índice, incluida una beta anual para cada Fondo. Beta es una medida de la volatilidad de los valores de un fondo en relación con el mercado o el índice. Si bien la beta ofrece una medida clara y cuantificable, no incorpora nueva información, y los movimientos de precios pasados no prevén el futuro con precisión.

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(a) Riesgo de precio del mercado (continuación)

A 29 de febrero de 2024

Fondo	Índice	Moneda	Impacto sobre el valor neto de los activos debido a un movimiento en el índice (en miles) Positivo 5 % *	Negativo 5 % *
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	FTSE Treasury Bill 1-Month	USD	(10.180)	10.180
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index	USD	11.022	(11.022)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index	USD	50.192	(50.192)
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	FTSE Euro Broad Investment-Grade Bond Index	EUR	2.988	(2.988)
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity	USD	258.671	(258.671)
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Bloomberg U.S. Corporate High Yield Bond Index 2 % Issuer Capped	USD	4.844	(4.844)
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Bloomberg Global High Yield Index Currency Hedged (USD)	USD	2.912	(2.912)
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Markit iBoxx Asian Local Bond Index	USD	12.363	(12.363)
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund **	ICE BofA U.S. Treasury 1-10 Years Index	USD	16.291	(16.291)
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	Bloomberg Global Aggregate Index Currency Hedged (USD)	USD	9.585	(9.585)
FTGF Western Asset Global Credit Fund^	Bloomberg Global Aggregate Credit Index Currency Hedged (USD)	USD	1.328	(1.328)
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	Bloomberg U.S. Mortgage Backed Securities Index	USD	55.874	(55.874)
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	FTSE World Government Bond Index	USD	11.323	(11.323)
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^	Bloomberg Global High Yield Index	USD	1.321	(1.321)
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	FTSE World Government Bond Index	USD	16.124	(16.124)
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^ ***	Bloomberg U.S. Aggregate	USD	s/d	s/d
FTGF ClearBridge Value Fund	Russell 1000 Value Index	USD	60.956	(60.956)
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	S&P 500 Index	USD	8.644	(8.644)
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	Russell 1000 Growth Index	USD	94.800	(94.800)
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	Russell 3000 Growth Index	USD	9.027	(9.027)
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	Dow Jones U.S. Select Dividend Index (Total)	USD	1.264	(1.264)
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	Russell 3000 Index	USD	71.499	(71.499)
FTGF ClearBridge Global Growth Fund^	MSCI AC World Net Index	USD	859	(859)
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^	OECD G7 CPI + 5,5 %. CPI: Consumer Price Index (Inflation)	EUR	42.112	(42.112)
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	OECD G7 CPI + 5,5 %. CPI: Consumer Price Index (Inflation)	USD	7.715	(7.715)
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^ ***	MSCI World Value Net Index	USD	s/d	s/d
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Russell 2000 Value Index	USD	32.566	(32.566)
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Russell 2000 Index	USD	4.581	(4.581)
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^	MSCI AC World Index Small Cap Net Index	USD	233	(233)
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	MSCI AC World Net Index	USD	8.500	(8.500)
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	50 % MSCI AC Asia Pacific Ex Japan Equity REITS Net Index /50 % MSCI AC Asia Pacific Ex Japan/UTILITIES Net Index	USD	948	(948)
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	MSCI Emerging Markets Net Index	USD	1.714	(1.714)
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^	MSCI Europe Value Index	EUR	13.292	(13.292)
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^ ***	Índice de referencia no disponible	USD	s/d	s/d
Franklin Responsible Income 2028 Fund^ **	30 % Bloomberg Euro High Yield 3-5 Yr + 70 % Bloomberg Euro Corporate 3-5 Yr	EUR	4.325	(4.325)

* El resultado más probable se basa en un mejor rendimiento relativo de +5 % o un peor rendimiento relativo de –5 % frente al rendimiento anual actual del índice de referencia.

** El fondo no tiene un índice como referencia, por lo que se utilizó un índice sustituto como indicador para el cálculo de la beta.

*** El fondo no tiene 1 año de rendimiento; por lo tanto, la versión beta no está disponible para el fondo.

A 28 de febrero de 2023

Fondo	Índice	Moneda	Impacto sobre el valor neto de los activos debido a un movimiento en el índice (en miles) Positivo 5 % *	Negativo 5 % *
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	FTSE Treasury Bill 1-Month (USD)	USD	26.917	(26.917)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index	USD	8.535	(8.535)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index	USD	76.497	(76.497)
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	FTSE Euro Broad Investment-Grade Bond Index	EUR	7.320	(7.320)
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity	USD	533.447	(533.447)
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Bloomberg U.S. Corporate High Yield Bond Index 2 % Issuer Capped	USD	6.239	(6.239)
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Bloomberg Global High Yield Index Currency Hedged (USD)	USD	3.132	(3.132)
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Markit iBoxx Asian Local Bond Index	USD	20.499	(20.499)
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund**	ICE BofA U.S. Treasury 1-10 Years Index	USD	25.905	(25.905)
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	Bloomberg Global Aggregate Index Currency Hedged (USD)	USD	9.824	(9.824)
FTGF Western Asset Global Credit Fund^	Bloomberg Global Aggregate Credit Index Currency Hedged (USD)	USD	2.680	(2.680)
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	Bloomberg U.S. Mortgage Backed Securities Index	USD	57.923	(57.923)
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^	ICE Bank of America Merrill Lynch Sterling Non-Gilt Index Gross Dividends (GBP)	GBP	2.438	(2.438)
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^	Bloomberg U.S. Credit Index	USD	5.237	(5.237)
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^	Bloomberg Global Aggregate – Corporate Index Currency Hedged (USD)	USD	488	(488)
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	FTSE World Government Bond Index	USD	11.449	(11.449)
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^	Bloomberg Global High Yield Index	USD	500	(500)
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	FTSE World Government Bond Index	USD	14.110	(14.110)

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(a) Riesgo de precio del mercado (continuación)

A 28 de febrero de 2023 (continuación)

			Impacto sobre el valor neto de los activos debido a un movimiento en el índice (en miles)	
Fondo	**Índice**	**Moneda**	**Positivo 5 % ***	**Negativo 5 % ***
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	ICE Bank of America Merrill Lynch Global High Yield BB-B Index	USD	407	(407)
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	Russell 1000 Value Index	USD	134	(134)
FTGF ClearBridge Value Fund	Russell 1000 Value Index	USD	49.285	(49.285)
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	S&P 500 Index	USD	7.716	(7.716)
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	Russell 1000 Growth Index	USD	59.710	(59.710)
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	Russell 3000 Growth Index	USD	8.695	(8.695)
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	Dow Jones U.S. Select Dividend Index (Total)	USD	1.728	(1.728)
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^	Russell 3000 Index	USD	81.564	(81.564)
FTGF ClearBridge Global Growth Fund^	MSCI AC World Net Dividends Index	USD	681	(681)
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^	OECD G7 CPI + 5,5 %. CPI: Consumer Price Index (Inflation)	EUR	(166.313)	166.313
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	OECD G7 CPI + 5,5 %. CPI: Consumer Price Index (Inflation)	USD	(99.562)	99.562
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Russell 2000 Value Index	USD	41.755	(41.755)
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Russell 2000 Index	USD	3.868	(3.868)
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^	MSCI AC World Index Small Cap Net Index	USD	224	(224)
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^	MSCI AC Asia Pacific ex Japan Net Dividends Index	USD	862	(862)
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	MSCI AC Asia ex-Japan Net Dividends Index	USD	206	(206)
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	MSCI AC World Net Dividends Index	USD	9.398	(9.398)
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	50 % MSCI AC Asia Pacific Ex Japan Equity REITS Index Net Dividends (USD)/50 % MSCI AC Asia Pacific Ex Japan/UTILITIES Index Net dividends (USD)	USD	1.001	(1.001)
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	MSCI Emerging Markets Net Index	USD	1.985	(1.985)
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^	MSCI Europe Value Index	EUR	14.681	(14.681)
Franklin Responsible Income 2028 Fund^ ***	Índice de referencia no disponible	EUR	s/d	s/d

* El resultado más probable se basa en un mejor rendimiento relativo de +5 % o un peor rendimiento relativo de –5 % frente al rendimiento anual actual del índice de referencia.

** El fondo no tiene un índice como referencia, por lo que se utilizó un índice sustituto como indicador para el cálculo de la beta.

*** El fondo no tiene 1 año de rendimiento; por lo tanto, la versión beta no está disponible para el fondo.

Este análisis de sensibilidad no debe utilizarse como una predicción de la rentabilidad futura.

El análisis de sensibilidad al riesgo de precio de mercado para FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^, FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^, FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^, Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^, FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^, FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^, FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ y FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ se ha incorporado al cálculo del riesgo de mercado utilizando el enfoque VaR (Nota 12.1 anterior).

(b) Riesgo de tipo de cambio

Una parte de los activos financieros de los Fondos está denominada en divisas distintas del dólar estadounidense y el euro (las monedas funcionales o monedas base de los Fondos), lo que produce el efecto de que el Estado de la Situación Financiera y la rentabilidad total puedan verse considerablemente afectados por los movimientos de las divisas.

Western Asset tiene un fuerte sesgo para cubrir todas las monedas extranjeras en la moneda funcional de la cartera del Fondo. Por lo general, Western Asset solo dejará sin cobertura una pequeña parte de la cartera, y solo si las perspectivas sugieren claramente que el riesgo cambiario es atractivo. En otras carteras, las coberturas se aplican siempre que se considere que una moneda corre el riesgo de depreciarse por encima del coste de la operación de cobertura. Western Asset puede cruzar la cobertura a monedas no funcionales, siempre y cuando lo permitan las directrices, bajo límites severos (normalmente menos del 5 % de la cartera), y tratando de reflejar una exposición relativa al índice de referencia.

Los siguientes cuadros recogen la exposición neta de los Fondos a las divisas a 29 de febrero de 2024 y 28 de febrero de 2023.

Los importes representados a continuación son principalmente activos y pasivos monetarios, salvo las inversiones en valores sin intereses, incluidos los planes de inversión colectiva, que no son activos monetarios.

Los importes que se indican a continuación para los contratos de divisas a plazo representan los valores que se han de recibir en virtud de los contratos de divisas e incluyen las operaciones de cobertura de divisas. Mientras que los importes anotados para otros derivados representan la apreciación o depreciación latente al final del ejercicio.

A 29 de febrero de 2024

Moneda	**Inversiones en títulos de interés fijo (en miles)**	**Inversiones en títulos de interés variable (en miles)**	**Inversiones en valores que no devengan intereses (en miles)**	**Contratos de divisas a plazo (en miles)**	**Otros derivados (en miles)**	**Otros activos/ (pasivos) netos (en miles)**	**Valor Neto de los Activos total (en miles)**
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund							
Dólar estadounidense	$ 813.894	$ 312.341	$ –	$ –	$ –	$ (11.817)	$ 1.114.418
Total	$ 813.894	$ 312.341	$ –	$ –	$ –	$ (11.817)	$ 1.114.418
FTGF Western Asset US Core Bond Fund							
Dólar estadounidense	$ 145.427	$ 41.224	$ 3.108	$ –	$ 1.458	$ (5.757)	$ 185.460
Total	$ 145.427	$ 41.224	$ 3.108	$ –	$ 1.458	$ (5.757)	$ 185.460

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(b) Riesgo de tipo de cambio (continuación)

A 29 de febrero de 2024 (continuación)

Moneda	Inversiones en títulos de interés fijo (en miles)	Inversiones en títulos de interés variable (en miles)	Inversiones en valores que no devengan intereses (en miles)	Contratos de divisas a plazo (en miles)	Otros derivados (en miles)	Otros activos/ (pasivos) netos (en miles)	Valor Neto de los Activos total (en miles)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund							
Peso argentino	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –	$ 2	$ 2
Dólar australiano	–	–	–	9.020	–	805	9.825
Real brasileño	5.641	–	–	–	(106)	910	6.445
Libra británica	–	–	–	(5.632)	(3)	1.214	(4.421)
Dólar canadiense	–	–	–	5.985	–	809	6.794
Renminbi chino	–	–	–	(13.213)	–	–	(13.213)
Euro	–	–	–	(7.059)	89	689	(6.281)
Rupia india	3.562	–	–	1.880	–	103	5.545
Yen japonés	–	–	–	16.056	(129)	1.126	17.053
Ringgit malasio	–	–	–	–	–	23	23
Peso mexicano	30.863	–	–	(7.184)	(929)	2.461	25.211
Corona noruega	–	–	–	6.224	–	(1)	6.223
Franco suizo	–	–	–	(512)	–	–	(512)
Dólar estadounidense	558.879	208.278	348	(6.557)	10.967	(9.354)	762.561
Total	$ 598.945	$ 208.278	$ 348	$ (992)	$ 9.889	$ (1.213)	$ 815.255
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund							
Dólar australiano	€ –	€ –	€ –	€ (50)	€ –	€ 49	€ (1)
Libra británica	931	188	–	(1.539)	4	303	(113)
Dólar canadiense	–	–	–	(71)	–	73	2
Euro	34.050	4.851	–	7.366	(178)	2.017	48.106
Yen japonés	–	–	–	(172)	(34)	221	15
Corona noruega	477	–	–	28	–	9	514
Zloty polaco	691	–	–	80	–	14	785
Corona sueca	–	–	–	512	–	–	512
Dólar estadounidense	4.914	925	782	(6.153)	(7)	(452)	9
Total	€ 41.063	€ 5.964	€ 782	€ 1	€ (215)	€ 2.234	€ 49.829
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 64.560	$ –	$ –	$ 64.560
Real brasileño	2.953	–	–	–	–	201	3.154
Libra británica	11.939	9.274	–	(19.292)	36	1.759	3.716
Dólar canadiense	–	–	–	907	–	2	909
Peso colombiano	–	–	–	–	–	78	78
Corona checa	–	–	–	–	–	36	36
Euro	17.789	7.736	–	(22.922)	(85)	1.740	4.258
Rupia india	2.192	–	–	–	–	73	2.265
Rupia indonesia	2.541	–	–	–	–	249	2.790
Yen japonés	–	–	–	6.516	–	–	6.516
Peso mexicano	8.270	–	–	(221)	–	173	8.222
Zloty polaco	4.200	–	–	780	–	227	5.207
Dólar de Singapur	–	–	–	930	–	–	930
Rand sudafricano	2.804	–	–	8.028	–	128	10.960
Franco suizo	–	–	–	59.415	–	–	59.415
Dólar taiwanés	–	–	–	(3.143)	–	–	(3.143)
Dólar estadounidense	122.540	26.735	3.664	(96.770)	(47)	14.945	71.067
Total	$ 175.228	$ 43.745	$ 3.664	$ (1.212)	$ (96)	$ 19.611	$ 240.940
FTGF Western Asset US High Yield Fund							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –	$ 2	$ 2
Libra británica	–	–	–	16	–	–	16
Dólar canadiense	–	–	–	(6)	–	–	(6)
Euro	–	–	–	1.794	–	–	1.794
Peso mexicano	–	–	–	–	–	3	3
Dólar de Singapur	–	–	–	583	–	3	586
Dólar estadounidense	75.307	19.466	1.233	(2.374)	210	641	94.483
Total	$ 75.307	$ 19.466	$ 1.233	$ 13	$ 210	$ 649	$ 96.878
FTGF Western Asset Global High Yield Fund							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 4.204	$ –	$ 10	$ 4.214
Libra británica	1.090	486	–	2.373	–	120	4.069
Euro	2.882	242	–	2.184	–	97	5.405
Rupia indonesia	–	–	–	–	–	20	20
Peso mexicano	837	–	–	–	–	59	896
Rublo ruso	–	–	–	–	–	69	69
Dólar de Singapur	–	–	–	1.734	–	30	1.764
Lira turca	–	–	–	–	–	1	1
Dólar estadounidense	38.376	3.438	208	(10.485)	8	536	32.081
Total	$ 43.185	$ 4.166	$ 208	$ 10	$ 8	$ 942	$ 48.519

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(b) Riesgo de tipo de cambio (continuación)

A 29 de febrero de 2024 (continuación)

Moneda	Inversiones en títulos de interés fijo (en miles)	Inversiones en títulos de interés variable (en miles)	Inversiones en valores que no devengan intereses (en miles)	Contratos de divisas a plazo (en miles)	Otros derivados (en miles)	Otros activos/ (pasivos) netos (en miles)	Valor Neto de los Activos total (en miles)
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund							
Dólar australiano	$ 4.317	$ –	$ –	$ 11.076	$ –	$ 55	$ 15.448
Renminbi chino	47.843	–	–	22.963	–	744	71.550
Euro	–	–	–	5.850	–	238	6.088
Rupia india	28.976	–	–	–	–	283	29.259
Rupia indonesia	33.289	–	–	–	–	199	33.488
Ringgit malasio	28.868	–	–	–	–	336	29.204
Dólar neozelandés	–	–	–	(4.262)	–	–	(4.262)
Peso filipino	12.614	–	–	–	–	88	12.702
Dólar de Singapur	11.880	5.840	–	15.487	–	147	33.354
Won surcoreano	35.101	–	–	–	(82)	710	35.729
Franco suizo	–	–	–	16	–	–	16
Bat tailandés	18.911	–	–	–	–	119	19.030
Dólar estadounidense	15.165	–	5.476	(51.278)	–	(341)	(30.978)
Total	$ 236.964	$ 5.840	$ 5.476	$ (148)	$ (82)	$ 2.578	$ 250.628
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund							
Libra británica	$ 81.628	$ 11.479	$ –	$ 179.440	$ –	$ 3.363	$ 275.910
Euro	187.976	25.082	–	(157.876)	121	5.743	61.046
Yen japonés	–	–	–	(729)	(76)	575	(230)
Corona sueca	–	–	–	10.809	–	6	10.815
Franco suizo	–	–	–	4.740	–	–	4.740
Dólar estadounidense	116.745	40.594	1.097	(33.712)	13	1.520	126.257
Total	$ 386.349	$ 77.155	$ 1.097	$ 2.672	$ 58	$ 11.207	$ 478.538
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 1.079	$ 14	$ 258	$ 1.351
Real brasileño	1.365	876	–	–	–	76	2.317
Libra británica	8.122	1.647	–	(12.303)	9	585	(1.940)
Dólar canadiense	2.053	–	–	72.645	–	222	74.920
Renminbi chino	–	–	–	(12.954)	–	–	(12.954)
Euro	22.138	6.711	–	(14.211)	(121)	786	15.303
Rupia indonesia	1.578	–	–	–	–	78	1.656
Yen japonés	2.273	–	–	1.026	(58)	374	3.615
Peso mexicano	3.888	–	–	(383)	–	82	3.587
Dólar neozelandés	–	–	–	2.448	–	(1)	2.447
Corona noruega	1.319	–	–	–	–	24	1.343
Zloty polaco	1.864	–	–	190	–	36	2.090
Rand sudafricano	1.754	–	–	(4)	–	262	2.012
Won surcoreano	1.842	–	–	(1.917)	–	24	(51)
Corona sueca	–	–	–	1.418	–	–	1.418
Dólar estadounidense	60.499	8.746	11.886	(36.863)	(21)	(11.941)	32.306
Total	$ 108.695	$ 17.980	$ 11.886	$ 171	$ (177)	$ (9.135)	$ 129.420
FTGF Western Asset Global Credit Fund^							
Libra británica	$ 1.801	$ 2.124	$ –	$ (4.108)	$ (3)	$ 225	$ 39
Dólar canadiense	–	–	–	(5)	–	–	(5)
Euro	10.736	3.833	–	(10.760)	(45)	873	4.637
Yen japonés	–	–	–	(64)	(13)	89	12
Dólar estadounidense	8.842	1.923	152	15.026	(66)	437	26.314
Total	$ 21.379	$ 7.880	$ 152	$ 89	$ (127)	$ 1.624	$ 30.997

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(b) Riesgo de tipo de cambio (continuación)

A 29 de febrero de 2024 (continuación)

Moneda	Inversiones en títulos de interés fijo (en miles)	Inversiones en títulos de interés variable (en miles)	Inversiones en valores que no devengan intereses (en miles)	Contratos de divisas a plazo (en miles)	Otros derivados (en miles)	Otros activos/ (pasivos) netos (en miles)	Valor Neto de los Activos total (en miles)
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 84.415	$ –	$ 1.337	$ 85.752
Real brasileño	19.663	–	–	53.012	12.333	926	85.934
Libra británica	–	6.042	–	21.343	390	2.019	29.794
Dólar canadiense	–	–	–	(1.886)	–	1.724	(162)
Renminbi chino	–	–	–	(516)	–	–	(516)
Peso dominicano	4.027	–	–	–	–	190	4.217
Libra egipcia	515	–	–	–	–	115	630
Euro	7.297	–	–	353.960	4.767	11.379	377.403
Rupia india	123.978	–	–	(113.314)	–	19.629	30.293
Rupia indonesia	77.105	–	–	(84.337)	–	643	(6.589)
Dólar jamaicano	961	–	–	–	–	28	989
Yen japonés	–	–	–	37.781	(3.684)	11.954	46.051
Peso mexicano	87.311	–	–	(92.528)	1.838	2.921	(458)
Corona noruega	–	–	–	4.433	–	(45)	4.388
Zloty polaco	56.366	–	–	(67.561)	–	1.084	(10.111)
Dólar de Singapur	–	–	–	27.094	–	52	27.146
Rand sudafricano	45.000	–	–	(25.341)	–	1.928	21.587
Won surcoreano	–	–	–	22.839	–	–	22.839
Corona sueca	–	–	–	1.001	–	–	1.001
Franco suizo	–	–	–	16.029	–	74	16.103
Dólar taiwanés	–	–	–	(25.484)	–	–	(25.484)
Dólar estadounidense	539.185	207.621	44.830	(208.887)	44.636	(133.223)	494.162
Total	$ 961.408	$ 213.663	$ 44.830	$ 2.053	$ 60.280	$ (77.265)	$ 1.204.969
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 7.052	$ 17	$ 122	$ 7.191
Real brasileño	–	–	–	1.672	(30)	212	1.854
Libra británica	3.312	1.343	–	261.427	201	338	266.621
Dólar canadiense	297	–	–	16.894	–	103	17.294
Renminbi chino	–	–	–	(1.868)	–	–	(1.868)
Euro	107	4.136	–	52.464	(84)	416	57.039
Rupia india	1.412	–	–	–	–	41	1.453
Rupia indonesia	–	–	–	(29)	–	29	–
Dólar jamaicano	204	–	–	–	–	6	210
Yen japonés	–	–	–	112	–	–	112
Peso mexicano	4.043	–	–	(1.133)	(256)	999	3.653
Dólar neozelandés	–	–	–	–	–	9	9
Corona sueca	–	–	–	–	–	2	2
Franco suizo	–	–	–	3.983	–	–	3.983
Lira turca	–	–	–	–	–	2	2
Dólar estadounidense	220.536	123.221	2.643	(339.476)	541	7.377	14.842
Peso uruguayo	–	282	–	–	–	2	284
Total	$ 229.911	$ 128.982	$ 2.643	$ 1.098	$ 389	$ 9.658	$ 372.681
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^							
Euro	$ –	$ –	$ –	$ 1.777	$ –	$ 99	$ 1.876
Franco suizo	–	–	–	72	–	–	72
Dólar estadounidense	97.008	400.914	21.501	(1.843)	(140)	6.768	524.208
Total	$ 97.008	$ 400.914	$ 21.501	$ 6	$ (140)	$ 6.867	$ 526.156
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^							
Dólar estadounidense	$ 1.056.220	$ 98.109	$ 17.502	$ –	$ 66	$ (22.189)	$ 1.149.708
Total	$ 1.056.220	$ 98.109	$ 17.502	$ –	$ 66	$ (22.189)	$ 1.149.708
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 632	$ –	$ 14	$ 646
Real brasileño	112	–	–	–	(4)	13	121
Libra británica	–	–	–	(345)	2	55	(288)
Dólar canadiense	–	–	–	335	–	11	346
Renminbi chino	–	–	–	(435)	–	–	(435)
Euro	–	–	–	(668)	–	107	(561)
Rupia india	246	–	–	–	–	7	253
Yen japonés	–	–	–	860	–	6	866
Peso mexicano	1.314	–	–	(161)	–	134	1.287
Corona noruega	–	–	–	181	–	–	181
Franco suizo	–	–	–	(57)	–	–	(57)
Dólar estadounidense	13.176	2.640	133	(384)	537	(65)	16.037
Total	$ 14.848	$ 2.640	$ 133	$ (42)	$ 535	$ 282	$ 18.396

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(b) Riesgo de tipo de cambio (continuación)

A 29 de febrero de 2024 (continuación)

Moneda	Inversiones en títulos de interés fijo (en miles)	Inversiones en títulos de interés variable (en miles)	Inversiones en valores que no devengan intereses (en miles)	Contratos de divisas a plazo (en miles)	Otros derivados (en miles)	Otros activos/ (pasivos) netos (en miles)	Valor Neto de los Activos total (en miles)
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund							
Dólar australiano	$ 5.806	$ –	$ –	$ 6.828	$ –	$ 52	$ 12.686
Real brasileño	10.267	–	–	(6.256)	–	(102)	3.909
Libra británica	9.634	–	–	6.451	–	68	16.153
Dólar canadiense	–	–	–	(543)	–	–	(543)
Renminbi chino	–	–	–	(2.147)	–	(1)	(2.148)
Peso colombiano	6.454	–	–	(1.231)	–	436	5.659
Corona danesa	–	–	–	(158)	–	–	(158)
Euro	5.896	–	–	25.862	–	14	31.772
Forinto húngaro	–	–	–	3.178	–	–	3.178
Rupia india	–	–	–	3.302	–	–	3.302
Shekel israelí	–	–	–	(194)	–	–	(194)
Yen japonés	–	–	–	14.083	–	–	14.083
Peso mexicano	15.927	–	–	(7.378)	–	350	8.899
Dólar neozelandés	1.994	–	–	(1.746)	–	25	273
Corona noruega	5.664	–	–	4.887	–	164	10.715
Zloty polaco	–	–	–	(313)	–	337	24
Dólar de Singapur	–	–	–	(236)	–	–	(236)
Rand sudafricano	7.203	–	–	(7.080)	–	18	141
Won surcoreano	–	–	–	8.565	–	–	8.565
Corona sueca	–	–	–	(120)	–	–	(120)
Dólar estadounidense	65.123	8.749	2.596	(47.245)	–	(98)	29.125
Total	$ 133.968	$ 8.749	$ 2.596	$ (1.491)	$ –	$ 1.263	$ 145.085
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 27.101	$ –	$ –	$ 27.101
Real brasileño	5.284	–	–	977	–	48	6.309
Libra británica	3.465	–	–	11.747	–	7	15.219
Peso chileno	–	–	–	4.542	–	–	4.542
Peso colombiano	10.217	–	–	–	–	635	10.852
Euro	–	–	–	9.101	256	2.176	11.533
Forinto húngaro	–	–	–	7.203	–	–	7.203
Rupia india	–	–	–	7.353	–	–	7.353
Yen japonés	–	–	–	7.155	(51)	7	7.111
Peso mexicano	8.787	–	–	–	–	337	9.124
Dólar neozelandés	3.784	–	–	(25.353)	–	45	(21.524)
Corona noruega	–	–	–	10.073	–	–	10.073
Zloty polaco	–	–	–	–	–	91	91
Rand sudafricano	5.192	–	–	(5.190)	–	(1)	1
Won surcoreano	–	–	–	7.266	–	–	7.266
Franco suizo	–	–	–	(22.272)	–	–	(22.272)
Dólar estadounidense	75.390	26.338	8.090	(40.594)	–	(2.937)	66.287
Total	$ 112.119	$ 26.338	$ 8.090	$ (891)	$ 205	$ 408	$ 146.269
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^							
Libra británica	$ 313	$ –	$ –	$ (88)	$ –	$ 6	$ 231
Dólar canadiense	–	–	–	11.183	–	–	11.183
Euro	1.711	–	–	9.172	–	25	10.908
Corona sueca	–	–	–	(4)	–	–	(4)
Franco suizo	–	–	–	(2)	–	–	(2)
Dólar estadounidense	27.055	662	794	(20.294)	1	630	8.848
Total	$ 29.079	$ 662	$ 794	$ (33)	$ 1	$ 661	$ 31.164

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(b) Riesgo de tipo de cambio (continuación)

A 29 de febrero de 2024 (continuación)

Moneda	Inversiones en títulos de interés fijo (en miles)	Inversiones en títulos de interés variable (en miles)	Inversiones en valores que no devengan intereses (en miles)	Contratos de divisas a plazo (en miles)	Otros derivados (en miles)	Otros activos/ (pasivos) netos (en miles)	Valor Neto de los Activos total (en miles)
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund							
Dólar australiano	$ 9.283	$ –	$ –	$ 15.239	$ –	$ 83	$ 24.605
Real brasileño	8.024	–	–	–	–	99	8.123
Libra británica	20.966	–	–	(18.694)	–	53	2.325
Dólar canadiense	–	–	–	(284)	–	–	(284)
Renminbi chino	–	–	–	(1.176)	–	(1)	(1.177)
Peso colombiano	12.832	–	–	(2.721)	–	811	10.922
Corona danesa	–	–	–	(38)	–	–	(38)
Euro	9.478	–	–	7.984	–	17	17.479
Forinto húngaro	–	–	–	6.164	–	–	6.164
Rupia india	–	–	–	6.160	–	–	6.160
Shekel israelí	–	–	–	(47)	–	–	(47)
Yen japonés	–	–	–	31.423	–	–	31.423
Peso mexicano	20.859	–	–	(4.408)	–	549	17.000
Dólar neozelandés	1.586	–	–	12.268	–	19	13.873
Corona noruega	9.127	–	–	10.991	–	264	20.382
Zloty polaco	–	–	–	(76)	–	608	532
Dólar de Singapur	–	–	–	(57)	–	–	(57)
Rand sudafricano	8.999	–	–	(9.054)	–	(1)	(56)
Won surcoreano	–	–	–	16.566	–	–	16.566
Corona sueca	–	–	–	(29)	–	–	(29)
Dólar estadounidense	94.909	8.109	3.580	(73.116)	–	28	33.510
Total	$ 196.063	$ 8.109	$ 3.580	$ (2.905)	$ –	$ 2.529	$ 207.376
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund							
Dólar australiano	$ 392	$ –	$ –	$ 4.273	$ –	$ 2	$ 4.667
Real brasileño	41.920	–	–	(3.122)	–	398	39.196
Libra británica	67.561	1.262	–	(34.190)	–	1.055	35.688
Renminbi chino	–	–	–	1.243	–	15	1.258
Peso colombiano	69.119	–	–	–	–	3.618	72.737
Corona checa	–	–	–	35	–	(1)	34
Euro	34.988	–	–	362.742	(2.359)	900	396.271
Peso mexicano	66.664	–	–	–	–	1.852	68.516
Dólar de Singapur	–	–	–	56.698	–	305	57.003
Corona sueca	–	–	–	2.434	–	–	2.434
Dólar estadounidense	654.466	184.172	20.461	(388.740)	55	3.162	473.576
Total	$ 935.110	$ 185.434	$ 20.461	$ 1.373	$ (2.304)	$ 11.306	$ 1.151.380
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^							
Real brasileño	$ 158	$ –	$ –	$ –	$ –	$ 49	$ 207
Peso colombiano	463	–	–	–	–	158	621
Peso mexicano	322	–	–	–	–	97	419
Dólar estadounidense	10.021	5.764	1.275	–	–	(1.904)	15.156
Total	$ 10.964	$ 5.764	$ 1.275	$ –	$ –	$ (1.600)	$ 16.403
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 72.442	$ –	$ –	$ 72.442
Real brasileño	8.587	–	–	–	–	83	8.670
Libra británica	–	–	–	6.960	14	76	7.050
Dólar canadiense	–	–	–	6.895	–	–	6.895
Peso colombiano	6.974	–	–	(2.040)	–	324	5.258
Corona checa	3.365	–	–	(3.266)	–	47	146
Euro	–	–	–	–	(167)	(5)	(172)
Rupia india	–	–	–	2.194	–	–	2.194
Yen japonés	–	–	–	16.830	–	–	16.830
Ringgit malasio	–	–	–	1.666	–	–	1.666
Peso mexicano	11.901	–	–	1.837	–	252	13.990
Dólar neozelandés	–	–	–	3.909	–	–	3.909
Corona noruega	–	–	–	3.035	–	–	3.035
Dólar de Singapur	–	–	–	76	–	(1)	75
Rand sudafricano	5.068	–	–	(533)	–	(1)	4.534
Won surcoreano	–	–	–	2.297	–	–	2.297
Franco suizo	–	–	–	(18.128)	–	–	(18.128)
Dólar estadounidense	19.143	8.566	3.994	(95.207)	–	3.850	(59.654)
Total	$ 55.038	$ 8.566	$ 3.994	$ (1.033)	$ (153)	$ 4.625	$ 71.037

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(b) Riesgo de tipo de cambio (continuación)

A 29 de febrero de 2024 (continuación)

Moneda	Inversiones en títulos de interés fijo (en miles)	Inversiones en títulos de interés variable (en miles)	Inversiones en valores que no devengan intereses (en miles)	Contratos de divisas a plazo (en miles)	Otros derivados (en miles)	Otros activos/ (pasivos) netos (en miles)	Valor Neto de los Activos total (en miles)
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^							
Real brasileño	$ 742	$ –	$ –	$ (222)	$ –	$ 6	$ 526
Libra británica	1.072	161	–	(1.198)	–	21	56
Peso colombiano	940	–	–	–	–	50	990
Euro	1.063	198	–	(1.122)	(4)	11	146
Peso mexicano	1.094	–	–	(157)	–	26	963
Dólar estadounidense	3.851	6.131	579	2.696	1	(110)	13.148
Total	$ 8.762	$ 6.490	$ 579	$ (3)	$ (3)	$ 4	$ 15.829
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^							
Dólar estadounidense	$ 29.345	$ 290	$ 1.040	$ –	$ 14	$ 1.010	$ 31.699
Total	$ 29.345	$ 290	$ 1.040	$ –	$ 14	$ 1.010	$ 31.699
FTGF ClearBridge Value Fund							
Libra británica	$ –	$ –	$ 11.325	$ –	$ –	$ –	$ 11.325
Dólar canadiense	–	–	–	–	–	142	142
Euro	–	–	21.934	108.987	–	2.739	133.660
Yen japonés	–	–	16.302	–	–	–	16.302
Dólar de Singapur	–	–	–	1.530	–	(42)	1.488
Dólar estadounidense	–	–	1.092.574	(109.901)	–	12.036	994.709
Total	$ –	$ –	$ 1.142.135	$ 616	$ –	$ 14.875	$ 1.157.626
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund							
Euro	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –	$ 11	$ 11
Dólar estadounidense	–	–	210.196	–	–	1.249	211.445
Total	$ –	$ –	$ 210.196	$ –	$ –	$ 1.260	$ 211.456
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund							
Real brasileño	$ –	$ –	$ –	$ 30.014	$ –	$ –	$ 30.014
Libra británica	–	–	–	–	–	74	74
Euro	–	–	–	88.973	–	(452)	88.521
Dólar estadounidense	–	–	1.827.864	(118.907)	–	45.034	1.753.991
Total	$ –	$ –	$ 1.827.864	$ 80	$ –	$ 44.656	$ 1.872.600
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 3.728	$ –	$ –	$ 3.728
Libra británica	–	–	–	238	–	79	317
Renminbi chino	–	–	–	825	–	–	825
Euro	–	–	–	944	–	(80)	864
Dólar de Singapur	–	–	–	5.074	–	1	5.075
Corona sueca	–	–	–	28	–	–	28
Franco suizo	–	–	–	60	–	–	60
Dólar estadounidense	–	–	205.138	(10.912)	–	2.267	196.493
Total	$ –	$ –	$ 205.138	$ (15)	$ –	$ 2.267	$ 207.390
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 737	$ –	$ –	$ 737
Dólar canadiense	–	–	–	–	–	8	8
Renminbi chino	–	–	–	64	–	–	64
Euro	–	–	–	562	–	–	562
Dólar de Singapur	–	–	–	221	–	3	224
Dólar estadounidense	–	–	35.857	(1.584)	–	68	34.341
Total	$ –	$ –	$ 35.857	$ –	$ –	$ 79	$ 35.936
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund							
Libra británica	$ –	$ –	$ –	$ 61.711	$ –	$ 4.673	$ 66.384
Euro	–	–	–	30.055	–	(31)	30.024
Corona sueca	–	–	–	–	–	58	58
Dólar estadounidense	–	–	1.367.716	(91.412)	–	(7.260)	1.269.044
Total	$ –	$ –	$ 1.367.716	$ 354	$ –	$ (2.560)	$ 1.365.510

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(b) Riesgo de tipo de cambio (continuación)

A 29 de febrero de 2024 (continuación)

Moneda	Inversiones en títulos de interés fijo (en miles)	Inversiones en títulos de interés variable (en miles)	Inversiones en valores que no devengan intereses (en miles)	Contratos de divisas a plazo (en miles)	Otros derivados (en miles)	Otros activos/ (pasivos) netos (en miles)	Valor Neto de los Activos total (en miles)
FTGF ClearBridge Global Growth Fund^							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ 172	$ –	$ –	$ –	$ 172
Libra británica	–	–	560	–	–	–	560
Dólar canadiense	–	–	432	–	–	–	432
Corona danesa	–	–	326	–	–	–	326
Euro	–	–	1.466	–	–	1	1.467
Dólar de Hong Kong	–	–	103	–	–	–	103
Yen japonés	–	–	869	–	–	–	869
Peso mexicano	–	–	87	–	–	–	87
Corona sueca	–	–	99	–	–	–	99
Franco suizo	–	–	298	–	–	(1)	297
Dólar taiwanés	–	–	350	–	–	–	350
Dólar estadounidense	–	–	11.821	–	–	135	11.956
Total	$ –	$ –	$ 16.583	$ –	$ –	$ 135	$ 16.718
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^							
Dólar australiano	€ –	€ –	€ 16.869	€ 1.203	€ –	€ 21	€ 18.093
Real brasileño	–	–	39.221	(1.674)	–	–	37.547
Libra británica	–	–	69.202	(593)	–	88	68.697
Dólar canadiense	–	–	40.271	38.984	–	–	79.255
Renminbi chino	–	–	–	26.132	–	252	26.384
Corona danesa	–	–	21.005	(1.458)	–	25	19.572
Euro	–	–	214.118	(112.475)	–	13.902	115.545
Yen japonés	–	–	33.247	(2.431)	–	1	30.817
Dólar de Singapur	–	–	–	4.614	–	4	4.618
Dólar estadounidense	–	–	373.984	46.833	–	1.578	422.395
Total	€ –	€ –	€ 807.917	€ (865)	€ –	€ 15.871	€ 822.923
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ 14.465	$ 5.632	$ –	$ 193	$ 20.290
Real brasileño	–	–	17.561	–	–	1	17.562
Libra británica	–	–	33.544	5.327	–	174	39.045
Dólar canadiense	–	–	22.721	–	–	172	22.893
Renminbi chino	–	–	–	1.467	–	–	1.467
Euro	–	–	76.058	35.603	–	1.042	112.703
Dólar de Hong Kong	–	–	5.665	–	–	–	5.665
Yen japonés	–	–	11.597	–	–	–	11.597
Dólar de Singapur	–	–	–	49.688	–	323	50.011
Dólar estadounidense	–	–	144.624	(97.586)	–	3.538	50.576
Total	$ –	$ –	$ 326.235	$ 131	$ –	$ 5.443	$ 331.809
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^							
Libra británica	$ –	$ –	$ 693	$ 12	$ –	$ 2	$ 707
Dólar canadiense	–	–	61	–	–	–	61
Euro	–	–	1.331	11	–	1	1.343
Dólar de Hong Kong	–	–	102	–	–	–	102
Rupia indonesia	–	–	110	–	–	–	110
Yen japonés	–	–	297	–	–	–	297
Dólar de Singapur	–	–	–	11	–	–	11
Dólar estadounidense	–	–	2.550	(34)	–	494	3.010
Total	$ –	$ –	$ 5.144	$ –	$ –	$ 497	$ 5.641
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 5.403	$ –	$ 30	$ 5.433
Real brasileño	–	–	–	5.477	–	–	5.477
Libra británica	–	–	–	144	–	131	275
Dólar canadiense	–	–	9.299	–	–	17	9.316
Renminbi chino	–	–	–	3.256	–	(135)	3.121
Euro	–	–	–	38.395	–	(3.186)	35.209
Zloty polaco	–	–	–	8.027	–	–	8.027
Dólar de Singapur	–	–	–	37.126	–	27	37.153
Corona sueca	–	–	–	64	–	–	64
Dólar estadounidense	–	–	679.843	(97.770)	–	8.742	590.815
Total	$ –	$ –	$ 689.142	$ 122	$ –	$ 5.626	$ 694.890

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(b) Riesgo de tipo de cambio (continuación)

A 29 de febrero de 2024 (continuación)

Moneda	Inversiones en títulos de interés fijo (en miles)	Inversiones en títulos de interés variable (en miles)	Inversiones en valores que no devengan intereses (en miles)	Contratos de divisas a plazo (en miles)	Otros derivados (en miles)	Otros activos/ (pasivos) netos (en miles)	Valor Neto de los Activos total (en miles)
FTGF Royce US Smaller Companies Fund							
Dólar canadiense	$ –	$ –	$ 1.622	$ –	$ –	$ –	$ 1.622
Euro	–	–	–	188	–	(21)	167
Corona sueca	–	–	–	3	–	–	3
Dólar estadounidense	–	–	94.460	(190)	–	(127)	94.143
Total	$ –	$ –	$ 96.082	$ 1	$ –	$ (148)	$ 95.935
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ 155	$ –	$ –	$ 2	$ 157
Real brasileño	–	–	74	–	–	(2)	72
Libra británica	–	–	677	–	–	–	677
Euro	–	–	261	–	–	–	261
Yen japonés	–	–	492	–	–	1	493
Zloty polaco	–	–	55	–	–	–	55
Won surcoreano	–	–	77	–	–	2	79
Corona sueca	–	–	58	–	–	1	59
Franco suizo	–	–	73	–	–	–	73
Dólar estadounidense	–	–	2.500	–	–	(40)	2.460
Total	$ –	$ –	$ 4.422	$ –	$ –	$ (36)	$ 4.386
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ 3.424	$ –	$ –	$ –	$ 3.424
Libra británica	–	–	2.611	3.071	–	1	5.683
Corona danesa	–	–	3.512	–	–	35	3.547
Euro	–	–	41.818	75.599	–	(8)	117.409
Corona sueca	–	–	10.852	–	–	–	10.852
Dólar estadounidense	–	–	61.696	(78.307)	–	(283)	(16.894)
Total	$ –	$ –	$ 123.913	$ 363	$ –	$ (255)	$ 124.021
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ 7.210	$ 21	$ –	$ 157	$ 7.388
Renminbi chino	–	–	–	1	–	–	1
Dólar de Hong Kong	–	–	5.894	–	–	–	5.894
Rupia india	–	–	2.349	–	–	(78)	2.271
Ringgit malasio	–	–	605	–	–	–	605
Dólar neozelandés	–	–	1.943	–	–	6	1.949
Peso filipino	–	–	360	–	–	–	360
Dólar de Singapur	–	–	2.008	228	–	20	2.256
Bat tailandés	–	–	555	–	–	15	570
Dólar estadounidense	–	–	142	(250)	–	(42)	(150)
Total	$ –	$ –	$ 21.066	$ –	$ –	$ 78	$ 21.144
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^							
Real brasileño	$ –	$ –	$ 1.795	$ –	$ –	$ 7	$ 1.802
Libra británica	–	–	797	–	–	–	797
Renminbi chino	–	–	1.189	–	–	(75)	1.114
Dólar de Hong Kong	–	–	5.274	–	–	–	5.274
Rupia india	–	–	6.525	–	–	(105)	6.420
Rupia indonesia	–	–	1.447	–	–	–	1.447
Peso mexicano	–	–	1.512	–	–	–	1.512
Peso filipino	–	–	99	–	–	–	99
Rial saudí	–	–	909	–	–	1	910
Rand sudafricano	–	–	389	–	–	–	389
Won surcoreano	–	–	5.186	–	–	17	5.203
Dólar taiwanés	–	–	4.037	–	–	–	4.037
Dólar estadounidense	–	–	2.667	–	–	(24)	2.643
Total	$ –	$ –	$ 31.826	$ –	$ –	$ (179)	$ 31.647
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^							
Real brasileño	€ –	€ –	€ –	€ 758	€ –	€ (1)	€ 757
Libra británica	–	–	7.877	–	–	–	7.877
Corona danesa	–	–	7.211	–	–	59	7.270
Euro	–	–	119.483	(825)	–	2.015	120.673
Corona sueca	–	–	25.324	–	–	–	25.324
Franco suizo	–	–	8.516	–	–	–	8.516
Dólar estadounidense	–	–	18.400	61	–	–	18.461
Total	€ –	€ –	€ 186.811	€ (6)	€ –	€ 2.073	€ 188.878

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(b) Riesgo de tipo de cambio (continuación)

A 29 de febrero de 2024 (continuación)

Moneda	Inversiones en títulos de interés fijo (en miles)	Inversiones en títulos de interés variable (en miles)	Inversiones en valores que no devengan intereses (en miles)	Contratos de divisas a plazo (en miles)	Otros derivados (en miles)	Otros activos/ (pasivos) netos (en miles)	Valor Neto de los Activos total (en miles)
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^							
Libra británica	$ –	$ –	$ 821	$ 1.355	$ –	$ –	$ 2.176
Corona danesa	–	–	359	–	–	1	360
Euro	–	–	557	96	–	–	653
Rupia indonesia	–	–	197	–	–	(1)	196
Yen japonés	–	–	71	–	–	–	71
Corona sueca	–	–	95	–	–	–	95
Dírham de los Emiratos Árabes Unidos	–	–	111	–	–	–	111
Dólar estadounidense	–	–	3.913	(1.446)	–	57	2.524
Total	$ –	$ –	$ 6.124	$ 5	$ –	$ 57	$ 6.186
Franklin Responsible Income 2028 Fund^							
Euro	€ 63.934	€ 21.590	€ –	€ –	€ –	€ 2.180	€ 87.704
Total	€ 63.934	€ 21.590	€ –	€ –	€ –	€ 2.180	€ 87.704

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(b) Riesgo de tipo de cambio (continuación)

A 28 de febrero de 2023

Moneda	Inversiones en títulos de interés fijo (en miles)	Inversiones en títulos de interés variable (en miles)	Inversiones en valores que no devengan intereses (en miles)	Contratos de divisas a plazo (en miles)	Otros derivados (en miles)	Otros activos/ (pasivos) netos (en miles)	Valor Neto de los Activos total (en miles)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund							
Dólar estadounidense	$ 526.575	$ 317.621	$ –	$ –	$ –	$ (10.581)	$ 833.615
Total	$ 526.575	$ 317.621	$ –	$ –	$ –	$ (10.581)	$ 833.615
FTGF Western Asset US Core Bond Fund							
Dólar estadounidense	$ 103.546	$ 34.879	$ 1.741	$ –	$ 2.605	$ (10.852)	$ 131.919
Total	$ 103.546	$ 34.879	$ 1.741	$ –	$ 2.605	$ (10.852)	$ 131.919
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund							
Peso argentino	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –	$ 5	$ 5
Dólar australiano	–	–	–	14.558	(473)	1.694	15.779
Real brasileño	6.186	–	–	–	–	424	6.610
Libra británica	–	–	–	(1.838)	(96)	2.607	673
Dólar canadiense	–	–	–	22.434	–	805	23.239
Renminbi chino	–	–	–	(17.733)	–	–	(17.733)
Euro	–	–	–	29.230	(521)	3.090	31.799
Rupia india	–	–	–	1.883	–	–	1.883
Rupia indonesia	10.217	–	–	(2.574)	–	1.225	8.868
Yen japonés	–	–	–	5.593	186	1.338	7.117
Ringgit malasio	–	–	–	–	–	25	25
Peso mexicano	38.173	–	–	(967)	(1.287)	3.348	39.267
Corona noruega	–	–	–	6.373	–	1	6.374
Zloty polaco	–	–	–	–	–	11	11
Rublo ruso	921	–	–	–	–	–	921
Rand sudafricano	–	–	–	1.597	–	–	1.597
Dólar estadounidense	846.500	281.132	–	(60.594)	7.390	(52.163)	1.022.265
Total	$ 901.997	$ 281.132	$ –	$ (2.038)	$ 5.199	$ (37.590)	$ 1.148.700
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund							
Dólar australiano	€ –	€ –	€ –	€ (224)	€ –	€ 140	€ (84)
Libra británica	1.785	456	–	(2.816)	(12)	437	(150)
Dólar canadiense	–	–	–	(429)	–	238	(191)
Euro	95.827	12.812	–	15.751	(681)	6.004	129.713
Yen japonés	–	–	–	(372)	120	256	4
Corona noruega	–	–	–	1.691	–	–	1.691
Zloty polaco	1.687	–	–	(1.637)	–	83	133
Corona sueca	–	–	–	1.397	–	–	1.397
Dólar estadounidense	12.088	529	654	(13.627)	(16)	326	(46)
Total	€ 111.387	€ 13.797	€ 654	€ (266)	€ (589)	€ 7.484	€ 132.467
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 61.881	$ –	$ –	$ 61.881
Real brasileño	2.045	–	–	–	–	552	2.597
Libra británica	10.807	7.532	–	(16.789)	–	580	2.130
Dólar canadiense	–	–	–	902	–	2	904
Peso colombiano	–	–	–	–	–	63	63
Corona checa	–	–	–	–	–	38	38
Euro	12.558	8.121	1.117	(22.728)	52	5.967	5.087
Rupia india	–	–	–	(1.629)	–	–	(1.629)
Rupia indonesia	6.727	–	–	(1.410)	–	343	5.660
Yen japonés	–	–	–	4.951	–	–	4.951
Peso mexicano	7.562	–	–	(1.933)	–	156	5.785
Zloty polaco	3.319	–	–	(523)	–	117	2.913
Rublo ruso	412	–	–	–	–	–	412
Dólar de Singapur	–	–	–	957	–	1	958
Rand sudafricano	2.497	–	–	617	–	643	3.757
Franco suizo	–	–	–	54.581	–	–	54.581
Dólar taiwanés	–	–	–	(3.258)	–	–	(3.258)
Dólar estadounidense	101.955	34.926	3.313	(78.855)	(7)	19.193	80.525
Total	$ 147.882	$ 50.579	$ 4.430	$ (3.236)	$ 45	$ 27.655	$ 227.355

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(b) Riesgo de tipo de cambio (continuación)

A 28 de febrero de 2023 (continuación)

Moneda	Inversiones en títulos de interés fijo (en miles)	Inversiones en títulos de interés variable (en miles)	Inversiones en valores que no devengan intereses (en miles)	Contratos de divisas a plazo (en miles)	Otros derivados (en miles)	Otros activos/ (pasivos) netos (en miles)	Valor Neto de los Activos total (en miles)
FTGF Western Asset US High Yield Fund							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –	$ 2	$ 2
Libra británica	–	–	–	41	–	–	41
Dólar canadiense	–	–	–	(6)	–	–	(6)
Euro	–	–	–	1.764	–	–	1.764
Peso mexicano	–	–	–	–	–	3	3
Dólar de Singapur	–	–	–	379	–	–	379
Dólar estadounidense	101.664	19.440	2.303	(2.212)	(45)	1.907	123.057
Total	$ 101.664	$ 19.440	$ 2.303	$ (34)	$ (45)	$ 1.912	$ 125.240
FTGF Western Asset Global High Yield Fund							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 5.298	$ –	$ 3	$ 5.301
Libra británica	1.976	482	–	1.411	–	96	3.965
Euro	3.035	269	133	1.672	–	587	5.696
Rupia indonesia	–	–	–	–	–	21	21
Peso mexicano	743	–	–	–	–	14	757
Rublo ruso	88	–	–	–	–	83	171
Dólar de Singapur	–	–	–	1.725	–	(4)	1.721
Lira turca	–	–	–	–	–	1	1
Dólar estadounidense	42.049	3.940	1	(10.317)	38	4.087	39.798
Total	$ 47.891	$ 4.691	$ 134	$ (211)	$ 38	$ 4.888	$ 57.431
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 20.732	$ –	$ 13	$ 20.745
Renminbi chino	74.978	–	–	3.536	–	1.759	80.273
Euro	–	–	–	10.745	–	–	10.745
Dólar de Hong Kong	–	956	–	–	–	33	989
Rupia india	33.683	–	–	–	–	458	34.141
Rupia indonesia	62.988	–	–	–	–	790	63.778
Ringgit malasio	50.257	–	–	–	–	390	50.647
Peso filipino	21.554	–	–	–	–	145	21.699
Dólar de Singapur	38.899	5.769	–	2.090	–	531	47.289
Won surcoreano	76.610	–	–	–	(373)	1.918	78.155
Franco suizo	–	–	–	287	–	–	287
Bat tailandés	23.532	–	–	–	–	151	23.683
Dólar estadounidense	30.027	10.358	3.862	(38.358)	–	(613)	5.276
Total	$ 412.528	$ 17.083	$ 3.862	$ (968)	$ (373)	$ 5.575	$ 437.707
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 9.724	$ –	$ –	$ 9.724
Libra británica	89.845	8.554	–	197.072	239	(10.044)	285.666
Euro	187.988	24.491	–	(111.391)	4.675	(4.688)	101.075
Yen japonés	–	–	–	(774)	138	607	(29)
Corona sueca	–	–	–	12.589	–	9	12.598
Dólar estadounidense	176.288	27.956	17.040	(106.732)	(61)	445	114.936
Total	$ 454.121	$ 61.001	$ 17.040	$ 488	$ 4.991	$ (13.671)	$ 523.970
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 1.421	$ (22)	$ 165	$ 1.564
Real brasileño	1.455	749	–	–	–	42	2.246
Libra británica	10.703	1.415	–	(14.679)	–	455	(2.106)
Dólar canadiense	2.388	–	–	87.135	–	220	89.743
Renminbi chino	–	–	–	(13.277)	–	–	(13.277)
Euro	20.719	4.775	–	(8.159)	(696)	1.654	18.293
Rupia india	–	–	–	(299)	–	–	(299)
Rupia indonesia	1.740	–	–	–	–	89	1.829
Shekel israelí	–	–	–	–	–	71	71
Yen japonés	5.195	3.399	–	(6.916)	144	416	2.238
Peso mexicano	3.922	–	–	(248)	–	82	3.756
Dólar neozelandés	–	–	–	5.015	–	–	5.015
Corona noruega	–	–	–	1.586	–	22	1.608
Zloty polaco	1.942	–	–	(1.856)	–	68	154
Rand sudafricano	2.282	–	–	–	–	147	2.429
Won surcoreano	1.808	–	–	(1.944)	–	79	(57)
Corona sueca	–	–	–	1.603	–	–	1.603
Dólar estadounidense	67.165	6.152	11.217	(50.468)	(116)	(2.057)	31.893
Total	$ 119.319	$ 16.490	$ 11.217	$ (1.086)	$ (690)	$ 1.453	$ 146.703

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(b) Riesgo de tipo de cambio (continuación)

A 28 de febrero de 2023 (continuación)

Moneda	Inversiones en títulos de interés fijo (en miles)	Inversiones en títulos de interés variable (en miles)	Inversiones en valores que no devengan intereses (en miles)	Contratos de divisas a plazo (en miles)	Otros derivados (en miles)	Otros activos/ (pasivos) netos (en miles)	Valor Neto de los Activos total (en miles)
FTGF Western Asset Global Credit Fund^							
Libra británica	$ 3.796	$ 2.542	$ –	$ (6.813)	$ 15	$ 401	$ (59)
Euro	13.255	5.127	–	(14.963)	112	713	4.244
Yen japonés	–	–	–	307	37	81	425
Dólar estadounidense	14.771	3.715	559	21.722	(72)	745	41.440
Total	$ 31.822	$ 11.384	$ 559	$ 253	$ 92	$ 1.940	$ 46.050
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^							
Dólar australiano	$ 15.845	$ –	$ –	$ 31.792	$ –	$ 2.589	$ 50.226
Real brasileño	22.887	–	–	50.630	(4.264)	2.460	71.713
Libra británica	–	5.770	–	32.947	(157)	4.294	42.854
Dólar canadiense	–	–	–	37.643	–	4.075	41.718
Renminbi chino	–	–	–	(18.680)	–	–	(18.680)
Peso colombiano	–	–	–	(20.092)	–	–	(20.092)
Libra egipcia	689	–	–	–	–	132	821
Euro	6.524	–	2.181	745.456	(13.694)	34.499	774.966
Rupia india	129.539	–	–	(75.670)	–	5.720	59.589
Rupia indonesia	174.005	–	–	(93.570)	–	4.402	84.837
Yen japonés	–	–	–	(230.491)	3.317	12.502	(214.672)
Ringgit malasio	–	–	–	11.047	–	–	11.047
Peso mexicano	114.924	–	–	(114.820)	1.018	16.451	17.573
Corona noruega	–	–	–	9.608	–	6	9.614
Zloty polaco	55.983	–	–	(53.060)	–	1.915	4.838
Rublo ruso	5.439	–	–	(4.096)	–	–	1.343
Dólar de Singapur	–	–	–	73.031	–	1	73.032
Rand sudafricano	31.036	–	–	771	–	854	32.661
Corona sueca	–	–	–	1.418	–	5	1.423
Franco suizo	–	–	–	21.026	–	53	21.079
Dólar taiwanés	–	–	–	(47.438)	–	–	(47.438)
Dólar estadounidense	1.002.252	331.800	16.369	(379.564)	59.656	103.536	1.134.049
Total	$ 1.559.123	$ 337.570	$ 18.550	$ (22.112)	$ 45.876	$ 193.494	$ 2.132.501
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^							
Peso argentino	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –	$ 1	$ 1
Dólar australiano	–	–	–	5.231	(63)	170	5.338
Real brasileño	–	–	–	338	–	202	540
Libra británica	1.370	950	–	175.544	(74)	(1.178)	176.612
Dólar canadiense	280	–	–	18.936	–	87	19.303
Renminbi chino	–	–	–	(2.600)	–	–	(2.600)
Euro	842	3.144	507	42.835	28	2.263	49.619
Rupia indonesia	3.019	–	–	(2.495)	–	148	672
Yen japonés	–	–	–	4.418	–	1	4.419
Peso mexicano	731	–	–	(4.362)	(756)	1.263	(3.124)
Dólar neozelandés	–	–	–	–	–	9	9
Corona noruega	–	–	–	3.614	–	(1)	3.613
Corona sueca	–	–	–	–	–	2	2
Franco suizo	–	–	–	4.217	–	–	4.217
Lira turca	–	–	–	–	–	3	3
Dólar estadounidense	173.588	81.010	2.424	(248.105)	830	6.641	16.388
Total	$ 179.830	$ 85.104	$ 2.931	$ (2.429)	$ (35)	$ 9.611	$ 275.012
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^							
Libra británica	$ –	$ –	$ –	$ 85	$ –	$ –	$ 85
Euro	–	–	–	6.064	–	–	6.064
Yen japonés	–	–	–	41.628	–	–	41.628
Franco suizo	–	–	–	300	–	–	300
Dólar estadounidense	77.126	462.713	17.212	(49.752)	244	3.928	511.471
Total	$ 77.126	$ 462.713	$ 17.212	$ (1.675)	$ 244	$ 3.928	$ 559.548
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^							
Dólar estadounidense	$ 1.042.661	$ 104.522	$ 1.154	$ –	$ (378)	$ (28.452)	$ 1.119.507
Total	$ 1.042.661	$ 104.522	$ 1.154	$ –	$ (378)	$ (28.452)	$ 1.119.507
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^							
Libra británica	£ 30.870	£ 10.333	£ –	£ 3.366	£ (12)	£ 1.385	£ 45.942
Euro	566	428	–	(1.152)	15	148	5
Yen japonés	–	–	–	(151)	19	120	(12)
Dólar estadounidense	544	1.180	–	(2.043)	(6)	302	(23)
Total	£ 31.980	£ 11.941	£ –	£ 20	£ 16	£ 1.955	£ 45.912

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(b) Riesgo de tipo de cambio (continuación)

A 28 de febrero de 2023 (continuación)

Moneda	Inversiones en títulos de interés fijo (en miles)	Inversiones en títulos de interés variable (en miles)	Inversiones en valores que no devengan intereses (en miles)	Contratos de divisas a plazo (en miles)	Otros derivados (en miles)	Otros activos/ (pasivos) netos (en miles)	Valor Neto de los Activos total (en miles)
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^							
Real brasileño	$ –	$ –	$ –	$ 276	$ –	$ –	$ 276
Libra británica	28	–	–	77.897	–	329	78.254
Euro	50	–	–	442	–	203	695
Yen japonés	–	–	–	477	–	–	477
Peso mexicano	620	–	–	180	–	164	964
Dólar estadounidense	65.420	27.821	253	(79.641)	(173)	429	14.109
Total	$ 66.118	$ 27.821	$ 253	$ (369)	$ (173)	$ 1.125	$ 94.775
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 520	$ (16)	$ 43	$ 547
Real brasileño	91	–	–	–	–	7	98
Libra británica	–	–	–	(38)	(1)	60	21
Dólar canadiense	–	–	–	742	–	11	753
Renminbi chino	–	–	–	(662)	–	–	(662)
Euro	–	–	–	(345)	3	73	(269)
Rupia indonesia	249	–	–	29	–	32	310
Yen japonés	–	–	–	69	–	6	75
Peso mexicano	1.214	–	–	(239)	–	80	1.055
Corona noruega	–	–	–	185	–	–	185
Rublo ruso	22	–	–	–	–	–	22
Dólar estadounidense	11.478	2.884	1.342	(308)	928	(18)	16.306
Total	$ 13.054	$ 2.884	$ 1.342	$ (47)	$ 914	$ 294	$ 18.441
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^							
Real brasileño	$ –	$ –	$ –	$ 2.532	$ –	$ –	$ 2.532
Libra británica	210	212	–	(400)	(1)	4	25
Euro	2.461	1.346	–	(4.176)	59	348	38
Dólar estadounidense	3.145	1.167	30	2.029	(4)	33	6.400
Total	$ 5.816	$ 2.725	$ 30	$ (15)	$ 54	$ 385	$ 8.995
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 186	$ –	$ –	$ 186
Real brasileño	9.738	–	–	(6.113)	–	(55)	3.570
Libra británica	7.053	–	–	16.986	–	121	24.160
Dólar canadiense	4.585	–	–	(1.219)	–	28	3.394
Renminbi chino	–	–	–	(950)	–	–	(950)
Peso colombiano	7.920	–	–	(2.571)	–	456	5.805
Corona danesa	–	–	–	(189)	–	–	(189)
Euro	8.814	–	–	36.527	–	249	45.590
Shekel israelí	–	–	–	(194)	–	–	(194)
Yen japonés	–	–	–	25.308	–	–	25.308
Peso mexicano	24.449	–	–	(21.477)	–	468	3.440
Dólar neozelandés	2.062	–	–	(1.953)	–	26	135
Corona noruega	6.120	–	–	(115)	–	94	6.099
Zloty polaco	7.036	–	–	(1.454)	–	456	6.038
Rublo ruso	6.292	–	–	–	–	55	6.347
Dólar de Singapur	–	–	–	(271)	–	–	(271)
Rand sudafricano	9.422	–	–	(9.386)	–	20	56
Won surcoreano	8.781	–	–	(4.666)	–	52	4.167
Corona sueca	–	–	–	(118)	–	–	(118)
Bat tailandés	–	–	–	1.431	–	–	1.431
Dólar estadounidense	47.246	10.717	4.095	(30.596)	–	(3.457)	28.005
Total	$ 149.518	$ 10.717	$ 4.095	$ (834)	$ –	$ (1.487)	$ 162.009
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 149.903	$ –	$ –	$ 149.903
Real brasileño	39.348	–	–	(13.194)	–	644	26.798
Libra británica	–	–	–	12.300	–	1.647	13.947
Dólar canadiense	–	–	–	16.353	–	–	16.353
Peso colombiano	31.019	–	–	20.996	–	1.747	53.762
Euro	–	4.018	–	154.722	–	(1.776)	156.964
Yen japonés	–	–	–	–	2.086	(11)	2.075
Peso mexicano	31.005	–	–	(32.918)	–	1.169	(744)
Dólar neozelandés	14.430	–	–	(3.487)	–	166	11.109
Corona noruega	–	–	–	48.046	–	1	48.047
Nuevo sol peruano	19.905	–	–	(20.189)	–	66	(218)
Zloty polaco	23.077	–	–	(23.648)	–	585	14
Rand sudafricano	15.712	–	–	(15.997)	–	(2)	(287)
Franco suizo	–	–	–	(64.929)	–	–	(64.929)
Dólar estadounidense	245.418	84.210	30.565	(238.561)	104	4.741	126.477
Total	$ 419.914	$ 88.228	$ 30.565	$ (10.603)	$ 2.190	$ 8.977	$ 539.271

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(b) Riesgo de tipo de cambio (continuación)

A 28 de febrero de 2023 (continuación)

Moneda	Inversiones en títulos de interés fijo (en miles)	Inversiones en títulos de interés variable (en miles)	Inversiones en valores que no devengan intereses (en miles)	Contratos de divisas a plazo (en miles)	Otros derivados (en miles)	Otros activos/ (pasivos) netos (en miles)	Valor Neto de los Activos total (en miles)
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^							
Libra británica	$ –	$ –	$ –	$ 67	$ –	$ –	$ 67
Dólar canadiense	–	–	–	9.884	–	–	9.884
Euro	79	–	–	(7)	–	–	72
Corona sueca	–	–	–	(2)	–	–	(2)
Franco suizo	–	–	–	(2)	–	–	(2)
Dólar estadounidense	9.551	334	396	(10.132)	2	224	375
Total	$ 9.630	$ 334	$ 396	$ (192)	$ 2	$ 224	$ 10.394
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ (255)	$ –	$ –	$ (255)
Real brasileño	11.157	–	–	(5.044)	–	174	6.287
Libra británica	1.556	–	–	9.178	–	6	10.740
Dólar canadiense	1.527	–	–	4.328	–	26	5.881
Renminbi chino	–	–	–	(688)	–	–	(688)
Peso colombiano	12.040	–	–	(3.628)	–	726	9.138
Corona danesa	–	–	–	(51)	–	–	(51)
Euro	11.990	40	–	21.821	–	142	33.993
Shekel israelí	–	–	–	(52)	–	–	(52)
Yen japonés	–	–	–	41.040	–	–	41.040
Ringgit malasio	5.778	–	–	(5.221)	–	83	640
Peso mexicano	25.446	–	–	(19.832)	–	624	6.238
Dólar neozelandés	1.673	–	–	13.940	–	20	15.633
Corona noruega	1.518	–	–	8.288	–	24	9.830
Zloty polaco	8.284	–	–	890	–	727	9.901
Rublo ruso	55	–	–	–	–	–	55
Dólar de Singapur	–	–	–	(73)	–	–	(73)
Rand sudafricano	7.572	–	–	(7.184)	–	(2)	386
Won surcoreano	13.957	–	–	(7.291)	–	82	6.748
Corona sueca	–	–	–	(32)	–	–	(32)
Bat tailandés	–	–	–	2.331	–	1	2.332
Dólar estadounidense	71.025	27.021	4.087	(55.256)	–	578	47.455
Total	$ 173.578	$ 27.061	$ 4.087	$ (2.791)	$ –	$ 3.211	$ 205.146
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund							
Dólar australiano	$ 388	$ –	$ –	$ 4.727	$ –	$ 2	$ 5.117
Real brasileño	44.532	–	–	(625)	–	719	44.626
Libra británica	–	1.173	–	46.639	–	89	47.901
Renminbi chino	–	–	–	868	–	–	868
Peso colombiano	35.719	–	–	–	–	2.820	38.539
Corona checa	–	–	–	29	–	–	29
Euro	22.650	–	–	408.937	(878)	532	431.241
Yen japonés	–	–	–	–	(2.581)	136	(2.445)
Peso mexicano	38.254	–	–	(2.826)	–	1.585	37.013
Dólar de Singapur	–	–	–	61.210	–	88	61.298
Corona sueca	–	–	–	2.020	–	–	2.020
Franco suizo	–	–	–	483	–	–	483
Dólar estadounidense	741.247	184.488	85.354	(530.341)	186	62.681	543.615
Total	$ 882.790	$ 185.661	$ 85.354	$ (8.879)	$ (3.273)	$ 68.652	$ 1.210.305
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^							
Real brasileño	$ 890	$ –	$ –	$ (890)	$ –	$ 15	$ 15
Libra británica	–	–	–	(1.169)	–	–	(1.169)
Peso colombiano	802	–	–	(889)	–	31	(56)
Euro	–	2.802	–	(3.578)	17	15	(744)
Yen japonés	–	–	–	–	(74)	4	(70)
Dólar estadounidense	12.080	26.981	2.238	6.550	(86)	1.017	48.780
Total	$ 13.772	$ 29.783	$ 2.238	$ 24	$ (143)	$ 1.082	$ 46.756
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^							
Libra británica	$ –	$ –	$ –	$ (9)	$ –	$ –	$ (9)
Dólar canadiense	–	–	–	(64)	–	–	(64)
Euro	97	–	–	8.360	–	1	8.458
Dólar estadounidense	7.778	202	411	(8.479)	–	92	4
Total	$ 7.875	$ 202	$ 411	$ (192)	$ –	$ 93	$ 8.389

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(b) Riesgo de tipo de cambio (continuación)

A 28 de febrero de 2023 (continuación)

Moneda	Inversiones en títulos de interés fijo (en miles)	Inversiones en títulos de interés variable (en miles)	Inversiones en valores que no devengan intereses (en miles)	Contratos de divisas a plazo (en miles)	Otros derivados (en miles)	Otros activos/ (pasivos) netos (en miles)	Valor Neto de los Activos total (en miles)
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 71.448	$ –	$ –	$ 71.448
Real brasileño	7.638	–	–	–	–	119	7.757
Libra británica	–	–	–	7.018	–	–	7.018
Dólar canadiense	–	–	–	7.370	–	–	7.370
Peso chileno	–	–	–	6.716	–	1	6.717
Peso colombiano	5.023	–	–	(1.784)	–	295	3.534
Corona checa	3.362	–	–	(3.361)	–	53	54
Euro	–	–	–	–	(283)	(1)	(284)
Yen japonés	–	–	–	14.477	–	–	14.477
Ringgit malasio	1.810	–	–	134	–	26	1.970
Peso mexicano	13.934	–	–	–	–	287	14.221
Dólar neozelandés	–	–	–	4.260	–	–	4.260
Corona noruega	–	–	–	3.326	–	–	3.326
Dólar de Singapur	–	–	–	73	–	–	73
Rand sudafricano	5.953	–	–	(557)	–	(2)	5.394
Won surcoreano	4.525	–	–	(2.231)	–	26	2.320
Bat tailandés	–	–	–	2.413	–	–	2.413
Dólar estadounidense	11.900	11.663	3.886	(112.535)	–	2.428	(82.658)
Total	$ 54.145	$ 11.663	$ 3.886	$ (3.233)	$ (283)	$ 3.232	$ 69.410
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^							
Real brasileño	$ 695	$ –	$ –	$ (184)	$ –	$ 9	$ 520
Libra británica	160	–	–	(108)	–	2	54
Peso colombiano	437	–	–	–	–	34	471
Euro	541	184	–	(619)	(62)	8	52
Yen japonés	–	–	–	–	(47)	2	(45)
Peso mexicano	612	–	–	(178)	–	20	454
Dólar estadounidense	7.741	2.760	–	1.111	19	1.667	13.298
Total	$ 10.186	$ 2.944	$ –	$ 22	$ (90)	$ 1.742	$ 14.804
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^							
Euro	$ –	$ –	$ –	$ 1.338	$ –	$ –	$ 1.338
Dólar estadounidense	–	–	2.583	(1.358)	–	(29)	1.196
Total	$ –	$ –	$ 2.583	$ (20)	$ –	$ (29)	$ 2.534
FTGF ClearBridge Value Fund							
Libra británica	$ –	$ –	$ 7.710	$ –	$ –	$ –	$ 7.710
Dólar canadiense	–	–	–	–	–	230	230
Euro	–	–	34.655	61.883	–	(580)	95.958
Yen japonés	–	–	10.195	–	–	–	10.195
Dólar de Singapur	–	–	–	1.757	–	(21)	1.736
Dólar estadounidense	–	–	869.426	(64.606)	–	9.077	813.897
Total	$ –	$ –	$ 921.986	$ (966)	$ –	$ 8.706	$ 929.726
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund							
Euro	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –	$ 42	$ 42
Dólar estadounidense	–	–	180.681	–	–	8.887	189.568
Total	$ –	$ –	$ 180.681	$ –	$ –	$ 8.929	$ 189.610
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund							
Real brasileño	$ –	$ –	$ –	$ 22.751	$ –	$ 477	$ 23.228
Libra británica	–	–	–	–	–	(55)	(55)
Euro	–	–	–	29.795	–	51	29.846
Dólar estadounidense	–	–	1.172.787	(53.811)	–	53.740	1.172.716
Total	$ –	$ –	$ 1.172.787	$ (1.265)	$ –	$ 54.213	$ 1.225.735
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 4.676	$ –	$ (1)	$ 4.675
Libra británica	–	–	–	348	–	170	518
Renminbi chino	–	–	–	980	–	–	980
Euro	–	–	–	738	–	1	739
Dólar de Singapur	–	–	–	1.365	–	–	1.365
Corona sueca	–	–	–	18	–	–	18
Franco suizo	–	–	–	48	–	–	48
Dólar estadounidense	–	–	214.039	(8.398)	–	10.809	216.450
Total	$ –	$ –	$ 214.039	$ (225)	$ –	$ 10.979	$ 224.793

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(b) Riesgo de tipo de cambio (continuación)

A 28 de febrero de 2023 (continuación)

Moneda	Inversiones en títulos de interés fijo (en miles)	Inversiones en títulos de interés variable (en miles)	Inversiones en valores que no devengan intereses (en miles)	Contratos de divisas a plazo (en miles)	Otros derivados (en miles)	Otros activos/ (pasivos) netos (en miles)	Valor Neto de los Activos total (en miles)
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 864	$ –	$ –	$ 864
Dólar canadiense	–	–	114	–	–	(105)	9
Renminbi chino	–	–	–	60	–	–	60
Euro	–	–	–	851	–	–	851
Dólar de Singapur	–	–	–	602	–	–	602
Dólar estadounidense	557	–	35.919	(2.432)	–	2.098	36.142
Total	$ 557	$ –	$ 36.033	$ (55)	$ –	$ 1.993	$ 38.528
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^							
Libra británica	$ –	$ –	$ –	$ 75.460	$ –	$ 546	$ 76.006
Dólar canadiense	–	–	21.126	–	–	(21.126)	–
Euro	–	–	–	31.670	–	(1.111)	30.559
Corona sueca	–	–	–	–	–	78	78
Dólar estadounidense	–	–	1.607.907	(107.948)	–	33.377	1.533.336
Total	$ –	$ –	$ 1.629.033	$ (818)	$ –	$ 11.764	$ 1.639.979
FTGF ClearBridge Global Growth Fund^							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ 265	$ –	$ –	$ 1	$ 266
Libra británica	–	–	507	–	–	–	507
Dólar canadiense	–	–	457	–	–	–	457
Euro	–	–	1.355	–	–	(1)	1.354
Dólar de Hong Kong	–	–	727	–	–	–	727
Yen japonés	–	–	722	–	–	–	722
Corona sueca	–	–	135	–	–	–	135
Franco suizo	–	–	477	–	–	–	477
Dólar estadounidense	–	–	8.178	–	–	356	8.534
Total	$ –	$ –	$ 12.823	$ –	$ –	$ 356	$ 13.179
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^							
Dólar australiano	€ –	€ –	€ 53.833	€ (1.557)	€ –	€ 63	€ 52.339
Real brasileño	–	–	18.045	1.357	–	–	19.402
Libra británica	–	–	115.566	5.910	–	848	122.324
Dólar canadiense	–	–	93.188	39.871	–	93	133.152
Renminbi chino	–	–	–	23.823	–	(73)	23.750
Corona danesa	–	–	–	–	–	40	40
Euro	–	–	266.281	(148.999)	–	26.462	143.744
Yen japonés	–	–	63.941	(4.896)	–	–	59.045
Dólar de Singapur	–	–	–	4.319	–	(25)	4.294
Dólar estadounidense	–	–	421.656	81.035	–	2.052	504.743
Total	€ –	€ –	€ 1.032.510	€ 863	€ –	€ 29.460	€ 1.062.833
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ 40.244	$ 8.200	$ –	$ 846	$ 49.290
Real brasileño	–	–	21.614	–	–	21	21.635
Libra británica	–	–	57.318	5.860	–	593	63.771
Dólar canadiense	–	–	49.509	–	–	(5.967)	43.542
Renminbi chino	–	–	–	1.376	–	–	1.376
Euro	–	–	88.419	45.189	–	775	134.383
Dólar de Hong Kong	–	–	4.748	–	–	–	4.748
Yen japonés	–	–	14.256	–	–	–	14.256
Dólar de Singapur	–	–	–	65.895	–	49	65.944
Dólar estadounidense	–	–	123.182	(128.725)	–	12.646	7.103
Total	$ –	$ –	$ 399.290	$ (2.205)	$ –	$ 8.963	$ 406.048
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ –	$ 5.819	$ –	$ (2)	$ 5.817
Real brasileño	–	–	–	6.595	–	–	6.595
Libra británica	–	–	–	457	–	101	558
Dólar canadiense	–	–	7.728	–	–	(4.628)	3.100
Renminbi chino	–	–	–	2.348	–	–	2.348
Euro	–	–	–	32.066	–	(281)	31.785
Zloty polaco	–	–	–	3.756	–	–	3.756
Dólar de Singapur	–	–	–	26.050	–	177	26.227
Corona sueca	–	–	–	79	–	–	79
Dólar estadounidense	–	–	736.385	(78.643)	–	3.522	661.264
Total	$ –	$ –	$ 744.113	$ (1.473)	$ –	$ (1.111)	$ 741.529

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(b) Riesgo de tipo de cambio (continuación)

A 28 de febrero de 2023 (continuación)

Moneda	Inversiones en títulos de interés fijo (en miles)	Inversiones en títulos de interés variable (en miles)	Inversiones en valores que no devengan intereses (en miles)	Contratos de divisas a plazo (en miles)	Otros derivados (en miles)	Otros activos/ (pasivos) netos (en miles)	Valor Neto de los Activos total (en miles)
FTGF Royce US Smaller Companies Fund							
Dólar canadiense	$ –	$ –	$ 1.206	$ –	$ –	$ –	$ 1.206
Euro	–	–	–	98	–	10	108
Corona sueca	–	–	–	1	–	1	2
Dólar estadounidense	–	–	77.448	(101)	–	(565)	76.782
Total	$ –	$ –	$ 78.654	$ (2)	$ –	$ (554)	$ 78.098
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ 150	$ –	$ –	$ 2	$ 152
Real brasileño	–	–	44	–	–	–	44
Libra británica	–	–	573	–	–	(1)	572
Euro	–	–	295	–	–	1	296
Yen japonés	–	–	496	–	–	–	496
Zloty polaco	–	–	57	–	–	–	57
Won surcoreano	–	–	85	–	–	1	86
Corona sueca	–	–	46	–	–	–	46
Franco suizo	–	–	76	–	–	–	76
Dólar estadounidense	–	–	2.451	–	–	(22)	2.429
Total	$ –	$ –	$ 4.273	$ –	$ –	$ (19)	$ 4.254
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ 2.708	$ 2.549	$ –	$ 12	$ 5.269
Renminbi chino	–	–	–	174	–	(1)	173
Dólar de Hong Kong	–	–	7.445	–	–	–	7.445
Rupia india	–	–	1.478	–	–	(41)	1.437
Rupia indonesia	–	–	1.102	–	–	–	1.102
Ringgit malasio	–	–	482	–	–	–	482
Rupia pakistaní	–	–	93	–	–	–	93
Peso filipino	–	–	310	–	–	–	310
Zloty polaco	–	–	–	36	–	–	36
Dólar de Singapur	–	–	261	32	–	–	293
Won surcoreano	–	–	2.654	–	–	41	2.695
Dólar taiwanés	–	–	3.609	–	–	–	3.609
Bat tailandés	–	–	293	–	–	–	293
Dólar estadounidense	–	–	448	(2.881)	–	286	(2.147)
Total	$ –	$ –	$ 20.883	$ (90)	$ –	$ 297	$ 21.090
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^							
Dólar de Hong Kong	$ –	$ –	$ 1.697	$ –	$ –	$ 1	$ 1.698
Rupia india	–	–	251	–	–	4	255
Rupia indonesia	–	–	67	–	–	–	67
Dólar de Singapur	–	–	562	–	–	–	562
Won surcoreano	–	–	584	–	–	13	597
Dólar taiwanés	–	–	437	–	–	–	437
Dólar estadounidense	–	–	–	–	–	(78)	(78)
Total	$ –	$ –	$ 3.598	$ –	$ –	$ (60)	$ 3.538
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ 4.608	$ –	$ –	$ 1	$ 4.609
Libra británica	–	–	3.291	2.614	–	18	5.923
Corona danesa	–	–	4.935	–	–	28	4.963
Euro	–	–	43.115	87.573	–	(30)	130.658
Dólar de Hong Kong	–	–	8.564	–	–	–	8.564
Corona sueca	–	–	14.064	–	–	–	14.064
Dólar estadounidense	–	–	63.952	(91.568)	–	(116)	(27.732)
Total	$ –	$ –	$ 142.529	$ (1.381)	$ –	$ (99)	$ 141.049
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund							
Dólar australiano	$ –	$ –	$ 8.456	$ 377	$ –	$ 137	$ 8.970
Renminbi chino	–	–	–	1	–	–	1
Dólar de Hong Kong	–	–	6.999	–	–	1	7.000
Rupia india	–	–	2.993	–	–	5	2.998
Ringgit malasio	–	–	647	–	–	(1)	646
Dólar neozelandés	–	–	2.015	–	–	–	2.015
Peso filipino	–	–	277	–	–	–	277
Dólar de Singapur	–	–	2.768	309	–	56	3.133
Bat tailandés	–	–	808	–	–	14	822
Dólar estadounidense	–	–	–	(705)	–	(36)	(741)
Total	$ –	$ –	$ 24.963	$ (18)	$ –	$ 176	$ 25.121

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(b) Riesgo de tipo de cambio (continuación)

A 28 de febrero de 2023 (continuación)

Moneda	Inversiones en títulos de interés fijo (en miles)	Inversiones en títulos de interés variable (en miles)	Inversiones en valores que no devengan intereses (en miles)	Contratos de divisas a plazo (en miles)	Otros derivados (en miles)	Otros activos/ (pasivos) netos (en miles)	Valor Neto de los Activos total (en miles)
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^							
Real brasileño	$ –	$ –	$ 2.089	$ –	$ –	$ 6	$ 2.095
Libra británica	–	–	751	–	–	–	751
Renminbi chino	–	–	1.557	–	–	–	1.557
Dólar de Hong Kong	–	–	8.238	–	–	(1)	8.237
Rupia india	–	–	5.907	–	–	(43)	5.864
Rupia indonesia	–	–	1.229	–	–	–	1.229
Peso mexicano	–	–	1.587	–	–	–	1.587
Peso filipino	–	–	148	–	–	–	148
Rial saudí	–	–	617	–	–	–	617
Won surcoreano	–	–	5.522	–	–	25	5.547
Dólar taiwanés	–	–	4.327	–	–	–	4.327
Dólar estadounidense	–	–	2.575	–	–	168	2.743
Total	$ –	$ –	$ 34.547	$ –	$ –	$ 155	$ 34.702
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^							
Real brasileño	€ –	€ –	€ –	€ 1.333	€ –	€ –	€ 1.333
Libra británica	–	–	9.887	–	–	871	10.758
Corona danesa	–	–	7.103	–	–	39	7.142
Euro	–	–	127.442	(1.383)	–	(760)	125.299
Corona sueca	–	–	25.502	–	–	132	25.634
Franco suizo	–	–	6.353	–	–	34	6.387
Dólar estadounidense	–	–	12.493	52	–	(1)	12.544
Total	€ –	€ –	€ 188.780	€ 2	€ –	€ 315	€ 189.097
Franklin Responsible Income 2028 Fund^							
Euro	€ 25.460	€ 9.299	€ –	€ –	€ –	€ 2.064	€ 36.823
Total	€ 25.460	€ 9.299	€ –	€ –	€ –	€ 2.064	€ 36.823

Algunos Fondos también tienen clases de acciones emitidas en divisas extranjeras. Determinados Fondos (como se indica en el Suplemento pertinente del Folleto) pueden celebrar contratos a plazo sobre divisas, tanto entregables como no entregables, para cubrir el riesgo de tipo de cambio, aumentar la exposición a una divisa, trasladar la exposición a las fluctuaciones cambiarias de una divisa a otra, o mejorar la rentabilidad. Cada Fondo de Renta Fija también puede celebrar opciones sobre contratos a plazo en moneda extranjera, tanto entregables como no entregables, lo que a cambio de una prima le da al Fondo la opción, pero no la obligación, de celebrar dicho contrato en algún momento antes de una fecha específica.

Las tablas siguientes muestran un análisis de sensibilidad con relación al riesgo cambiario y su efecto en el valor neto de los activos de los Fondos en los que el riesgo de tipo de cambio se considera significativo. Se ha realizado una revisión de las posiciones subyacentes de todos los Fondos a 29 de febrero de 2024 y a 28 de febrero de 2023 Los tipos de cambio se apreciaron/depreciaron en un +/- 5 % (dada la naturaleza de los mercados en los que los Fondos invierten, se ha aplicado un incremento/una disminución del 5 %); se ha estimado el impacto correspondiente para el valor liquidativo total. Todos los demás parámetros de mercado se supone que no han variado.

		Impacto sobre el valor neto de los activos debido a movimientos en los tipos de cambio (Importe en la Moneda Base del Fondo) (en miles)			
		29 de febrero de 2024		28 de febrero de 2023	
Fondo	Divisa	Positivo 5 %	Negativo 5 %	Positivo 5 %	Negativo 5 %
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Dólar australiano	3.398	(3.074)	3.257	(2.947)
	Franco suizo	3.127	(2.829)	2.873	(2.599)
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Euro	284	(257)	s/d	s/d
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Renminbi chino	3.766	(3.407)	s/d	s/d
	Rupia india	1.540	(1.393)	s/d	s/d
	Rupia indonesia	1.763	(1.595)	3.357	(3.037)
	Ringgit malasio	1.537	(1.391)	2.666	(2.412)
	Dólar de Singapur	1.755	(1.588)	2.489	(2.252)
	Won surcoreano	1.880	(1.701)	4.113	(3.722)
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Libra británica	14.522	(13.139)	15.035	(13.603)
	Euro	3.213	(2.907)	5.320	(4.813)
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	Dólar canadiense	3.943	(3.568)	4.723	(4.273)
	Renminbi chino	(682)	617	s/d	s/d
	Euro	805	(729)	963	(871)
FTGF Western Asset Global Credit Fund^	Euro	244	(221)	s/d	s/d
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	Euro	19.863	(17.972)	40.788	(36.903)
	Yen japonés	s/d	s/d	(11.299)	10.222
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	Libra británica	14.033	(12.696)	9.295	(8.410)
	Euro	3.002	(2.716)	2.612	(2.363)
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^	Libra británica	s/d	s/d	4.119	(3.726)
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^	Real brasileño	s/d	s/d	133	(121)
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	Libra británica	850	(769)	1.272	(1.150)
	Euro	1.672	(1.513)	2.399	(2.171)
	Yen japonés	s/d	s/d	1.332	(1.205)
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	Dólar australiano	1.426	(1.291)	7.890	(7.138)
	Libra británica	801	(725)	s/d	s/d
	Euro	s/d	s/d	8.261	(7.474)
	Dólar neozelandés	(1.133)	1.025	s/d	s/d
	Franco suizo	(1.172)	1.061	(3.417)	3.092
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^	Dólar canadiense	589	(533)	520	(471)
	Euro	574	(519)	s/d	s/d

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(b) Riesgo de tipo de cambio (continuación)

		Impacto sobre el valor neto de los activos debido a movimientos en los tipos de cambio (Importe en la Moneda Base del Fondo) (en miles)			
		29 de febrero de 2024		28 de febrero de 2023	
Fondo	**Divisa**	**Positivo 5 %**	**Negativo 5 %**	**Positivo 5 %**	**Negativo 5 %**
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	Dólar australiano	1.295	(1.172)	s/d	s/d
	Euro	s/d	s/d	1.789	(1.619)
	Yen japonés	1.654	(1.496)	2.160	(1.954)
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	Euro	20.856	(18.870)	22.697	(20.535)
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	Euro	s/d	s/d	445	(403)
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^	Dólar australiano	3.813	(3.450)	3.760	(3.402)
	Real brasileño	456	(413)	408	(369)
	Libra británica	s/d	s/d	369	(334)
	Dólar canadiense	s/d	s/d	388	(351)
	Yen japonés	886	(801)	762	(689)
	Peso mexicano	736	(666)	748	(677)
	Franco suizo	(954)	863	s/d	s/d
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^	Euro	s/d	s/d	70	(64)
FTGF ClearBridge Value Fund	Euro	7.035	(6.365)	5.050	(4.569)
FTGF ClearBridge Global Growth Fund^	Euro	s/d	s/d	71	(64)
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^	Dólar canadiense	s/d	s/d	7.008	(6.341)
	Libra británica	s/d	s/d	6.438	(5.825)
	Dólar estadounidense	22.231	(20.114)	26.565	(24.035)
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	Dólar australiano	s/d	s/d	2.594	(2.347)
	Libra británica	2.055	(1.859)	3.356	(3.037)
	Dólar canadiense	s/d	s/d	2.292	(2.073)
	Euro	5.932	(5.367)	7.073	(6.399)
	Dólar de Singapur	2.632	(2.381)	3.471	(3.140)
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^	Libra británica	36	(32)	30	(27)
	Yen japonés	26	(23)	26	(24)
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	Dólar australiano	s/d	s/d	277	(251)
	Dólar de Hong Kong	s/d	s/d	392	(355)
	Won surcoreano	s/d	s/d	142	(128)
	Dólar taiwanés	s/d	s/d	190	(172)
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^	Dólar de Hong Kong	s/d	s/d	89	(81)
	Dólar de Singapur	s/d	s/d	30	(27)
	Won surcoreano	s/d	s/d	31	(28)
	Dólar taiwanés	s/d	s/d	23	(21)
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	Euro	6.179	(5.591)	6.877	(6.222)
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	Dólar australiano	389	(352)	472	(427)
	Dólar de Hong Kong	310	(281)	368	(333)
	Rupia india	120	(108)	158	(143)
	Dólar de Singapur	119	(107)	165	(149)
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	Dólar de Hong Kong	278	(251)	434	(392)
	Rupia india	338	(306)	309	(279)
	Won surcoreano	274	(248)	292	(264)
	Dólar taiwanés	212	(192)	228	(206)
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^	Corona sueca	1.333	(1.206)	1.349	(1.221)
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^	Libra británica	115	(104)	s/d	s/d
	Euro	34	(31)	s/d	s/d

El análisis se muestra para los casos en los que el Fondo mantiene una exposición a divisas significativa. Se considera significativa cualquier exposición superior al 10 % del patrimonio neto. Los movimientos en todos los tipos de cambio de las divisas tendrán un impacto directo en el valor liquidativo. Los tipos de cambio de las divisas a 29 de febrero de 2024 y a 28 de febrero de 2023 se detallan en la Nota 11. Este análisis de sensibilidad no debe utilizarse como una predicción de la rentabilidad futura.

El análisis de sensibilidad al riesgo de divisas para FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^, FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^, FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^, Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^, FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^, FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^, FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ y FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ se ha incorporado al cálculo del riesgo de mercado utilizando el enfoque VaR (Nota 12.1 anterior).

(c) Riesgo de tipo de interés

No se ha preparado un análisis de sensibilidad para los Fondos de renta variable, ya que la mayoría de los activos de los Fondos de renta variable son activos que no devengan intereses y, por tanto, el riesgo no es suficientemente significativo.

A 29 de febrero de 2024 y a 28 de febrero de 2023, todo el efectivo en poder de los Fondos se mantiene con el Depositario u otros intermediarios y tienen el potencial de producir ingresos por intereses, cuyo nivel fluctuará según el nivel prevaleciente de los tipos de interés del mercado.

El análisis de los valores a interés fijo, interés variable y sin intereses se recoge en la Nota 12.1(b) anterior.

El rendimiento medio ponderado y los años medios ponderados hasta el vencimiento de cada Fondo sobre sus instrumentos a tipo fijo por divisa a 29 de febrero de 2024 y 28 de febrero de 2023 son los siguientes:

A 29 de febrero de 2024

Divisa	**Rendimiento medio ponderado**	**Media ponderada de años hasta el vencimiento**
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		
Dólar estadounidense	2,25 %	0,12
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		
Dólar estadounidense	4,25 %	20,01
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Real brasileño	10,20 %	5,85
Rupia india	7,22 %	6,61
Peso mexicano	8,85 %	16,59
Dólar estadounidense	4,58 %	17,69

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(c) Riesgo de tipo de interés (continuación)

A 29 de febrero de 2024 (continuación)

Moneda	Rendimiento medio ponderado	Media ponderada de años hasta el vencimiento
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		
Euro	1,78 %	9,12
Corona noruega	3,08 %	9,28
Zloty polaco	2,26 %	8,16
Libra británica	4,90 %	4,44
Dólar estadounidense	4,49 %	14,28
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Real brasileño	10,01 %	2,84
Euro	4,61 %	4,39
Rupia india	6,61 %	4,54
Rupia indonesia	6,87 %	3,21
Peso mexicano	8,85 %	12,27
Zloty polaco	2,26 %	8,16
Libra británica	5,21 %	5,70
Rand sudafricano	10,93 %	17,01
Dólar estadounidense	4,80 %	8,91
FTGF Western Asset US High Yield Fund		
Dólar estadounidense	7,59 %	5,56
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		
Euro	5,09 %	3,57
Peso mexicano	8,66 %	12,88
Libra británica	5,67 %	2,65
Dólar estadounidense	6,15 %	5,64
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Dólar australiano	3,95 %	13,15
Renminbi chino	3,55 %	10,34
Rupia india	7,25 %	9,90
Rupia indonesia	7,14 %	11,51
Ringgit malasio	4,20 %	9,39
Peso filipino	6,66 %	11,88
Dólar de Singapur	2,78 %	14,84
Won surcoreano	2,06 %	8,59
Bat tailandés	3,12 %	14,31
Dólar estadounidense	4,29 %	6,08
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Euro	1,95 %	4,44
Libra británica	3,81 %	3,47
Dólar estadounidense	3,48 %	4,10
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^		
Real brasileño	10,32 %	6,84
Dólar canadiense	3,55 %	16,60
Euro	1,39 %	9,10
Rupia indonesia	7,31 %	15,13
Yen japonés	0,55 %	26,01
Peso mexicano	8,96 %	18,72
Corona noruega	3,08 %	9,28
Zloty polaco	2,26 %	8,16
Libra británica	4,61 %	10,46
Rand sudafricano	10,93 %	17,01
Won surcoreano	1,94 %	2,28
Dólar estadounidense	3,21 %	14,32
FTGF Western Asset Global Credit Fund^		
Euro	2,82 %	6,08
Libra británica	3,77 %	5,27
Dólar estadounidense	5,33 %	13,89
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^		
Real brasileño	10,25 %	5,96
Peso dominicano	10,21 %	11,55
Libra egipcia	18,61 %	0,25
Euro	5,80 %	7,92
Rupia india	6,85 %	6,38
Rupia indonesia	6,86 %	6,46
Dólar jamaicano	9,09 %	6,68
Peso mexicano	9,01 %	20,05
Zloty polaco	2,26 %	8,16
Rand sudafricano	9,89 %	13,01
Dólar estadounidense	5,81 %	18,14

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(c) Riesgo de tipo de interés (continuación)

A 29 de febrero de 2024 (continuación)

Moneda	Rendimiento medio ponderado	Media ponderada de años hasta el vencimiento
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^		
Dólar canadiense	5,48 %	2,21
Euro	5,88 %	2,77
Rupia india	7,22 %	6,61
Dólar jamaicano	9,09 %	6,68
Peso mexicano	8,28 %	4,68
Libra británica	5,92 %	3,00
Dólar estadounidense	7,13 %	7,27
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^		
Dólar estadounidense	6,73 %	13,86
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^		
Dólar estadounidense	4,71 %	25,85
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^		
Real brasileño	10,39 %	8,85
Rupia india	7,22 %	6,61
Peso mexicano	8,96 %	18,72
Dólar estadounidense	4,55 %	16,82
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		
Dólar australiano	2,76 %	0,14
Real brasileño	9,87 %	1,86
Peso colombiano	10,34 %	18,25
Euro	0,00 %	0,13
Peso mexicano	8,71 %	15,36
Dólar neozelandés	4,32 %	15,40
Corona noruega	3,00 %	0,04
Libra británica	2,55 %	27,44
Rand sudafricano	10,02 %	15,10
Dólar estadounidense	3,84 %	13,68
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^		
Real brasileño	10,39 %	8,85
Peso colombiano	10,26 %	23,52
Peso mexicano	9,21 %	27,80
Dólar neozelandés	4,08 %	27,22
Libra británica	2,55 %	27,44
Rand sudafricano	12,11 %	24,01
Dólar estadounidense	4,42 %	17,95
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^		
Euro	6,11 %	4,63
Libra británica	2,77 %	0,29
Dólar estadounidense	6,90 %	4,03
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Dólar australiano	2,76 %	0,14
Real brasileño	10,17 %	5,13
Peso colombiano	9,74 %	16,19
Euro	0,00 %	0,13
Peso mexicano	9,07 %	20,77
Dólar neozelandés	4,08 %	27,22
Corona noruega	3,00 %	0,04
Libra británica	3,04 %	17,49
Rand sudafricano	11,67 %	21,39
Dólar estadounidense	4,41 %	19,05
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Dólar australiano	2,66 %	6,80
Real brasileño	9,69 %	3,31
Peso colombiano	8,71 %	13,31
Euro	2,84 %	28,69
Peso mexicano	8,48 %	15,98
Libra británica	4,31 %	29,67
Dólar estadounidense	5,52 %	4,17
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^		
Real brasileño	7,89 %	4,84
Peso colombiano	7,46 %	21,22
Peso mexicano	6,52 %	9,24
Dólar estadounidense	5,91 %	3,92
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^		
Real brasileño	10,23 %	5,71
Peso colombiano	7,70 %	6,82
Corona checa	2,03 %	8,32
Peso mexicano	9,00 %	18,88
Rand sudafricano	11,87 %	22,57
Dólar estadounidense	5,85 %	25,88

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(c) Riesgo de tipo de interés (continuación)

A 29 de febrero de 2024 (continuación)

Moneda	Rendimiento medio ponderado	Media ponderada de años hasta el vencimiento
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^		
Real brasileño	8,66 %	2,98
Peso colombiano	8,72 %	13,38
Euro	2,27 %	16,19
Peso mexicano	7,89 %	13,80
Libra británica	4,44 %	24,98
Dólar estadounidense	5,99 %	4,49
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^		
Dólar estadounidense	4,83 %	16,10
Franklin Responsible Income 2028 Fund^		
Euro	2,63 %	4,07

A 28 de febrero de 2023

Divisa	Rendimiento medio ponderado	Media ponderada de años hasta el vencimiento
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		
Dólar estadounidense	2,10 %	0,05
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		
Dólar estadounidense	3,91 %	17,10
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Real brasileño	11,46 %	6,45
Rupia indonesia	6,53 %	9,13
Peso mexicano	8,96 %	17,37
Rublo ruso	0,00 %	8,80
Dólar estadounidense	4,07 %	16,48
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		
Euro	1,65 %	9,72
Zloty polaco	2,57 %	9,16
Libra británica	4,59 %	5,01
Dólar estadounidense	4,98 %	13,87
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Real brasileño	10,92 %	3,84
Euro	5,73 %	5,10
Rupia indonesia	7,30 %	5,32
Peso mexicano	9,03 %	19,72
Zloty polaco	2,57 %	9,16
Libra británica	5,29 %	6,46
Rublo ruso	0,00 %	8,26
Rand sudafricano	10,32 %	18,01
Dólar estadounidense	5,55 %	10,34
FTGF Western Asset US High Yield Fund		
Dólar estadounidense	7,47 %	5,97
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		
Euro	5,46 %	4,27
Peso mexicano	8,78 %	14,10
Libra británica	6,55 %	3,51
Rublo ruso	0,00 %	5,52
Dólar estadounidense	6,10 %	6,18
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Renminbi chino	3,54 %	9,88
Rupia india	7,62 %	5,39
Rupia indonesia	7,41 %	4,02
Ringgit malasio	3,94 %	8,13
Peso filipino	6,58 %	12,88
Dólar de Singapur	1,62 %	11,90
Won surcoreano	2,15 %	7,88
Bat tailandés	3,18 %	15,31
Dólar estadounidense	3,87 %	20,28
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Euro	1,29 %	4,27
Libra británica	3,12 %	3,47
Dólar estadounidense	2,55 %	4,41
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^		
Real brasileño	11,82 %	7,85
Dólar canadiense	3,15 %	12,68
Euro	2,11 %	10,77
Rupia indonesia	7,45 %	16,14
Yen japonés	0,37 %	18,27
Peso mexicano	9,03 %	19,72
Zloty polaco	2,57 %	9,16
Libra británica	4,49 %	10,37
Rand sudafricano	10,32 %	18,01
Won surcoreano	1,99 %	3,28
Dólar estadounidense	3,03 %	12,58

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(c) Riesgo de tipo de interés (continuación)

A 28 de febrero de 2023 (continuación)

Moneda	Rendimiento medio ponderado	Media ponderada de años hasta el vencimiento
FTGF Western Asset Global Credit Fund^		
Euro	1,72 %	6,04
Libra británica	3,52 %	5,93
Dólar estadounidense	5,03 %	13,42
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^		
Dólar australiano	3,66 %	24,07
Real brasileño	11,53 %	6,58
Libra egipcia	19,19 %	1,25
Euro	6,35 %	8,93
Rupia india	7,41 %	4,13
Rupia indonesia	7,17 %	9,92
Peso mexicano	9,06 %	21,28
Zloty polaco	2,57 %	9,16
Rublo ruso	0,00 %	10,55
Rand sudafricano	9,68 %	14,57
Dólar estadounidense	5,32 %	14,38
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^		
Dólar canadiense	5,78 %	3,21
Euro	4,75 %	32,52
Rupia indonesia	6,80 %	5,57
Peso mexicano	8,88 %	6,26
Libra británica	6,99 %	4,12
Dólar estadounidense	6,74 %	8,16
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^		
Dólar estadounidense	6,02 %	10,84
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^		
Dólar estadounidense	4,27 %	25,94
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^		
Euro	2,89 %	8,65
Libra británica	4,00 %	9,73
Dólar estadounidense	4,21 %	24,53
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^		
Euro	5,09 %	15,01
Peso mexicano	9,10 %	15,73
Libra británica	6,82 %	15,89
Dólar estadounidense	4,80 %	9,16
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^		
Real brasileño	12,15 %	9,85
Rupia indonesia	6,69 %	6,82
Peso mexicano	9,03 %	19,72
Rublo ruso	0,00 %	6,24
Dólar estadounidense	4,33 %	16,65
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^		
Euro	2,05 %	6,12
Libra británica	2,86 %	6,35
Dólar estadounidense	4,65 %	13,12
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		
Real brasileño	10,44 %	2,99
Dólar canadiense	2,55 %	2,26
Peso colombiano	7,95 %	5,17
Euro	1,84 %	9,47
Peso mexicano	8,90 %	15,49
Dólar neozelandés	4,24 %	16,51
Corona noruega	2,00 %	0,23
Zloty polaco	2,57 %	9,16
Libra esterlina	0,76 %	0,39
Rublo ruso	8,30 %	3,38
Rand sudafricano	9,63 %	16,25
Won surcoreano	3,15 %	21,80
Dólar estadounidense	2,60 %	23,18
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^		
Real brasileño	11,93 %	8,54
Peso colombiano	12,00 %	20,55
Peso mexicano	9,16 %	28,81
Dólar neozelandés	3,92 %	28,23
Sol peruano	7,00 %	9,46
Zloty polaco	2,57 %	9,16
Rand sudafricano	11,21 %	25,02
Dólar estadounidense	3,98 %	16,53
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^		
Euro	3,00 %	8,47
Dólar estadounidense	6,93 %	4,77

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

A 28 de febrero de 2023 (continuación)

Moneda	Rendimiento medio ponderado	Media ponderada de años hasta el vencimiento
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Real brasileño	11,43 %	6,24
Dólar canadiense	2,03 %	0,51
Peso colombiano	9,94 %	10,86
Euro	1,79 %	8,29
Ringgit malasio	3,67 %	2,07
Peso mexicano	9,05 %	18,22
Dólar neozelandés	3,92 %	28,23
Corona noruega	2,00 %	0,23
Zloty polaco	2,57 %	9,16
Libra británica	0,76 %	0,39
Rublo ruso	0,00 %	7,12
Rand sudafricano	10,77 %	21,57
Won surcoreano	2,37 %	13,30
Dólar estadounidense	4,05 %	26,32
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Dólar australiano	2,79 %	7,80
Real brasileño	11,75 %	9,41
Peso colombiano	9,86 %	8,08
Euro	2,01 %	28,20
Yen japonés	0,00 %	0,00
Peso mexicano	8,86 %	28,40
Dólar estadounidense	5,18 %	7,34
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^		
Real brasileño	12,15 %	9,85
Peso colombiano	13,18 %	27,68
Dólar estadounidense	5,87 %	21,21
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^		
Euro	5,06 %	3,59
Dólar estadounidense	6,47 %	4,48
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^		
Real brasileño	11,60 %	6,72
Peso colombiano	9,42 %	7,79
Corona checa	2,28 %	9,32
Ringgit malasio	3,67 %	2,12
Peso mexicano	9,03 %	17,86
Rand sudafricano	11,04 %	23,65
Won surcoreano	2,37 %	13,18
Dólar estadounidense	5,27 %	23,41
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^		
Real brasileño	10,39 %	7,67
Peso colombiano	9,86 %	8,08
Euro	1,95 %	7,29
Yen japonés	0,00 %	0,00
Peso mexicano	7,89 %	21,98
Libra esterlina	5,20 %	1,22
Dólar estadounidense	5,28 %	6,84
Franklin Responsible Income 2028 Fund^		
Euro	2,74 %	5,00

(d) Otro riesgo de precios – Valor razonable de los activos y pasivos financieros

Además del Comité, Franklin Templeton ha establecido un comité de valoración (el "Comité de Valoración") para supervisar la aplicación de las políticas y los procedimientos de valoración adoptados por el Consejo de Administración (el "Consejo"). El Comité de Valoración, incluido su Presidente, se compone de no menos de cuatro miembros. El Comité de Valoración estará atendido por representantes del Departamento Jurídico y de Cumplimento Normativo de Franklin Templeton, en calidad de asesores. El Comité de Valoración se reúne una vez al mes para examinar todos los valores cuyos precios se fijan manualmente, a través de corredores o matriz de precios, o a valor razonable, o que son ilíquidos o están obsoletos. No obstante, puede convocarse una reunión del Comité de Valoración en cualquier momento para considerar cualquier pregunta o cuestión que entre en sus competencias. La asistencia a las reuniones del Comité de Valoración puede ser en persona, por correo electrónico o de otra forma escrita.

Algunos Fondos celebraron contratos de derivados durante el año. El valor de los derivados se basa en ciertas acciones o bonos subyacentes, tipos de interés, divisas o índices e incluye futuros, opciones, opciones sobre futuros, contratos por diferencia y contratos de swap. Los derivados pueden ser difíciles de vender a un precio o tiempo ventajosos y son sensibles a los cambios en el valor subyacente, tipo de interés, divisa o índice. Por lo tanto, los derivados pueden ser muy volátiles y podrían dar lugar a una pérdida para el Fondo. Consulte la Cartera de Inversiones de los Fondos correspondiente para conocer los detalles de las posiciones de derivados abiertas al cierre del ejercicio.

Estimación del valor razonable

De acuerdo con la NIF 102, la Sociedad ha optado por aplicar las disposiciones de reconocimiento y valoración de la Norma Internacional de Contabilidad ("NIC") 39 "Instrumentos financieros: Reconocimiento y valoración" ("NIC 39"), adoptada para su uso en la Unión Europea y los requisitos de revelación de información de las Secciones 11 y 12 de la NIF 102.

El valor razonable de los instrumentos financieros negociados en mercados activos (como derivados negociados públicamente y valores negociables) se basa en precios de cotización de mercado referidos en la fecha del Estado de situación financiera.

En el caso de que no exista una "cotización de mercado inmediatamente disponible", la Sociedad utiliza metodologías de "valor razonable" para fijar el precio de los valores. Como principio general, el valor razonable es el precio que el Fondo espera percibir razonablemente por una venta actual. El proceso de valoración razonable exige que el Comité de Valoración fije el valor de un determinado valor o grupo de valores con criterio de buena fe, atendiendo a los hechos y circunstancias concretos que le afecten.

Las circunstancias en las que no está disponible inmediatamente una cotización de mercado pueden incluir suspensiones de la contratación antes del cierre del mercado correspondiente; acontecimientos que cierren de improviso mercados enteros (como catástrofes, cortes del suministro eléctrico, o acontecimientos similares de importancia), días festivos en el mercado o volumen de contratación de un valor.

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(d) Otro riesgo de precios – Valor razonable de los activos y pasivos financieros (continuación)

Al determinar el valor razonable de un valor en cartera, el Comité de Valoración puede considerar todos los métodos pertinentes, incluidos, a modo de ejemplo, alguno o todos los métodos de fijación de precios siguientes:

(i) un múltiplo de las ganancias;

(ii) un descuento del mercado de un valor similar que se negocie libremente;

(iii) un análisis de flujo de efectivo descontado;

(iv) el valor contable o un múltiplo de este;

(v) un análisis de la prima de riesgo/rendimiento;

(vi) rentabilidad hasta el vencimiento; o

(vii) análisis de inversión fundamental.

El Comité de Valoración examina mensualmente la adecuación y la precisión de los métodos utilizados para obtener el valor razonable, incluidos una comparación de los valores razonables respecto del último precio de mercado y el siguiente precio de mercado disponible, como el precio de apertura de la jornada siguiente.

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.

La siguiente tabla analiza, según la jerarquía del valor razonable, los activos y pasivos financieros de los Fondos valorados a su valor razonable a 29 de febrero de 2024:

	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Western Asset US Core Bond Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	€ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	309
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	258	1.779	9	43
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	(145)	(747)	(224)	(139)
	–	**113**	**1.032**	**(215)**	**213**
Nivel 2					
Bonos y obligaciones	$ 816.638	$ 187.284	$ 812.104	€ 47.027	$ 218.973
Bonos y obligaciones	–	(740)	(5.842)	–	–
Instrumentos del mercado monetario	309.597	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	3.108	348	782	3.355
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	1.346	10.933	16	364
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	(1)	(3.068)	(15)	(1.576)
	1.126.235	**190.997**	**814.475**	**47.810**	**221.116**
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	$ –	$ 107	$ 961	€ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	**107**	**961**	**–**	**–**
Total de inversiones	**$ 1.126.235**	**$ 191.217**	**$ 816.468**	**€ 47.595**	**$ 221.329**

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(d) Otro riesgo de precios – Valor razonable de los activos y pasivos financieros (continuación)

	FTGF Western Asset US High Yield Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	2	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	8	8	–	638	52
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	(82)	(82)	(230)
	8	**10**	**(82)**	**556**	**(178)**
Level 2					
Bonos y obligaciones	$ 94.525	$ 47.351	$ 242.804	$ 463.504	$ 127.087
Bonos y obligaciones	–	–	–	–	(412)
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	900	206	5.476	1.097	11.886
Activos en derivados mantenidos para negociación	435	34	34	2.849	543
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(220)	(24)	(182)	(675)	(371)
	95.640	**47.567**	**248.132**	**466.775**	**138.733**
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	$ 248	$ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	333	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	581	**–**	**–**	**–**	**–**
Total de inversiones	**$ 96.229**	**$ 47.577**	**$ 248.050**	**$ 467.331**	**$ 138.555**

	FTGF Western Asset Global Credit Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	82	22.985	647	166	313
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(21)	(27.277)	(262)	(306)	(247)
	61	**(4.292)**	**385**	**(140)**	**66**
Nivel 2					
Bonos y obligaciones	$ 29.259	$ 1.175.071	$ 356.607	$ 481.444	$ 1.160.664
Bonos y obligaciones	–	–	–	–	(6.335)
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	152	44.830	161	21.501	17.502
Activos en derivados mantenidos para negociación	90	91.549	1.799	12	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(189)	(24.924)	(697)	(6)	–
	29.312	**1.286.526**	**357.870**	**502.951**	**1.171.831**
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ 2.286	$ 16.478	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	2.482	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	**–**	**4.768**	**16.478**	**–**
Total de inversiones	**$ 29.373**	**$ 1.282.234**	**$ 363.023**	**$ 519.289**	**$ 1.171.897**

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(d) Otro riesgo de precios – Valor razonable de los activos y pasivos financieros (continuación)

	Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Brandywine Global High Yield Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	76	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	97	–	256	1	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(56)	–	(51)	–	–
	41	**–**	**205**	**77**	**–**
Nivel 2					
Bonos y obligaciones	$ 17.488	$ 142.717	$ 138.457	$ 29.741	$ 204.172
Bonos y obligaciones	–	–	–	–	–
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	133	2.596	8.090	718	3.580
Activos en derivados mantenidos para negociación	519	855	3.036	38	942
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(67)	(2.346)	(3.927)	(71)	(3.847)
	18.073	**143.822**	**145.656**	**30.426**	**204.847**
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	**–**	**–**	**–**	**–**
Total de inversiones	$ **18.114**	**$ 143.822**	**$ 145.861**	**$ 30.503**	**$ 204.847**

	FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	11	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	55	–	14	1	14
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(274)	–	(167)	(4)	–
	(219)	**11**	**(153)**	**(3)**	**14**
Nivel 2					
Bonos y obligaciones	$ 1.120.544	$ 16.728	$ 63.604	$ 15.252	$ 29.635
Bonos y obligaciones	–	–	–	–	–
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	20.461	1.264	3.994	579	1.040
Activos en derivados mantenidos para negociación	6.119	–	430	54	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(6.831)	–	(1.463)	(57)	–
	1.140.293	**17.992**	**66.565**	**15.828**	**30.675**
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	**–**	**–**	**–**	**–**
Total de inversiones	**$ 1.140.074**	**$ 18.003**	**$ 66.412**	**$ 15.825**	**$ 30.689**

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(d) Otro riesgo de precios – Valor razonable de los activos y pasivos financieros (continuación)

	FTGF ClearBridge Value Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF ClearBridge US Appreciation Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	1.142.135	210.196	1.827.864	205.138	35.735
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	1.142.135	**210.196**	**1.827.864**	**205.138**	**35.735**
Nivel 2					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Bonos y obligaciones	–	–	–	–	–
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	122
Activos en derivados mantenidos para negociación	622	–	392	7	3
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(6)	–	(312)	(22)	(3)
	616	**–**	**80**	**(15)**	**122**
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	**–**	**–**	**–**	**–**
Total de inversiones	**$ 1.142.751**	**$ 210.196**	**$ 1.827.944**	**$ 205.123**	**$ 35.857**

	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF ClearBridge Global Growth Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	€ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	1.367.716	16.583	807.917	326.235	5.144
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	1.367.716	**16.583**	**807.917**	**326.235**	**5.144**
Nivel 2					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	€ –	$ –	$ –
Bonos y obligaciones	–	–	–	–	–
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	370	–	26	255	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(16)	–	(891)	(124)	–
	354	**–**	**(865)**	**131**	–
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	€ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	**–**	**–**	**–**	**–**
Total de inversiones	**$ 1.368.070**	**$ 16.583**	**€ 807.052**	**$ 326.366**	**$ 5.144**

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(d) Otro riesgo de precios – Valor razonable de los activos y pasivos financieros (continuación)

	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Royce US Smaller Companies Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)	Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)	Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	€ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	671.600	94.401	4.213	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	671.600	**94.401**	**4.213**	**–**	**–**
Nivel 2					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	€ –	$ –
Bonos y obligaciones	–	–	–	–	–
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	17.542	1.681	209	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	292	1	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(170)	–	–	–	–
	17.664	**1.682**	**209**	**–**	**–**
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	€ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	**–**	**–**	**–**	**–**
Total de inversiones	**$ 689.264**	**$ 96.083**	**$ 4.422**	**€ –**	**$ –**

	Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	€ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	122.293	20.924	31.406	186.811
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	**122.293**	**20.924**	**31.406**	**186.811**
Nivel 2					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	€ –
Bonos y obligaciones	–	–	–	–	–
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	1.620	142	420	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	385	–	–	3
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	(22)	–	–	(9)
	–	**1.983**	**142**	**420**	**(6)**
Level 3					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	€ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	**–**	**–**	**–**	**–**
Total de inversiones	**$ –**	**$ 124.276**	**$ 21.066**	**$ 31.826**	**€ 186.805**

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(d) Otro riesgo de precios – Valor razonable de los activos y pasivos financieros (continuación)

	FTGF Martin Currie Improving Society Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)	Franklin Responsible Income 2028 Fund^ a 29 de febrero de 2024 (en miles)
Nivel 1		
Bonos y obligaciones	$ –	€ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–
Instrumentos de renta variable	6.124	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–
	6.124	**–**
Nivel 2		
Bonos y obligaciones	$ –	€ 85.524
Bonos y obligaciones	–	–
Instrumentos del mercado monetario	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	5	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–
	5	**85.524**
Nivel 3		
Bonos y obligaciones	$ –	€ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–
	–	**–**
Total de inversiones	**$ 6.129**	**€ 85.524**

La siguiente tabla analiza, según la jerarquía del valor razonable, los activos y pasivos financieros de los Fondos valorados a su valor razonable a 28 de febrero de 2023:

	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset US Core Bond Fund a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund a 28 de febrero de 2023 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	€ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	414
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	367	3.030	480	74
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	(250)	(4.240)	(1.069)	(29)
	–	**117**	**(1.210)**	**(589)**	**459**
Nivel 2					
Bonos y obligaciones	$ 599.348	$ 138.314	$ 1.182.487	€ 125.184	$ 198.461
Instrumentos del mercado monetario	244.848	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	1.741	–	654	4.016
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	2.534	8.816	72	775
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	(46)	(4.445)	(338)	(4.011)
	844.196	**142.543**	**1.186.858**	**125.572**	**199.241**
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	$ –	$ 111	$ 642	€ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	**111**	**642**	**–**	**–**
Total de inversiones	**$ 844.196**	**$ 142.771**	**$ 1.186.290**	**€ 124.983**	**$ 199.700**

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(d) Otro riesgo de precios – Valor razonable de los activos y pasivos financieros (continuación)

	FTGF Western Asset US High Yield Fund a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	1	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	38	–	4.839	343
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(31)	–	(373)	(61)	(1.047)
	(31)	**39**	**(373)**	**4.778**	**(704)**
Level 2					
Bonos y obligaciones	$ 121.003	$ 52.582	$ 429.611	$ 515.122	$ 135.809
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	1.661	133	3.862	17.040	11.217
Activos en derivados mantenidos para negociación	103	60	162	3.920	1.025
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(151)	(271)	(1.130)	(3.219)	(2.097)
	122.616	**52.504**	**432.505**	**532.863**	**145.954**
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	$ 101	$ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	642	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	743	**–**	**–**	**–**	**–**
Total de inversiones	**$ 123.328**	**$ 52.543**	**$ 432.132**	**$ 537.641**	**$ 145.250**

	FTGF Western Asset Global Credit Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	202	26.445	277	317	353
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(34)	(86.734)	(926)	(73)	(731)
	168	**(60.289)**	**(649)**	**244**	**(378)**
Level 2					
Bonos y obligaciones	$ 43.206	$ 1.888.885	$ 263.595	$ 521.432	$ 1.147.183
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	559	18.550	507	17.212	1.154
Activos en derivados mantenidos para negociación	343	177.483	1.911	8	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(166)	(93.430)	(3.726)	(1.683)	–
	43.942	**1.991.488**	**262.287**	**536.969**	**1.148.337**
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	$ –	$ 7.808	$ 1.339	$ 18.407	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	2.424	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	**7.808**	**3.763**	**18.407**	**–**
Total de inversiones	**$ 44.110**	**$ 1.939.007**	**$ 265.401**	**$ 555.620**	**$ 1.147.959**

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(d) Otro riesgo de precios – Valor razonable de los activos y pasivos financieros (continuación)

	FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund a 28 de febrero de 2023 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	£ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	253	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	45	4	175	59	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(29)	(103)	(158)	(5)	–
	16	**154**	**17**	**54**	**–**
Nivel 2					
Bonos y obligaciones	£ 43.921	$ 93.939	$ 15.938	$ 8.541	$ 160.235
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	1.342	30	4.095
Activos en derivados mantenidos para negociación	27	35	910	92	3.132
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(7)	(478)	(60)	(107)	(3.966)
	43.941	**93.496**	**18.130**	**8.556**	**163.496**
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	£ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	**–**	**–**	**–**	**–**
Total de inversiones	**£ 43.957**	**$ 93.650**	**$ 18.147**	**$ 8.610**	**$ 163.496**

	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Brandywine Global High Yield Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	22
Activos en derivados mantenidos para negociación	2.190	2	–	–	69
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	(3.704)	(175)
	2.190	**2**	**–**	**(3.704)**	**(84)**
Level 2					
Bonos y obligaciones	$ 508.142	$ 9.964	$ 200.639	$ 1.068.451	$ 43.555
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	30.565	396	4.087	85.354	2.216
Activos en derivados mantenidos para negociación	13.024	10	1.448	4.819	403
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(23.627)	(202)	(4.239)	(13.267)	(416)
	528.104	**10.168**	**201.935**	**1.145.357**	**45.758**
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	**–**	**–**	**–**	**–**
Total de inversiones	**$ 530.294**	**$ 10.170**	**$ 201.935**	**$ 1.141.653**	**$ 45.674**

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(d) Otro riesgo de precios – Valor razonable de los activos y pasivos financieros (continuación)

	FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF ClearBridge Value Fund a 28 de febrero de 2023 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	2.542	921.986
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	(283)	(123)	–	–
	–	**(283)**	**(123)**	**2.542**	**921.986**
Nivel 2					
Bonos y obligaciones	$ 8.077	$ 65.808	$ 13.130	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	411	3.886	–	41	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	249	119	–	10
Pasivos derivados mantenidos para negociación	(192)	(3.482)	(64)	(20)	(976)
	8.296	**66.461**	**13.185**	**21**	**(966)**
Level 3					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	**–**	**–**	**–**	**–**
Total de inversiones	**$ 8.296**	**$ 66.178**	**$ 13.062**	**$ 2.563**	**$ 921.020**

	FTGF ClearBridge US Appreciation Fund a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	180.681	1.172.787	214.039	36.033	1.629.033
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	180.681	**1.172.787**	**214.039**	**36.033**	**1.629.033**
Nivel 2					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ 557	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	286	4	1	22
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	(1.551)	(229)	(56)	(840)
	–	**(1.265)**	**(225)**	**502**	**(818)**
Level 3					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	**–**	**–**	**–**	**–**
Total de inversiones	**$ 180.681**	**$ 1.171.522**	**$ 213.814**	**$ 36.535**	**$ 1.628.215**

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(d) Otro riesgo de precios – Valor razonable de los activos y pasivos financieros (continuación)

	FTGF ClearBridge Global Growth Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Royce US Smaller Companies Fund a 28 de febrero de 2023 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	$ –	€ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	12.820	1.032.510	399.290	711.568	77.554
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	12.820	**1.032.510**	**399.290**	**711.568**	**77.554**
Nivel 2					
Bonos y obligaciones	$ –	€ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	3	–	–	32.545	1.100
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	1.921	24	150	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	(1.058)	(2.229)	(1.623)	(2)
	3	**863**	**(2.205)**	**31.072**	**1.098**
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	$ –	€ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	**–**	**–**	**–**	**–**
Total de inversiones	**$ 12.823**	**€ 1.033.373**	**$ 397.085**	**$ 742.640**	**$ 78.652**

	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	$ –	€ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	4.093	–	20.882	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	4.093	**–**	**20.882**	**–**	**–**
Nivel 2					
Bonos y obligaciones	$ –	€ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	180	–	1	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	(90)	–	–
	180	**–**	**(89)**	**–**	**–**
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	$ –	€ –	$ –	$ –	$ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	**–**	**–**	**–**	**–**
Total de inversiones	**$ 4.273**	**€ –**	**$ 20.793**	**$ –**	**$ –**

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(d) Otro riesgo de precios – Valor razonable de los activos y pasivos financieros (continuación)

	FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)
Nivel 1					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	€ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	3.598	142.529	24.928	34.547	188.780
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	3.598	**142.529**	**24.928**	**34.547**	**188.780**
Nivel 2					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	€ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	35	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	41	1	–	22
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	(1.422)	(19)	–	(20)
	–	**(1.381)**	**17**	**–**	**2**
Nivel 3					
Bonos y obligaciones	$ –	$ –	$ –	$ –	€ –
Instrumentos del mercado monetario	–	–	–	–	–
Instrumentos de renta variable	–	–	–	–	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–	–	–	–	–
	–	**–**	**–**	**–**	**–**
Total de inversiones	**$ 3.598**	**$ 141.148**	**$ 24.945**	**$ 34.547**	**€ 188.782**

	Franklin Responsible Income 2028 Fund^ a 28 de febrero de 2023 (en miles)
Nivel 1	
Bonos y obligaciones	€ –
Instrumentos del mercado monetario	–
Instrumentos de renta variable	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–
	–
Nivel 2	
Bonos y obligaciones	€ 34.759
Instrumentos del mercado monetario	–
Instrumentos de renta variable	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–
	34.759
Nivel 3	
Bonos y obligaciones	€ –
Instrumentos del mercado monetario	–
Instrumentos de renta variable	–
Activos en derivados mantenidos para negociación	–
Pasivos derivados mantenidos para negociación	–
	–
Total de inversiones	**€ 34.759**

Los importes que se indican con "–" equivalen a 0 $/€/£ o son inferiores a 1.000 $/€/£.

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.1 Riesgo de mercado (continuación)

(d) Otro riesgo de precios – Valor razonable de los activos y pasivos financieros (continuación)

Los valores que el Gestor o el Gestor de Inversiones respectiva valoran de manera razonable a 29 de febrero de 2024 figuran en la Cartera de Inversiones. En caso de que un precio no esté disponible a través de un Servicio de Fijación de Precios, el Comité de Valoración podrá obtener una o más cotizaciones indicativas de agentes-intermediarios autorizados.

El precio matricial se utiliza para los Fondos cuando el Comité de Valoración no puede obtener una o más cotizaciones de agente-intermediario para un valor para el que no haya un precio disponible de un servicio de fijación de precios. El precio de matriz estima el valor actual de mercado de un valor denominado en dólares estadounidenses utilizando la cotización más reciente recibida de un agente-intermediario y ajustando el precio por el cambio en el rendimiento de los EE.UU.

Seguridad de tesorería más similar en duración a la seguridad que se está valorando.

En las siguientes tablas se recoge el valor de los valores de cada Fondo que han sido valorados utilizando fuentes de un único agente y valorados equitativamente por el Comité de Valoración a 29 de febrero de 2024 y 28 de febrero de 2023:

A 29 de febrero de 2024	Precio de un único agente (en miles)	Valor razonable por el Comité de Valoración (en miles)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	–	107 $
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	346 $	963 $
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	–	216 $
FTGF Western Asset US High Yield Fund	248 $	860 $
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	–	368 $
FTGF Western Asset Global Credit Fund^	–	83 $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	–	5.047 $
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	2.286 $	2.830 $
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^	–	16.924 $

A 28 de febrero de 2023	Precio de un único agente (en miles)	Valor razonable por el Comité de Valoración (en miles)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	111 $	111 $
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	642 $	642 $
FTGF Western Asset US High Yield Fund	642 $	642 $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	7.808 $	7.808 $
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	2.424 $	2.626 $
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^	–	19.190 $
FTGF ClearBridge Global Growth Fund^	–	3 $
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^	–	1 $
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	–	35 $

Los importes que se indican con "–" equivalen a 0 $ o son inferiores a 1.000 $.

Para conocer los detalles de los activos y pasivos derivados mantenidos para negociar que eran de valor razonable a 29 de febrero de 2024, consulte la Cartera de Inversiones.

En determinadas circunstancias, la Sociedad emplea precios ajustados de ICE Data Services ("ICE") en la valoración de acciones no estadounidenses. El ICE calcula y suministra un precio de cierre ajustado para utilizarlo como precio de valor razonable.

A 29 de febrero 2024, los precios ajustados al ICE se aplicaron a FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF ClearBridge Value Fund, FTGF ClearBridge US Appreciation Fund, FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund, FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund, FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund, FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund, FTGF ClearBridge Global Growth Fund^, FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^, FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^, FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund, FTGF Royce US Smaller Companies Fund, FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^, FTGF Martin Currie 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^ (28 de febrero de 2023: El precio ajustado del ICE se aplicó al FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF ClearBridge Value Fund, FTGF ClearBridge US Appreciation Fund, FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund, FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund, FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund, FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^, FTGF ClearBridge Global Growth Fund^, FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^, FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund, FTGF Royce US Smaller Companies Fund, FTGF Royce US Smaller Companies Fund, FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^, FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^, FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^, FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^ y FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^).

12.2 Riesgo de crédito

El riesgo de crédito es el riesgo de que una contraparte o el emisor de un instrumento financiero deje de cumplir una obligación o compromiso que haya suscrito con un Fondo. La Sociedad se expone al riesgo de crédito de las partes con las que negocia y además asume el riesgo de incumplimiento en la liquidación. El Gestor de Inversiones y/o los Subgestores de Inversiones correspondientes minimizan las concentraciones de riesgo de crédito realizando operaciones con un gran número de intermediarios y contrapartes en bolsas reconocidas y de buena reputación. Todas las transacciones de valores cotizados se liquidan/pagan en el momento de la entrega utilizando agentes autorizados. El riesgo de impago se considera mínimo, debido a que la entrega de los títulos vendidos solo se hace una vez que el agente de bolsa ha recibido el pago. El pago de una compra se hace una vez que los valores han sido recibidos por el agente de bolsa. La operación fallará si alguna de las partes deja de cumplir su obligación.

Cada Fondo estará expuesto al riesgo de crédito de las contrapartes con las que negocie en relación con opciones, contratos a plazo y otros instrumentos financieros derivados que no se negocien en una bolsa reconocida. Estos instrumentos no gozan de las mismas protecciones que pueden aplicarse a los participantes que negocian swaps, futuros u opciones en intercambios organizados, como la garantía de rendimiento de una cámara de compensación. Los Fondos estarán sujetos a la posibilidad de insolvencia, quiebra o incumplimiento de una contraparte con la que negocien dichos instrumentos, lo que podría dar lugar a pérdidas sustanciales para los Fondos.

La Sociedad está expuesta al riesgo de crédito de las contrapartes OTC con las que opera. Todas las contrapartes OTC deben cumplir los siguientes criterios establecidos en los Reglamentos, a saber:

(i) ser una entidad de crédito de conformidad con la Regla 7 del Reglamento sobre OICVM del Banco Central, o una empresa de inversión autorizada de conformidad con la Directiva sobre mercados de instrumentos financieros en un Estado miembro del EEE, o ser una entidad sujeta a la regulación como entidad supervisada consolidada por la Comisión del Mercado de Valores, o

(ii) Tener una calificación crediticia mínima de A2 o equivalente, o en opinión del Gestor de Inversiones o de los Gestores de Subinversiones pertinentes, una calificación crediticia mínima implícita de A2 o equivalente.

Las exposiciones frente a contrapartes individuales se limitan normalmente al 10 % del valor neto de los activos en el caso de entidades de crédito autorizadas y al 5 % del valor neto de los activos en el caso de otras contrapartes.

Las operaciones con instrumentos financieros derivados suelen ser con contrapartes con las que la Sociedad ha firmado acuerdos marco de compensación. Los acuerdos marco de compensación prevén la liquidación neta de contratos de un determinado Fondo con la misma contraparte en caso de impago. El riesgo de crédito asociado a los activos financieros derivados sujetos a un acuerdo marco de compensación se elimina únicamente en la medida en que los pasivos financieros debidos a la misma contraparte se liquiden una vez materializados los activos.

Las transacciones que den lugar a grandes ganancias latentes a un Fondo pueden requerir que un Fondo mantenga una garantía recibida de un agente. En estos casos, el riesgo de crédito para el Fondo se reduce por el valor de la garantía real mantenida. En caso de que un corredor se declare en quiebra, en los EE. UU. (aunque las regulaciones pueden variar según la jurisdicción), la garantía real depositada en relación con ciertos instrumentos financieros derivados está exenta de la suspensión automática implementada al inicio de un procedimiento de quiebra. Esta exención de instrumentos financieros derivados permitiría a un Fondo ejecutar inmediatamente la garantía real colocada por la parte insolvente para satisfacer las demandas contra dicha parte insolvente.

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.2 Riesgo de crédito (continuación)

El valor de los valores recibidos como garantía en relación con las operaciones con derivados mantenidas por los siguientes Fondos a 29 de febrero de 2024 y 28 de febrero de 2023 era el siguiente:

Fondo	Agente	A 29 de febrero de 2024 Valor de mercado de la garantía en miles	A 28 de febrero de 2023 Valor de mercado de la garantía en miles
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	BNP Paribas	79 $	– $
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Goldman Sachs	62 $	– $
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	JP Morgan	69 $	– $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	Bank of America Merrill Lynch	2.873 $	– $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	BNP Paribas	8.658 $	– $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	Goldman Sachs	79 $	567 $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	JP Morgan	1.581 $	– $
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	Goldman Sachs	58 $	– $
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	Morgan Stanley	– $	202 $

Los importes que se indican con "–" equivalen a 0 $ o son inferiores a 1.000 $.

La Sociedad supervisa su riesgo considerando periódicamente la calidad crediticia y las posiciones financieras de las contrapartes que utilizan los Fondos. Los Fondos solo podrán negociar con contrapartes aprobadas. Se mantiene una lista de contrapartes aprobadas y los Fondos solo pueden negociar con estas contrapartes aprobadas. Las adiciones a esta lista se revisan trimestralmente y anualmente se realiza 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 que puedan ser apropiados.

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

Hasta la expiración de los contratos de recompra, los contratos de recompra inversa y las operaciones de préstamo de acciones, las garantías reales obtenidas en virtud de dichos contratos u operaciones:

(i) debe estar marcado en el mercado todos los días;

(ii) debe ser igual o superior, en valor, en todo momento al valor del monto invertido o de los valores prestados;

(iii) deben transferirse al fideicomisario o a su agente; y

(iv) debe estar inmediatamente disponible para el sistema, sin recurrir a la contraparte, en caso de incumplimiento por parte de dicha entidad.

No se puede vender ni amortizar ninguna garantía no dineraria recibida por la Sociedad; debe mantenerse bajo el riesgo de crédito de la contraparte; y debe ser emitida por una entidad independiente de la contraparte. El riesgo de crédito se aborda mediante el uso diversificado de contrapartes y emisores, y mediante calificaciones mínimas de valores y calificaciones medias de cartera. El Gestor de Inversiones y/o los Gestores de Subinversiones respectivos podrán establecer límites de cartera y podrán invertir sobre la base de parámetros internos con límites mutuamente acordados establecidos al inicio de un Fondo, incluidas limitaciones de emisión y emisor, mínimos de crédito y una calidad crediticia media, y la cuenta será objeto de un seguimiento continuo para garantizar que sigue cumpliendo estos parámetros. También se puede realizar un análisis riguroso e independiente de todos los títulos de crédito antes de la compra, incluidos el modelo financiero, el análisis de escenarios y el seguimiento de los cambios en el perfil de riesgo. Por lo general, no se puede invertir más del 5 % de la cartera en ningún emisor corporativo en el momento de la compra.

El Comité de Valoración se reúne al menos una vez al mes y siempre que las circunstancias lo requieran, para revisar y deliberar sobre cuestiones de valoración, incluido el riesgo de crédito. El Gestor de Inversiones y/o los Gestores de Subinversiones respectivos proporcionan análisis de riesgos al Consejo y al Comité semestralmente.

La práctica totalidad del efectivo y los valores en poder de los Fondos se mantienen a través del Depositario, que tiene una calificación crediticia de AA- (28 de febrero de 2023: 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, el Gestor de Inversiones o los Gestores de Subinversiones respectivos podrán trasladar las tenencias de efectivo a otro banco.

Cualquier valor colocado como garantía se declara en la Cartera de Inversiones. El efectivo y los equivalentes de efectivo mantenidos en las cuentas de Depósito y de margen y el efectivo restringido se declaran en el Estado de la 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 acuerdos comerciales con la contraparte, a retirar dicha garantía depositada. Sin embargo, en la práctica el Fondo puede tratar de reducir los importes adeudados a la contraparte para liquidar cualquier transacción abierta mediante la compensación de los importes adeudados con la garantía depositada. Si se devolviera al Fondo cualquier garantía real después de compensar los importes adeudados (p. ej., si la posición del Fondo se hubiera sobregarantizado), es probable que el Fondo tuviera un crédito no garantizado contra la contraparte en el procedimiento de insolvencia por el importe en exceso que se le adeude.

La siguiente tabla representa el valor de mercado de los valores que se han colocado como garantía con agentes al 29 de febrero de 2024 y al 28 de febrero de 2023 en relación con las operaciones con derivados:

Fondo	Agente	A 29 de febrero de 2024 Valor de mercado de la garantía en miles	A 28 de febrero de 2023 Valor de mercado de la garantía en miles
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Morgan Stanley	1 $	– $
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	Citi	– $	152 $
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	Bank of America Merrill Lynch	69.547 $	1.590 $

Los importes que se indican con "–" equivalen a 0 $ o son inferiores a 1.000 $.

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

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.2 Riesgo de crédito (continuación)

Los cuadros siguientes presentan un resumen de la exposición crediticia basada en las calificaciones crediticias de los títulos de deuda mantenidos en los Fondos de Renta Fija:

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		
Calificación	Feb-24	Feb-23
AAA	100,00 %	100,00 %
	100,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset US Core Bond Fund		
Calificación	Feb-24	Feb-23
AAA	59,99 %	54,62 %
AA	7,18 %	10,57 %
A	17,05 %	16,58 %
BBB	15,50 %	17,85 %
BB	0,03 %	0,38 %
B	0,25 %	–
	100,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Calificación	Feb-24	**Feb-23**
AAA	47,06 %	44,86 %
AA	5,02 %	5,62 %
A	17,71 %	15,52 %
BBB	21,07 %	21,97 %
BB	5,26 %	8,18 %
B	1,42 %	1,51 %
CCC e inferior	2,46 %	2,34 %
	100,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
AAA	23,98 %	20,84 %
AA	23,49 %	26,73 %
A	22,24 %	23,27 %
BBB	24,67 %	24,69 %
BB	4,92 %	3,57 %
B	0,70 %	0,90 %
	100,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
AAA	28,44 %	12,54 %
AA	1,43 %	1,27 %
A	6,99 %	7,23 %
BBB	28,50 %	35,87 %
BB	21,21 %	27,14 %
B	10,34 %	13,35 %
CCC e inferior	2,95 %	2,40 %
No calificado	0,14 %	0,20 %
	100,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset US High Yield Fund		
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
A	0,38 %	0,24 %
BBB	6,74 %	5,14 %
BB	35,66 %	30,19 %
B	36,42 %	47,96 %
CCC e inferior	20,80 %	16,47 %
	100,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset Global High Yield Fund		
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
AA	–	4,85 %
BBB	7,57 %	3,26 %
BB	41,54 %	33,42 %
B	35,83 %	44,10 %
CCC e inferior	15,06 %	14,22 %
No calificado	–	0,15 %
	100,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
AAA	7,14 %	11,27 %
AA	19,31 %	20,43 %
A	41,94 %	29,69 %
BBB	29,77 %	26,60 %
BB	1,84 %	0,66 %
No calificado	–	11,35 %
	100,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
AAA	6,19 %	18,93 %
AA	30,02 %	27,37 %
A	63,79 %	53,43 %
BBB	–	0,27 %
	100,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^		
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
AAA	46,41 %	32,86 %
AA	12,16 %	15,13 %
A	20,11 %	27,67 %
BBB	15,98 %	17,24 %
BB	4,68 %	6,19 %
B	0,56 %	0,91 %
CCC e inferior	0,10 %	–
	100,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset Global Credit Fund^		
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
AAA	0,87 %	11,77 %
AA	6,58 %	2,67 %
A	27,18 %	21,00 %
BBB	55,81 %	57,17 %
BB	9,08 %	7,39 %
B	0,21 %	–
CCC e inferior	0,27 %	–
	100,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^		
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
AAA	16,88 %	20,30 %
AA	1,97 %	2,80 %
A	7,01 %	5,42 %
BBB	49,23 %	44,03 %
BB	20,36 %	22,63 %
B	3,81 %	4,55 %
CCC e inferior	0,63 %	0,27 %
No calificado	0,11 %	–
	100,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^		
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
AAA	4,87 %	5,53 %
AA	0,90 %	0,66 %
A	6,08 %	4,15 %
BBB	22,76 %	21,63 %
BB	34,11 %	38,14 %
B	20,68 %	20,23 %
CCC e inferior	10,60 %	9,66 %
	100,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^β		
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
AAA	1,82 %	1,35 %
AA	0,93 %	0,38 %
A	3,96 %	1,73 %
BBB	17,50 %	12,14 %
BB	14,51 %	15,83 %
B	14,06 %	18,36 %
CCC e inferior	47,22 %	50,21 %
	100,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^		
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
AAA	98,23 %	98,38 %
AA	0,23 %	0,10 %
A	0,88 %	0,22 %
BBB	0,35 %	1,07 %
BB	0,21 %	0,23 %
B	0,10 %	–
	0,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^		
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
AAA	–	7,61 %
AA	–	9,33 %
A	–	45,81 %
BBB	–	36,31 %
BB	–	0,94 %
	0,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^		
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
AAA	–	0,80 %
AA	–	10,66 %
A	–	31,89 %
BBB	–	45,59 %
BB	–	8,94 %
B	–	2,04 %
CCC e inferior	–	0,08 %
	0,00 %	100,00 %

Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^		
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
AAA	77,49 %	6,91 %
AA	2,38 %	0,42 %
A	3,53 %	1,65 %
BBB	11,69 %	34,03 %
BB	0,16 %	25,58 %
B	0,77 %	8,50 %
CCC e inferior	–	2,31 %
No calificado	3,98 %	20,60 %
	100,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^		
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
AAA	–	9,60 %
AA	–	4,25 %
A	–	41,98 %
BBB	–	39,62 %
BB	–	4,55 %
	0,00 %	100,00 %

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
AAA	27,10 %	55,13 %
AA	46,86 %	9,96 %
A	3,24 %	8,03 %
BBB	14,08 %	18,38 %
BB	8,72 %	8,50 %
	100,00 %	100,00 %

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^		
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
AAA	2,73 %	59,94 %
AA	69,71 %	2,93 %
A	2,04 %	9,21 %
BBB	16,90 %	14,30 %
BB	7,56 %	13,62 %
B	1,06 %	–
	100,00 %	100,00 %

FTGF Brandywine Global High Yield Fund^		
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
A	1,74 %	0,39 %
BBB	9,61 %	7,12 %
BB	34,57 %	36,83 %
B	46,72 %	43,32 %
CCC e inferior	4,09 %	8,61 %
No calificado	3,27 %	3,73 %
	100,00 %	100,00 %

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
AAA	14,47 %	50,78 %
AA	59,25 %	9,75 %
A	–	8,22 %
BBB	17,00 %	20,25 %
BB	8,31 %	10,90 %
B	0,97 %	0,02 %
No calificado		0,08 %
	100,00 %	100,00 %

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
AAA	10,52 %	11,57 %
AA	8,71 %	1,61 %
A	5,07 %	7,74 %
BBB	29,86 %	39,90 %
BB	24,44 %	18,89 %
B	15,91 %	14,48 %
CCC e inferior	5,08 %	5,81 %
No calificado	0,41 %	–
	100,00 %	100,00 %

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.2 Riesgo de crédito (continuación)

	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^			FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^			FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^			FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^	
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**	**Calificación**	**Feb-24**	**Feb-23**	**Calificación**	**Feb-24**	**Feb-23**	**Calificación**	**Feb-24**	**Feb-23**
AAA	6,16 %	22,78 %	AAA	–	0,39 %	AAA	40,85 %	27,27 %	AAA	2,81 %	8,27 %
AA	–	9,04 %	AA	–	6,82 %	AA	2,03 %	14,11 %	AA	26,36 %	3,00 %
A	–	11,44 %	A	–	41,27 %	A	0,00 %	6,10 %	A	11,92 %	9,72 %
BBB	11,31 %	22,46 %	BBB	–	48,05 %	BBB	32,37 %	26,76 %	BBB	33,73 %	47,17 %
BB	25,04 %	9,63 %	BB	–	0,81 %	BB	21,39 %	25,76 %	BB	17,72 %	15,96 %
B	51,70 %	6,93 %	B	–	2,66 %	B	3,36 %	–	B	6,95 %	13,72 %
CCC e inferior	5,79 %	2,22 %							CCC e inferior	0,51 %	2,16 %
No calificado	–	15,50 %									
	100,00 %	100,00 %		0,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

	FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^	
Calificación	**Feb-24**	**Feb-23**
AAA	94,05 %	–
AA	2,07 %	–
BBB	3,88 %	–
	100,00 %	0,00 %

β La cartera se construye de manera ascendente utilizando el proceso de valor fundamental de Western Asset. El equipo de inversión no se basa en la investigación de las agencias de calificación; sin embargo, evalúa su trabajo y los niveles de mejora en valores. Para los valores que no están calificados por una organización de calificación estadística reconocida a nivel nacional (NRSRO), el equipo de inversión asigna una calificación crediticia interna basada en el análisis fundamental del equipo de inversión.

12.3 Riesgo de liquidez

El Folleto Informativo de la Sociedad prevé la creación y cancelación diaria de Acciones, por lo que esta se encuentra expuesta al riesgo de liquidez en lo que refiere al cumplimiento de reembolsos a los Accionistas en cualquier momento.

El Administrador supervisa diariamente los volúmenes de suscripción y reembolso y notifica al Gestor de Inversiones o a los Gestores de Subinversiones pertinentes los movimientos significativos y las tendencias inusuales, según proceda. Si las solicitudes de rescate en cualquier día de negociación (según se define en el Folleto) superan el 10 % de las acciones emitidas en relación con cualquier Fondo, la Sociedad podrá optar por restringir el número total de acciones rescatadas en ese día de negociación al 10 % de las acciones en circulación del Fondo, en cuyo caso todas las solicitudes de rescate pertinentes se reducirán proporcionalmente. La Sociedad aplazará las solicitudes de reembolso excesivas y tratará las solicitudes aplazadas como si se hubieran recibido para cada día de negociación posterior (en relación con el cual la Sociedad tenga el mismo poder de aplazamiento al límite vigente en ese momento) hasta que se hayan rescatado todas las acciones a las que se refiere la solicitud original. En tales casos, la Sociedad podrá reducir las solicitudes de manera prorrateada en los días de negociación siguientes a fin de hacer efectiva la limitación anterior.

La Sociedad podrá suspender temporalmente el cálculo del valor neto de los activos y la venta o reembolso de las acciones de cualquier Fondo durante cualquier periodo:

(i) cuando esté cerrado cualquier mercado que sea el principal para una parte significativa de las inversiones del Fondo, o cuando la negociación en el mismo esté restringida o suspendida;

(ii) cuando exista alguna emergencia a consecuencia de la cual no sea factible en la práctica la enajenación por parte de la Sociedad de inversiones que constituyan una parte sustancial de los activos del Fondo;

(iii) cuando, por cualquier motivo, el Fondo no pueda determinar de forma razonable, rápida o precisa los precios de cualquiera de sus inversiones;

(iv) cuando el envío de las sumas de dinero que intervengan o puedan intervenir en la materialización o en el pago de las inversiones del Fondo no pueda efectuarse, a juicio de los Administradores, a los tipos de cambio normales; o

(v) cuando el producto de la venta o el reembolso de las acciones no pueda transmitirse a o desde las cuentas del Fondo.

La Sociedad tiene la capacidad de endeudarse a corto plazo para garantizar la liquidación. De conformidad con los Reglamentos OICVM, un Fondo solo podrá tomar dinero prestado del siguiente modo:

(a) un Fondo puede adquirir divisas mediante un préstamo "back-to-back"; y

(b) un Fondo puede pedir prestado:

(i) hasta el 10 % de su valor neto de los activos siempre que dicho préstamo sea temporal; y

(ii) hasta el 10 % de su valor neto de los activos siempre que el empréstito sea para hacer posible la adquisición de bienes inmuebles necesarios para el desarrollo de su actividad;

siempre que dicho préstamo mencionado en los incisos b) (i) y b) (ii) no supere en total el 15 % de los activos del prestatario.

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 2.675 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 Global Credit Facility, 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 Global Credit Facility.

Todos los Fondos de la Sociedad, con la excepción del FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, se encuentran dentro del ámbito del Global Credit Facility.

Una de las responsabilidades del Comité de Valoración es revisar y deliberar sobre cuestiones de valoración, incluidos los valores no líquidos. La Sociedad puede invertir ocasionalmente en contratos de derivados negociados en mercados extrabursátiles, que no se negocian en un mercado público organizado y pueden ser ilíquidos. En consecuencia, es posible que la Sociedad no pueda liquidar rápidamente sus inversiones en estos instrumentos por un importe cercano a su valor razonable para cumplir sus requisitos de liquidez o para responder a sucesos específicos como el deterioro de la solvencia de cualquier emisor en particular.

Las tablas siguientes se han elaborado sobre la base de las salidas brutas de efectivo no descontadas relativas a los respectivos pasivos financieros. Los contratos de divisas a plazo incluidos en las tablas siguientes se liquidan en términos brutos. Consulte la Cartera de Inversiones correspondiente para obtener detalles sobre los importes brutos de liquidación de estos contratos.

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.3 Riesgo de liquidez (continuación)

Los detalles de los plazos de vencimiento residual contractuales de los pasivos financieros de cada Fondo se recogen a continuación:

	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	
Pasivos (en miles)	**a 29 de febrero de 2024**	**a 28 de febrero de 2023**	**a 29 de febrero de 2024**	**a 28 de febrero de 2023**	**a 29 de febrero de 2024**	**a 28 de febrero de 2023**	**a 29 de febrero de 2024**	**a 28 de febrero de 2023**
Menos de 1 mes								
Descubierto de efectivo	$ –	$ –	$ 1.402	$ 620	$ 1.193	$ 849	€ 60	€ –
Cuentas de margen y efectivo restringido	–	–	1.640	2.826	5.946	445	7	9
Opciones	–	–	10	18	65	161	–	4
Contratos de swap	–	–	1	46	1.640	1.867	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	–	–	12	709	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	3	7	222	1.793	212	868
Pagadero por inversiones adquiridas	9.918	9.879	8.473	11.726	24.808	101.191	525	187
Distribuciones pagables a los tenedores de participaciones reembolsables	3.318	2.054	166	132	158	148	2	1
Comisiones de gestión por pagar	513	363	95	71	385	487	3	3
Comisiones de administrador y depositario por pagar	30	24	18	16	57	73	8	14
Comisiones por servicios a los accionistas	–	–	9	1	20	20	–	–
Cuentas por pagar por acciones participativas rescatables readquiridas	–	–	49	1	1.503	1.904	–	–
Participaciones reembolsables	1.114.418	833.615	185.460	131.919	815.255	1.148.700	49.829	132.467
1-3 meses								
Opciones	–	–	6	–	25	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	–	–	1.396	1.869	15	338
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Más de 3 meses								
Inversiones vendidas en corto	–	–	740	–	5.842	–	–	–
Opciones	–	–	54	52	125	454	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	72	173	330	1.832	12	197
Gastos acumulados y otros pasivos	200	298	91	116	353	375	54	55
Total de pasivos financieros	**$1.128.397**	**$ 846.233**	**$ 198.289**	**$ 147.724**	**$ 859.335**	**$1.262.877**	**€ 50.727**	**€ 134.143**

	FTGF Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund^		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund^		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^	
Pasivos (en miles)	**a 29 de febrero de 2024**	**a 28 de febrero de 2023**	**a 29 de febrero de 2024**	**a 28 de febrero de 2023**	**a 29 de febrero de 2024**	**a 28 de febrero de 2023**	**a 29 de febrero de 2024**	**a 28 de febrero de 2023**
Menos de 1 mes								
Descubierto de efectivo	$ 235	$ 140	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
Cuentas de margen y efectivo restringido	8	38	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratos de swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	15	265	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Pagadero por inversiones adquiridas	736	4	–	–	–	–	–	–
Distribuciones pagables a los tenedores de participaciones reembolsables	90	89	–	–	–	–	–	–
Comisiones de gestión por pagar	33	41	–	–	–	–	–	–
Comisiones de administrador y depositario por pagar	10	11	–	–	–	–	–	3
Comisiones por servicios a los accionistas	1	4	–	–	–	–	–	–
Cuentas por pagar por acciones participativas rescatables readquiridas	103	–	1	–	–	–	–	–
Participaciones reembolsables	48.519	57.431	–	–	–	–	–	–
1-3 meses								
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	9	6	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Más de 3 meses								
Inversiones vendidas en corto	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Gastos acumulados y otros pasivos	70	94	14	14	17	17	12	42
Total de pasivos financieros	**$ 49.829**	**$ 58.123**	**$ 15**	**$ 14**	**$ 17**	**$ 17**	**$ 12**	**$ 45**

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

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 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023
$ –	$ –	$ –	$ 559	$ –	$ 155	$ –	$ –	$ –	$ –
–	–	39	27	237	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	219	116	–	–	–	–
–	–	1.357	3.642	1	35	–	–	–	–
–	–	92	–	–	–	–	–	–	–
–	–	541	266	2.660	1.250	–	–	–	–
–	12	86	94	163	172	–	–	–	–
–	14	94	91	57	67	–	–	–	–
2	9	22	20	13	14	–	3	–	3
–	2	6	6	5	7	–	–	–	–
662	1.366	102	45	35	74	11	11	–	–
–	–	240.940	227.355	96.878	125.240	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	219	366	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	3	–	–	–	–	–	–
–	–	47	29	–	31	–	–	–	–
11	23	104	184	48	79	12	48	18	32
$ 675	**$ 1.426**	**$ 243.649**	**$ 232.687**	**$ 100.316**	**$ 127.240**	**$ 23**	**$ 62**	**$ 18**	**$ 35**

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 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023
$ 236	$ 522	$ 2	$ 484	$ 8	$ –	$ 29	$ –	€ –	€ –
1	6	5	1	123	17	23	3	–	–
–	–	–	–	–	4	–	–	–	–
–	–	498	–	–	–	188	76	–	–
182	789	106	3.188	321	1.985	1	69	–	–
82	373	76	–	179	747	14	–	–	–
219	770	364	25.758	14.941	9.282	–	306	–	–
15	15	2	2	–	–	–	–	–	–
151	200	142	153	14	17	1	2	–	–
26	32	36	36	15	15	8	9	–	3
13	13	12	11	–	–	–	–	–	–
523	299	590	1.106	25	72	–	–	–	–
250.628	437.707	478.538	523.970	129.420	146.703	30.997	46.050	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	71	31	50	98	–	21	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	412	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	341	–	–	–	14	–	–	–	–
–	–	6	61	51	296	7	34	–	–
159	313	82	84	131	101	57	56	12	28
$ 252.235	**$ 441.380**	**$ 480.530**	**$ 554.885**	**$ 145.690**	**$ 159.351**	**$ 31.325**	**$ 46.626**	**€ 12**	**€ 31**

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.3 Riesgo de liquidez (continuación)

Pasivos (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 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023
Menos de 1 mes								
Descubierto de efectivo	$ 4	$ 83.849	$ –	$ –	$ 1.022	$ 2	$ –	$ –
Cuentas de margen y efectivo restringido	56.547	76.579	–	–	119	119	–	–
Opciones	5.750	36.086	–	–	8	–	–	–
Contratos de swap	18.195	43.002	–	–	286	761	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	1.589	19.856	–	–	158	2.113	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	10.696	21.228	–	–	84	63	–	–
Pagadero por inversiones adquiridas	97.494	4.384	–	–	3.733	7.800	–	–
Distribuciones pagables a los tenedores de participaciones reembolsables	–	–	–	–	–	–	–	–
Comisiones de gestión por pagar	1.269	2.062	–	–	27	24	–	–
Comisiones de administrador y depositario por pagar	80	151	–	–	29	22	–	–
Comisiones por servicios a los accionistas	104	136	–	–	–	–	–	–
Cuentas por pagar por acciones participativas rescatables readquiridas	3.476	3.140	–	–	4	82	–	–
Participaciones reembolsables	1.204.969	2.132.501	–	–	372.681	275.012	–	–
1-3 meses								
Opciones	1.549	4.816	–	–	9	24	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	4.869	23.760	–	–	245	852	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Más de 3 meses								
Inversiones vendidas en corto	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	587	5.450	–	–	–	12	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	8.966	25.966	–	–	169	827	–	–
Gastos acumulados y otros pasivos	916	1.652	–	30	170	207	–	–
Total de pasivos financieros	**$1.417.060**	**$2.484.618**	**$ –**	**$ 30**	**$ 378.744**	**$ 287.920**	**$ –**	**$ –**

Pasivos (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 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023
Menos de 1 mes								
Descubierto de efectivo	$ –	$ –	$ 79	$ 4	$ 9	$ 7	$ –	$ –
Cuentas de margen y efectivo restringido	–	26	–	850	270	2.495	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratos de swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	78	1.847	2.038	3.050	17.448	55	149
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	51	–	–	–
Pagadero por inversiones adquiridas	–	145	139	490	2.526	1.798	287	163
Distribuciones pagables a los tenedores de participaciones reembolsables	–	–	–	–	–	–	8	1
Comisiones de gestión por pagar	–	–	72	83	101	260	1	–
Comisiones de administrador y depositario por pagar	11	13	18	24	16	38	8	7
Comisiones por servicios a los accionistas	–	–	10	11	1	–	–	–
Cuentas por pagar por acciones participativas rescatables readquiridas	–	–	179	2.595	2.176	–	60	–
Participaciones reembolsables	–	8.995	145.085	162.009	146.269	539.271	31.164	10.394
1-3 meses								
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	29	499	1.928	877	6.179	16	53
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Más de 3 meses								
Inversiones vendidas en corto	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	5	–	–	–	–	–	–
Gastos acumulados y otros pasivos	30	31	343	386	228	247	41	44
Total de pasivos financieros	**$ 41**	**$ 9.322**	**$ 148.271**	**$ 170.418**	**$ 155.574**	**$ 567.743**	**$ 31.640**	**$ 10.811**

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

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 29 de febrero 2024	a 28 de febrero 2023	a 29 de febrero 2024	a 28 de febrero 2023	a 29 de febrero 2024	a 28 de febrero 2023	a 29 de febrero 2024	a 28 de febrero 2023	a 29 de febrero 2024	a 28 de febrero 2023
$ 533	$ –	$ 3.121	$ 878	£ –	£ –	$ –	$ –	$ 119	$ –
–	–	72	54	–	–	–	6	105	389
–	–	–	–	–	–	–	–	6	21
–	–	–	–	–	–	–	74	4	2
6	1.683	–	–	–	–	–	361	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	5	55
–	–	250.542	83.125	–	229	–	1.787	137	193
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
43	77	15	13	–	–	–	4	–	–
39	38	77	69	3	11	6	12	17	31
1	2	–	–	–	–	–	–	–	–
98	–	–	–	–	–	28	–	–	–
526.156	559.548	1.149.708	1.119.507	–	45.912	–	94.775	18.396	18.441
–	–	–	–	–	–	–	–	–	1
–	–	–	–	–	7	–	43	62	58
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	6.335	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	12	16
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
306	73	247	731	–	29	–	103	34	65
284	350	197	222	43	45	89	64	47	52
$ 527.466	**$ 561.771**	**$1.410.314**	**$1.204.599**	**£ 46**	**£ 46.233**	**$ 123**	**$ 97.229**	**$ 18.944**	**$ 19.324**

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^	
a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023
$ 1	$ 3	$ –	$ –	$ 3.226	$ 1	$ 152	$ –	$ –	$ 103
320	110	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	2.085	878	–	37	–	–
3.062	1.723	–	–	4.746	11.891	–	311	–	144
–	–	–	–	274	2.581	–	175	–	–
–	9.308	–	–	4.968	5.978	663	–	–	30
–	–	–	–	147	106	–	–	–	–
105	100	–	–	681	701	3	39	–	–
22	27	–	–	82	77	13	20	2	7
–	1	–	–	74	78	–	–	–	1
16	4	–	–	4.823	714	5.311	–	–	–
207.376	205.146	–	–	1.151.380	1.210.305	16.403	46.756	–	8.389
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
785	2.507	–	–	–	498	–	68	–	48
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	9	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	1.123	–	–	–	–
128	148	2.172	2.173	349	128	80	66	13	60
$ 211.815	**$ 219.086**	**$ 2.172**	**$ 2.173**	**$1.172.835**	**$1.235.059**	**$ 22.625**	**$ 47.472**	**$ 15**	**$ 8.782**

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.3 Riesgo de liquidez (continuación)

Pasivos (en miles)	Legg Mason Brandywine Global–US High Yield Fund^ a 29 de febrero de 2024	Legg Mason Brandywine Global–US High Yield Fund^ a 28 de febrero de 2023	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ a 29 de febrero de 2024	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ a 28 de febrero de 2023	FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ a 29 de febrero de 2024	FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ a 28 de febrero de 2023	FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^ a 29 de febrero de 2024	FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^ a 28 de febrero de 2023
Menos de 1 mes								
Descubierto de efectivo	$ –	$ –	$ 1	$ 1	$ 9	$ –	$ 218	$ –
Cuentas de margen y efectivo restringido	–	–	288	122	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratos de swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	1.163	3.010	56	44	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	167	283	4	109	–	–
Pagadero por inversiones adquiridas	–	–	–	327	209	–	–	–
Distribuciones pagables a los tenedores de participaciones reembolsables	–	–	–	–	–	–	–	–
Comisiones de gestión por pagar	–	–	–	–	–	–	–	–
Comisiones de administrador y depositario por pagar	–	–	11	13	20	4	4	–
Comisiones por servicios a los accionistas	–	–	–	–	–	–	–	–
Cuentas por pagar por acciones participativas rescatables readquiridas	15	–	–	–	–	–	–	–
Participaciones reembolsables	–	–	71.037	69.410	15.829	14.804	31.699	–
1-3 meses								
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	300	462	1	20	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Más de 3 meses								
Inversiones vendidas en corto	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	–	10	–	–	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	14	–	–
Gastos acumulados y otros pasivos	–	–	171	132	57	27	21	–
Total de pasivos financieros	**$ 15**	**$ –**	**$ 73.138**	**$ 73.770**	**$ 16.185**	**$ 15.022**	**$ 31.942**	**$ –**

Pasivos (en miles)	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund a 29 de febrero de 2024	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund a 28 de febrero de 2023	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund a 29 de febrero de 2024	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund a 28 de febrero de 2023	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund a 29 de febrero de 2024	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund a 28 de febrero de 2023	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund a 29 de febrero de 2024	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund a 28 de febrero de 2023
Menos de 1 mes								
Descubierto de efectivo	$ 2	$ 5	$ –	$ –	$ 74	$ –	$ 5.786	$ 7
Cuentas de margen y efectivo restringido	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratos de swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	304	1.284	22	229	3	56	16	840
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Pagadero por inversiones adquiridas	18.684	429	28	179	3	–	10.962	3.682
Distribuciones pagables a los tenedores de participaciones reembolsables	–	–	–	–	–	–	–	–
Comisiones de gestión por pagar	1.176	795	196	200	20	33	583	704
Comisiones de administrador y depositario por pagar	189	165	40	43	10	11	105	130
Comisiones por servicios a los accionistas	154	109	36	35	–	4	115	170
Cuentas por pagar por acciones participativas rescatables readquiridas	2.792	3.685	208	176	34	44	6.183	28.161
Participaciones reembolsables	1.872.600	1.225.735	207.390	224.793	35.936	38.528	1.365.510	1.639.979
1-3 meses								
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	8	267	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Más de 3 meses								
Inversiones vendidas en corto	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Gastos acumulados y otros pasivos	179	368	174	224	55	47	159	111
Total de pasivos financieros	**$1.896.088**	**$1.232.842**	**$ 208.094**	**$ 225.879**	**$ 36.135**	**$ 38.723**	**$1.389.419**	**$1.673.784**

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^		FTGF ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Growth Fund^		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund^		FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	
a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023
$ –	$ –	$ 614	$ 2.030	$ –	$ –	$ –	$ –	$ 6	$ –
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	20	6	976	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	3.823	6.635	–	–	–	–	–	43
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	715	609	–	–	–	–	185	165
3	7	90	86	–	–	–	–	26	27
–	–	57	56	–	–	–	–	28	23
–	–	4.096	288	17	29	–	–	562	55
–	2.534	1.157.626	929.726	–	–	–	–	211.456	189.610
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
19	50	94	118	–	30	1	55	86	81
$ 22	**$ 2.611**	**$1.167.121**	**$ 940.524**	**$ 17**	**$ 59**	**$ 1**	**$ 55**	**$ 212.349**	**$ 190.004**

FTGF ClearBridge Global Growth Fund^		FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^	
a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023
$ –	$ –	€ 1	€ 2	$ –	$ –	$ –	$ 6	$ –	$ –
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	891	1.018	–	–	124	2.229	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
52	–	450	2.286	–	–	5.843	3.872	3	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
3	6	655	826	–	–	296	377	–	–
8	9	69	103	–	3	28	31	10	–
–	–	76	99	–	–	51	74	–	–
50	–	3.388	1.022	–	–	989	2.062	–	–
16.718	13.179	822.923	1.062.833	–	–	331.809	406.048	5.641	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	40	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
41	27	104	94	24	47	64	62	15	–
$ 16.872	**$ 13.221**	**€ 828.557**	**€1.068.323**	**$ 24**	**$ 50**	**$ 339.204**	**$ 414.761**	**$ 5.669**	**$ –**

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.3 Riesgo de liquidez (continuación)

Pasivos (en miles)	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		FTGF Royce US Smaller Companies Fund		FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^		Legg Mason US Equity Fund^	
	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023
Menos de 1 mes								
Descubierto de efectivo	$ 4	$ 643	$ –	$ 142	$ 8	$ –	$ –	$ –
Cuentas de margen y efectivo restringido	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratos de swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	169	1.547	–	2	–	–	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Pagadero por inversiones adquiridas	1.393	1.944	343	358	–	–	–	–
Distribuciones pagables a los tenedores de participaciones reembolsables	–	–	–	–	–	–	–	–
Comisiones de gestión por pagar	595	624	97	83	–	1	–	–
Comisiones de administrador y depositario por pagar	74	82	15	16	6	7	–	–
Comisiones por servicios a los accionistas	111	109	12	12	–	–	–	–
Cuentas por pagar por acciones participativas rescatables readquiridas	3.599	915	25	37	–	–	–	–
Participaciones reembolsables	694.890	741.529	95.935	78.098	4.386	4.254	–	–
1-3 meses								
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	1	76	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Más de 3 meses								
Inversiones vendidas en corto	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Gastos acumulados y otros pasivos	161	207	61	68	40	19	23	23
Total de pasivos financieros	**$ 700.997**	**$ 747.676**	**$ 96.488**	**$ 78.816**	**$ 4.440**	**$ 4.281**	**$ 23**	**$ 23**

Pasivos (en miles)	Legg Mason Japan Equity Fund^		FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund^		Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^	
	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023
Menos de 1 mes								
Descubierto de efectivo	¥ –	¥ –	$ –	$ –	$ –	$ –	€ –	€ –
Cuentas de margen y efectivo restringido	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Contratos de swap	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Pagadero por inversiones adquiridas	–	–	–	–	–	–	–	–
Distribuciones pagables a los tenedores de participaciones reembolsables	–	–	–	–	–	–	–	–
Comisiones de gestión por pagar	–	–	–	2	–	–	–	–
Comisiones de administrador y depositario por pagar	–	–	3	14	–	–	–	–
Comisiones por servicios a los accionistas	–	–	–	–	–	–	–	–
Cuentas por pagar por acciones participativas rescatables readquiridas	–	–	–	–	–	–	–	–
Participaciones reembolsables	–	–	–	3.538	–	–	–	–
1-3 meses								
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Más de 3 meses								
Inversiones vendidas en corto	–	–	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–	–	–
Gastos acumulados y otros pasivos	126.058	114.974	54	74	28	28	83	65
Total de pasivos financieros	**¥ 126.058**	**¥ 114.974**	**$ 57**	**$ 3.628**	**$ 28**	**$ 28**	**€ 83**	**€ 65**

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

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^	
a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023
€ –	€ –	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	90	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	25	–	–	–	–	–	–
–	3	2	11	–	–	–	–	–	4
–	–	–	2	–	–	–	–	–	–
1.175	1.185	2.213	–	59	59	1	2	2.517	2.516
–	–	–	21.090	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
253	71	49	133	2	1	37	39	27	49
€ 1.428	**€ 1.259**	**$ 2.264**	**$ 21.351**	**$ 61**	**$ 60**	**$ 38**	**$ 41**	**$ 2.544**	**$ 2.569**

Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund^		Legg Mason Martin Currie Greater China 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^	
a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023	a 29 de febrero de 2024	a 28 de febrero de 2023
$ –	$ –	$ –	$ –	$ 180	$ –	$ –	$ –	$ –	$ –
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	22	1.422	–	19	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	63	154	507	–	75	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	64	76	8	18	16	26
–	–	–	–	16	19	8	9	10	11
–	–	–	–	7	8	–	3	–	1
51	51	38	38	89	184	5	–	40	–
–	–	–	–	124.021	141.049	21.144	25.121	31.647	34.702
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	23	23	51	45	177	95	172	116
$ 51	**$ 51**	**$ 61**	**$ 61**	**$ 124.513**	**$ 142.957**	**$ 21.849**	**$ 25.265**	**$ 31.960**	**$ 34.856**

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

12. Exposición a riesgos y gestión del riesgo (continuación)

12.3 Riesgo de liquidez (continuación)

	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^		FTGF Martin Currie Improving Society Fund^		Franklin Responsible Income 2028 Fund^	
Pasivos (en miles)	**a 29 de febrero de 2024**	**a 28 de febrero de 2023**	**a 29 de febrero de 2024**	**a 28 de febrero de 2023**	**a 29 de febrero de 2024**	**a 28 de febrero de 2023**
Menos de 1 mes						
Descubierto de efectivo	€ –	€ 3	$ –	$ –	€ –	€ –
Cuentas de margen y efectivo restringido	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–
Contratos de swap	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	9	1	–	–	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–
Pagadero por inversiones adquiridas	–	4.372	–	–	–	815
Distribuciones pagables a los tenedores de participaciones reembolsables	–	–	–	–	–	–
Comisiones de gestión por pagar	54	55	–	–	32	–
Comisiones de administrador y depositario por pagar	23	41	21	–	9	2
Comisiones por servicios a los accionistas	1	1	–	–	–	–
Cuentas por pagar por acciones participativas rescatables readquiridas	–	2.603	–	–	–	–
Participaciones reembolsables	188.878	189.097	6.186	–	87.704	36.823
1-3 meses						
Opciones	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	19	–	–	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–
Más de 3 meses						
Inversiones vendidas en corto	–	–	–	–	–	–
Opciones	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente sobre contratos de divisas a plazo	–	–	–	–	–	–
Depreciación latente de contratos de futuros	–	–	–	–	–	–
Gastos acumulados y otros pasivos	40	37	44	–	43	22
Total de pasivos financieros	**€ 189.005**	**€ 196.229**	**$ 6.251**	**$ –**	**€ 87.788**	**€ 37.662**

13. Divulgación para inversiones cruzadas por fondos dentro de la Sociedad

Ciertos Fondos invierten en otros Fondos de la Sociedad. Estas inversiones cruzadas han sido eliminadas en los estados financieros de la Sociedad, como sigue:

- los valores de mercado de los planes de inversión colectiva subyacentes se han eliminado en los importes totales de la Sociedad en el Estado de la Situación Financiera;
- las ganancias y pérdidas materializadas, incluidos los movimientos en las ganancias y pérdidas latentes, y los ingresos de dividendos y las distribuciones correspondientes de las inversiones cruzadas se han eliminado en los importes totales de la Sociedad declarados en el Estado de ingresos globales; y
- los importes monetarios de las compras y ventas de participaciones en dichos planes 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 consignados en el estado de cambios en el patrimonio neto atribuible a los accionistas con participación reembolsable.

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ mantuvo 29.816 (2023: 29.816) acciones en el FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^ a final del ejercicio. Las transacciones relacionadas con estas acciones y las ganancias, pérdidas y distribuciones relacionadas durante el año fueron:

	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	
	Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024 (en miles)	**Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 28 de febrero de 2023 (en miles)**
Emisión de acciones	– $	– $
Reembolso de acciones	–	–
Ganancia neta materializada en activos financieros a valor razonable con cambios en resultados	–	–
Distribuciones recibidas	–	–
Coste	3.500	3.500
Valor razonable	3.994	3.886
Ganancia neta latente en activos financieros a valor razonable con cambios en resultados	**494 $**	**386 $**

14. Hechos relevantes

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

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

El 12 de junio de 2023, la Sociedad emitió un Suplemento del FTGF Martin Currie Improving Society Fund^, un Folleto Complementario y un Folleto Especializado para Franklin Templeton Global Funds Plc, lo cual fue aprobado por el Banco Central.

A partir del 20 de junio de 2023, comenzó a operar FTGF Martin Currie Improving Society Fund^.

A partir del 17 de julio de 2023, dejó de operar FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^.

El 17 de julio de 2023, William Jackson dimitió como Consejero de la Sociedad.

El 27 de julio de 2023, Craig Tyle fue nombrado Consejero del Consejo de Administración de la Sociedad.

El 18 de septiembre de 2023, la Sociedad emitió un Suplemento del FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^, un Folleto Complementario y un Folleto actualizado para Franklin Templeton Global Funds Plc, que fue aprobado por el Banco Central.

A partir del 22 de septiembre de 2023, comenzó a operar FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^.

A partir del 23 de octubre de 2023, dejó de operar FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^.

El 1 de noviembre de 2023, la Sociedad emitió un Suplemento de FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^ to the Prospectus of Franklin Templeton Global Funds Plc y el Folleto Especializado de Franklin Templeton Global Funds Plc, con fecha del 1 de noviembre de 2023, y el Banco Central lo anotó. También se emitió el Suplemento de Fondos Existentes de la Sociedad, con fecha 1 de noviembre de 2023, de lo cual tomó nota el Banco Central.

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

Notas relativas a los estados financieros *(continuación)*

14. Hechos relevantes (continuación)

A partir del 3 de noviembre de 2023, Elinor Murray fue nombrada Directora del Consejo de Administración de la Sociedad.

A partir del 6 de noviembre de 2023, comenzó a operar FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^.

A partir del 10 de noviembre de 2023, dejó de operar FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^.

A partir del 5 de diciembre de 2023, dejó de operar FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^.

El 26 de enero de 2024, la Sociedad emitió un Suplemento para FTGF Western Asset US Core Bond Fund que fue aprobado por el Banco Central. La modificación significativa fue la corrección de la Comisión de Gestión máxima de las acciones de Clase F.

A partir del 21 de febrero de 2024, Jane Trust dimitió como Directora de la Sociedad.

El 21 de febrero de 2024, la Sociedad emitió un Suplemento del Franklin Responsible Income 2029 Fund^ (anteriormente Franklin Responsible Series 2 Fund^, redenominado el 21 de febrero de 2024) y un Folleto Complementario para Franklin Templeton Global Funds Plc, que fue aprobado por el Banco Central.

No se produjeron otros hechos relevantes durante el ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024.

15. Responsabilidad segregada

La Sociedad es un fondo paraguas con responsabilidad segregada entre sus Fondos. Por tanto, 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 es posible garantizar que, en caso de que se emprendiese un procedimiento contra la Sociedad ante el tribunal de otra jurisdicción, se pudiera mantener el carácter segregado de los Fondos.

16. Hechos posteriores

El 14 de marzo de 2024, la Sociedad emitió un Suplemento actualizado del Franklin Responsible Income 2029 Fund^ que fue aprobado por el Banco Central.

A partir del 27 de marzo de 2024, el Fondo Franklin Responsible Income 2029 comenzó a cotizar.

A partir del 1 de abril de 2024, el Secretario de la Sociedad ha sido cambiado de Bradwell Limited a OGS Corporate Governance Limited.

El 30 de abril de 2024, las autorizaciones de Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund^ y Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund^ fueron revocadas, a solicitud de la Sociedad, por el Banco Central.

El 31 de mayo de 2024, el Banco Central registró una nueva versión del Folleto. El objetivo principal del Folleto actualizado era facilitar un cambio en la convención de denominación en varias clases de acciones de la Sociedad. Además, FTGF ClearBridge Value Fund cambió su nombre a FTGF ClearBridge US Value Fund. Tenga en cuenta además que se llevaron a cabo algunas modificaciones adicionales en ciertos Fondos, según fuera necesario, tal y como se establece en el aviso a los Accionistas de fecha 12 de abril de 2024.

Además de lo anterior, también se modificó sustancialmente la política de inversión con respecto a FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund. Estas modificaciones incluyeron: (i) una reducción de la exposición a los países de mercados emergentes, (ii) modificaciones a los límites de duración promedio ponderada, (iii) un cambio de referencia, (iv) un cambio en los rendimientos objetivo y (v) la introducción de límites de exposición cambiaria. Los Accionistas del Fondo aprobaron los cambios introducidos en la política en una Asamblea General Extraordinaria celebrada el 8 de mayo de 2024, hecho que el Banco Central registró el 31 de mayo de 2024.

A partir del 17 de julio de 2024, FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ cesará sus operaciones.

No se han producido otros hechos significativos posteriores a la fecha del Estado de la Situación Financiera que requieran ser revelados en los estados financieros.

17. Aprobación del Informe Anual y de los Estados Financieros Auditados

Los Administradores aprobaron el Informe anual y los Estados financieros auditados el 13 de junio de 2024.

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

Información complementaria – Ratios de gastos totales (TER) (sin auditar)

	Relación del total de operaciones Gastos en CU(1) en promedio Financiar activos netos diarios en CU(1)(%) Para el ejercicio cerrado a 29 de febrero de 2024**
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	1,20
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)	0,68
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	
Clase A USD de Capitalización	1,08
Clase A USD de Distribución (D)	1,08
Clase C USD de Capitalización	1,58
Clase C USD de Distribución (D)	1,58
Clase E USD de Capitalización	1,69
Clase F USD de Capitalización	0,62
Clase F USD de Distribución (D)	0,62
Clase X USD de Capitalización	0,58
Clase X USD de Distribución (D)	0,58
Clase Premier USD de Capitalización	0,58
Clase LM USD de Capitalización	0,14
Clase GA USD de Capitalización	0,96
Clase GE USD de Capitalización	1,56
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	
Clase A USD de Capitalización	1,25
Clase A USD de Distribución (D)	1,25
Clase A USD de Distribución (M) Plus	1,25
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	1,27
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	1,25
Clase B USD de Distribución (D)	1,51
Clase C USD de Capitalización	1,75
Clase C USD de Distribución (D)	1,75
Clase E USD de Capitalización	1,85
Clase F USD de Capitalización	0,66
Clase F USD de Distribución (D)	0,65
Clase X USD de Capitalización	0,55
Clase X USD de Distribución (D)	0,55
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	0,56
Clase Premier USD de Capitalización	0,40
Clase Premier USD de Distribución (M)	0,40
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	0,45
Clase LM USD de Distribución (M)	0,11
Clase LM EUR de Capitalización	0,12
Clase LM GBP de Capitalización (cubierta)	0,10
Clase A (G) USD de Capitalización	1,25
Clase A (G) USD de Distribución (D)	1,25
Clase B (G) USD de Distribución (D)	1,76
Clase L (G) USD de Capitalización	1,75
Clase L (G) USD de Distribución (D)	1,75
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	
Clase A USD de Distribución (D)	1,17
Clase A EUR de Distribución (D)	1,13
Clase C USD de Distribución (D)	1,63
Clase Premier EUR de Capitalización	0,48
Clase LM EUR de Capitalización	0,16
Clase GA EUR de Capitalización	1,00
Clase GA EUR de Distribución (A)	1,00
Clase GE EUR de Capitalización	1,60

	Relación del total de operaciones Gastos en CU(1) en promedio Financiar activos netos diarios en CU(1)(%) Para el ejercicio cerrado a 29 de febrero de 2024**
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	
Clase A USD de Capitalización	1,38
Clase A USD de Distribución (D)	1,38
Clase A USD de Distribución (M)	1,38
Clase A USD de Distribución (M) Plus	1,38
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	1,38
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	1,38
Clase A EUR de Distribución (M) (cubierta)	1,38
Clase A Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	1,38
Clase A GBP de Distribución (M) (cubierta)	1,38
Clase A HKD de Distribución (M) Plus	1,38
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	1,38
Clase B USD de Distribución (D)	1,63
Clase C USD de Capitalización	1,88
Clase C USD de Distribución (D)	1,88
Clase A ZAR de Distribución (M) (cubierta) Plus	1,40
Clase E USD de Capitalización	1,98
Clase E USD de Distribución (D)	1,98
Clase E Euro de Capitalización (cubierta)	1,98
Clase E EUR de Distribución (M) (cubierta)	1,99
Clase F USD de Capitalización	0,79
Clase F USD de Distribución (D)	0,78
Clase X USD de Distribución (D)	0,83
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	0,85
Clase X GBP de Distribución (D) (cubierta)	0,83
Clase Premier USD de Capitalización	0,54
Clase Premier USD de Distribución (M)	0,53
Clase Premier CHF de Capitalización (cubierta)	0,53
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	0,53
Clase Premier EUR de Distribución (M) (cubierta)	0,53
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta)	0,53
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	0,53
Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)	0,53
Clase LM AUD de Distribución (M) (cubierta)	0,13
Clase LM GBP de Capitalización (cubierta)	0,13
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	1,25
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 Euro 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)	0,60
Clase S USD de Distribución (M)	0,45
Clase S EUR de Distribución (M) (cubierta)	0,45
Clase LM USD de Distribución (M)	0,15
Clase LM GBP de Capitalización (cubierta)	0,15
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	1,10

Información complementaria – Ratios de gastos totales (TER) (sin auditar) *(continuación)*

	Relación del total de operaciones Gastos en CU(1) en promedio Financiar activos netos diarios en CU(1)(%) Para el ejercicio cerrado a 29 de febrero de 2024**
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	
Clase A USD de Capitalización	1,25
Clase A USD de Distribución (D)	1,25
Clase A USD de Distribución (M)	1,25
Clase A USD de Distribución (M) Plus	1,25
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	1,25
Clase A EUR de Capitalización	1,25
Clase A EUR de Distribución (D) (cubierta)	1,25
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	1,25
Clase B USD de Distribución (D)	1,50
Clase C USD de Capitalización	1,75
Clase C USD de Distribución (D)	1,75
Clase E USD de Capitalización	1,97
Clase E USD de Distribución (D)	1,97
Clase E EUR de Distribución (M) (cubierta)	1,97
Clase F USD de Capitalización	0,96
Clase F USD de Distribución (D)	0,97
Clase X USD de Distribución (D)	0,87
Clase X GBP de Distribución (D) (cubierta)	0,87
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	0,72
Clase Premier GBP de Distribución (D) (cubierta)	0,72
Clase S USD de Distribución (M)	0,45
Clase S EUR de Distribución (M) (cubierta)	0,45
Clase A (G) USD de Capitalización	1,52
Clase A (G) USD de Distribución (D)	1,52
Clase L (G) USD de Capitalización	2,02
Clase L (G) USD de Distribución (D)	2,02
FTGF Western Asset Asian Opportunities 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 CHF de Capitalización (cubierta)	1,37
Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus	1,38
Clase A EUR de Capitalización	1,37
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	1,37
Clase A EUR de Distribución (A)	1,37
Clase A HKD de Distribución (M) Plus	1,37
Clase A SGD de Capitalización (cubierta)	1,37
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	1,37
Clase A SGD de Distribución (M) Plus	1,37
Clase B USD de Capitalización	1,62
Clase C USD de Capitalización	1,87
Clase C USD de Distribución (D)	1,87
Clase E USD de Capitalización	1,97
Clase E USD de Distribución (D)	1,97
Clase F USD de Capitalización	0,97
Clase F USD de Distribución (D)	0,97
Clase X USD de Distribución (M)	0,87
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	0,87
Clase Premier USD de Capitalización	0,72
Clase Premier EUR de Capitalización	0,72
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	0,72
Clase Premier EUR de Distribución (A)	0,72
Clase Premier EUR de Distribución (M)	0,72
Clase Premier GBP de Distribución (M)	0,72
Clase LM USD de Capitalización	0,12
Clase LM USD de Distribución (M)	0,12
Clase LM Euro de Distribución (M) (cubierta)	0,12
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	
Clase A USD de Capitalización	1,12
Clase A USD de Distribución (M)	1,12
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	1,12
Clase A SEK de Capitalización (cubierta)	1,12
Clase A SEK de Distribución (M) (cubierta)	1,00
Clase C USD de Capitalización	1,62
Clase C USD de Distribución (M)	1,62
Clase E USD de Capitalización	1,72
Clase E USD de Distribución (D)	1,71
Clase F USD de Capitalización	0,72
Clase F USD de Distribución (D)	0,71
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	0,62
Clase Premier USD de Capitalización	0,47
Clase Premier CHF de Distribución (M) (cubierta)	0,48
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	0,46
Clase Premier EUR de Distribución (M) (cubierta)	0,47
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)	0,47
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta)	0,48
Clase S USD de Distribución (M) Plus (e)	0,37
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	0,37
Clase S Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	0,37
Clase S GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	0,37

	Relación del total de operaciones Gastos en CU(1) en promedio Financiar activos netos diarios en CU(1)(%) Para el ejercicio cerrado a 29 de febrero de 2024**
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	
Clase A USD de Distribución (A)	1,19
Clase X USD de Capitalización	0,69
Clase Premier USD de Capitalización	0,56
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	0,56
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)	0,55
Clase Premier NZD de Capitalización (cubierta)	0,55
Clase S USD de Capitalización	0,45
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	0,45
Clase LM USD de Capitalización	0,17
Clase LM Euro de Capitalización (cubierta)	0,16
Clase LM CAD de Capitalización (cubierta)	0,17
FTGF Western Asset Global Credit Fund^	
Clase A USD de Capitalización	1,27
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	1,28
Clase X USD de Capitalización	0,65
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	0,64
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)	0,64
Clase LM USD de Capitalización	0,28
Clase LM Euro de Capitalización (cubierta)	0,29
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)	1,74
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)	1,74
Clase A EUR de Distribución (A)	1,74
Clase A Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	1,74
Clase A EUR de Distribución (S) (cubierta)	1,74
Clase A GBP de Capitalización	1,73
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 Euro 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)	1,23
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 Euro 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	1,24
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)	1,24
Clase Premier USD de Capitalización	1,08
Clase Premier USD de Distribución (S)	1,09
Clase Premier AUD de Capitalización (cubierta)	1,09
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)	1,09
Clase Premier EUR de Capitalización	1,08
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	1,09
Clase Premier EUR de Distribución (S) (cubierta)	1,09
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)	1,09
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	1,09
Clase Premier JPY de Capitalización (cubierta)	1,09
Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)	1,09
Clase Premier SEK de Capitalización (cubierta)	1,09
Clase S USD de Capitalización	0,69
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	0,68
Clase LM AUD de Distribución (S) (cubierta)	0,09
Clase LM EUR de Capitalización	0,09

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

Información complementaria – Ratios de gastos totales (TER) (sin auditar) *(continuación)*

	Relación del total de operaciones Gastos en CU(1) en promedio Financiar activos netos diarios en CU(1)(%) Para el ejercicio cerrado a 29 de febrero de 2024**
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	
Clase A USD de Capitalización	1,52
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	1,52
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	1,52
Clase C USD de Capitalización	2,05
Clase X CHF de Distribución (M) (cubierta)	0,90
Clase S USD de Capitalización	0,52
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	0,52
Clase S GBP de Capitalización (cubierta)	0,52
Clase LM Euro de Capitalización (cubierta)	0,12
Clase LM GBP de Capitalización (cubierta)	0,12
Clase LM CAD de Capitalización (cubierta)	0,12
Clase S CHF de Distribución (A)	0,52
Clase S CHF de Distribución (A) (cubierta)	0,52
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^	
Clase D Euro de Capitalización (cubierta)	1,46
Clase D USD de Capitalización	1,45
Clase D USD de Distribución (M)	1,46
Clase D USD de Distribución (M) Plus	1,46
Clase M CHF de Capitalización (cubierta)	0,86
Clase M USD de Distribución (M)	0,86
Clase M Euro de Capitalización (cubierta)	0,86
Clase Premier USD de Capitalización	0,71
Clase Premier USD de Distribución (Q)	0,71
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	0,71
Clase Premier EUR de Distribución (Q) (cubierta)	0,70
Clase LM USD de Capitalización	0,11
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	1,27
Clase Premier USD de Capitalización	0,40
Clase LM USD de Capitalización	0,10
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^	
Clase LM USD de Distribución (Q)	s/d
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	
Clase A USD de Capitalización	1,41
Clase A USD de Distribución (M)	1,41
Clase A USD de Distribución (S)	1,41
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	1,40
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	1,41
Clase A Euro de Capitalización (cubierta) (IH)	1,41
Clase A EUR de Distribución (A) (cubierta)	1,40
Clase A EUR de Distribución (S)	1,41
Clase A EUR de Distribución (S) (cubierta) (IH)	1,41
Clase A GBP de Capitalización	1,41
Clase A GBP de Distribución (M) (cubierta)	1,41
Clase A GBP de Distribución (S) (cubierta) (IH)	1,41
Clase A SGD de Capitalización	1,39
Clase B USD de Capitalización	1,67
Clase B USD de Distribución (S)	1,66
Clase C USD de Capitalización	1,91
Clase C USD de Distribución (S)	1,91
Clase E USD de Capitalización	2,01
Clase E Euro de Capitalización (cubierta) (IH)	2,01
Clase F USD de Capitalización	1,01
Clase F USD de Distribución (S)	1,01
Clase R GBP de Distribución (S) (cubierta) (IH)	1,01
Clase X USD de Capitalización	0,91
Clase X USD de Distribución (S)	0,91
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	0,90
Clase X Euro de Capitalización (cubierta) (IH)	0,91
Clase X GBP de Capitalización	0,91
Clase X GBP de Capitalización (cubierta)	0,91
Clase X GBP de Capitalización (cubierta) (IH)	0,91
Clase X GBP de Distribución (S) (cubierta)	0,91
Clase X GBP de Distribución (S) (cubierta) (IH)	0,91
Clase Premier USD de Capitalización	0,76
Clase Premier USD de Distribución (S)	0,75
Clase Premier EUR de Capitalización	0,76
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	0,76
Clase Premier Euro de Capitalización (cubierta) (IH)	0,76
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)	0,76
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta)	0,76
Clase Premier GBP de Distribución (S) (cubierta) (IH)	0,76
Clase LM USD de Capitalización	0,16
Clase LM USD de Capitalización (cubierta) (IH)	0,16

	Relación del total de operaciones Gastos en CU(1) en promedio Financiar activos netos diarios en CU(1)(%) Para el ejercicio cerrado a 29 de febrero de 2024**
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	
Clase A USD de Capitalización	1,63
Clase A USD de Distribución (A)	1,64
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	1,63
Clase A SGD de Capitalización	1,60
Clase C USD de Capitalización	2,15
Clase E USD de Distribución (A)	2,23
Clase F USD de Capitalización	1,21
Clase X USD de Capitalización	1,17
Clase X GBP de Capitalización (cubierta)	1,17
Clase X GBP de Distribución (M) (cubierta)	1,17
Clase Premier USD de Capitalización	1,03
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	1,02
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta)	1,04
Clase LM USD de Capitalización	0,14
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^	
Clase A USD de Capitalización	1,40
Clase A USD de Distribución (D)	1,40
Clase F USD de Distribución (D)	0,90
Clase Premier USD de Capitalización	0,75
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta) (IH)	0,75
Clase S EUR de Distribución (A) (cubierta) (IH)	0,48
Clase S CAD de Capitalización (cubierta) (IH)	0,48
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	
Clase A USD de Capitalización	1,43
Clase A USD de Distribución (M)	1,43
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	1,45
Clase A SGD de Capitalización	1,42
Clase C USD de Capitalización	1,94
Clase E USD de Capitalización	2,04
Clase F USD de Capitalización	1,04
Clase F USD de Distribución (M)	1,04
Clase X GBP de Distribución (M) (cubierta)	0,93
Clase X GBP de Distribución (M) (cubierta) (IH)	0,93
Clase Premier USD de Capitalización	0,79
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta) (IH)	0,79
Clase Premier NZD de Capitalización (cubierta) (IH)	0,79
Clase LM EUR de Capitalización	0,13
Clase LM NZD de Capitalización (cubierta) (IH)	0,14

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

Información complementaria – Ratios de gastos totales (TER) (sin auditar) *(continuación)*

	Relación del total de operaciones Gastos en CU(1) en promedio Financiar activos netos diarios en CU(1)(%) Para el ejercicio cerrado a 29 de febrero de 2024**
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 Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus	1,37
Clase A Euro 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 Euro 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	0,72
Clase X USD de Distribución (D)	0,75
Clase X USD de Distribución (M) Plus (e)	0,72
Clase X EUR de Capitalización	0,72
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	0,72
Clase X Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	0,72
Clase X GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	0,72
Clase Premier USD de Capitalización	0,57
Clase Premier USD de Distribución (M) Plus (e)	0,57
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)	0,57
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	0,57
Clase Premier Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	0,57
Clase Premier GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	0,57
Clase Premier SEK de Capitalización (cubierta)	0,57
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 Euro 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 USD de Distribución (M) Plus (e)	0,13
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	1,95
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	2,29
Clase A SGD de Capitalización (cubierta)	2,29
Clase X GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	1,45
Clase LM AUD de Capitalización (cubierta)	0,15
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^	
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	1,40
Clase S USD de Capitalización	0,45
Clase S Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	0,45
Clase S GBP de Capitalización (cubierta)	0,45
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^	
Clase A USD de Capitalización	1,09
Clase S USD de Capitalización	0,35

	Relación del total de operaciones Gastos en CU(1) en promedio Financiar activos netos diarios en CU(1)(%) Para el ejercicio cerrado a 29 de febrero de 2024**
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)	1,21
Clase U USD de Capitalización	0,63
Clase X USD de Capitalización	1,13
Clase X USD de Distribución (A)	1,13
Clase X EUR de Capitalización	1,14
Clase Premier USD de Capitalización	0,79
Clase Premier USD de Distribución (A)	0,79
Clase Premier EUR de Capitalización	0,79
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	0,78
Clase Premier GBP de Capitalización	0,78
Clase LM USD de Distribución (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	1,75
Clase B USD de Capitalización	2,24
Clase B USD de Distribución (A)	2,24
Clase C USD de Capitalización	2,24
Clase C USD de Distribución (A)	2,24
Clase E USD de Capitalización	2,50
Clase E USD de Distribución (A)	2,50
Clase F USD de Capitalización	1,15
Clase F USD de Distribución (A)	1,15
Clase X USD de Distribución (A)	1,12
Clase X EUR de Capitalización	1,12
Clase Premier USD de Capitalización	0,77
Clase Premier USD de Distribución (A)	0,77
Clase Premier EUR de Capitalización	0,77
Clase LM USD de Capitalización	0,15
Clase LM EUR de Capitalización	0,15
Clase A (G) USD de Capitalización	1,40
Clase B (G) USD de Capitalización	2,35
Clase L (G) USD de Capitalización	1,90
Clase GA USD de Capitalización	1,57
Clase GA EUR de Capitalización	1,57
Clase GA EUR de Distribución (A)	1,57
Clase GE USD de Capitalización	2,32
Clase GE EUR de Capitalización	2,32
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 A EUR de Distribución (A)	1,75
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)	2,45
Clase F USD de Capitalización	1,10
Clase F USD de Distribución (A)	1,10
Clase U USD de Capitalización	0,62
Clase U USD de Distribución (Q)	0,63
Clase U EUR de Capitalización	0,63
Clase X USD de Capitalización	1,07
Clase X EUR de Capitalización	1,07
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	1,07
Clase X GBP de Capitalización	1,07
Clase Premier USD de Capitalización	0,72
Clase Premier USD de Distribución (A)	0,72
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)	0,72
Clase Premier EUR de Capitalización	0,72
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	0,72
Clase Premier EUR de Distribución (A)	0,72
Clase Premier GBP de Capitalización	0,72
Clase LM USD de Capitalización	0,10
Clase LM EUR de Capitalización	0,10
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

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

Información complementaria – Ratios de gastos totales (TER) (sin auditar) *(continuación)*

	Relación del total de operaciones Gastos en CU(1) en promedio Financiar activos netos diarios en CU(1)(%) Para el ejercicio cerrado a 29 de febrero de 2024**
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	
Clase A USD de Capitalización	1,79
Clase A USD de Distribución (A)	1,79
Clase A AUD de Capitalización (cubierta)	1,79
Clase A CHF de Capitalización (cubierta)	1,79
Clase A CNH de Capitalización (cubierta)	1,79
Clase A EUR de Capitalización	1,79
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	1,79
Clase A EUR de Distribución (A) (cubierta)	1,79
Clase A GBP de Capitalización	1,79
Clase A HKD de Capitalización	1,79
Clase A SEK de Capitalización (cubierta)	1,79
Clase A SGD de Capitalización (cubierta)	1,79
Clase B USD de Distribución (A)	2,30
Clase C USD de Capitalización	2,29
Clase C USD de Distribución (A)	2,29
Clase E USD de Capitalización	2,54
Clase E USD de Distribución (A)	2,54
Clase E EUR de Capitalización	2,54
Clase E Euro de Capitalización (cubierta)	2,54
Clase F USD de Capitalización	1,19
Clase F USD de Distribución (A)	1,19
Clase X USD de Capitalización	1,14
Clase X USD de Distribución (A)	1,14
Clase X EUR de Capitalización	1,14
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	1,14
Clase X GBP de Capitalización	1,14
Clase Premier USD de Capitalización	0,79
Clase Premier EUR de Capitalización	0,79
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	0,80
Clase Premier GBP de Capitalización	0,79
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)	0,79
Clase Premier GBP de Distribución (A)	0,79
Clase LM EUR de Capitalización	0,14
Clase A (G) USD de Capitalización	1,44
Clase B (G) USD de Capitalización	1,94
Clase L (G) USD de Capitalización	1,94
Clase GA EUR de Capitalización	1,56
Clase GA EUR de Distribución (A)	1,56
Clase GE USD de Capitalización	2,31
Clase GE EUR de Capitalización	2,31
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)	1,75
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 Euro 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	1,15
Clase F EUR de Capitalización	1,15
Clase F EUR de Distribución (A)	1,15
Clase X Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus (e)	1,13

	Relación del total de operaciones Gastos en CU(1) en promedio Financiar activos netos diarios en CU(1)(%) Para el ejercicio cerrado a 29 de febrero de 2024**
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	
Clase A USD de Capitalización	1,67
Clase A USD de Distribución (A)	1,67
Clase A EUR de Capitalización	1,67
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	1,67
Clase A SEK de Capitalización	1,50
Clase F USD de Capitalización	1,07
Clase X USD de Capitalización	1,07
Clase X USD de Distribución (A)	1,06
Clase X EUR de Capitalización	1,07
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	1,07
Clase X GBP de Capitalización	1,06
Clase X GBP de Capitalización (cubierta)	1,06
Clase Premier USD de Capitalización	0,72
Clase Premier USD de Distribución (A)	0,72
Clase Premier EUR de Capitalización	0,75
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	0,71
Clase Premier GBP de Capitalización	0,72
Clase S USD de Capitalización	0,52
Clase S EUR de Capitalización	0,52
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	0,52
Clase S GBP de Capitalización	0,52
Clase S GBP de Capitalización (cubierta)	0,52
Clase S GBP de Distribución (Q)	0,52
Clase LM EUR de Capitalización	0,12
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	1,96
Clase A USD de Capitalización (cubierta)	1,97
Clase A USD de Distribución (M) (cubierta) Plus	1,97
Clase A USD de Distribución (M) Plus	2,00
Clase A USD de Distribución (Q)	1,97
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	1,97
Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus	1,97
Clase A EUR de Capitalización	1,97
Clase A Euro de Capitalización (cubierta) (PH)	1,96
Clase A EUR de Distribución (A)	1,97
Clase A Euro de Distribución (M) Plus	1,97
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	1,97
Clase C USD de Capitalización	2,47
Clase C USD de Capitalización (cubierta)	2,47
Clase E USD de Capitalización	2,71
Clase E USD de Capitalización (cubierta)	2,71
Clase E EUR de Capitalización	2,73
Clase E EUR de Distribución (A)	2,75
Clase F USD de Capitalización	1,37
Clase F USD de Capitalización (cubierta)	1,37
Clase U EUR de Capitalización	0,73
Clase X USD de Capitalización	1,06
Clase X USD de Distribución (A)	1,07
Clase X EUR de Capitalización	1,06
Clase X Euro de Capitalización (cubierta) (PH)	1,06
Clase X GBP de Distribución (Q)	1,07
Clase Premier USD de Capitalización	0,87
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)	0,86
Clase Premier CAD de Distribución (Q) (cubierta) (PH) Plus (e)	0,87
Clase Premier EUR de Capitalización	0,87
Clase Premier Euro de Capitalización (cubierta) (PH)	0,87
Clase Premier GBP de Capitalización	0,86
Clase Premier GBP de Distribución (A) (cubierta) (PH) Plus (e)	0,86
Clase Premier GBP de Distribución (Q)	0,87

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

Información complementaria – Ratios de gastos totales (TER) (sin auditar) *(continuación)*

	Relación del total de operaciones Gastos en CU(1) en promedio Financiar activos netos diarios en CU(1)(%) Para el ejercicio cerrado a 29 de febrero de 2024**
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	
Clase A USD de Capitalización	1,97
Clase A USD de Distribución (M) Plus	1,97
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	1,97
Clase A AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	1,97
Clase A CNH de Distribución (M) (cubierta) Plus	1,98
Clase A EUR de Distribución (A) Plus (e)	1,98
Clase A Euro de Distribución (M) (cubierta) Plus	1,98
Clase A GBP de Distribución (M) (cubierta) Plus	1,97
Clase A HKD de Distribución (M) Plus	1,97
Clase A SGD de Distribución (M) (cubierta) Plus	1,97
Clase U USD de Capitalización	0,73
Clase U USD de Distribución (Q) Plus (e)	0,72
Clase U EUR de Capitalización	0,72
Clase U EUR de Distribución (Q) Plus (e)	0,73
Clase U GBP de Capitalización	0,73
Clase U GBP de Capitalización (cubierta)	0,73
Clase U GBP de Distribución (Q) (cubierta) Plus (e)	0,73
Clase U GBP de Distribución (Q) Plus (e)	0,73
Clase X USD de Distribución (M) Plus (e)	1,22
Clase X EUR de Distribución (M) (cubierta)	1,23
Clase X EUR de Distribución (Q) (cubierta) Plus (e)	1,23
Clase X GBP de Distribución (Q) (cubierta) Plus (e)	1,22
Clase Premier USD de Capitalización	0,88
Clase Premier USD de Distribución (M) Plus	0,88
Clase Premier EUR de Distribución (M) (cubierta)	0,88
Clase S USD de Capitalización	0,53
Clase S USD de Distribución (M) Plus	0,53
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^	
Clase A USD de Capitalización	1,80
Clase A SGD de Capitalización (cubierta)	1,80
Clase Premier USD de Capitalización	0,80
Clase S USD de Capitalización	0,45
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	0,45
Clase S GBP de Capitalización (cubierta)	0,45
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	
Clase A USD de Capitalización	1,97
Clase A USD de Distribución (A)	1,97
Clase A AUD de Capitalización (cubierta)	1,97
Clase A CNH de Capitalización (cubierta)	1,97
Clase A EUR de Capitalización	1,97
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	1,97
Clase A EUR de Distribución (A) (cubierta)	1,97
Clase A GBP de Capitalización (cubierta)	1,97
Clase A GBP de Distribución (A)	1,97
Clase A SEK de Capitalización (cubierta)	1,97
Clase A SGD de Capitalización	1,97
Clase A SGD de Capitalización (cubierta)	1,97
Clase B USD de Capitalización	2,47
Clase B USD de Distribución (A)	2,47
Clase C USD de Capitalización	2,47
Clase C USD de Distribución (A)	2,47
Clase E USD de Capitalización	2,72
Clase E USD de Distribución (A)	2,72
Clase E EUR de Capitalización	2,72
Clase E Euro de Capitalización (cubierta)	2,72
Clase F USD de Capitalización	1,37
Clase F USD de Distribución (A)	1,37
Clase R EUR de Capitalización	1,47
Clase X USD de Capitalización	1,22
Clase X USD de Distribución (A)	1,22
Clase X EUR de Capitalización	1,22
Clase X Euro de Capitalización (cubierta)	1,22
Clase X GBP de Capitalización	1,22
Clase X GBP de Distribución (A)	1,22
Clase Premier USD de Capitalización	0,87
Clase Premier BRL de Capitalización (cubierta)	0,87
Clase Premier EUR de Capitalización	0,87
Clase Premier Euro Capitalización (cubierta)	0,87
Clase Premier GBP de Capitalización	0,87
Clase Premier PLN de Capitalización (cubierta)	0,87

	Relación del total de operaciones Gastos en CU(1) en promedio Financiar activos netos diarios en CU(1)(%) Para el ejercicio cerrado a 29 de febrero de 2024**
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)	2,03
Clase C USD de Capitalización	2,49
Clase C USD de Distribución (A)	2,54
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	1,44
Clase F USD de Distribución (A)	1,44
Clase R USD de Capitalización	1,53
Clase X USD de Capitalización	1,29
Clase X USD de Distribución (A)	1,28
Clase Premier USD de Capitalización	0,94
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	1,94
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^	
Clase A USD de Capitalización	1,99
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	1,99
Clase A EUR de Capitalización	1,98
Clase A EUR de Capitalización (cubierta)	1,99
Clase C USD de Capitalización	2,48
Clase E USD de Capitalización	2,73
Clase F USD de Capitalización	1,39
Clase X USD de Capitalización	1,24
Clase X EUR de Capitalización	1,24
Clase X GBP de Capitalización	1,24
Clase X GBP de Capitalización (cubierta)	1,24
Clase Premier USD de Capitalización	0,89
Clase Premier GBP de Capitalización (cubierta)	0,88
Clase S Euro de Capitalización (cubierta)	0,54
Clase S GBP de Capitalización	0,54
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	
Clase A USD de Distribución (M) Plus	2,00
Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	1,99
Clase A AUD de Distribución (M) Plus	1,99
Clase A Euro de Distribución (M) Plus (e)	1,99
Clase A SGD de Distribución (M) Plus	2,00
Clase D AUD de Distribución (M) (cubierta) Plus	1,60
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	1,40
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

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

Información complementaria – Ratios de gastos totales (TER) (sin auditar) *(continuación)*

	Relación del total de operaciones Gastos en CU(1) en promedio Financiar activos netos diarios en CU(1)(%) Para el ejercicio cerrado a 29 de febrero de 2024**
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^	
Clase A USD de Capitalización	1,99
Clase X GBP de Capitalización	1,25
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	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 Gasto Total (TER) se describe en el sitio web de la Asset Management Association Switzerland (AMAS) (www.am-switzerland.ch).

(1) CU = Unidades monetarias en la moneda contable del Fondo.

** Anualizado por períodos inferiores a un año.

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

Información complementaria – Datos de rendimiento del fondo (sin auditar)

Fondo	Clases de Acciones	Fecha de lanzamiento	Clase CCY	Año fiscal hasta la fecha 01/03/23-29/02/24	Calendario 01/01/23-31/12/23	3 años acumulativo 01/01/21-31/12/23	Rendimiento a 10 años 01/03/14-28/02/24
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	Clase A USD de Capitalización	08/05/2007	USD	4,71 %	4,53 %	5,77 %	10,57 %
	Clase A USD de Distribución (D)	27/02/2004	USD	4,70 %	4,52 %	5,74 %	10,60 %
	Clase B USD de Capitalización	15/11/2007	USD	4,27 %	4,07 %	5,05 %	8,24 %
	Clase B USD de Distribución (D)	20/04/2022	USD	4,22 %	4,05 %	–	–
	Clase C USD de Capitalización	15/11/2007	USD	3,97 %	3,80 %	4,62 %	7,04 %
	Clase X USD de Distribución (D)	10/10/2018	USD	4,91 %	4,73 %	6,09 %	–
	Clase A (G) USD de Capitalización	20/04/2007	USD	4,70 %	4,53 %	5,76 %	10,57 %
	Clase A (G) USD de Distribución (D)	20/04/2007	USD	4,71 %	4,52 %	5,75 %	10,55 %
	Clase L (G) USD de Distribución (D)	20/04/2007	USD	4,71 %	4,53 %	5,78 %	10,58 %
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Clase A USD de Capitalización	09/05/2007	USD	2,77 %	5,95 %	(14,12) %	10,10 %
	Clase A USD de Distribución (D)	30/08/2002	USD	2,76 %	5,95 %	(14,14) %	9,84 %
	Clase C USD de Capitalización	15/11/2007	USD	2,26 %	5,43 %	(15,39) %	4,74 %
	Clase C USD de Distribución (D)	24/02/2004	USD	2,25 %	5,43 %	(15,40) %	4,49 %
	Clase E USD de Capitalización	16/08/2019	USD	2,15 %	5,29 %	(15,71) %	–
	Clase F USD de Capitalización	09/08/2013	USD	3,30 %	6,46 %	(12,89) %	15,70 %
	Clase F USD de Distribución (D)	27/02/2017	USD	3,35 %	6,51 %	(12,85) %	–
	Clase X USD de Capitalización	13/05/2016	USD	3,28 %	6,49 %	(12,85) %	–
	Clase X USD de Distribución (D)	03/05/2016	USD	3,27 %	6,48 %	(12,86) %	–
	Clase Premier USD de Capitalización	19/04/2017	USD	3,40 %	6,58 %	(12,36) %	–
	Clase LM USD de Capitalización	08/04/2021	USD	3,75 %	6,93 %	–	–
	Clase GA USD de Capitalización	27/08/2010	USD	2,90 %	6,07 %	(13,68) %	12,52 %
	Clase GE USD de Capitalización	27/08/2010	USD	2,27 %	5,42 %	(15,22) %	5,95 %
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Clase A USD de Capitalización	20/04/2007	USD	3,07 %	6,18 %	(15,27) %	8,91 %
	Clase A USD de Distribución (D)	20/04/2007	USD	3,07 %	6,18 %	(15,28) %	8,95 %
	Clase A USD de Distribución (M) Plus	19/02/2016	USD	3,08 %	6,18 %	(15,27) %	–
	Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	19/02/2016	AUD	1,29 %	4,28 %	(18,00) %	–
	Clase A Euro de Capitalización (Cubierta)	12/06/2018	EUR	0,95 %	3,81 %	(19,82) %	–
	Clase B USD de Distribución (D)	20/04/2007	USD	2,79 %	5,90 %	(16,05) %	6,16 %
	Clase C USD de Capitalización	15/11/2007	USD	2,55 %	5,64 %	(16,53) %	3,60 %
	Clase C USD de Distribución (D)	20/04/2007	USD	2,55 %	5,65 %	(16,53) %	3,63 %
	Clase E USD de Capitalización	03/02/2012	USD	2,45 %	5,54 %	(16,79) %	2,55 %
	Clase F USD de Capitalización	05/04/2013	USD	3,69 %	6,81 %	(13,58) %	17,03 %
	Clase F USD de Distribución (D)	31/10/2018	USD	3,67 %	6,80 %	(13,59) %	–
	Clase X USD de Capitalización	20/03/2015	USD	3,80 %	6,92 %	(13,63) %	–
	Clase X USD de Distribución (D)	28/11/2017	USD	3,77 %	6,89 %	(13,63) %	–
	Clase X Euro de Capitalización (Cubierta)	10/10/2019	EUR	1,60 %	4,47 %	(18,39) %	–
	Clase Premier USD de Capitalización	14/09/2010	USD	3,95 %	7,08 %	(12,93) %	19,99 %
	Clase Premier USD de Distribución (M)	29/09/2011	USD	3,96 %	7,07 %	(12,93) %	19,91 %
	Clase Premier Euro Capitalización (Cubierta)	02/03/2016	EUR	1,72 %	4,62 %	(17,60) %	–
	Clase LM USD de Distribución (M)	13/08/2021	USD	4,26 %	7,40 %	–	–
	Clase LM EUR de Capitalización	05/04/2016	EUR	1,89 %	3,99 %	(2,92) %	–
	Clase LM GBP de Capitalización (Cubierta)	19/11/2010	GBP	3,54 %	6,52 %	(14,03) %	13,88 %
	Clase A (G) USD de Capitalización	20/04/2007	USD	3,07 %	6,17 %	(15,12) %	10,22 %
	Clase A (G) USD de Distribución (D)	20/04/2007	USD	3,06 %	6,17 %	(15,12) %	10,21 %
	Clase B (G) USD de Distribución (D)	20/04/2007	USD	2,58 %	5,66 %	(16,32) %	5,11 %
	Clase L (G) USD de Capitalización	20/04/2007	USD	2,56 %	5,64 %	(16,39) %	4,85 %
	Clase L (G) USD de Distribución (D)	20/04/2007	USD	2,54 %	5,63 %	(16,39) %	4,85 %
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	Clase A USD de Distribución (D)	24/02/2004	USD	7,50 %	10,54 %	(23,42) %	(22,03) %
	Clase A EUR de Distribución (D)	30/09/2003	EUR	5,14 %	7,13 %	(15,26) %	1,97 %
	Clase C USD de Distribución (D)	24/02/2004	USD	6,90 %	9,93 %	(24,47) %	(23,60) %
	Clase Premier EUR de Capitalización	01/03/2019	EUR	5,83 %	7,82 %	(13,38) %	–
	Clase LM EUR de Capitalización	02/05/2017	EUR	6,14 %	8,14 %	(12,59) %	–
	Clase GA EUR de Capitalización	27/08/2010	EUR	5,28 %	7,26 %	(14,72) %	4,96 %
	Clase GA EUR de Distribución (A)	27/08/2010	EUR	5,28 %	7,26 %	(14,72) %	4,96 %
	Clase GE EUR de Capitalización	27/08/2010	EUR	4,66 %	6,63 %	(16,23) %	(1,15) %
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Clase A USD de Capitalización	09/05/2007	USD	6,04 %	7,36 %	(6,30) %	19,29 %
	Clase A USD de Distribución (D)	30/08/2002	USD	6,01 %	7,35 %	(6,30) %	19,19 %
	Clase A USD de Distribución (M)	19/02/2008	USD	6,04 %	7,36 %	(6,30) %	19,27 %
	Clase A USD de Distribución (M) Plus	19/01/2017	USD	6,04 %	7,36 %	(6,30) %	–
	Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	19/01/2017	AUD	4,48 %	5,72 %	(8,93) %	–
	Clase A Euro de Capitalización (Cubierta)	12/02/2008	EUR	3,98 %	5,07 %	(11,13) %	0,74 %
	Clase A EUR de Distribución (M) (Cubierta)	28/04/2008	EUR	3,94 %	5,05 %	(11,15) %	0,71 %
	Clase A Euro de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	02/04/2013	EUR	3,96 %	5,07 %	(11,15) %	0,67 %
	Clase A GBP de Distribución (M) (Cubierta)	29/05/2008	GBP	5,41 %	6,59 %	(7,90) %	10,59 %

Información complementaria – Datos de rendimiento del fondo (sin auditar) *(continuación)*

Fondo	Clases de Acciones	Fecha de lanzamiento	Clase CCY	Año fiscal hasta la fecha 01/03/23-29/02/24	Calendario 01/01/23-31/12/23	3 años acumulativo 01/01/21-31/12/23	Rendimiento a 10 años 01/03/14-28/02/24
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund (continuación)	Clase A HKD de Distribución (M) Plus	07/09/2017	HKD	5,77 %	7,40 %	(5,60) %	–
	Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	26/05/2009	SGD	4,36 %	5,79 %	(7,88) %	14,70 %
	Clase B USD de Distribución (D)	24/02/2004	USD	5,74 %	7,09 %	(7,00) %	16,24 %
	Clase C USD de Capitalización	15/11/2007	USD	5,52 %	6,83 %	(7,69) %	13,49 %
	Clase C USD de Distribución (D)	24/02/2004	USD	5,49 %	6,82 %	(7,69) %	13,36 %
	Clase A ZAR de Distribución (M) (Cubierta) Plus	26/04/2018	ZAR	8,85 %	10,18 %	3,68 %	–
	Clase E USD de Capitalización	21/01/2010	USD	5,41 %	6,73 %	(7,97) %	12,34 %
	Clase E USD de Distribución (D)	21/01/2010	USD	5,38 %	6,71 %	(7,98) %	12,23 %
	Clase E Euro de Capitalización (Cubierta)	19/05/2011	EUR	3,34 %	4,42 %	(12,71) %	(5,12) %
	Clase E EUR de Distribución (M) (Cubierta)	02/08/2013	EUR	3,33 %	4,44 %	(12,71) %	(5,08) %
	Clase F USD de Capitalización	04/02/2010	USD	6,69 %	8,01 %	(4,60) %	26,66 %
	Clase F USD de Distribución (D)	21/01/2010	USD	6,64 %	7,99 %	(4,60) %	26,54 %
	Clase X USD de Distribución (D)	03/07/2013	USD	6,60 %	7,94 %	(4,77) %	25,87 %
	Clase X Euro de Capitalización (Cubierta)	21/02/2023	EUR	4,61 %	–	–	–
	Clase X GBP de Distribución (D) (Cubierta)	27/06/2016	GBP	5,94 %	7,15 %	(6,44) %	–
	Clase Premier USD de Capitalización Clase Premier USD	10/09/2008	USD	6,95 %	8,28 %	(3,88) %	29,86 %
	Distribución (M)	06/02/2009	USD	6,96 %	8,28 %	(3,86) %	29,89 %
	Clase Premier CHF de Capitalización (Cubierta)	01/12/2022	CHF	2,60 %	3,94 %	–	–
	Clase Premier Euro Capitalización (Cubierta)	17/12/2009	EUR	4,84 %	5,93 %	(8,93) %	9,61 %
	Clase Premier EUR de Distribución (M) (Cubierta)	23/11/2012	EUR	4,86 %	5,98 %	(8,83) %	9,66 %
	Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta)	18/04/2008	GBP	6,33 %	7,51 %	(5,52) %	19,95 %
	Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	05/02/2013	GBP	6,33 %	7,52 %	(5,51) %	20,31 %
	Clase Premier PLN de Capitalización (Cubierta)	08/10/2015	PLN	8,12 %	9,81 %	1,05 %	–
	Clase LM AUD de Distribución (M) (Cubierta)	03/12/2010	AUD	5,79 %	7,02 %	(5,51) %	34,93 %
	Clase LM GBP de Capitalización (Cubierta)	03/12/2010	GBP	6,77 %	7,94 %	(4,40) %	25,05 %
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Clase A USD de Capitalización	09/05/2007	USD	8,39 %	11,31 %	0,47 %	30,33 %
	Clase A USD de Distribución (D)	27/02/2004	USD	8,34 %	11,28 %	0,44 %	30,17 %
	Clase A USD de Distribución (M)	20/12/2010	USD	8,39 %	11,31 %	0,45 %	30,33 %
	Clase A USD de Distribución (M) Plus	21/11/2012	USD	8,40 %	11,32 %	0,46 %	30,35 %
	Clase A EUR de Distribución (M) (Cubierta)	19/12/2012	EUR	6,23 %	8,93 %	(4,73) %	10,23 %
	Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	31/01/2013	SGD	6,71 %	9,71 %	(1,22) %	25,29 %
	Clase C USD de Capitalización	15/11/2007	USD	7,85 %	10,76 %	(1,02) %	23,98 %
	Clase C USD de Distribución (D)	27/02/2004	USD	7,79 %	10,74 %	(1,05) %	23,73 %
	Clase E USD de Capitalización	21/01/2010	USD	7,73 %	10,64 %	(1,34) %	22,72 %
	Clase E USD de Distribución (D)	21/01/2010	USD	7,67 %	10,57 %	(1,39) %	22,45 %
	Clase E Euro de Capitalización (Cubierta)	25/09/2019	EUR	5,60 %	8,28 %	(6,38) %	–
	Clase F USD de Capitalización	04/01/2011	USD	8,82 %	11,76 %	1,92 %	37,91 %
	Clase F USD de Distribución (D)	04/01/2011	USD	8,76 %	11,71 %	1,96 %	37,38 %
	Clase Premier USD de Capitalización	08/11/2010	USD	9,09 %	12,04 %	2,69 %	41,32 %
	Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)	09/08/2019	GBP	8,42 %	11,31 %	1,06 %	–
	Clase S USD de Distribución (M)	09/03/2022	USD	9,39 %	12,32 %	–	–
	Clase S EUR de Distribución (M) (Cubierta)	09/03/2022	EUR	7,12 %	9,81 %	–	–
	Clase LM USD de Distribución (M)	27/05/2008	USD	9,60 %	12,54 %	4,11 %	47,87 %
	Clase LM GBP de Capitalización (Cubierta)	12/06/2020	GBP	8,92 %	11,72 %	2,15 %	–
	Clase A (G) USD de Capitalización	20/04/2007	USD	8,33 %	11,25 %	0,56 %	31,76 %
	Clase A (G) USD de Distribución (D)	20/04/2007	USD	8,29 %	11,24 %	0,55 %	31,57 %
	Clase L (G) USD de Capitalización	20/04/2007	USD	7,79 %	10,69 %	(0,94) %	25,34 %
	Clase L (G) USD de Distribución (D)	20/04/2007	USD	7,75 %	10,70 %	(0,94) %	25,15 %
	Clase GF USD de Capitalización	19/11/2010	USD	8,55 %	11,48 %	1,17 %	34,45 %
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Clase A USD de Capitalización	20/04/2007	USD	7,33 %	9,17 %	(6,38) %	17,78 %
	Clase A USD de Distribución (D)	20/04/2007	USD	7,29 %	9,16 %	(6,36) %	17,83 %
	Clase A USD de Distribución (M)	30/01/2008	USD	7,32 %	9,16 %	(6,39) %	17,69 %
	Clase A USD de Distribución (M) Plus	21/11/2012	USD	7,32 %	9,15 %	(6,39) %	17,70 %
	Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	28/06/2010	AUD	5,68 %	7,45 %	(9,33) %	16,88 %
	Clase A EUR de Capitalización	23/05/2017	EUR	5,04 %	5,86 %	3,57 %	–
	Clase A EUR de Distribución (D) (Cubierta)	25/09/2012	EUR	5,23 %	6,85 %	(11,26) %	(0,56) %
	Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	18/01/2011	SGD	5,67 %	7,49 %	(8,18) %	12,88 %

Información complementaria – Datos de rendimiento del fondo (sin auditar) *(continuación)*

Fondo	Clases de Acciones	Fecha de lanzamiento	Clase CCY	Año fiscal hasta la fecha 01/03/23-29/02/24	Calendario 01/01/23-31/12/23	3 años acumulativo 01/01/21-31/12/23	Rendimiento a 10 años 01/03/14-28/02/24
FTGF Western Asset Global High Yield Fund (continuación)	Clase B USD de Distribución (D)	20/04/2007	USD	7,03 %	8,90 %	(7,04) %	14,89 %
	Clase C USD de Capitalización	15/11/2007	USD	6,79 %	8,63 %	(7,76) %	12,03 %
	Clase C USD de Distribución (D)	20/04/2007	USD	6,74 %	8,60 %	(7,78) %	12,05 %
	Clase E USD de Capitalización	21/01/2010	USD	6,55 %	8,42 %	(8,18) %	10,65 %
	Clase E USD de Distribución (D)	21/01/2010	USD	6,52 %	8,41 %	(8,17) %	10,65 %
	Clase E EUR de Distribución (M) (Cubierta)	02/08/2013	EUR	4,43 %	6,06 %	(13,09) %	(6,60) %
	Clase F USD de Capitalización	04/01/2011	USD	7,62 %	9,50 %	(5,03) %	25,28 %
	Clase F USD de Distribución (D)	04/01/2011	USD	7,58 %	9,47 %	(5,07) %	25,12 %
	Clase X USD de Distribución (D)	21/03/2018	USD	7,69 %	9,59 %	(4,93) %	–
	Clase X GBP de Distribución (D) (Cubierta)	15/01/2013	GBP	7,11 %	8,85 %	(6,72) %	15,04 %
	Clase Premier Euro Capitalización (Cubierta)	12/10/2012	EUR	5,77 %	7,42 %	(9,38) %	8,37 %
	Clase Premier GBP de Distribución (D) (Cubierta)	12/08/2011	GBP	7,29 %	9,01 %	(6,09) %	18,09 %
	Clase S USD de Distribución (M)	09/03/2022	USD	8,29 %	10,14 %	–	–
	Clase S EUR de Distribución (M) (Cubierta)	09/03/2022	EUR	6,07 %	7,67 %	–	–
	Clase A (G) USD de Capitalización	20/04/2007	USD	7,03 %	8,90 %	(6,58) %	18,60 %
	Clase A (G) USD de Distribución (D)	20/04/2007	USD	6,99 %	8,89 %	(6,60) %	18,60 %
	Clase L (G) USD de Capitalización	20/04/2007	USD	6,50 %	8,35 %	(7,97) %	12,81 %
	Clase L (G) USD de Distribución (D)	20/04/2007	USD	6,47 %	8,34 %	(7,96) %	12,90 %
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Clase A USD de Capitalización	02/07/2008	USD	2,93 %	4,37 %	(9,26) %	13,49 %
	Clase A USD de Distribución (D)	02/07/2008	USD	2,96 %	4,41 %	(9,22) %	13,40 %
	Clase A USD de Distribución (M)	07/01/2010	USD	2,93 %	4,37 %	(9,26) %	13,49 %
	Clase A USD de Distribución (M) Plus	21/11/2012	USD	2,92 %	4,37 %	(9,26) %	13,47 %
	Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	28/09/2011	AUD	1,43 %	2,76 %	(11,68) %	13,80 %
	Clase A CHF de Capitalización (Cubierta)	26/01/2015	CHF	(1,18) %	0,23 %	(16,09) %	–
	Clase A CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus	20/06/2013	CNH	0,28 %	1,59 %	(9,45) %	29,42 %
	Clase A EUR de Capitalización	02/07/2008	EUR	0,74 %	1,20 %	0,45 %	44,97 %
	Clase A Euro de Capitalización (Cubierta)	19/05/2011	EUR	0,96 %	2,21 %	(13,82) %	(4,44) %
	Clase A EUR de Distribución (A)	01/04/2011	EUR	0,78 %	1,24 %	0,46 %	44,68 %
	Clase A HKD de Distribución (M) Plus	27/10/2015	HKD	2,67 %	4,39 %	(8,66) %	–
	Clase A SGD de Capitalización (Cubierta)	19/05/2009	SGD	1,30 %	2,89 %	(10,78) %	8,78 %
	Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	18/01/2011	SGD	1,24 %	2,74 %	(10,88) %	8,74 %
	Clase A SGD de Distribución (M) Plus	04/08/2010	SGD	2,62 %	2,70 %	(9,56) %	19,88 %
	Clase B USD de Capitalización	02/07/2008	USD	2,67 %	4,11 %	(9,93) %	10,68 %
	Clase C USD de Capitalización	02/07/2008	USD	2,41 %	3,85 %	(10,60) %	7,96 %
	Clase C USD de Distribución (D)	02/07/2008	USD	2,43 %	3,87 %	(10,59) %	7,86 %
	Clase E USD de Capitalización	21/01/2010	USD	2,31 %	3,74 %	(10,88) %	6,89 %
	Clase E USD de Distribución (D)	21/01/2010	USD	2,33 %	3,78 %	(10,85) %	6,78 %
	Clase F USD de Capitalización	04/02/2010	USD	3,35 %	4,79 %	(8,16) %	18,12 %
	Clase F USD de Distribución (D)	21/01/2010	USD	3,38 %	4,83 %	(8,11) %	18,16 %
	Clase X USD de Distribución (M)	07/05/2015	USD	3,45 %	4,88 %	(7,90) %	–
	Clase Premier USD de Capitalización	02/07/2008	USD	3,61 %	5,05 %	(7,48) %	21,11 %
	Clase Premier EUR de Capitalización	03/09/2010	EUR	1,35 %	1,86 %	2,39 %	54,40 %
	Clase Premier Euro Capitalización (Cubierta)	10/03/2011	EUR	1,59 %	2,85 %	(12,12) %	2,24 %
	Clase Premier EUR de Distribución (A)	09/01/2013	EUR	1,39 %	1,86 %	2,38 %	54,47 %
	Clase Premier EUR de Distribución (M)	08/09/2010	EUR	1,39 %	1,86 %	2,39 %	54,81 %
	Clase Premier GBP de Distribución (M)	16/07/2010	GBP	(1,31) %	(0,40) %	(0,66) %	61,16 %
	Clase LM USD de Capitalización	12/06/2008	USD	4,23 %	5,68 %	(5,80) %	28,60 %
	Clase LM USD de Distribución (M)	01/03/2022	USD	4,23 %	5,68 %	–	–
	Clase LM Euro de Distribución (M) (Cubierta)	27/07/2021	EUR	2,24 %	3,48 %	–	–
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Clase A USD de Capitalización	25/06/2009	USD	4,93 %	6,03 %	(2,58) %	9,33 %
	Clase A USD de Distribución (M)	02/06/2009	USD	4,93 %	6,03 %	(2,58) %	9,37 %
	Clase A Euro de Capitalización (Cubierta)	30/01/2014	EUR	2,91 %	3,84 %	(7,41) %	(7,47) %
	Clase A SEK de Capitalización (Cubierta)	23/06/2020	SEK	2,86 %	3,86 %	(6,66) %	–
	Clase A SEK de Distribución (M) (Cubierta)	23/06/2020	SEK	3,01 %	4,00 %	(5,95) %	–
	Clase C USD de Capitalización	25/06/2009	USD	4,42 %	5,51 %	(4,02) %	4,03 %
	Clase C USD de Distribución (M)	25/06/2009	USD	4,41 %	5,51 %	(4,03) %	4,02 %
	Clase E USD de Capitalización	21/01/2010	USD	4,30 %	5,40 %	(4,31) %	3,10 %
	Clase E USD de Distribución (D)	21/01/2010	USD	4,27 %	5,36 %	(4,35) %	2,96 %
	Clase F USD de Capitalización	04/02/2010	USD	5,36 %	6,46 %	(1,40) %	13,96 %
	Clase F USD de Distribución (D)	22/06/2020	USD	5,34 %	6,44 %	(1,42) %	–

Información complementaria – Datos de rendimiento del fondo (sin auditar) *(continuación)*

Fondo	Clases de Acciones	Fecha de lanzamiento	Clase CCY	Año fiscal hasta la fecha 01/03/23-29/02/24	Calendario 01/01/23-31/12/23	3 años acumulativo 01/01/21-31/12/23	Rendimiento a 10 años 01/03/14-28/02/24
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund (continuación)	Clase X Euro de Capitalización (Cubierta)	17/06/2020	EUR	3,51 %	4,41 %	(6,05) %	–
	Clase Premier USD de Capitalización	02/06/2009	USD	5,62 %	6,72 %	(0,67) %	16,94 %
	Clase Premier Euro Capitalización (Cubierta)	01/03/2019	EUR	3,60 %	4,49 %	(5,61) %	–
	Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)	02/06/2009	GBP	5,02 %	5,96 %	(2,27) %	8,68 %
	Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta)	02/06/2009	GBP	5,06 %	6,02 %	(2,27) %	8,90 %
	Clase S USD de Distribución (M) Plus (e)	15/12/2017	USD	5,72 %	6,83 %	(0,35) %	–
	Clase S Euro de Capitalización (Cubierta)	15/10/2021	EUR	3,74 %	4,62 %	–	–
	Clase S Euro de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	12/12/2017	EUR	3,77 %	4,67 %	(5,26) %	–
	Clase S GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	12/12/2017	GBP	5,15 %	6,10 %	(1,97) %	–
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	Clase A USD de Distribución (A)	05/03/2015	USD	4,81 %	7,58 %	(9,53) %	–
	Clase X USD de Capitalización	17/02/2015	USD	5,23 %	7,95 %	(8,93) %	–
	Clase Premier USD de Capitalización	03/12/2010	USD	5,38 %	8,11 %	(8,35) %	23,48 %
	Clase Premier Euro Capitalización (Cubierta)	27/06/2014	EUR	3,24 %	5,75 %	(13,11) %	–
	Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)	09/12/2021	GBP	4,89 %	7,50 %	–	–
	Clase S USD de Capitalización	09/03/2022	USD	5,52 %	8,27 %	–	–
	Clase S Euro de Capitalización (Cubierta)	09/03/2022	EUR	3,34 %	5,84 %	–	–
	Clase LM USD de Capitalización	28/03/2019	USD	5,77 %	8,53 %	(7,25) %	–
	Clase LM CAD de Capitalización (Cubierta)	17/10/2018	CAD	5,00 %	7,79 %	(8,26) %	–
FTGF Western Asset Global Credit Fund^	Clase A USD de Capitalización	15/11/2011	USD	4,16 %	6,62 %	(12,45) %	17,84 %
	Clase A Euro de Capitalización (Cubierta)	15/11/2011	EUR	2,08 %	4,30 %	(16,99) %	(0,62) %
	Clase Premier Euro Capitalización (Cubierta)	03/11/2021	EUR	2,76 %	4,99 %	–	–
	Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)	03/11/2021	GBP	4,17 %	6,49 %	–	–
	Clase LM USD de Capitalización	27/01/2011	USD	5,19 %	7,69 %	(9,62) %	32,24 %
	Clase LM Euro de Capitalización (Cubierta)	15/01/2021	EUR	3,10 %	5,35 %	–	–
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^	Clase A USD de Capitalización	29/11/2013	USD	7,17 %	13,11 %	(12,90) %	24,60 %
	Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	01/08/2014	USD	7,16 %	13,10 %	(12,90) %	–
	Clase A USD de Distribución (S)	08/04/2014	USD	7,16 %	13,11 %	(12,90) %	–
	Clase A AUD de Capitalización (Cubierta)	16/10/2017	AUD	4,98 %	10,73 %	(16,14) %	–
	Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	27/02/2015	AUD	4,99 %	10,73 %	(16,17) %	–
	Clase A CHF de Capitalización (Cubierta)	14/02/2014	CHF	2,40 %	8,11 %	(20,10) %	(1,95) %
	Clase A CNH de Capitalización (Cubierta)	19/09/2014	CNH	4,27 %	9,93 %	(13,20) %	–
	Clase A CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	03/12/2014	CNH	4,24 %	9,90 %	(13,25) %	–
	Clase A Euro de Capitalización (Cubierta)	14/02/2014	EUR	4,75 %	10,33 %	(17,93) %	4,37 %
	Clase A EUR de Distribución (A)	07/04/2015	EUR	4,85 %	9,67 %	(3,63) %	–
	Clase A Euro de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	15/03/2019	EUR	4,74 %	10,33 %	(17,95) %	–
	Clase A EUR de Distribución (S) (Cubierta)	07/04/2016	EUR	4,74 %	10,33 %	(17,93) %	–
	Clase A GBP de Capitalización	23/12/2014	GBP	2,11 %	7,28 %	(6,51) %	–
	Clase A GBP de Capitalización (Cubierta)	14/02/2014	GBP	6,17 %	11,91 %	(15,03) %	12,68 %
	Clase A GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	18/08/2016	GBP	6,19 %	11,92 %	(15,07) %	–
	Clase A SEK de Capitalización (Cubierta)	15/05/2015	SEK	4,39 %	10,09 %	(17,77) %	–
	Clase A SGD de Capitalización (Cubierta)	10/03/2014	SGD	5,11 %	11,14 %	(14,76) %	–
	Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	03/12/2014	SGD	5,26 %	11,19 %	(14,79) %	–
	Clase A SGD de Distribución (M) Plus (e)	09/02/2022	SGD	6,88 %	11,44 %	–	–
	Clase C USD de Capitalización	05/05/2014	USD	6,62 %	12,54 %	(14,20) %	–
	Clase C USD de Distribución (S)	15/07/2014	USD	6,62 %	12,54 %	(14,20) %	–
	Clase A JPY de Distribución (M) Plus (e)	17/12/2019	JPY	17,93 %	21,52 %	18,95 %	–
	Clase A NOK de Capitalización (Cubierta)	21/09/2017	NOK	4,55 %	10,26 %	(16,32) %	–

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

Información complementaria – Datos de rendimiento del fondo (sin auditar) *(continuación)*

Fondo	Clases de Acciones	Fecha de lanzamiento	Clase CCY	Año fiscal hasta la fecha 01/03/23-29/02/24	Calendario 01/01/23-31/12/23	3 años acumulativo 01/01/21-31/12/23	Rendimiento a 10 años 01/03/14-28/02/24
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ (continuación)	Clase E USD de Capitalización	13/05/2014	USD	6,52 %	12,43 %	(14,45) %	–
	Clase E USD de Distribución (S)	28/07/2014	USD	6,51 %	12,43 %	(14,45) %	–
	Clase E Euro de Capitalización (Cubierta)	25/08/2014	EUR	4,11 %	9,66 %	(19,40) %	–
	Clase F USD de Capitalización	18/06/2014	USD	7,59 %	13,56 %	(11,85) %	–
	Clase F USD de Distribución (S)	16/10/2014	USD	7,59 %	13,56 %	(11,85) %	–
	Clase X USD de Capitalización	05/03/2014	USD	7,70 %	13,67 %	(11,59) %	–
	Clase X USD de Distribución (M) Plus (e)	26/10/2015	USD	7,70 %	13,66 %	(11,59) %	–
	Clase X USD de Distribución (S)	03/02/2015	USD	7,69 %	13,66 %	(11,59) %	–
	Clase X CHF de Capitalización (Cubierta)	05/03/2014	CHF	2,92 %	8,64 %	(18,87) %	–
	Clase X EUR de Capitalización	29/07/2014	EUR	5,38 %	10,21 %	(2,02) %	–
	Clase X Euro de Capitalización (Cubierta)	14/02/2014	EUR	5,26 %	10,88 %	(16,75) %	9,76 %
	Clase X EUR de Distribución (A) (Cubierta)	11/08/2016	EUR	5,24 %	10,86 %	(16,69) %	–
	Clase X EUR de Distribución (M) (Cubierta)	17/05/2016	EUR	5,26 %	10,89 %	(16,68) %	–
	Clase X GBP de Capitalización	23/12/2014	GBP	2,61 %	7,80 %	(5,17) %	–
	Clase X GBP de Capitalización (Cubierta)	14/02/2014	GBP	6,70 %	12,46 %	(13,77) %	19,44 %
	Clase X GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	20/10/2015	GBP	6,72 %	12,49 %	(13,76) %	–
	Clase X SGD de Capitalización (Cubierta)	10/03/2014	SGD	5,65 %	11,69 %	(13,54) %	–
	Clase Premier USD de Capitalización	29/11/2013	USD	7,86 %	13,86 %	(11,18) %	32,99 %
	Clase Premier USD de Distribución (S)	10/02/2015	USD	7,86 %	13,84 %	(11,20) %	–
	Clase Premier AUD de Capitalización (Cubierta)	03/07/2017	AUD	5,65 %	11,45 %	(14,51) %	–
	Clase Premier AUD de Distribución (S) (Cubierta)	24/07/2015	AUD	5,63 %	11,42 %	(14,57) %	–
	Clase Premier BRL de Capitalización (Cubierta)	22/12/2015	BRL	12,87 %	19,86 %	3,98 %	–
	Clase Premier CHF de Capitalización (Cubierta)	04/12/2014	CHF	3,07 %	8,82 %	(18,55) %	–
	Clase Premier CHF de Distribución (S) (Cubierta)	27/11/2015	CHF	3,07 %	8,82 %	(18,53) %	–
	Clase Premier EUR de Capitalización	03/07/2014	EUR	5,64 %	10,49 %	(1,61) %	–
	Clase Premier Euro Capitalización (Cubierta)	26/03/2014	EUR	5,42 %	11,04 %	(16,31) %	–
	Clase Premier EUR de Distribución (S) (Cubierta)	27/11/2015	EUR	5,41 %	11,06 %	(16,34) %	–
	Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)	01/12/2014	GBP	6,86 %	12,63 %	(13,39) %	–
	Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	21/05/2014	GBP	6,89 %	12,65 %	(13,40) %	–
	Clase Premier JPY de Capitalización (Cubierta)	01/12/2016	JPY	1,39 %	7,18 %	(18,84) %	–
	Clase Premier PLN de Capitalización (Cubierta)	21/07/2017	PLN	8,48 %	14,85 %	(7,57) %	–
	Clase Premier SEK de Capitalización (Cubierta)	15/05/2015	SEK	5,08 %	10,83 %	(16,14) %	–
	Clase S USD de Capitalización	29/11/2013	USD	8,30 %	14,30 %	(10,11) %	38,41 %
	Clase S Euro de Capitalización (Cubierta)	29/11/2013	EUR	5,83 %	11,46 %	(15,32) %	16,03 %
	Clase LM AUD de Distribución (S) (Cubierta)	09/08/2016	AUD	6,69 %	12,54 %	(11,96) %	–
	Clase LM EUR de Capitalización	05/04/2016	EUR	6,61 %	11,49 %	1,28 %	–
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	Clase A USD de Capitalización	11/08/2016	USD	6,31 %	8,70 %	(4,22) %	–
	Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	16/12/2015	USD	6,31 %	8,69 %	(4,07) %	–
	Clase A Euro de Capitalización (Cubierta)	23/01/2017	EUR	4,17 %	6,31 %	(9,20) %	–
	Clase C USD de Capitalización	09/08/2016	USD	6,19 %	8,56 %	(4,56) %	–
	Clase X CHF de Distribución (M) (Cubierta)	22/02/2017	CHF	2,63 %	4,93 %	(9,87) %	–
	Clase S USD de Capitalización	15/01/2021	USD	7,38 %	9,79 %	–	–
	Clase S Euro de Capitalización (Cubierta)	18/11/2019	EUR	5,23 %	7,40 %	(6,38) %	–
	Clase S GBP de Capitalización (Cubierta)	20/11/2019	GBP	6,69 %	8,95 %	(3,09) %	–
	Clase LM Euro de Capitalización (Cubierta)	25/07/2019	EUR	5,67 %	7,84 %	(5,30) %	–
	Clase LM GBP de Capitalización (Cubierta)	16/12/2015	GBP	7,12 %	9,37 %	(1,93) %	–
	Clase LM CAD de Capitalización (Cubierta)	28/02/2022	CAD	7,03 %	9,42 %	–	–
	Clase S CHF de Distribución (A)	26/11/2021	CHF	0,84 %	(0,14) %	–	–
	Clase S CHF de Distribución (A) (Cubierta)	25/07/2022	CHF	2,95 %	5,26 %	–	–

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

Información complementaria – Datos de rendimiento del fondo (sin auditar) *(continuación)*

Fondo	Clases de Acciones	Fecha de lanzamiento	Clase CCY	Año fiscal hasta la fecha 01/03/23-29/02/24	Calendario 01/01/23-31/12/23	3 años acumulativo 01/01/21-31/12/23	Rendimiento a 10 años 01/03/14-28/02/24
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^	Clase D Euro de Capitalización (Cubierta)	23/05/2018	EUR	3,97 %	4,37 %	(4,76) %	–
	Clase D USD de Capitalización	24/01/2018	USD	5,90 %	6,41 %	(0,07) %	–
	Clase D USD de Distribución (M)	14/02/2018	USD	5,88 %	6,40 %	(0,09) %	–
	Clase D USD de Distribución (M) Plus	30/05/2018	USD	5,88 %	6,40 %	(0,08) %	–
	Clase M CHF de Capitalización (Cubierta)	30/05/2018	CHF	2,37 %	2,81 %	(5,67) %	–
	Clase M USD de Distribución (M)	28/11/2018	USD	6,54 %	7,04 %	1,73 %	–
	Clase M Euro de Capitalización (Cubierta)	31/01/2018	EUR	4,59 %	4,95 %	(3,06) %	–
	Clase Premier USD de Capitalización	04/05/2016	USD	6,69 %	7,20 %	2,18 %	–
	Clase Premier USD de Distribución (Q)	13/12/2017	USD	6,68 %	7,19 %	2,18 %	–
	Clase Premier Euro Capitalización (Cubierta)	04/05/2016	EUR	4,72 %	5,06 %	(2,74) %	–
	Clase Premier EUR de Distribución (Q) (Cubierta)	27/12/2017	EUR	4,70 %	5,03 %	(2,69) %	–
	Clase LM USD de Capitalización	13/01/2016	USD	7,33 %	7,84 %	4,04 %	–
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	13/01/2016	USD	1,25 %	3,54 %	(11,92) %	–
	Clase Premier USD de Capitalización	15/06/2022	USD	2,13 %	4,45 %	–	–
	Clase LM USD de Capitalización	13/01/2016	USD	2,45 %	4,76 %	(8,81) %	–
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^	Clase LM USD de Distribución (Q)	11/01/2021	USD	3,37 %	7,54 %	–	–
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	Clase A USD de Capitalización	09/05/2007	USD	0,38 %	4,03 %	(19,98) %	(14,85) %
	Clase A USD de Distribución (M)	06/12/2010	USD	0,37 %	4,04 %	(19,98) %	(14,87) %
	Clase A USD de Distribución (S)	01/10/2003	USD	0,39 %	4,04 %	(19,97) %	(14,85) %
	Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	28/07/2014	AUD	(1,50) %	2,03 %	(23,25) %	–
	Clase A Euro de Capitalización (Cubierta)	19/02/2013	EUR	(1,96) %	1,46 %	(24,94) %	(30,14) %
	Clase A Euro de Capitalización (Cubierta) (IH)	18/01/2008	EUR	0,01 %	2,88 %	(14,43) %	(6,19) %
	Clase A EUR de Distribución (A) (Cubierta)	07/06/2013	EUR	(1,91) %	1,47 %	(24,99) %	(30,16) %
	Clase A EUR de Distribución (S)	14/10/2016	EUR	(1,80) %	0,84 %	(11,50) %	–
	Clase A GBP de Capitalización	22/06/2018	GBP	(4,34) %	(1,32) %	(14,14) %	–
	Clase A GBP de Distribución (M) (Cubierta)	14/11/2014	GBP	(0,49) %	2,99 %	(22,43) %	–
	Clase A GBP de Distribución (S) (Cubierta) (IH)	07/02/2008	GBP	1,30 %	4,27 %	(11,44) %	1,44 %
	Clase A SGD de Capitalización	08/06/2015	SGD	0,12 %	2,37 %	(20,39) %	–
	Clase B USD de Capitalización	15/11/2007	USD	0,14 %	3,79 %	(20,56) %	(16,94) %
	Clase B USD de Distribución (S)	24/02/2004	USD	0,12 %	3,77 %	(20,58) %	(16,99) %
	Clase C USD de Capitalización	15/11/2007	USD	(0,13) %	3,52 %	(21,17) %	(19,01) %
	Clase C USD de Distribución (S)	24/02/2004	USD	(0,13) %	3,52 %	(21,17) %	(19,01) %
	Clase E USD de Capitalización	08/09/2011	USD	(0,22) %	3,42 %	(21,40) %	(19,82) %
	Clase E Euro de Capitalización (Cubierta) (IH)	13/07/2012	EUR	(0,59) %	2,26 %	(15,96) %	(11,55) %
	Clase F USD de Capitalización	14/09/2012	USD	0,78 %	4,46 %	(19,00) %	(11,39) %
	Clase F USD de Distribución (S)	04/10/2012	USD	0,77 %	4,46 %	(19,00) %	(11,38) %
	Clase R GBP de Distribución (S) (Cubierta) (IH)	02/05/2013	GBP	1,70 %	4,67 %	(10,32) %	5,73 %
	Clase X USD de Capitalización	04/06/2013	USD	0,89 %	4,56 %	(18,77) %	(10,48) %
	Clase X USD de Distribución (S)	26/03/2013	USD	0,88 %	4,56 %	(18,77) %	(10,50) %
	Clase X Euro de Capitalización (Cubierta)	28/06/2013	EUR	(1,42) %	1,97 %	(23,80) %	(26,57) %
	Clase X Euro de Capitalización (Cubierta) (IH)	19/08/2015	EUR	0,48 %	3,36 %	(13,17) %	–
	Clase X GBP de Capitalización	23/12/2014	GBP	(3,89) %	(0,86) %	(12,96) %	–
	Clase X GBP de Capitalización (Cubierta)	10/10/2014	GBP	(0,12) %	3,38 %	(21,46) %	–
	Clase X GBP de Capitalización (Cubierta) (IH)	19/08/2015	GBP	1,85 %	4,84 %	(10,16) %	–
	Clase X GBP de Distribución (S) (Cubierta)	25/02/2013	GBP	(0,09) %	3,46 %	(21,35) %	(20,16) %
	Clase X GBP de Distribución (S) (Cubierta) (IH)	15/07/2014	GBP	1,82 %	4,81 %	(10,08) %	–
	Clase Premier USD de Capitalización	24/03/2011	USD	1,04 %	4,71 %	(18,40) %	(9,14) %
	Clase Premier USD de Distribución (S)	24/02/2012	USD	1,03 %	4,70 %	(18,41) %	(9,13) %
	Clase Premier EUR de Capitalización	25/01/2011	EUR	(1,14) %	1,52 %	(9,73) %	15,25 %
	Clase Premier Euro Capitalización (Cubierta)	30/01/2013	EUR	(1,32) %	2,13 %	(23,45) %	(25,57) %
	Clase Premier Euro de Capitalización (Cubierta) (IH)	04/11/2011	EUR	0,70 %	3,58 %	(12,73) %	0,24 %
	Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)	15/09/2021	GBP	0,01 %	3,57 %	–	–

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

Información complementaria – Datos de rendimiento del fondo (sin auditar) *(continuación)*

Fondo	Clases de Acciones	Fecha de lanzamiento	Clase CCY	Año fiscal hasta la fecha 01/03/23-29/02/24	Calendario 01/01/23-31/12/23	3 años acumulativo 01/01/21-31/12/23	Rendimiento a 10 años 01/03/14-28/02/24
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund (continuación)	Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta)	10/10/2014	GBP	0,08 %	3,56 %	(20,98) %	–
	Clase Premier GBP de Distribución (S) (Cubierta) (IH)	14/08/2012	GBP	1,96 %	4,94 %	(9,70) %	8,12 %
	Clase LM USD de Capitalización	28/03/2019	USD	1,64 %	5,35 %	(16,92) %	–
	Clase LM USD de Capitalización (Cubierta) (IH)	25/11/2015	USD	3,44 %	6,57 %	(6,18) %	–
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	Clase A USD de Capitalización	03/04/2012	USD	1,71 %	2,37 %	(4,03) %	8,75 %
	Clase A USD de Distribución (A)	17/09/2013	USD	1,72 %	2,38 %	(4,03) %	8,82 %
	Clase A Euro de Capitalización (Cubierta)	18/06/2013	EUR	(0,53) %	(0,11) %	(9,38) %	(8,73) %
	Clase A SGD de Capitalización	17/05/2022	SGD	1,34 %	0,82 %	–	–
	Clase C USD de Capitalización	17/07/2013	USD	1,21 %	1,87 %	(5,45) %	3,42 %
	Clase E USD de Distribución (A)	27/08/2013	USD	1,10 %	1,77 %	(5,70) %	2,42 %
	Clase F USD de Capitalización	29/07/2014	USD	2,11 %	2,78 %	(2,88) %	–
	Clase X USD de Capitalización	16/03/2018	USD	2,19 %	2,83 %	(2,73) %	–
	Clase X GBP de Capitalización (Cubierta)	16/06/2014	GBP	1,32 %	1,78 %	(4,87) %	–
	Clase X GBP de Distribución (M) (Cubierta)	21/01/2014	GBP	1,26 %	1,72 %	(4,93) %	4,08 %
	Clase Premier USD de Capitalización	25/03/2013	USD	2,33 %	2,99 %	(2,28) %	15,45 %
	Clase Premier Euro Capitalización (Cubierta)	02/07/2012	EUR	0,02 %	0,47 %	(7,71) %	(2,93) %
	Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta)	25/03/2013	GBP	1,40 %	1,92 %	(4,44) %	5,64 %
	Clase LM USD de Capitalización	12/06/2014	USD	3,26 %	3,92 %	0,38 %	–
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^	Clase A USD de Capitalización	14/10/2016	USD	12,46 %	13,99 %	1,42 %	–
	Clase A USD de Distribución (D)	18/07/2016	USD	12,56 %	14,09 %	1,51 %	–
	Clase Premier USD de Capitalización	30/11/2012	USD	13,22 %	14,75 %	3,61 %	43,80 %
	Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta) (IH)	30/11/2012	GBP	12,37 %	13,58 %	4,59 %	42,04 %
	Clase S CAD de Capitalización (Cubierta) (IH)	23/02/2016	CAD	12,50 %	13,89 %	5,74 %	–
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	Clase A USD de Capitalización	06/05/2011	USD	2,20 %	6,47 %	(17,83) %	(4,90) %
	Clase A USD de Distribución (M)	25/06/2010	USD	2,19 %	6,46 %	(17,83) %	(4,92) %
	Clase A Euro de Capitalización (Cubierta)	04/04/2018	EUR	0,08 %	3,97 %	(22,69) %	–
	Clase A SGD de Capitalización	17/04/2020	SGD	1,61 %	4,59 %	(18,50) %	–
	Clase C USD de Capitalización	21/03/2012	USD	1,69 %	5,93 %	(19,05) %	(9,55) %
	Clase E USD de Capitalización	17/02/2012	USD	1,58 %	5,83 %	(19,30) %	(10,46) %
	Clase F USD de Capitalización	22/07/2014	USD	2,61 %	6,89 %	(16,84) %	–
	Clase F USD de Distribución (M)	19/07/2013	USD	2,59 %	6,89 %	(16,84) %	(1,09) %
	Clase X GBP de Distribución (M) (Cubierta)	10/10/2014	GBP	1,50 %	5,58 %	(19,55) %	–
	Clase X GBP de Distribución (M) (Cubierta) (IH)	27/05/2020	GBP	3,59 %	7,20 %	(7,83) %	–
	Clase Premier USD de Capitalización	06/01/2012	USD	2,87 %	7,16 %	(16,21) %	1,45 %
	Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta) (IH)	24/06/2016	GBP	3,77 %	7,38 %	(7,41) %	–
	Clase Premier NZD de Capitalización (Cubierta) (IH)	19/09/2012	NZD	3,95 %	7,56 %	(6,73) %	36,83 %
	Clase LM EUR de Capitalización	05/04/2016	EUR	1,27 %	4,53 %	(5,52) %	–
	Clase LM NZD de Capitalización (Cubierta) (IH)	13/01/2012	NZD	4,58 %	8,21 %	(5,00) %	45,81 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	Clase A USD de Capitalización	30/08/2013	USD	5,82 %	7,22 %	(8,20) %	28,86 %
	Clase A USD de Distribución (A)	26/08/2020	USD	5,83 %	7,21 %	(8,21) %	–
	Clase A USD de Distribución (D)	28/08/2020	USD	5,80 %	7,22 %	(8,16) %	–
	Clase A USD de Distribución (M) Plus	15/01/2021	USD	5,82 %	7,22 %	–	–
	Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	03/06/2013	USD	5,82 %	7,22 %	(8,21) %	28,79 %
	Clase A AUD de Capitalización (Cubierta)	23/06/2021	AUD	4,22 %	5,42 %	–	–
	Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	30/08/2021	AUD	4,28 %	5,42 %	–	–
	Clase A CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus	15/04/2021	CNH	3,05 %	4,30 %	–	–
	Clase A EUR de Capitalización	25/11/2020	EUR	3,60 %	4,01 %	1,76 %	–
	Clase A Euro de Capitalización (Cubierta)	22/08/2016	EUR	3,66 %	4,75 %	(13,37) %	–
	Clase A EUR de Distribución (A) (Cubierta)	19/05/2015	EUR	3,66 %	4,76 %	(13,42) %	–
	Clase A Euro de Distribución (M) (Cubierta) Plus	30/08/2021	EUR	3,64 %	4,78 %	–	–
	Clase A Euro de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	21/10/2013	EUR	3,64 %	4,79 %	(13,37) %	7,95 %

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

Información complementaria – Datos de rendimiento del fondo (sin auditar) *(continuación)*

Fondo	Clases de Acciones	Fecha de lanzamiento	Clase CCY	Año fiscal hasta la fecha 01/03/23-29/02/24	Calendario 01/01/23-31/12/23	3 años acumulativo 01/01/21-31/12/23	Rendimiento a 10 años 01/03/14-28/02/24
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund (continuación)	Clase A GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus	30/08/2021	GBP	5,08 %	6,34 %	–	–
	Clase A GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	24/10/2013	GBP	5,10 %	6,36 %	(10,39) %	18,22 %
	Clase A HKD de Capitalización	30/08/2021	HKD	5,54 %	7,24 %	–	–
	Clase A HKD de Distribución (M) Plus	09/04/2021	HKD	5,54 %	7,24 %	–	–
	Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	21/10/2015	SGD	4,07 %	5,60 %	(9,98) %	–
	Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	17/02/2021	SGD	4,12 %	5,54 %	–	–
	Clase A SGD de Distribución (M) Plus	29/01/2021	SGD	5,64 %	5,54 %	–	–
	Clase C USD de Capitalización	23/09/2020	USD	5,29 %	6,69 %	(9,57) %	–
	Clase C USD de Distribución (D)	24/11/2020	USD	5,28 %	6,68 %	(9,52) %	–
	Clase A CZK de Capitalización (Cubierta)	20/05/2022	CZK	7,02 %	8,45 %	–	–
	Clase E USD de Capitalización	21/04/2020	USD	5,19 %	6,58 %	(9,84) %	–
	Clase E USD de Distribución (D)	22/01/2021	USD	5,17 %	6,59 %	–	–
	Clase E Euro de Capitalización (Cubierta)	03/04/2017	EUR	3,02 %	4,11 %	(14,95) %	–
	Clase F USD de Capitalización	22/10/2020	USD	6,30 %	7,69 %	(6,96) %	–
	Clase F USD de Distribución (D)	24/07/2019	USD	6,27 %	7,70 %	(6,90) %	–
	Clase X USD de Capitalización	25/09/2020	USD	6,51 %	7,91 %	(6,58) %	–
	Clase X USD de Distribución (D)	18/07/2017	USD	6,72 %	8,09 %	(6,74) %	–
	Clase X USD de Distribución (M) Plus (e)	21/01/2014	USD	6,52 %	7,92 %	(6,58) %	36,55 %
	Clase X EUR de Capitalización	17/02/2021	EUR	4,19 %	4,63 %	–	–
	Clase X Euro de Capitalización (Cubierta)	16/02/2021	EUR	4,34 %	5,42 %	–	–
	Clase X Euro de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	23/12/2013	EUR	4,31 %	5,45 %	(11,86) %	14,29 %
	Clase X GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	20/12/2013	GBP	5,79 %	7,07 %	(8,79) %	25,16 %
	Clase Premier USD de Capitalización	09/10/2020	USD	6,67 %	8,07 %	(6,16) %	–
	Clase Premier USD de Distribución (M) Plus (e)	03/06/2013	USD	6,67 %	8,09 %	(6,16) %	38,58 %
	Clase Premier BRL de Capitalización (Cubierta)	10/09/2021	BRL	12,01 %	14,11 %	–	–
	Clase Premier Euro Capitalización (Cubierta)	07/10/2014	EUR	4,50 %	5,59 %	(11,43) %	–
	Clase Premier Euro de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	13/12/2013	EUR	4,45 %	5,58 %	(11,44) %	16,06 %
	Clase Premier GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	23/10/2014	GBP	5,94 %	7,18 %	(8,35) %	–
	Clase Premier SEK de Capitalización (Cubierta)	22/10/2014	SEK	4,45 %	5,63 %	(11,14) %	–
	Clase S USD de Capitalización	06/07/2020	USD	6,78 %	8,18 %	(5,71) %	–
	Clase S USD de Distribución (Q) Plus (e)	14/09/2021	USD	6,77 %	8,18 %	–	–
	Clase S Euro de Capitalización (Cubierta)	10/04/2018	EUR	4,59 %	5,68 %	(11,04) %	–
	Clase S Euro de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	18/09/2018	EUR	4,59 %	5,74 %	(11,00) %	–
	Clase S GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	01/02/2018	GBP	6,06 %	7,29 %	(8,01) %	–
	Clase LM USD de Capitalización	06/07/2022	USD	7,16 %	8,56 %	–	–
	Clase LM USD de Distribución (M)	30/09/2021	USD	7,16 %	8,55 %	–	–
	Clase LM EUR de Distribución (Q) (Cubierta) Plus (e)	11/08/2021	EUR	4,98 %	6,08 %	–	–
	Clase LM GBP de Capitalización (Cubierta)	08/10/2020	GBP	6,46 %	7,71 %	(6,97) %	–
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	Clase A USD de Capitalización	30/06/2014	USD	0,95 %	(1,68) %	0,91 %	–
	Clase X USD de Distribución (M)	30/04/2021	USD	1,52 %	(1,12) %	–	–
	Clase Premier USD de Capitalización	30/06/2014	USD	1,61 %	(1,05) %	2,89 %	–
	Clase LM USD de Capitalización	30/06/2014	USD	2,79 %	0,09 %	6,50 %	–
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^	Clase A USD de Capitalización	16/08/2018	USD	5,89 %	9,71 %	(11,72) %	–
	Clase A SGD de Capitalización (Cubierta)	16/09/2019	SGD	3,94 %	7,83 %	(14,13) %	–
	Clase X GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	16/08/2018	GBP	5,77 %	9,40 %	(12,72) %	–
	Clase LM AUD de Capitalización (Cubierta)	16/08/2018	AUD	5,95 %	9,65 %	(10,52) %	–
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^	Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	01/12/2022	USD	5,95 %	7,59 %	–	–
	Clase S USD de Capitalización	01/12/2022	USD	6,96 %	8,60 %	–	–
	Clase S Euro de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	01/12/2022	EUR	4,93 %	6,26 %	–	–
	Clase S GBP de Capitalización (Cubierta)	17/01/2023	GBP	6,21 %	–	–	–

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

Información complementaria – Datos de rendimiento del fondo (sin auditar) *(continuación)*

Fondo	Clases de Acciones	Fecha de lanzamiento	Clase CCY	Año fiscal hasta la fecha 01/03/23-29/02/24	Calendario 01/01/23-31/12/23	3 años acumulativo 01/01/21-31/12/23	Rendimiento a 10 años 01/03/14-28/02/24
FTGF ClearBridge Value Fund	Clase A USD de Capitalización	24/04/2007	USD	14,08 %	16,72 %	35,15 %	116,47 %
	Clase A USD de Distribución (A)	23/03/1998	USD	14,09 %	16,71 %	35,14 %	116,47 %
	Clase A EUR de Capitalización	12/06/2007	EUR	11,68 %	13,20 %	49,42 %	175,52 %
	Clase A Euro de Capitalización (Cubierta)	02/09/2022	EUR	11,61 %	13,94 %	–	–
	Clase A EUR de Distribución (A) (Cubierta)	02/09/2014	EUR	11,67 %	13,98 %	25,89 %	–
	Clase A GBP de Distribución (A)	28/08/2014	GBP	8,71 %	10,70 %	44,41 %	–
	Clase A SGD de Capitalización	18/05/2007	SGD	13,86 %	15,00 %	34,80 %	129,25 %
	Clase A SGD de Capitalización (Cubierta)	10/09/2012	SGD	12,14 %	14,90 %	31,41 %	103,19 %
	Clase C USD de Capitalización	15/11/2007	USD	13,52 %	16,14 %	33,13 %	105,92 %
	Clase C USD de Distribución (A)	24/02/2004	USD	13,52 %	16,13 %	33,14 %	105,92 %
	Clase E USD de Capitalización	26/03/2021	USD	13,23 %	15,85 %	–	–
	Clase F USD de Capitalización	21/01/2010	USD	14,78 %	17,41 %	37,59 %	130,94 %
	Clase F USD de Distribución (A)	19/10/2016	USD	14,78 %	17,40 %	37,58 %	–
	Clase X USD de Capitalización	08/03/2022	USD	14,85 %	17,49 %	–	–
	Clase X USD de Distribución (A)	07/10/2013	USD	14,86 %	17,50 %	37,91 %	131,71 %
	Clase X EUR de Capitalización	22/02/2021	EUR	12,35 %	13,89 %	–	–
	Clase Premier USD de Capitalización	01/07/2008	USD	15,26 %	17,91 %	39,36 %	139,83 %
	Clase Premier USD de Distribución (A)	25/04/2014	USD	15,26 %	17,91 %	39,35 %	–
	Clase Premier EUR de Capitalización	30/06/2014	EUR	12,77 %	14,30 %	54,17 %	–
	Clase Premier Euro Capitalización (Cubierta)	08/04/2021	EUR	12,90 %	15,25 %	–	–
	Clase LM USD de Distribución (A)	21/07/2021	USD	16,05 %	18,71 %	–	–
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	Clase A USD de Capitalización	20/04/2007	USD	28,56 %	18,91 %	21,57 %	153,17 %
	Clase A USD de Distribución (A)	20/04/2007	USD	28,56 %	18,91 %	21,57 %	153,19 %
	Clase A EUR de Capitalización	03/06/2008	EUR	25,81 %	15,28 %	34,53 %	223,35 %
	Clase B USD de Capitalización	15/11/2007	USD	27,92 %	18,32 %	19,77 %	140,94 %
	Clase C USD de Capitalización	15/11/2007	USD	27,91 %	18,32 %	19,77 %	140,81 %
	Clase C USD de Distribución (A)	20/04/2007	USD	27,92 %	18,31 %	19,77 %	140,81 %
	Clase E USD de Capitalización	21/01/2010	USD	27,59 %	18,01 %	18,87 %	134,83 %
	Clase E USD de Distribución (A)	21/01/2010	USD	27,58 %	18,01 %	18,84 %	134,78 %
	Clase F USD de Capitalización	17/09/2012	USD	29,32 %	19,60 %	23,74 %	168,69 %
	Clase F USD de Distribución (A)	04/02/2010	USD	29,32 %	19,60 %	23,74 %	168,68 %
	Clase X USD de Distribución (A)	07/10/2013	USD	29,36 %	19,63 %	23,84 %	169,35 %
	Clase X EUR de Capitalización	07/10/2013	EUR	26,59 %	16,00 %	37,05 %	244,71 %
	Clase Premier USD de Capitalización	06/05/2010	USD	29,81 %	20,05 %	25,14 %	179,00 %
	Clase Premier USD de Distribución (A)	09/04/2009	USD	29,81 %	20,05 %	25,14 %	178,94 %
	Clase Premier EUR de Capitalización	07/06/2010	EUR	27,09 %	16,48 %	38,67 %	256,57 %
	Clase LM USD de Capitalización	05/04/2016	USD	30,62 %	20,80 %	27,50 %	–
	Clase LM EUR de Capitalización	05/04/2016	EUR	27,80 %	17,10 %	41,08 %	–
	Clase A (G) USD de Capitalización	20/04/2007	USD	29,00 %	19,31 %	22,82 %	162,07 %
	Clase B (G) USD de Capitalización	20/04/2007	USD	28,33 %	18,68 %	20,85 %	148,76 %
	Clase L (G) USD de Capitalización	20/04/2007	USD	28,36 %	18,71 %	21,00 %	149,29 %
	Clase GA USD de Capitalización	10/06/2011	USD	28,78 %	19,10 %	22,20 %	157,64 %
	Clase GA EUR de Capitalización	10/06/2011	EUR	26,05 %	15,51 %	35,25 %	229,35 %
	Clase GA EUR de Distribución (A)	10/06/2011	EUR	26,03 %	15,49 %	35,25 %	229,07 %
	Clase GE USD de Capitalización	10/06/2011	USD	27,82 %	18,22 %	19,48 %	139,04 %
	Clase GE EUR de Capitalización	10/06/2011	EUR	25,11 %	14,66 %	32,23 %	205,94 %
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	Clase A USD de Capitalización	20/04/2007	USD	46,86 %	42,52 %	15,54 %	239,87 %
	Clase A USD de Distribución (A)	20/04/2007	USD	46,86 %	42,52 %	15,54 %	239,92 %
	Clase A EUR de Capitalización	27/08/2008	EUR	43,71 %	38,19 %	27,83 %	332,88 %
	Clase A Euro de Capitalización (Cubierta)	05/02/2016	EUR	43,98 %	39,42 %	7,95 %	–
	Clase B USD de Capitalización	15/11/2007	USD	46,13 %	41,82 %	13,82 %	223,27 %
	Clase B USD de Distribución (A)	20/04/2007	USD	46,12 %	41,81 %	13,83 %	223,30 %
	Clase C USD de Capitalización	15/11/2007	USD	46,13 %	41,82 %	13,83 %	223,30 %
	Clase C USD de Distribución (A)	20/04/2007	USD	46,12 %	41,82 %	13,83 %	223,30 %
	Clase E USD de Capitalización	14/01/2016	USD	45,76 %	41,46 %	12,98 %	–
	Clase E USD de Distribución (A)	13/10/2015	USD	45,77 %	41,47 %	12,98 %	–
	Clase F USD de Capitalización	19/04/2016	USD	47,74 %	43,37 %	17,64 %	–
	Clase F USD de Distribución (A)	04/11/2015	USD	47,74 %	43,37 %	17,64 %	–
	Clase U USD de Capitalización	02/03/2018	USD	48,45 %	44,05 %	19,32 %	–
	Clase U EUR de Capitalización	02/03/2018	EUR	45,32 %	39,71 %	32,02 %	–
	Clase X USD de Capitalización	29/09/2015	USD	47,78 %	43,41 %	17,73 %	–
	Clase X EUR de Capitalización	17/01/2018	EUR	44,69 %	39,17 %	30,08 %	–
	Clase X Euro de Capitalización (Cubierta)	27/07/2016	EUR	44,94 %	40,34 %	9,85 %	–
	Clase X GBP de Capitalización	04/12/2015	GBP	40,76 %	35,97 %	26,33 %	–
	Clase Premier USD de Capitalización	19/09/2014	USD	48,30 %	43,92 %	18,96 %	–
	Clase Premier USD de Distribución (A)	21/02/2020	USD	48,30 %	43,91 %	18,97 %	–
	Clase Premier BRL de Capitalización (Cubierta)	15/02/2018	BRL	55,45 %	51,45 %	37,25 %	–
	Clase Premier EUR de Capitalización	15/09/2016	EUR	45,14 %	39,55 %	31,58 %	–

Información complementaria – Datos de rendimiento del fondo (sin auditar) *(continuación)*

Fondo	Clases de Acciones	Fecha de lanzamiento	Clase CCY	Año fiscal hasta la fecha 01/03/23-29/02/24	Calendario 01/01/23-31/12/23	3 años acumulativo 01/01/21-31/12/23	Rendimiento a 10 años 01/03/14-28/02/24
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund (continuación)	Clase Premier Euro Capitalización (Cubierta)	02/03/2016	EUR	45,46 %	40,83 %	11,08 %	–
	Clase Premier EUR de Distribución (A)	21/02/2020	EUR	45,12 %	39,56 %	31,62 %	–
	Clase Premier GBP de Capitalización	02/12/2015	GBP	41,30 %	36,48 %	27,59 %	–
	Clase LM USD de Capitalización	05/04/2016	USD	49,22 %	44,82 %	21,22 %	–
	Clase LM EUR de Capitalización	05/04/2016	EUR	46,14 %	40,48 %	34,25 %	–
	Clase A (G) USD de Capitalización	20/04/2007	USD	47,37 %	43,02 %	16,76 %	251,92 %
	Clase L (G) USD de Capitalización	20/04/2007	USD	46,64 %	42,31 %	15,03 %	234,76 %
	Clase GA USD de Capitalización	27/08/2010	USD	47,12 %	42,78 %	16,17 %	245,98 %
	Clase GA EUR de Capitalización	27/08/2010	EUR	43,98 %	38,46 %	28,57 %	341,96 %
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	Clase A USD de Capitalización	20/04/2007	USD	23,34 %	25,80 %	(4,25) %	54,68 %
	Clase A USD de Distribución (A)	20/04/2007	USD	23,33 %	25,80 %	(4,24) %	54,74 %
	Clase A AUD de Capitalización (Cubierta)	03/06/2013	AUD	20,90 %	22,91 %	(10,07) %	42,51 %
	Clase A CHF de Capitalización (Cubierta)	23/10/2014	CHF	18,19 %	20,44 %	(12,68) %	–
	Clase A CNH de Capitalización (Cubierta)	14/11/2014	CNH	20,09 %	22,22 %	(5,44) %	–
	Clase A EUR de Capitalización	07/09/2010	EUR	20,69 %	21,97 %	5,96 %	96,87 %
	Clase A Euro de Capitalización (Cubierta)	02/04/2013	EUR	20,81 %	22,87 %	(10,68) %	28,66 %
	Clase A EUR de Distribución (A) (Cubierta)	28/08/2014	EUR	20,81 %	22,87 %	(10,68) %	–
	Clase A GBP de Capitalización	29/09/2014	GBP	17,54 %	19,34 %	2,76 %	–
	Clase A HKD de Capitalización	27/10/2015	HKD	22,99 %	25,81 %	(3,61) %	–
	Clase A SEK de Capitalización (Cubierta)	31/01/2013	SEK	20,44 %	22,64 %	(11,27) %	23,55 %
	Clase A SGD de Capitalización (Cubierta)	31/01/2013	SGD	21,18 %	23,70 %	(7,00) %	44,78 %
	Clase B USD de Distribución (A)	20/04/2007	USD	22,72 %	25,17 %	(5,66) %	47,15 %
	Clase C USD de Capitalización	15/11/2007	USD	22,72 %	25,17 %	(5,67) %	47,14 %
	Clase C USD de Distribución (A)	20/04/2007	USD	22,72 %	25,18 %	(5,67) %	47,14 %
	Clase E USD de Capitalización	04/01/2011	USD	22,42 %	24,86 %	(6,37) %	43,51 %
	Clase E USD de Distribución (A)	04/01/2011	USD	22,41 %	24,86 %	(6,37) %	43,51 %
	Clase E EUR de Capitalización	16/03/2021	EUR	19,78 %	21,06 %	–	–
	Clase E Euro de Capitalización (Cubierta)	10/09/2013	EUR	19,88 %	21,94 %	(12,71) %	19,69 %
	Clase F USD de Capitalización	04/01/2011	USD	24,07 %	26,55 %	(2,51) %	64,23 %
	Clase F USD de Distribución (A)	04/01/2011	USD	24,07 %	26,55 %	(2,51) %	64,24 %
	Clase X USD de Capitalización	17/05/2013	USD	24,14 %	26,61 %	(2,36) %	65,06 %
	Clase X USD de Distribución (A)	13/02/2013	USD	24,14 %	26,61 %	(2,37) %	65,06 %
	Clase X EUR de Capitalización	21/01/2014	EUR	21,50 %	22,78 %	8,05 %	110,95 %
	Clase X Euro de Capitalización (Cubierta)	19/02/2014	EUR	21,50 %	23,57 %	(9,03) %	37,31 %
	Clase X GBP de Capitalización	24/04/2013	GBP	18,28 %	20,08 %	4,72 %	117,74 %
	Clase Premier USD de Capitalización	17/03/2010	USD	24,57 %	27,06 %	(1,34) %	70,92 %
	Clase Premier EUR de Capitalización	14/12/2010	EUR	21,90 %	23,22 %	9,20 %	117,44 %
	Clase Premier GBP de Capitalización	27/02/2017	GBP	18,71 %	20,51 %	5,79 %	–
	Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)	22/04/2014	GBP	23,64 %	25,84 %	(5,24) %	–
	Clase Premier GBP de Distribución (A)	13/12/2012	GBP	18,69 %	20,49 %	5,82 %	126,41 %
	Clase LM EUR de Capitalización	05/04/2016	EUR	22,70 %	23,99 %	11,32 %	–
	Clase A (G) USD de Capitalización	20/04/2007	USD	23,77 %	26,24 %	(3,24) %	60,18 %
	Clase B (G) USD de Capitalización	20/04/2007	USD	23,18 %	25,64 %	(4,65) %	52,49 %
	Clase L (G) USD de Capitalización	20/04/2007	USD	23,15 %	25,61 %	(4,67) %	52,38 %
	Clase GA EUR de Capitalización	27/08/2010	EUR	20,98 %	22,26 %	6,70 %	101,94 %
	Clase GA EUR de Distribución (A)	27/08/2010	EUR	20,98 %	22,26 %	6,70 %	101,94 %
	Clase GE USD de Capitalización	27/08/2010	USD	22,69 %	25,15 %	(5,72) %	46,85 %
	Clase GE EUR de Capitalización	27/08/2010	EUR	20,07 %	21,35 %	4,32 %	87,54 %
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	Clase A USD de Capitalización	13/08/2013	USD	15,65 %	13,76 %	17,77 %	46,86 %
	Clase A USD de Distribución (A)	27/03/2015	USD	15,65 %	13,76 %	17,77 %	–
	Clase A USD de Distribución (M) Plus	19/06/2014	USD	15,66 %	13,76 %	17,77 %	–
	Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	03/06/2013	USD	15,61 %	13,74 %	17,75 %	46,85 %
	Clase A USD de Distribución (Q)	08/05/2015	USD	15,65 %	13,75 %	17,76 %	–
	Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	25/06/2014	AUD	13,59 %	11,42 %	11,57 %	–
	Clase A CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus	28/07/2014	CNH	12,61 %	10,56 %	16,70 %	–
	Clase A EUR de Capitalización	27/03/2015	EUR	13,18 %	10,31 %	30,32 %	–
	Clase A Euro de Capitalización (Cubierta)	21/11/2014	EUR	13,25 %	11,04 %	10,22 %	–
	Clase A Euro de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	27/02/2014	EUR	13,23 %	11,02 %	10,25 %	22,55 %
	Clase A HKD de Distribución (M) Plus	28/07/2014	HKD	15,35 %	13,75 %	18,49 %	–
	Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	28/07/2014	SGD	13,68 %	11,86 %	14,74 %	–

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

Información complementaria – Datos de rendimiento del fondo (sin auditar) *(continuación)*

Fondo	Clases de Acciones	Fecha de lanzamiento	Clase CCY	Año fiscal hasta la fecha 01/03/23-29/02/24	Calendario 01/01/23-31/12/23	3 años acumulativo 01/01/21-31/12/23	Rendimiento a 10 años 01/03/14-28/02/24
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund (continuación)	Clase C USD de Capitalización	27/09/2013	USD	15,08 %	13,19 %	16,02 %	39,70 %
	Clase C USD de Distribución (A)	27/03/2015	USD	15,08 %	13,19 %	16,02 %	–
	Clase C USD de Distribución (Q)	29/08/2014	USD	15,08 %	13,20 %	16,03 %	–
	Clase F USD de Capitalización	27/03/2015	USD	16,35 %	14,43 %	19,90 %	–
	Clase F EUR de Capitalización	27/03/2015	EUR	13,86 %	10,96 %	32,68 %	–
	Clase F EUR de Distribución (A)	27/03/2015	EUR	13,88 %	10,98 %	32,69 %	–
	Clase X Euro de Distribución (M) (Cubierta) Plus (e)	24/04/2017	EUR	13,98 %	11,76 %	12,28 %	–
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	Clase A USD de Capitalización	11/03/2020	USD	16,25 %	15,16 %	9,76 %	–
	Clase A USD de Distribución (A)	30/09/2015	USD	16,25 %	15,16 %	9,76 %	–
	Clase A EUR de Capitalización	28/02/2022	EUR	13,74 %	11,67 %	–	–
	Clase A Euro de Capitalización (Cubierta)	30/09/2015	EUR	13,87 %	12,54 %	2,49 %	–
	Clase A SEK de Capitalización	21/01/2020	SEK	15,31 %	11,48 %	35,12 %	–
	Clase F USD de Capitalización	11/03/2020	USD	16,95 %	15,86 %	11,75 %	–
	Clase X USD de Capitalización	30/07/2020	USD	16,94 %	15,86 %	11,76 %	–
	Clase X USD de Distribución (A)	30/09/2015	USD	16,95 %	15,85 %	11,75 %	–
	Clase X EUR de Capitalización	24/03/2021	EUR	14,47 %	12,43 %	–	–
	Clase X Euro de Capitalización (Cubierta)	30/09/2015	EUR	14,58 %	13,20 %	4,45 %	–
	Clase X GBP de Capitalización	22/12/2015	GBP	11,39 %	9,84 %	19,64 %	–
	Clase X GBP de Capitalización (Cubierta)	18/12/2019	GBP	16,17 %	14,89 %	7,78 %	–
	Clase Premier USD de Capitalización	24/06/2020	USD	17,36 %	16,26 %	12,93 %	–
	Clase Premier USD de Distribución (A)	30/09/2015	USD	17,36 %	16,26 %	12,93 %	–
	Clase Premier EUR de Capitalización	27/05/2022	EUR	14,91 %	12,77 %	–	–
	Clase Premier Euro Capitalización (Cubierta)	30/09/2015	EUR	14,95 %	13,61 %	5,63 %	–
	Clase Premier GBP de Capitalización	30/09/2015	GBP	11,78 %	10,21 %	21,12 %	–
	Clase S USD de Capitalización	11/07/2018	USD	17,60 %	16,49 %	13,60 %	–
	Clase S EUR de Capitalización	13/07/2020	EUR	15,06 %	12,93 %	24,92 %	–
	Clase S Euro de Capitalización (Cubierta)	13/07/2020	EUR	15,14 %	13,76 %	6,25 %	–
	Clase S GBP de Capitalización	31/07/2019	GBP	12,03 %	10,48 %	21,67 %	–
	Clase S GBP de Capitalización (Cubierta)	19/11/2019	GBP	16,71 %	15,46 %	9,52 %	–
	Clase S GBP de Distribución (Q)	31/07/2019	GBP	12,05 %	10,48 %	21,77 %	–
	Clase LM EUR de Capitalización	21/05/2021	EUR	15,53 %	13,41 %	–	–
FTGF ClearBridge Global Growth Fund^	Clase A USD de Capitalización	29/06/2018	USD	25,56 %	21,46 %	3,36 %	–
	Clase Premier USD de Capitalización	29/06/2018	USD	26,83 %	22,67 %	6,49 %	–
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^	Clase A USD de Capitalización	10/11/2017	USD	4,86 %	5,59 %	10,24 %	–
	Clase A USD de Capitalización (Cubierta)	16/03/2017	USD	4,24 %	4,24 %	27,94 %	–
	Clase A USD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	19/06/2017	USD	4,15 %	4,13 %	27,81 %	–
	Clase A USD de Distribución (Q)	12/12/2016	USD	4,81 %	5,55 %	10,53 %	–
	Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	24/10/2019	AUD	2,76 %	2,54 %	23,20 %	–
	Clase A CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus	24/10/2019	CNH	1,60 %	1,52 %	27,64 %	–
	Clase A EUR de Capitalización	12/12/2016	EUR	2,59 %	2,37 %	22,40 %	–
	Clase A Euro de Capitalización (Cubierta) (PH)	03/12/2019	EUR	3,06 %	3,03 %	13,09 %	–
	Clase A EUR de Distribución (A)	26/04/2022	EUR	2,58 %	2,36 %	–	–
	Clase A Euro de Distribución (M) Plus	22/10/2018	EUR	2,56 %	2,42 %	22,43 %	–
	Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	05/06/2017	SGD	2,67 %	2,68 %	25,59 %	–
	Clase C USD de Capitalización	26/09/2017	USD	4,30 %	5,15 %	8,73 %	–
	Clase C USD de Capitalización (Cubierta)	26/09/2017	USD	3,64 %	3,64 %	25,83 %	–
	Clase E USD de Capitalización	12/12/2016	USD	4,06 %	4,86 %	8,15 %	–
	Clase E USD de Capitalización (Cubierta)	12/04/2021	USD	3,49 %	3,49 %	–	–
	Clase F USD de Capitalización	10/08/2017	USD	5,55 %	6,34 %	12,49 %	–
	Clase F USD de Capitalización (Cubierta)	26/09/2017	USD	4,82 %	4,82 %	30,08 %	–
	Clase X USD de Capitalización	20/03/2019	USD	5,75 %	6,47 %	13,45 %	–
	Clase X USD de Distribución (A)	17/05/2017	USD	5,78 %	6,52 %	13,70 %	–
	Clase X EUR de Capitalización	24/10/2018	EUR	3,56 %	3,34 %	25,75 %	–
	Clase X Euro de Capitalización (Cubierta) (PH)	05/03/2021	EUR	4,03 %	4,08 %	–	–
	Clase X GBP de Distribución (Q)	30/05/2019	GBP	0,77 %	1,02 %	21,69 %	–
	Clase Premier USD de Capitalización	04/02/2014	USD	6,05 %	6,76 %	14,20 %	60,08 %
	Clase Premier BRL de Capitalización (Cubierta)	15/02/2018	BRL	10,65 %	11,27 %	55,44 %	–

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

Información complementaria – Datos de rendimiento del fondo (sin auditar) *(continuación)*

Fondo	Clases de Acciones	Fecha de lanzamiento	Clase CCY	Año fiscal hasta la fecha 01/03/23-29/02/24	Calendario 01/01/23-31/12/23	3 años acumulativo 01/01/21-31/12/23	Rendimiento a 10 años 01/03/14-28/02/24
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ (continuación)	Clase Premier CAD de Distribución (Q) (Cubierta) (PH) Plus (e)	16/06/2017	CAD	5,35 %	5,51 %	20,67 %	–
	Clase Premier EUR de Capitalización	11/05/2012	EUR	3,73 %	3,51 %	26,56 %	104,34 %
	Clase Premier Euro de Capitalización (Cubierta) (PH)	17/04/2019	EUR	4,11 %	4,15 %	16,52 %	–
	Clase Premier GBP de Capitalización	30/06/2016	GBP	0,96 %	1,19 %	22,62 %	–
	Clase Premier GBP de Distribución (A) (Cubierta) (PH) Plus (e)	25/06/2009	GBP	5,53 %	5,55 %	19,46 %	73,83 %
	Clase Premier GBP de Distribución (Q)	26/04/2018	GBP	0,95 %	1,24 %	22,53 %	–
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	Clase A USD de Capitalización	16/06/2021	USD	(0,79) %	1,96 %	–	–
	Clase A USD de Distribución (M) Plus	30/04/2021	USD	(0,79) %	1,96 %	–	–
	Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	30/04/2021	USD	(0,80) %	1,97 %	–	–
	Clase A AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	12/08/2021	AUD	(2,92) %	(0,36) %	–	–
	Clase A CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus	01/10/2021	CNH	(3,59) %	(0,98) %	–	–
	Clase A EUR de Distribución (A) Plus (e)	11/08/2022	EUR	(2,88) %	(1,09) %	–	–
	Clase A Euro de Distribución (M) (Cubierta) Plus	11/08/2021	EUR	(2,99) %	(0,49) %	–	–
	Clase A GBP de Distribución (M) (Cubierta) Plus	23/11/2021	GBP	(1,59) %	0,91 %	–	–
	Clase A HKD de Distribución (M) Plus	01/07/2021	HKD	(1,05) %	2,02 %	–	–
	Clase A SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	16/06/2021	SGD	(2,66) %	0,15 %	–	–
	Clase U USD de Capitalización	27/01/2023	USD	0,46 %	–	–	–
	Clase U EUR de Capitalización	25/01/2023	EUR	(1,77) %	–	–	–
	Clase U GBP de Capitalización	26/01/2023	GBP	(4,22) %	–	–	–
	Clase X USD de Distribución (M) Plus (e)	30/04/2021	USD	(0,04) %	2,74 %	–	–
	Clase X EUR de Distribución (M) (Cubierta)	26/04/2022	EUR	(2,28) %	0,24 %	–	–
	Clase X EUR de Distribución (Q) (Cubierta) Plus (e)	30/04/2021	EUR	(2,36) %	0,16 %	–	–
	Clase X GBP de Distribución (Q) (Cubierta) Plus (e)	12/01/2022	GBP	(0,99) %	1,59 %	–	–
	Clase Premier USD de Capitalización	27/05/2022	USD	0,31 %	3,09 %	–	–
	Clase Premier USD de Distribución (M) Plus	09/06/2021	USD	0,31 %	3,09 %	–	–
	Clase Premier EUR de Distribución (M) (Cubierta)	24/06/2021	EUR	(1,91) %	0,64 %	–	–
	Clase S USD de Capitalización	17/06/2021	USD	0,66 %	3,45 %	–	–
	Clase S USD de Distribución (M) Plus	06/07/2021	USD	0,65 %	3,45 %	–	–
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Clase A USD de Capitalización	09/05/2007	USD	7,42 %	18,23 %	25,01 %	102,49 %
	Clase A USD de Distribución (A)	08/11/2002	USD	7,42 %	18,24 %	25,01 %	102,47 %
	Clase A AUD de Capitalización (Cubierta)	03/06/2013	AUD	4,98 %	15,55 %	16,91 %	82,28 %
	Clase A CNH de Capitalización (Cubierta)	05/12/2016	CNH	4,55 %	14,94 %	23,50 %	–
	Clase A EUR de Capitalización	12/07/2007	EUR	5,10 %	14,62 %	38,19 %	157,95 %
	Clase A Euro de Capitalización (Cubierta)	20/02/2013	EUR	4,99 %	15,40 %	16,50 %	67,35 %
	Clase A EUR de Distribución (A) (Cubierta)	16/11/2016	EUR	5,02 %	15,40 %	16,10 %	–
	Clase A GBP de Capitalización (Cubierta)	20/12/2013	GBP	6,49 %	17,07 %	19,72 %	75,38 %
	Clase A GBP de Distribución (A)	26/04/2011	GBP	2,35 %	12,12 %	34,08 %	168,90 %
	Clase A SEK de Capitalización (Cubierta)	31/01/2013	SEK	4,63 %	15,32 %	15,51 %	58,79 %
	Clase A SGD de Capitalización	16/02/2011	SGD	7,06 %	16,34 %	24,46 %	113,59 %
	Clase A SGD de Capitalización (Cubierta)	10/09/2012	SGD	5,37 %	16,15 %	21,24 %	88,14 %
	Clase B USD de Capitalización	15/11/2007	USD	6,89 %	17,66 %	23,17 %	92,61 %
	Clase B USD de Distribución (A)	24/02/2004	USD	6,87 %	17,64 %	23,13 %	92,43 %
	Clase C USD de Capitalización	15/11/2007	USD	6,88 %	17,65 %	23,16 %	92,61 %
	Clase C USD de Distribución (A)	24/02/2004	USD	6,88 %	17,65 %	23,16 %	92,63 %
	Clase E USD de Capitalización	04/01/2011	USD	6,61 %	17,35 %	22,23 %	87,85 %
	Clase E USD de Distribución (A)	04/01/2011	USD	6,61 %	17,35 %	22,24 %	87,85 %
	Clase E EUR de Capitalización	26/11/2010	EUR	4,32 %	13,82 %	35,08 %	139,88 %
	Clase E Euro de Capitalización (Cubierta)	23/09/2013	EUR	4,24 %	14,58 %	13,98 %	55,19 %
	Clase F USD de Capitalización	04/01/2011	USD	8,07 %	18,94 %	27,28 %	115,00 %
	Clase F USD de Distribución (A)	04/01/2011	USD	8,07 %	18,94 %	27,28 %	115,00 %

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

Información complementaria – Datos de rendimiento del fondo (sin auditar) *(continuación)*

Fondo	Clases de Acciones	Fecha de lanzamiento	Clase CCY	Año fiscal hasta la fecha 01/03/23-29/02/24	Calendario 01/01/23-31/12/23	3 años acumulativo 01/01/21-31/12/23	Rendimiento a 10 años 01/03/14-28/02/24
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund (continuación)	Clase R EUR de Capitalización	09/12/2013	EUR	5,65 %	15,22 %	40,66 %	172,34 %
	Clase X USD de Capitalización	25/02/2013	USD	8,23 %	19,12 %	27,85 %	118,25 %
	Clase X USD de Distribución (A)	28/11/2016	USD	8,23 %	19,12 %	27,85 %	–
	Clase X EUR de Capitalización	11/10/2017	EUR	5,97 %	15,55 %	41,42 %	–
	Clase X Euro de Capitalización (Cubierta)	21/10/2013	EUR	5,83 %	16,23 %	19,09 %	80,11 %
	Clase X GBP de Capitalización	18/01/2013	GBP	3,12 %	12,97 %	37,10 %	188,98 %
	Clase X GBP de Distribución (A)	23/04/2013	GBP	3,12 %	12,98 %	37,08 %	188,21 %
	Clase Premier USD de Capitalización	27/04/2010	USD	8,61 %	19,54 %	29,20 %	126,01 %
	Clase Premier BRL de Capitalización (Cubierta)	15/02/2018	BRL	13,59 %	25,54 %	47,98 %	–
	Clase Premier EUR de Capitalización	07/06/2010	EUR	6,28 %	15,92 %	42,85 %	188,38 %
	Clase Premier Euro Capitalización (Cubierta)	31/08/2015	EUR	6,23 %	16,73 %	20,54 %	–
	Clase Premier GBP de Capitalización	15/02/2013	GBP	3,48 %	13,36 %	38,39 %	198,47 %
	Clase Premier PLN de Capitalización (Cubierta)	03/08/2018	PLN	9,24 %	20,68 %	31,70 %	–
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Clase A USD de Capitalización	09/05/2007	USD	10,44 %	20,08 %	25,39 %	77,51 %
	Clase A USD de Distribución (A)	01/03/2004	USD	10,39 %	20,03 %	25,30 %	77,24 %
	Clase A EUR de Capitalización	01/10/2008	EUR	7,99 %	16,32 %	38,44 %	125,42 %
	Clase A Euro de Capitalización (Cubierta)	05/06/2013	EUR	7,97 %	17,18 %	16,82 %	46,62 %
	Clase A EUR de Distribución (A)	09/02/2011	EUR	7,95 %	16,30 %	38,50 %	128,82 %
	Clase A GBP de Distribución (A)	05/11/2009	GBP	5,19 %	13,85 %	34,40 %	134,96 %
	Clase A SEK de Capitalización (Cubierta)	31/01/2013	SEK	7,60 %	17,05 %	16,23 %	40,94 %
	Clase C USD de Capitalización	15/11/2007	USD	9,89 %	19,48 %	23,53 %	68,83 %
	Clase C USD de Distribución (A)	01/03/2004	USD	9,84 %	19,44 %	23,44 %	68,59 %
	Clase E USD de Capitalización	21/01/2010	USD	9,57 %	19,14 %	22,52 %	64,43 %
	Clase E USD de Distribución (A)	03/06/2020	USD	9,57 %	19,14 %	22,45 %	–
	Clase E EUR de Capitalización	14/01/2019	EUR	7,22 %	15,51 %	35,58 %	–
	Clase F USD de Capitalización	21/01/2010	USD	11,06 %	20,75 %	27,57 %	88,20 %
	Clase F USD de Distribución (A)	04/02/2010	USD	11,06 %	20,75 %	27,57 %	88,21 %
	Clase X USD de Capitalización	08/02/2013	USD	11,22 %	20,94 %	28,11 %	90,96 %
	Clase X USD de Distribución (A)	15/04/2021	USD	11,31 %	21,11 %	–	–
	Clase Premier USD de Capitalización	24/11/2009	USD	11,61 %	21,35 %	29,49 %	97,80 %
	Clase Premier USD de Distribución (A)	18/02/2011	USD	11,61 %	21,35 %	29,49 %	97,84 %
	Clase Premier GBP de Distribución (A)	20/05/2011	GBP	6,28 %	15,02 %	38,87 %	161,89 %
	Clase LM EUR de Capitalización	05/04/2016	EUR	10,08 %	18,58 %	46,58 %	–
	Clase A (G) USD de Capitalización	20/04/2007	USD	11,06 %	20,75 %	27,57 %	88,19 %
	Clase L (G) USD de Capitalización	20/04/2007	USD	10,50 %	20,15 %	25,68 %	79,02 %
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^	Clase A USD de Capitalización	01/12/2021	USD	2,15 %	10,25 %	–	–
	Clase X USD de Capitalización	01/12/2021	USD	2,94 %	11,08 %	–	–
	Clase X GBP de Capitalización	11/08/2022	GBP	(2,09) %	5,20 %	–	–
	Clase Premier USD de Capitalización	01/12/2021	USD	3,29 %	11,47 %	–	–
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	Clase A USD de Capitalización	28/06/2016	USD	24,42 %	21,49 %	(10,92) %	–
	Clase A EUR de Capitalización	28/06/2016	EUR	21,70 %	17,75 %	(1,44) %	–
	Clase A Euro de Capitalización (Cubierta)	24/03/2021	EUR	21,42 %	18,26 %	–	–
	Clase C USD de Capitalización	09/09/2021	USD	23,80 %	20,89 %	–	–
	Clase E USD de Capitalización	14/08/2019	USD	23,49 %	20,58 %	(12,90) %	–
	Clase F USD de Capitalización	29/07/2021	USD	25,17 %	22,22 %	–	–
	Clase X USD de Capitalización	01/04/2021	USD	25,34 %	22,41 %	–	–
	Clase X EUR de Capitalización	28/06/2016	EUR	22,68 %	18,68 %	0,86 %	–
	Clase X GBP de Capitalización	28/06/2016	GBP	19,45 %	16,08 %	(2,25) %	–
	Clase X GBP de Capitalización (Cubierta)	28/06/2016	GBP	24,03 %	20,88 %	(13,18) %	–
	Clase Premier USD de Capitalización	28/06/2016	USD	25,79 %	22,82 %	(7,94) %	–
	Clase Premier GBP de Capitalización (Cubierta)	16/04/2019	GBP	24,46 %	21,28 %	(12,29) %	–
	Clase S Euro de Capitalización (Cubierta)	05/03/2021	EUR	23,17 %	19,96 %	–	–
	Clase S GBP de Capitalización	28/06/2016	GBP	20,38 %	16,98 %	(0,20) %	–
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	Clase A USD de Distribución (M) Plus (e)	28/06/2016	USD	1,08 %	3,43 %	2,40 %	–
	Clase A AUD de Distribución (M) Plus	28/06/2016	AUD	4,66 %	3,34 %	15,84 %	–
	Clase A Euro de Distribución (M) Plus (e)	28/06/2016	EUR	(1,08) %	0,29 %	13,29 %	–
	Clase A SGD de Distribución (M) Plus	12/09/2018	SGD	0,76 %	1,94 %	2,04 %	–

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

Información complementaria – Datos de rendimiento del fondo (sin auditar) *(continuación)*

Fondo	Clases de Acciones	Fecha de lanzamiento	Clase CCY	Año fiscal hasta la fecha 01/03/23-29/02/24	Calendario 01/01/23-31/12/23	3 años acumulativo 01/01/21-31/12/23	Rendimiento a 10 años 01/03/14-28/02/24
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund (continuación)	Clase D AUD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	29/04/2020	AUD	(0,80) %	1,40 %	(1,76) %	–
	Clase D CNH de Distribución (M) (Cubierta) Plus	29/04/2020	CNH	(1,29) %	0,90 %	2,80 %	–
	Clase D HKD de Distribución (M) Plus	29/04/2020	HKD	1,25 %	3,91 %	4,44 %	–
	Clase D SGD de Distribución (M) (Cubierta) Plus	29/04/2020	SGD	(0,35) %	2,07 %	1,06 %	–
	Clase D USD de Distribución (M) Plus	29/04/2020	USD	1,48 %	3,84 %	3,63 %	–
	Clase D USD de Capitalización	29/04/2020	USD	1,49 %	3,84 %	3,63 %	–
	Clase X AUD de Capitalización	31/05/2017	AUD	5,43 %	4,11 %	18,14 %	–
	Clase X USD de Capitalización	28/06/2016	USD	1,85 %	4,20 %	4,72 %	–
	Clase S GBP de Capitalización	28/06/2016	GBP	(2,31) %	(0,52) %	14,59 %	–
	Clase S GBP de Distribución (M) Plus (e)	28/06/2016	GBP	(2,32) %	(0,52) %	14,56 %	–
	Clase LM AUD de Capitalización	10/11/2017	AUD	6,60 %	5,26 %	22,46 %	–
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	Clase A USD de Capitalización	24/11/2017	USD	1,00 %	4,39 %	(27,88) %	–
	Clase E USD de Capitalización	10/09/2018	USD	0,23 %	3,61 %	(29,49) %	–
	Clase F USD de Capitalización	13/11/2018	USD	1,60 %	5,01 %	(26,58) %	–
	Clase X USD de Capitalización	13/12/2017	USD	1,69 %	5,12 %	(26,29) %	–
	Clase Premier USD de Capitalización	13/12/2017	USD	2,11 %	5,54 %	(25,47) %	–
	Clase S USD de Capitalización	29/10/2018	USD	2,30 %	5,74 %	(25,02) %	–
	Clase S EUR de Capitalización	16/01/2018	EUR	0,12 %	2,53 %	(16,96) %	–
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^	Clase A USD de Capitalización (Cubierta)	15/10/2021	USD	19,92 %	20,49 %	–	–
	Clase A EUR de Capitalización	09/11/2018	EUR	17,57 %	17,99 %	(1,42) %	–
	Clase E USD de Capitalización (Cubierta)	15/10/2021	USD	19,01 %	19,57 %	–	–
	Clase X EUR de Capitalización	09/11/2018	EUR	18,46 %	18,87 %	0,81 %	–
	Clase Premier BRL de Capitalización (Cubierta)	01/06/2021	BRL	26,85 %	28,20 %	–	–
	Clase Premier EUR de Capitalización	09/11/2018	EUR	18,87 %	19,29 %	1,88 %	–
	Clase S USD de Capitalización	12/05/2022	USD	22,14 %	23,67 %	–	–
	Clase S EUR de Capitalización	07/05/2019	EUR	19,36 %	19,77 %	3,10 %	–
	Clase S GBP de Capitalización	19/11/2021	GBP	16,20 %	17,14 %	–	–
Franklin Responsible Income 2028 Fund^	Clase A EUR de Capitalización	23/01/2023	EUR	6,06 %	–	–	–
	Clase A EUR de Distribución (A)	23/01/2023	EUR	6,07 %	–	–	–
	Clase D EUR de Capitalización	23/01/2023	EUR	5,49 %	–	–	–
	Clase D EUR de Distribución (A)	23/01/2023	EUR	5,48 %	–	–	–
	Clase X EUR de Capitalización	23/01/2023	EUR	6,47 %	–	–	–
	Clase X EUR de Distribución (A)	23/01/2023	EUR	6,50 %	–	–	–

Los datos de rendimiento del fondo no tienen en cuenta las comisiones y los costes incurridos en la emisión y amortización de acciones.

Rentabilidades pasadas no garantizan rentabilidades futuras.

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado)

Correspondiente al ejercicio fiscal finalizado el 29 de febrero de 2024

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 año 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 acuerdos de recompra inversa, las notas de descuento a un día y los depósitos a plazo, que se emplean principalmente como medio para garantizar una gestión eficiente de la cartera) que superen el 1,00 % del valor total de las compras y ventas del año. Como mínimo, se indican las veinte compras y ventas más voluminosas. Si un Fondo realizó menos de veinte adquisiciones o ventas durante el año analizado, se ofrecen todas las operaciones.

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 22/02/2024	42.813
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 26/06/2023	42.382
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 21/06/2023	40.505
United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 18/05/2023	37.892
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 14/03/2023	34.996
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 15/05/2023	34.986
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 27/11/2023	34.985
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 13/03/2023	32.288
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 05/02/2024	29.987
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 06/11/2023	29.919
United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 02/01/2024	29.700
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 29/09/2023	29.676
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 18/08/2023	29.617
United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 24/11/2023	29.599
United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 12/03/2024	26.278
Federal Home Loan Banks Floating Rate Note – A la emisión, 5,090 %, con vencimiento el 25/09/2023	26.198
United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 16/04/2024	25.886
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 16/05/2023	25.264
Federal Farm Credit Banks Funding Corp Floating Rate Note – A la emisión, 0,000 %, con vencimiento el 20/03/2024	25.001
Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Serie 0000, 5,350 %, con vencimiento el 29/04/2024	24.997

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 22/02/2024	43.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 26/06/2023	42.400
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 21/06/2023	40.600
United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 18/05/2023	37.900
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 27/11/2023	35.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 15/05/2023	35.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 14/03/2023	35.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 13/03/2023	32.300
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 05/02/2024	30.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 29/09/2023	30.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 06/11/2023	30.000
United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 24/11/2023	30.000
United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 02/01/2024	30.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 18/08/2023	30.000
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 25/09/2023	26.200
Federal Home Loan Bank Discount Notes, 0,000 %, con vencimiento el 16/05/2023	25.300
Federal Home Loan Bank Discount Notes, cupón cero, con vencimiento el 16/03/2023	25.000
United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 14/03/2023	25.000
United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 06/06/2023	25.000
Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 0,000 %, con vencimiento el 20/03/2024	25.000

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	95.539
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	8.458
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 15/05/2053	7.793
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	7.473
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 31/07/2028	6.091
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	5.565
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	5.449
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	4.573
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	4.502
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	4.434
United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, con vencimiento el 15/11/2053	4.337
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	4.328
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	4.004
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 %	3.965
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	3.903
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	3.678
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	3.605
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	3.567
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	3.560
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	3.514

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	94.172
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	8.448
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	7.472
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 31/07/2028	5.959
United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, con vencimiento el 31/12/2027	5.726
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	5.537
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	5.409
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	4.599
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	4.464
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	4.425
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	4.319
United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, con vencimiento el 15/11/2053	4.229
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	4.042
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	3.994
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 %	3.971
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	3.666
Ginnie Mae, 30 años, TBA, cupón cero	3.651
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	3.562
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	3.519
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	3.500

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	27.049
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 4,000 %, con vencimiento el 29/02/2028	24.520
Pagaré/Nota del Tesoro estadounidense, cupón cero, con vencimiento el 31/05/2028	23.945
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,500 %	19.023
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	18.324
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	18.120
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	17.327
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	16.648
United States Treasury Note/Bond, 0,000 %, con vencimiento el 31/08/2030	16.384
United States Treasury Note/Bond, 0,000 %, con vencimiento el 30/09/2030	15.584
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	14.970
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	14.791
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	14.248
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 %	13.621
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	12.993
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, con vencimiento el 31/01/2031	12.865
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	12.515
United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, con vencimiento el 15/11/2053	12.514
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	12.086
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	12.003

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	27.473
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 4,000 %, con vencimiento el 29/02/2028	24.827
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 31/05/2028	23.890
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,500 %	22.824
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	18.485
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	18.308
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 3,000 %	17.858
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	17.546
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, con vencimiento el 31/01/2028	17.256
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	16.606
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 31/08/2030	16.388
United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, con vencimiento el 15/08/2050	15.833
United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, con vencimiento el 30/09/2030	15.570
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 31/01/2025	15.342
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,500 %	14.970
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	14.847
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	14.797
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	14.316
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	12.927
United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, con vencimiento el 15/11/2053	12.829

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado) *(continuación)*

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) EUR
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	8.415
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, con vencimiento el 15/08/2032	3.895
Bonos Indexados de Inflación de Estaos Unidos, 1,375 %, con vencimiento el 15/07/2033	1.310
Goldman Sachs Group Inc/The, 0,875 %, con vencimiento el 09/05/2029	1.220
Bundesobligación, 0,000 %, con vencimiento el 04/10/2026	900
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	829
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	823
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	816
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	786
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	708
Vodafone Group Plc, 2,875 %, con vencimiento el 20/11/2037	694
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	684
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Serie I/L, 0,500 %, con vencimiento el 15/04/2030	662
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	629
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Serie 2007, 4,250 %, con vencimiento el 04/07/2039	618
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	593
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	551
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	532
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	522
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	447

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) EUR
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, con vencimiento el 15/02/2031	9.825
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	8.266
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, con vencimiento el 15/08/2032	6.341
Bono del Estado de los Países bajos, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 15/07/2030	3.711
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie 31Y, 144A, 3,250 %, con vencimiento el 01/09/2046	3.496
Bono del Estado de la República Francesa OAT, 3,250 %, con vencimiento el 25/05/2045	3.475
Bono del Estado de la República Francesa OAT, 0,000 %, con vencimiento el 25/11/2030	3.427
Bono del Estado de España, Serie 30Y, 144A, 2,700 %, con vencimiento el 31/10/2048	2.561
Bono del Estado de la República de Austria, 144A, 0,900 %, con vencimiento el 20/02/2032	2.160
Mecanismo Europeo de Estabilidad Financiera, Serie EUR, 0,750 %, con vencimiento el 05/09/2028	2.117
Bono del Estado del Reino de Bélgica, Serie 71, 3,750 %, con vencimiento el 22/06/2045	1.850
Bono del Estado de España, 144A, 1,300 %, con vencimiento el 31/10/2026	1.525
Bono internacional del Estado de México, 4,600 %, con vencimiento el 23/01/2046	1.435
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie CPI, 144A, 0,400 %, con vencimiento el 15/05/2030	1.421
Bank of America Corp, 1,379 %, con vencimiento el 07/02/2025	1.387
Bono Internacional del Estado de la República de Sudáfrica, 4,300 %, con vencimiento el 12/10/2028	1.382
JPMorgan Chase & Co, 0,625 %, con vencimiento el 25/01/2024	1.364
Bono del Estado de la República de Polonia, Serie 0432, 1,750 %, con vencimiento el 25/04/2032	1.325
HSBC Holdings Plc, 3,019 %, con vencimiento el 15/06/2027	1.245
Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000 %, con vencimiento el 01/11/2028	1.196

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 2,000 %, con vencimiento el 15/02/2025	11.910
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 4,125 %, con vencimiento el 31/10/2027	11.729
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, 0,000 %, con vencimiento el 15/06/2035	5.300
Mexican Bonos, Serie M, 8,500 %, con vencimiento el 31/05/2029	4.019
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 2,000 %, con vencimiento el 15/11/2026	3.981
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 0,625 %, con vencimiento el 31/03/2027	1.964
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, con vencimiento el 15/08/2043	1.628
Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 15/08/2027	1.513
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 4,000 %, con vencimiento el 15/11/2042	1.417
Vodafone Group Plc, 8,000 % vencimiento el 30/08/2086	1.252
International Bank for Reconstruction & Development, 6,750 %, con vencimiento el 13/07/2029	1.092
Banco Santander SA, 5,750 %, con vencimiento el 23/08/2033	1.083
Cellnex Finance Co SA, 2,000 %, con vencimiento el 15/02/2033	1.056
European Bank for Reconstruction & Development, 6,300 %, con vencimiento el 26/10/2027	1.041
Sedgwick CMS Inc, 9,083 %, con vencimiento el 17/02/2028	913
Intesa Sanpaolo SpA, 6,500 %, con vencimiento el 14/03/2029	908
APi Group De Inc, 7,701 %, con vencimiento el 01/10/2026	882
Mosaic Solar Loan Trust 2023-4, Serie 2023 4A, Clase C, 144A, 8,800 %, con vencimiento el 20/05/2053	849
Goldstory SAS, 6,750 %, con vencimiento el 01/02/2030	845
Nidda Healthcare Holding GmbH, 7,500 %, con vencimiento el 21/08/2026	844
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, con vencimiento el 15/02/2031	840
ServiceMaster Funding LLC, Serie 2021 1, Clase A2II, 144A, 3,113 %, con vencimiento el 30/07/2051	826
Altice Financing SA, 2,250 %, con vencimiento el 15/01/2025	817
Altice France SA/France, 2,125 %, con vencimiento el 15/02/2025	811
Neighborly Issuer 2023-1, Serie 2023 1A, Clase A2, 144A, 7,308 %, con vencimiento el 30/01/2053	789

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Serie 2018 PHMZ, Clase M, 144A, 13,096 %, con vencimiento el 15/06/2035	5.300
Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, con vencimiento el 13/11/2042	4.021
Bono del Tesoro de Indonesia, Series FR78, 8,250 %, con vencimiento el 15/05/2029	3.656
UBS Group AG, 7,000 %, Perpetuo	2.010
JPMorgan Chase & Co, Serie U, 6,125 %, Perpetuo	1.743
Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 15/08/2027	1.522
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 01/05/2027	1.335
Bono Internacional del Estado de Gabón, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 24/11/2031	1.290
Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 144A, 5,250 %, con vencimiento el 27/04/2029	1.278
Hilton Worldwide Finance LLC, 6,380 %, con vencimiento el 21/06/2026	1.166
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, con vencimiento el 21/07/2023	1.162
Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – LM Class Euro Accumulating	1.141
Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/02/2024	1.100
1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/01/2028	1.085
Vale Overseas Ltd, 6,250 %, con vencimiento el 10/08/2026	1.079
Match Group Holdings II LLC, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 15/12/2027	1.018
EQT Corp, 3,900 %, con vencimiento el 01/10/2027	1.002
Southern Copper Corp, 5,250 %, con vencimiento el 08/11/2042	970
Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 01/05/2025	951
Sedgwick Claims Management Services Inc, 7,820 %, con vencimiento el 31/12/2025	913
DP World Ltd/United Arab Emirates, 5,625 %, con vencimiento el 25/09/2048	892
APi Group Inc, 7,070 %, con vencimiento el 01/10/2026	882
Clarios Global LP, 7,820 %, con vencimiento el 30/04/2026	811
Terrier Media Buyer, Inc., 8,230 %, con vencimiento el 17/12/2026	791
Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR59, 7,000 %, con vencimiento el 15/05/2027	770
Enterprise Products Operating LLC, 4,800 %, con vencimiento el 01/02/2049	714
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 01/06/2033	686
Focus Financial Partners LLC, 7,811 %, con vencimiento el 30/06/2028	633
Prime Security Installations Ltd, 7,517 %, con vencimiento el 23/09/2026	587
Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, con vencimiento el 01/04/2028	565
Bono Internacional del Estado de Panamá, 4,500 %, con vencimiento el 01/04/2056	499
AbbVie Inc, 4,850 %, con vencimiento el 15/06/2044	491
Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-1, Serie 2017 1, Clase M1, 144A, 4,000 %, con vencimiento el 25/01/2056	461
Morgan Stanley, 3,622 %, vencimiento 01/04/2031	459
Sands China Ltd, 3,100 %, con vencimiento el 08/03/2029	448
Delta Air Lines Inc, 7,375 %, con vencimiento el 15/01/2026	445
Comcast Corp, 4,950 %, con vencimiento el 15/10/2058	420
ICICI Bank Ltd/Dubai, 4,000 %, con vencimiento el 18/03/2026	405

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado) *(continuación)*

FTGF Western Asset US High Yield Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	37.580
Open Text Corp, 144A, 6,900 %, con vencimiento el 01/12/2027	1.543
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, con vencimiento el 01/06/2031	1.517
ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 14/04/2030	1.112
GTCR W-2 Merger Sub LLC, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 15/01/2031	1.068
NCL Corp Ltd, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 15/01/2029	927
Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Perpetuo	822
Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 15/08/2027	806
Carnival Corp, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 01/06/2030	796
BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, Perpetuo	788
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 9,375 %, con vencimiento el 01/03/2029	740
American Airlines Inc, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/05/2029	734
UBS Group AG, 144A, 9,016 %, con vencimiento el 15/11/2033	703
Venture Global LNG Inc, 144A, 9,875 %, con vencimiento el 01/02/2032	696
Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, Perpetuo	682
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, con vencimiento el 15/09/2031	681
Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, con vencimiento el 08/08/2024	678
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, con vencimiento el 15/01/2026	674
Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/03/2032	632
LifePoint Health Inc, 144A, 9,875 %, con vencimiento el 15/08/2030	610

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	38.664
Open Text Corp, 144A, 6,900 %, con vencimiento el 01/12/2027	1.719
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/10/2027	1.345
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, con vencimiento el 01/06/2031	1.305
Bath & Body Works Inc, 7,500 %, con vencimiento el 15/06/2029	1.299
United Rentals North America Inc, 5,250 %, con vencimiento el 15/01/2030	1.099
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, con vencimiento el 09/05/2029	912
Ford Motor Co, 6,100 %, con vencimiento el 19/08/2032	897
Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 26/08/2028	887
Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 15/08/2027	867
NCL Ltd, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 15/02/2027	852
Ford Motor Credit Co LLC, 5,113 %, con vencimiento el 03/05/2029	843
Western Midstream Operating LP, 5,450 %, con vencimiento el 01/04/2044	787
Sands China Ltd, 3,250 %, con vencimiento el 08/08/2031	752
Bombardier Inc, 144A, 7,875 %, con vencimiento el 15/04/2027	750
Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 01/02/2026	729
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, con vencimiento el 01/05/2032	718
H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/12/2028	717
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 01/11/2033	715
Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 15/05/2029	710

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 0,750 %, con vencimiento el 30/04/2026	905
JB Poindexter & Co Inc, 144A, 8,750 %, con vencimiento el 15/12/2031	870
ZF North America Capital Inc, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 14/04/2028	578
United Rentals North America Inc, 3,875 %, con vencimiento el 15/11/2027	512
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2033	502
Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/08/2029	501
Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 01/05/2025	499
Bono Internacional del Estado de Panamá, 2,252 %, con vencimiento el 29/09/2032	498
United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 05/03/2024	498
Vodafone Group Plc, 4,125 %, con vencimiento el 30/05/2025	395
GFL Environmental Inc, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 01/06/2025	386
American Airlines Group Inc, 144A, 3,750 %, con vencimiento el 01/03/2025	384
China Aoyuan Group L 6,35 % 08/02/25, 0,000 %, con vencimiento 08/02/2025	384
Ecopetrol SA, 8,375 %, con vencimiento el 19/01/2036	278
Bono Internacional del Estado de Nigeria, 144A, 7,143 %, con vencimiento el 23/02/2030	270
AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,400 %, con vencimiento el 29/10/2033	262
Colombia Government International Bond, 3,125 %, con vencimiento el 15/04/2031	261
Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 2,875 %, con vencimiento el 15/10/2026	261
Comerica Bank, 2,500 %, con vencimiento el 23/07/2024	253
Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, Perpetuo	253
CSC Holdings LLC, 144A, 11,250 %, con vencimiento el 15/05/2028	250
Ritchie Bros Holdings Inc, 144A, 7,750 %, con vencimiento el 15/03/2031	250
United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 27/02/2024	250
United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 28/12/2023	250
Bono Internacional del Estado de México, 2,659 %, con vencimiento el 24/05/2031	249
United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 01/02/2024	249
United States Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 05/09/2023	249
TransDigm Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 01/12/2031	238
T-Mobile USA Inc, 2,625 %, con vencimiento el 15/04/2026	235
Stena International SA, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 15/01/2031	230
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 9,375 %, con vencimiento el 01/03/2029	220
Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 8,875 %, con vencimiento el 15/11/2031	220
Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, Perpetuo	219
Banijay Entertainment SASU, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 01/05/2029	210
Bono Internacional del Estado de Turquía, 4,875 %, con vencimiento el 16/04/2043	208
ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 14/04/2030	203
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, con vencimiento el 01/06/2031	200
GTCR W-2 Merger Sub LLC, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 15/01/2031	200
DCert Buyer, Inc., 9,333 %, con vencimiento el 16/10/2026	199
Rakuten Group Inc, 144A, 11,250 %, con vencimiento el 15/02/2027	196
Telecom Italia SpA/Milano, 144A, 5,303 %, con vencimiento el 30/05/2024	196
Bono Internacional del Estado de Omán, 6,750 %, con vencimiento el 17/01/2048	195
Delta Air Lines Inc, 2,900 %, con vencimiento el 28/10/2024	193

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, con vencimiento el 01/10/2026	992
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 15/01/2034	948
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 0,750 %, con vencimiento el 30/04/2026	908
JB Poindexter & Co Inc, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 15/04/2026	814
Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, con vencimiento el 16/02/2028	765
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, con vencimiento el 31/05/2029	690
Saga Plc, 5,500 %, con vencimiento el 15/07/2026	682
United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, con vencimiento el 31/08/2029	662
VZ Secured Financing BV, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 15/01/2032	631
Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 15/08/2027	599
Ford Motor Co, 3,250 %, con vencimiento el 12/02/2032	564
Bono Internacional del Estado de Turquía, 4,250 %, con vencimiento el 14/04/2026	539
NCL Finance Ltd, 144A, 6,125 %, con vencimiento el 15/03/2028	525
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, con vencimiento el 31/12/2023	487
United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 15/04/2029	472
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, con vencimiento el 28/02/2027	470
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2033	469
Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 15/05/2029	449
Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 15/09/2024	449
Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 15/08/2029	432
StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 15/05/2029	385
China Aoyuan Group Ltd, 6,350 %, con vencimiento el 08/02/2024	384
Level 3 Financing Inc, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 15/01/2029	364
Sands China Ltd, 3,250 %, con vencimiento el 08/08/2031	332
Carrols Restaurant Group Inc, 144A, 5,875 %, con vencimiento el 01/07/2029	328
JB Poindexter & Co Inc, 144A, 8,750 %, con vencimiento el 15/12/2031	306
INEOS Quattro Finance 1 Plc, 3,750 %, con vencimiento el 15/07/2026	305
NCL Corp Ltd, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 15/12/2024	305
TC Ziraat Bankasi AS, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 29/09/2023	300
Carnival Corp, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 01/06/2030	296
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, con vencimiento el 01/06/2032	294
Ecopetrol SA, 8,875 %, con vencimiento el 13/01/2033	271
FAGE International SA / FAGE USA Dairy Industry Inc, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 15/08/2026	255
MGM China Holdings Ltd, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2027	255

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado) *(continuación)*

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	134.452
Bono del Estado de Malasia, Serie 0318, 4,642 %, con vencimiento el 07/11/2033	22.731
Bono del Estado de China, Serie INBK, 3,120 %, con vencimiento el 25/10/2052	11.645
Bono del Estado de Singapur, 2,625 %, con vencimiento el 01/08/2032	11.183
Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR89, 6,875 %, con vencimiento el 15/08/2051	10.613
European Bank for Reconstruction & Development, 15,150 %, con vencimiento el 16/02/2024	9.564
Ley de la Autoridad Monetaria de Singapur, Serie 87, cupón cero, con vencimiento 07/07/2023	8.924
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, con vencimiento el 31/07/2023	7.914
Ley de la Autoridad Monetaria de Singapur, Serie 87, cupón cero, con vencimiento el 21/07/2023	7.846
Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR97, 7,125 %, con vencimiento el 15/06/2043	6.796
Bono del Estado de Australia, 3,750 %, con vencimiento el 21/04/2037	6.514
Bono del Estado de la India, 7,180 %, con vencimiento el 24/07/2037	5.433
Ley de la Autoridad Monetaria de Singapur, Serie 87, cupón cero, con vencimiento el 28/04/2023	4.506
Ley de la Autoridad Monetaria de Singapur, Serie 87, cupón cero, con vencimiento el 23/06/2023	4.478
Ley de la Autoridad Monetaria de Singapur, Serie 87, cupón cero, con vencimiento el 31/03/2023	4.288
HSBC Holdings Plc, 7,260 %, con vencimiento el 14/03/2033	3.692
Bono del Estado de la India, 7,260 %, con vencimiento el 22/08/2032	3.575
Ley de la Autoridad Monetaria de Singapur, Serie 87, cupón cero, con vencimiento el 13/10/2023	3.445
Bono del Estado de la India, 7,300 %, con vencimiento el 19/06/2053	3.347
Ley de la Autoridad Monetaria de Singapur, Serie 87, cupón cero, con vencimiento el 15/09/2023	2.949
Bono Internacional del Estado de Vietnam, 4,800 %, con vencimiento el 19/11/2024	2.947

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	132.837
Bono del Tesoro de Corea, Serie 3006, 1,375 %, con vencimiento el 10/06/2030	22.716
Bono del Estado del Reino de Bélgica, Serie 0411, 4,232 %, con vencimiento el 30/06/2031	17.146
China Government Bond, Serie INBK, 3,390 %, con vencimiento el 16/03/2050	15.057
European Bank for Reconstruction & Development, 15,150 %, con vencimiento el 16/02/2024	9.611
Ley de la Autoridad Monetaria de Singapur, Serie 87, cupón cero, con vencimiento 07/07/2023	8.856
Ley de la Autoridad Monetaria de Singapur, Serie 87, cupón cero, con vencimiento el 10/04/2023	8.524
Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR54, 9,500 %, con vencimiento el 15/07/2031	8.495
Bono Internacional del Estado de Filipinas, 6,250 %, con vencimiento el 14/01/2036	8.334
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, con vencimiento el 31/07/2023	7.920
Ley de la Autoridad Monetaria de Singapur, Serie 87, cupón cero, con vencimiento el 21/07/2023	7.880
Temasek Financial I Ltd, 2,800 %, con vencimiento el 17/08/2071	7.609
Bonos del Tesoro coreano, Serie 2409, 3,125 %, con vencimiento el 10/09/2024	7.607
Ley de la Autoridad Monetaria de Singapur, Serie 84, cupón cero, con vencimiento el 10/03/2023	7.413
Bono del Tesoro de Corea, Serie 2912, 1,375 %, con vencimiento el 10/12/2029	7.145
Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR59, 7,000 %, con vencimiento el 15/05/2027	7.057
China Government Bond, Serie INBK, 2,680 %, con vencimiento el 21/05/2030	7.052
United Overseas Bank Ltd, 3,875 %, Perpetuo	6.896
Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR56, 8,375 %, con vencimiento el 15/09/2026	6.868
Bono del Tesoro de Corea, Serie 3206, 3,375 %, con vencimiento el 10/06/2032	6.604
Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR87, 6,500 %, con vencimiento el 15/02/2031	6.410
Bono del Estado de Malasia, Serie 0219, 3,885 %, con vencimiento el 15/08/2029	5.797
Export-Import Bank of China/The, Serie 2007, 3,260 %, con vencimiento el 24/02/2027	5.710
Bono del Estado de la India, Serie SPB, 8,240 %, con vencimiento el 15/02/2027	5.569
Bono del Estado de Malasia, Serie 0115, 3,955 %, con vencimiento el 15/09/2025	5.409
United States Treasury Note/Bond, 0,125 %, con vencimiento el 15/12/2023	5.192
International Finance Corp, 8,000 %, con vencimiento el 09/10/2023	4.908
Bono del Estado de India, 7,380 %, con vencimiento el 20/06/2027	4.857

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	267.738
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 1,500 %, con vencimiento el 31/01/2027	42.467
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, con vencimiento el 15/02/2027	14.602
United Kingdom Gilt, 4,125 %, con vencimiento el 29/01/2027	13.012
United States Treasury Note/Bond, 1,000 %, con vencimiento el 15/12/2024	12.464
Nederlandse Waterschapsbank NV, 4,500 %, con vencimiento el 18/06/2025	10.887
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,650 %, con vencimiento el 19/05/2030	7.986
Caterpillar Financial Services Corp, 5,050 %, con vencimiento el 27/02/2026	7.138
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2033	5.380
Bank of New York Mellon Corp/The, 4,947 %, con vencimiento el 26/04/2027	5.200
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE, 3,375 %, con vencimiento el 21/10/2025	4.698
Nationwide Building Society, 6,125 %, con vencimiento el 21/08/2028	4.345
Deutsche Boerse AG, 3,750 %, con vencimiento el 28/09/2029	4.128
Cargill Inc, 144A, 4,500 %, con vencimiento el 24/06/2026	3.992
AbbVie Inc, 4,800 %, con vencimiento el 15/03/2029	3.992
NatWest Markets Plc, 6,375 %, con vencimiento el 08/11/2027	3.940
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3,000 %, con vencimiento el 22/11/2028	3.859
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, con vencimiento el 31/08/2028	3.651
Banco Santander SA, 4,250 %, con vencimiento el 12/06/2030	3.425
Bristol-Myers Squibb Co, 4,900 %, con vencimiento el 22/02/2029	3.403

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	283.681
United States Treasury Note/Bond, 1,000 %, con vencimiento el 15/12/2024	48.437
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 1,500 %, con vencimiento el 31/01/2027	39.723
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, con vencimiento el 15/02/2027	14.279
United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, con vencimiento el 15/05/2030	12.540
United Kingdom Gilt, 4,125 %, con vencimiento el 29/01/2027	12.529
Nederlandse Waterschapsbank NV, 4,500 %, con vencimiento el 18/06/2025	10.887
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,875 %, con vencimiento el 18/07/2024	7.039
Nederlandse Waterschapsbank NV, 4,500 %, con vencimiento el 18/06/2025	6.233
Exxon Mobil Corp, 0,142 %,, con vencimiento el26/06/2024	6.157
Charles Schwab Corp. (The), 1,950 %, 02/12/2031	5.813
Nykredit Realkredit AS, 0,250 %, con vencimiento el 13/01/2026	5.587
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2033	5.302
American Express Co, 4,900 %,, con vencimiento el13/02/2026	5.213
NIKE Inc, 2,400 %, con vencimiento el 27/03/2025	5.171
United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, con vencimiento el 15/02/2030	4.632
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3,375 %, con vencimiento el 24/08/2031	3.929
Verizon Communications Inc, 4,329 %, con vencimiento el 21/09/2028	3.816
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, con vencimiento el 31/08/2028	3.646
Westpac Banking Corp, 0,625 %, con vencimiento el 22/11/2024	3.188

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 0,375 %, con vencimiento el 15/04/2024	17.889
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 0,250 %, con vencimiento el 31/08/2025	9.704
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, con vencimiento el 15/08/2028	8.312
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	6.258
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	5.986
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	5.156
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 1,375 %, con vencimiento el 31/10/2028	5.071

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 1,125 %, con vencimiento el 28/02/2025	15.827
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 0,250 %, con vencimiento el 31/08/2025	8.846
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 0,375 %, con vencimiento el 15/04/2024	6.724
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	6.231
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	5.993
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	5.182
United States Treasury Note/Bond, 0,125 %, con vencimiento el 30/06/2023	4.716
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	4.357

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

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado) *(continuación)*

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^ (continuación)

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
United States Treasury Note/Bond, 0,125 %, con vencimiento el 30/06/2023	4.706
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	4.407
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.676
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.595
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.569
Ginnie Mae, 30 años, TBA, cupón cero	3.553
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.394
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.326
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.275
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.256
Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Clase LM	3.204
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.190
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	2.946

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, con vencimiento el 15/08/2028	4.186
Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Clase LM	3.752
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.660
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.576
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.562
Ginnie Mae, 30 años, TBA, cupón cero	3.553
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.350
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.333
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 1,375 %, con vencimiento el 31/10/2028	3.324
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.244
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.229
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.196

FTGF Western Asset Global Credit Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	16.061
JPMorgan Chase & Co, 0,389 %, con vencimiento el 24/02/2028	607
Morgan Stanley, 4,656 %, vencimiento 02/03/2029	581
McDonald's Corp, 5,450 %, con vencimiento el 14/08/2053	379
Danske Bank A/S, 4,750 %, con vencimiento el 21/06/2030	367
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, con vencimiento el 15/08/2031	357
Thales SA, 4,125 %, con vencimiento el 18/10/2028	317
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2033	285
Bank of America Corp, 1,662 %, con vencimiento el 25/04/2028	284
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, con vencimiento el 15/02/2029	284
Citigroup Inc, 4,125 %, con vencimiento el 15/05/2031	284
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 7,375 %, con vencimiento el 15/09/2029	271
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, con vencimiento el 15/02/2031	254
Société Générale SA, 5,750 %, con vencimiento el 22/01/2032	254
CRH SMW Finance DAC, 4,000 %, con vencimiento el 11/07/2031	250
Wells Fargo & Co, 5,389 %, con vencimiento el 24/04/2034	250
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, con vencimiento el 15/08/2029	249
Vodafone Group Plc, 8,000 % vencimiento el 30/08/2086	246
BNP Paribas SA, 144A, 5,176 %, con vencimiento el 09/01/2030	240
UBS Group AG, 1,305 %, 02/02/2027	229

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	16.551
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, con vencimiento el 15/08/2029	647
CDBL Funding 182, 0,000 %, con vencimiento el 10/10/2025	569
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, con vencimiento el 15/08/2031	518
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, con vencimiento el 15/02/2029	516
Banco Santander SA, 1,750 %, con vencimiento el 17/02/2027	430
BNP Paribas SA, 1,875 %, con vencimiento el 14/12/2027	430
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, con vencimiento el 15/02/2027	418
NatWest Group Plc, 3,754 %, con vencimiento el 01/11/2029	398
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, con vencimiento el 15/11/2052	390
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, con vencimiento el 01/06/2041	387
Stellantis NV, 5,250 %, con vencimiento el 15/04/2023	360
Danske Bank A/S, 1,375 %, con vencimiento el 12/02/2030	359
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, con vencimiento el 30/04/2028	345
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, con vencimiento el 15/05/2052	336
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 2,000 %, con vencimiento el 15/11/2026	328
Suzano Austria GmbH, 7,000 %, con vencimiento el 16/03/2047	303
AT&T Inc, Serie B, 2,875 %, Perpetuo	300
HSBC Holdings Plc, 5,875 %, Perpetuo	291
Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, con vencimiento el 01/10/2024	290

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	1.357.026
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	115.959
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	114.318
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,625 %, con vencimiento el 31/03/2028	101.356
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	97.556
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 15/05/2053	88.311
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	79.123
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	75.984
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 31/05/2028	72.352
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2053	71.234
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	68.887
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	68.002
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	65.199
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	59.201
Freddie Mac Pool, 6,000 %, con vencimiento el 01/07/2053	58.165
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	57.983
Fannie Mae Pool, 5,500 %, con vencimiento el 01/08/2053	57.413
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	57.159
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	54.592
United States Treasury Note/Bond, 3,750 %, con vencimiento el 31/05/2030	54.085
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	53.189
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	50.981
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 31/08/2030	49.629
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	48.125
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, con vencimiento el 30/04/2028	42.250

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	1.333.612
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 %	115.959
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	114.318
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,625 %, con vencimiento el 31/03/2028	101.058
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	97.577
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 15/05/2053	83.295
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	79.176
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	77.464
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 31/05/2028	72.115
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	69.851
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	67.956
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	65.013
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	58.377
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	58.176
Freddie Mac Pool, 6,000 %, con vencimiento el 01/07/2053	57.795
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	57.420
Fannie Mae Pool, 5,500 %, con vencimiento el 01/08/2053	56.905
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, con vencimiento el 15/11/2052	56.779
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	56.017
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2053	55.265
United States Treasury Note/Bond, 3,750 %, con vencimiento el 31/05/2030	54.317
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	52.936
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	51.815
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 31/08/2030	49.643

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

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado) *(continuación)*

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 5,000 %, con vencimiento el 31/10/2025	6.020
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,500 %	3.466
Mexican Bonos, Serie M, 8,500 %, con vencimiento el 31/05/2029	2.489
Accelerate360 Holdings LLC, 144A, 8,000 %, con vencimiento el 01/03/2028	1.905
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 01/02/2031	1.880
Occidental Petroleum Corp, 7,950 %, con vencimiento el 15/06/2039	1.867
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, con vencimiento el 01/06/2031	1.679
Comerica Bank, 2,500 %, con vencimiento el 23/07/2024	1.597
American News Co LLC, 144A, 8,500 %, con vencimiento el 01/09/2026	1.557
DCert Buyer, Inc., 12,333 %, con vencimiento el 16/02/2029	1.549
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 01/03/2026	1.536
Caesars Entertainment Inc, 144A, 6,500 %, con vencimiento el 15/02/2032	1.480
CSC Holdings LLC, 144A, 11,250 %, con vencimiento el 15/05/2028	1.456
SilverBow Resources Inc, 144A, 13,135 %, con vencimiento el 15/12/2028	1.450
Triumph Group Inc, 144A, 9,000 %, con vencimiento el 15/03/2028	1.432
Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, con vencimiento el 15/02/2031	1.389
Inter-American Development Bank, 7,350 %, con vencimiento el 06/10/2030	1.384
Bono Internacional del Estado de Costa de Marfil, 144A, 7,625 %, con vencimiento el 30/01/2033	1.384
CSC Holdings LLC, 144A, 11,750 %, con vencimiento el 31/01/2029	1.382
Ford Motor Co, 3,250 %, con vencimiento el 12/02/2032	1.372

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 5,000 %, con vencimiento el 31/10/2025	3.948
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,500 %	3.526
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,500 %	2.383
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 01/03/2026	2.198
Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR59, 7,000 %, con vencimiento el 15/05/2027	1.936
Ford Motor Co, 6,100 %, con vencimiento el 19/08/2032	1.845
UBS Group AG, 144A, 7,000 %, Perpetuo	1.820
Comerica Bank, 2,500 %, con vencimiento el 23/07/2024	1.652
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 4,125 %, con vencimiento el 31/10/2027	1.605
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 20/01/2026	1.472
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, con vencimiento el 01/06/2031	1.441
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	1.365
Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 5,625 %, con vencimiento el 01/12/2025	1.305
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 7,375 %, con vencimiento el 01/03/2031	1.293
TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/03/2026	1.288
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	1.259
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/10/2027	1.240
Hilton USA Trust 2018-THPT, Serie 2018 THL, Clase D, 144A, 8,824 %, con vencimiento el 11/11/2034	1.215
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, con vencimiento el 15/09/2031	1.206
Hardee's Funding LLC, Serie 2020 1A, Clase A2, 144A, 3,981 %, con vencimiento el 20/12/2050	1.199

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	140.938
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, cupón cero, con vencimiento el 15/06/2035	28.546
280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust, Serie 2017 280P, Clase F, 144A, 8,449 %, con vencimiento el 15/09/2034	5.248
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	4.985
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 5,000 %	4.711
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	4.492
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	4.090
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	3.801
Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Clase A3, 144A, 6,319 %, con vencimiento el 25/05/2068	3.620
BRAVO Residential Funding Trust 2024-NQM2, Serie 2024 NQM2, Clase M1, 144A, 6,819 %, con vencimiento el 25/02/2064	3.500
Chase Mortgage Finance Trust Serie 2007-A1, Serie 2007 A1, Clase 11M1, 4,321 %, con vencimiento el 25/03/2037	3.199
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,500 %	2.963
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, cupón cero	2.898
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1, Serie 2015 JP1, Clase C, 4,723 %, con vencimiento el 15/01/2049	2.880
Eagle RE 2023-1 Ltd, Serie 2023 1, Clase M2, 144A, 10,522 %, con vencimiento el 26/09/2033	2.780
Verus Securitization Trust 2024-1, Serie 2024 1, Clase B1, 144A, 7,909 %, con vencimiento el 25/01/2069	2.750
GS Mortgage Securities Trust 2015-GC28, Serie 2015 GC28, Clase D, 144A, 4,306 %, con vencimiento el 10/02/2048	2.732
Morgan Stanley Capital I Trust 2016-BNK2, Serie 2016 BNK2, Clase B, 3,485 %, con vencimiento el 15/11/2049	2.732
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, Serie 2014 GC23, Clase C, 4,420 %, con vencimiento el 10/07/2047	2.717
Verus Securitization Trust 2023-4, Serie 2023 4, Clase B1, 144A, 8,195 %, con vencimiento el 25/05/2068	2.640

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	136.650
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Serie 2018 PHMZ, Clase M, 144A, 13,096 %, con vencimiento el 15/06/2035	28.546
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	4.983
Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Serie 2019 DNA3, Clase B1, 144A, 7,867 %, con vencimiento el 25/07/2049	4.854
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 5,000 %	4.705
CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Clase B6, 144A, 3,591 %, con vencimiento el 25/02/2048	4.629
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	4.478
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C06, Clase 1B1, 8,767 %, con vencimiento el 25/02/2030	4.288
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C06, Clase 1B1, 9,186 %, con vencimiento el 25/03/2031	4.156
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	4.093
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	3.807
PMT Credit Risk Transfer Trust 2021-1R, Serie 2021 1R, Clase A, 144A, 8,358 %, con vencimiento el 27/02/2024	3.690
BHMS 2018-MZB, Serie 2018 MZB, Clase MZB, 144A, 12,251 %, con vencimiento el 15/07/2025	3.511
Freddie Mac STACR Debt Notes 2017-DNA2, Serie 2017 DNA2, Clase B2, 16,686 %, con vencimiento el 25/10/2029	3.476
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C07, Clase 1B1, 9,436 %, con vencimiento el 25/05/2030	3.436
Nomura Resecuritization Trust 2015-4R, Serie 2015 4R, Clase 4A7, 144A, 3,662 %, con vencimiento el 26/03/2037	3.383
CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Clase B5, 144A, 3,591 %, con vencimiento el 25/02/2048	3.087
FRESB 2018-SB48 Mortgage Trust, Serie 2018 SB48, Clase B, 144A, 4,358 %, con vencimiento el 25/02/2038	3.024
Seasoned Credit Risk Transfer Trust Serie 2017-3, Serie 2017 3, Clase M2, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 25/07/2056	2.983
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 4,500 %	2.943

FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	248.095
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	66.691
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	47.321
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	42.326
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	41.173
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	39.103
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	37.520
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	36.733
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	35.533
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	35.424
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 %	35.290
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	34.077
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 3,000 %	31.475

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	231.747
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	66.838
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	47.613
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	42.065
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	41.208
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	38.752
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	37.257
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	37.035
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	35.550
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	35.425
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 %	35.321
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	33.838
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 3,000 %	31.475

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

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado) *(continuación)*

FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^ (continuación)

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,500 %	31.202
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	30.716
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	30.634
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,000 %	28.230
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	27.138
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	26.824
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,500 %	26.446
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	25.892
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	25.838
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 5,000 %	25.211
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 %	24.658

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,500 %	31.208
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	30.791
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 0,000 %	30.498
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 2,000 %	27.976
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 2,500 %	27.004
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 %	26.971
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	26.906
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 3,500 %	26.453
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	25.909
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 0,000 %	25.610
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 5,000 %	25.325
Fannie Mae o Freddie Mac, 30 años, TBA, 5,000 %	23.701

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) GPB
United Kingdom Gilt, 1,250 %, con vencimiento el 22/07/2027	453
Intesa Sanpaolo SpA, 6,500 %, con vencimiento el 14/03/2029	359
Tesco Corporate Treasury Services Plc, 1,875 %, con vencimiento el 02/11/2028	354
Engie SA, 5,625 %, con vencimiento el 03/04/2053	296
United Kingdom Gilt, 4,250 %, con vencimiento el 07/12/2027	267
Ford Motor Credit Co LLC, 6,860 %, con vencimiento el 05/06/2026	217
ABN AMRO Bank NV, 5,250 %, con vencimiento el 26/05/2026	199
United Kingdom Gilt, 0,375 %, con vencimiento el 22/10/2026	198
United Kingdom Gilt, 1,500 %, con vencimiento el 22/07/2026	196
CPUK Finance Ltd, 5,876 %, con vencimiento el 28/08/2027	190
Northern Gas Networks Finance Plc, 6,125 %, con vencimiento el 02/06/2033	179
United Kingdom Gilt, 4,250 %, con vencimiento el 07/12/2040	178
United Kingdom Gilt, 0,500 %, con vencimiento el 31/01/2029	176
HSBC Holdings Plc, 6,332 %, con vencimiento el 09/03/2044	167
Cadent Finance Plc, 5,750 %, con vencimiento el 14/03/2034	150
United Utilities Water Finance Plc, 5,125 %, con vencimiento el 06/10/2038	139
United Kingdom Gilt, 1,625 %, con vencimiento el 22/10/2028	122
Weir Group Plc/The, 6,875 %, con vencimiento el 14/06/2028	110
NatWest Group Plc, 3,619 %, con vencimiento el 29/03/2029	106
National Gas Transmission Plc, 5,750 %, con vencimiento el 05/04/2035	100
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 15/05/2053	73

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) GPB
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 6,000 %, con vencimiento el 07/12/2028	987
Banco Europeo de Inversiones, 1,375 %, con vencimiento el 07/03/2025	769
Banco Europeo de Inversiones, 3,750 %, con vencimiento el 07/12/2027	651
Banco Santander SA, 2,250 %, con vencimiento el 04/10/2032	648
Wells Fargo & Co, 4,875 %, con vencimiento el 29/11/2035	530
Lloyds Bank Plc, 7,625 %, con vencimiento el 22/04/2025	520
UBS Group AG, VAR, con vencimiento el 03/11/2028	520
Verizon Communications Inc, 1,875 %, con vencimiento el 19/09/2030	456
United Kingdom Gilt, 1,250 %, con vencimiento el 22/07/2027	454
DNB Bank ASA, 4,000 %, con vencimiento el 17/08/2027	449
British Land Co Plc/The, 2,375 %, con vencimiento el 14/09/2029	448
Barclays Plc, 3,250 %, con vencimiento el 12/07/2027	443
Annington Funding Plc, 4,750 %, con vencimiento el 09/08/2033	435
Leeds Building Society, 1,375 %, con vencimiento el 06/10/2027	432
Santander UK Group Holdings Plc, 2,920 %, con vencimiento el 08/05/2026	413
BPCE SA, 2,500 %, con vencimiento el 30/11/2032	407
Whitbread Group Plc, 2,375 %, con vencimiento el 31/05/2027	406
E.ON International Finance BV, 6,125 %, con vencimiento el 06/07/2039	387
Credit Agricole SA, 4,875 %, con vencimiento el 23/10/2029	376
Derwent London Plc, 1,875 %, con vencimiento el 17/11/2031	376

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	35.559
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, con vencimiento el 15/05/2033	1.820
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2033	1.053
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,625 %, con vencimiento el 15/02/2053	1.032
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 15/05/2053	1.010
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2033	681
ABN AMRO Bank NV, 6,339 %, con vencimiento el 18/09/2027	500
Credit Suisse AG/New York NY, 1,000 %, con vencimiento el 05/05/2023	490
HSBC Holdings Plc, 6,254 %, con vencimiento el 09/03/2034	460
HEICO Corp, 5,250 %, con vencimiento el 01/08/2028	459
Bank of America Corp, 2,972 %, con vencimiento el 04/02/2033	446
HCA Inc, 5,500 %, con vencimiento el 01/06/2033	420
Bank of America Corp, 5,288 %, vencimiento 25/04/2034	410
Electricite de France SA, 6,250 %, con vencimiento el 23/05/2033	400
Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,750 %, con vencimiento el 19/05/2033	395
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, con vencimiento el 26/06/2024	390
Morgan Stanley Bank NA, 4,754 %, con vencimiento el 21/04/2026	390
United Airlines 2023-1 Clase A Pass Through Trust, 5,800 %, con vencimiento el 15/01/2036	390
ONEOK Inc, 6,050 %, con vencimiento el 01/09/2033	370
Morgan Stanley, 5,449 %, con vencimiento el 20/07/2029	360

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	35.559
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, con vencimiento el 15/05/2033	1.811
Credit Suisse AG/New York NY, 1,000 %, con vencimiento el 05/05/2023	1.250
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2033	1.099
Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, con vencimiento el 12/02/2026	1.020
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,625 %, con vencimiento el 15/02/2053	992
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 15/05/2053	982
Credit Suisse AG/New York NY, 0,520 %, con vencimiento el 09/08/2023	930
Bank of America Corp, 0,981 %, con vencimiento el 25/09/2025	891
Enel Finance International NV, 144A, 6,800 %, con vencimiento el 14/10/2025	846
ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 29/04/2025	809
Citigroup Inc, 0,981 %, con vencimiento el 01/05/2025	793
Morgan Stanley, 0,985 %, vencimiento 10/12/2026	741
JPMorgan Chase & Co, 5,546 %, con vencimiento el 15/12/2025	709
Amgen Inc, 5,250 %, con vencimiento el 02/03/2033	690
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2033	681
Danske Bank A/S, 144A, 6,466 %, con vencimiento el 09/01/2026	680
Danske Bank A/S, 144A, 4,298 %, con vencimiento el 01/04/2028	669
Regal Rexnord Corp, 144A, 6,050 %, con vencimiento el 15/02/2026	622
Mexican Bonos, Series M, 8,500 %, con vencimiento el 18/11/2038	619

Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	5.579
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,625 %, con vencimiento el 31/03/2028	938
United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, con vencimiento el 15/11/2053	748
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 31/08/2030	686
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 15/05/2053	582
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, con vencimiento el 30/04/2028	470
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, con vencimiento el 31/01/2031	328
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, con vencimiento el 30/11/2030	280
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, con vencimiento el 28/02/2031	279

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	6.788
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,625 %, con vencimiento el 31/03/2028	801
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 31/08/2030	687
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, con vencimiento el 30/04/2028	470
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, con vencimiento el 30/11/2030	281
United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, con vencimiento el 31/12/2027	237
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, con vencimiento el 31/01/2031	216
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 %	199
Ameriquest Mortgage Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Ctf Ser 2004-R10, Serie 2004 R10, Clase M6, 6,672 %, con vencimiento el 25/11/2034	198

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

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado) *(continuación)*

Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^ (continuación)

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Bonos Indexados de Inflación de Estaos Unidos, 1,125 %, con vencimiento el 15/01/2033	266
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,625 %, con vencimiento el 31/03/2030	250
Inter-American Development Bank, 7,350 %, con vencimiento el 06/10/2030	241
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2053	236
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 4,000 %, con vencimiento el 31/07/2030	209
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 %	197
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 %	197
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,625 %, con vencimiento el 15/02/2053	175
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, con vencimiento el 15/08/2043	157
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2015 C03, Clase 1M2, 10,436 %, con vencimiento el 25/07/2025	141
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, con vencimiento el 15/02/2054	108

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 %	197
United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, con vencimiento el 29/02/2028	185
Bono del Tesoro de Indonesia, Serie FR87, 6,500 %, con vencimiento el 15/02/2031	172
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, con vencimiento el 15/02/2051	163
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, con vencimiento el 15/08/2043	160
United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, con vencimiento el 15/11/2053	139
Bonos Indexados de Inflación de Estaos Unidos, 1,125 %, con vencimiento el 15/01/2033	123
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, con vencimiento el 21/07/2023	119
Bono Federal Ruso – OFZ, 0,000 %, con vencimiento el 23/05/2029	105
Ginnie Mae II Pool 'MA8490', 5,000 %, con vencimiento el 20/12/2052	100
Ginnie Mae, 30 años, TBA, 5,000 %	100

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	2.987
European Investment Bank, 0,050 %, con vencimiento el 15/11/2029	401
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, con vencimiento el 15/05/2033	381
European Investment Bank, 3,750 %, con vencimiento el 14/02/2033	303
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, con vencimiento el 15/08/2031	264
McDonald's Corp, 5,450 %, con vencimiento el 14/08/2053	189
Tesco Corporate Treasury Services Plc, 1,875 %, con vencimiento el 02/11/2028	115
E.ON SE, 3,750 %, con vencimiento el 01/03/2029	108
Danske Bank A/S, 4,750 %, con vencimiento el 21/06/2030	108
Intesa Sanpaolo SpA, 5,125 %, con vencimiento el 29/08/2031	108
Bouygues SA, 3,875 %, con vencimiento el 17/07/2031	107
Morgan Stanley,VAR, 4,656 %, con vencimiento el 02/03/2029	106
Pandora A/S, 4,500 %, con vencimiento el 10/04/2028	106
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,625 %, con vencimiento el 15/02/2053	102
Banco Santander SA, 1,125 %, con vencimiento el 17/01/2025	102
NatWest Markets Plc, 2,000 %, con vencimiento el 27/08/2025	102
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, con vencimiento el 15/02/2028	99
Bank of America Corp, 1,662 %, con vencimiento el 25/04/2028	98
UBS Group AG, 1,000 %, con vencimiento el 24/06/2027	95
BNP Paribas SA, 0,500 %, con vencimiento el 30/05/2028	92
European Investment Bank, 3,750 %, con vencimiento el 15/06/2032	91
T-Mobile USA Inc, 1,500 %, con vencimiento el 15/06/2054	90
European Investment Bank, 3,750 %, con vencimiento el 13/11/2037	83
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, con vencimiento el 15/05/2053	70

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	3.017
European Investment Bank, 0,050 %, con vencimiento el 15/11/2029	406
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, con vencimiento el 15/05/2033	378
European Investment Bank, 3,750 %, con vencimiento el 14/02/2033	291
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, con vencimiento el 15/08/2031	265
UBS Group AG, 1,500 %, con vencimiento el 30/11/2024	210
Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 12/01/2024	199
HSBC Holdings Plc, 4,950 %, con vencimiento el 31/03/2030	195
Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 10/04/2027	194
BNP Paribas SA, 144A, 3,052 %, con vencimiento el 13/01/2031	194
Cooperatieve Rabobank UA, 3,250 %, Perpetuo	187
McDonald's Corp, 5,450 %, con vencimiento el 14/08/2053	187
Standard Chartered Plc, 2,608 %, con vencimiento el 12/01/2028	179
GELF Bond Issuer I SA, 1,125 %, con vencimiento el 18/07/2029	178
Allianz SE, 3,200 %, Perpetuo	150
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, con vencimiento el 01/06/2032	149
Enel Finance International NV, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 07/10/2039	142
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 2,000 %, con vencimiento el 15/02/2025	135
Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, con vencimiento el 01/10/2024	129
AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, con vencimiento el 30/01/2032	124

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	86.639
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2033	35.039
Bono del Estado de Australia, Serie 137, 2,750 %, con vencimiento el 21/04/2024	12.716
Bono del Estado de Noruega, Serie 476, 144A, 3,000 %, con vencimiento el 14/03/2024	11.811
United Kingdom Gilt, 1,250 %, con vencimiento el 31/07/2051	11.539
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 5,492 %, con vencimiento el 31/07/2025	11.182
German Treasury Bill, 0,000 %, con vencimiento el 20/09/2023	9.094
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 5,501 %, con vencimiento el 31/10/2025	8.753
United Kingdom Gilt, 3,250 %, con vencimiento el 31/01/2033	8.316
Colombian TES, Serie B, 9,250 %, con vencimiento el 28/05/2042	7.395
International Bank for Reconstruction & Development, 2,500 %, con vencimiento el 25/11/2024	7.159
Bono internacional del Estado de Indonesia, 0,750 %, con vencimiento el 25/05/2053	6.697
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2053	6.255
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 5,125 %, con vencimiento el 29/09/2025	6.191
Bono del Tesoro alemán, cupón cero, con vencimiento el 17/04/2024	5.897
Mexican Bonos, Serie MS, 8,000 %, con vencimiento el 24/05/2035	5.766
German Treasury Bill, 0,000 %, con vencimiento el 31/03/2025	5.287
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025	4.388
Bono Internacional del Estado de Chile, 4,950 %, con vencimiento el 05/01/2036	3.285
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,250 %, con vencimiento el 19/10/2023	2.448

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	84.043
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 1,875 %, con vencimiento el 15/11/2051	17.975
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,250 %, con vencimiento el 19/10/2023	11.250
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 5,538 %, con vencimiento el 31/07/2025	11.182
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 3,334 %, con vencimiento el 31/07/2024	10.711
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, con vencimiento el 15/08/2032	9.086
Bonos del Tesoro coreano, Serie 4412, 2,750 %, 10/12/2044	9.008
German Treasury Bill, 0,000 %, con vencimiento el 20/09/2023	8.981
Colombian TES, Series B, 6,000 %, con vencimiento el 28/04/2028	8.416
United Kingdom Gilt, 3,250 %, con vencimiento el 31/01/2033	7.891
Bono del Estado de la República de Polonia, Serie 0432, 1,750 %, con vencimiento el 25/04/2032	7.884
United Kingdom Gilt, 0,750 %, con vencimiento el 22/07/2023	7.223
Bono internacional del Estado de Indonesia, 0,750 %, con vencimiento el 25/05/2053	6.839
Bono del Estado de Australia, Serie 137, 2,750 %, con vencimiento el 21/04/2024	6.635
Bono del Estado de Noruega, Serie 476, 144A, 3,000 %, con vencimiento el 14/03/2024	6.326
Bono del Estado de Noruega, Serie 475, 144A, 2,000 %, con vencimiento el 24/05/2023	5.833
Mexican Bonos, Series M, 8,500 %, con vencimiento el 18/11/2038	5.745
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, con vencimiento el 15/02/2052	5.682
Mexican Bonos, Serie M, 8,500 %, con vencimiento el 31/05/2029	5.485
German Treasury Bill, 0,000 %, con vencimiento el 17/01/2024	5.468

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

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado) *(continuación)*

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund (continuación)

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Provincia de Manitoba (Canadá), 2,450 %, con vencimiento el 02/06/2025	4.619
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025	4.387
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2033	4.259
Goldman Sachs USD Liquid Reserves Fund – Clase Institucional	4.256
Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, con vencimiento el 07/11/2047	4.237
Colombian TES, Serie B, 9,250 %, con vencimiento el 28/05/2042	3.215
International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, con vencimiento el 22/01/2026	2.952

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	265.123
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025	55.362
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 5,418 %, con vencimiento el 30/04/2025	54.401
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 2,750 %, con vencimiento el 15/08/2032	26.004
Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2033	22.551
Colombian TES, Serie B, 9,250 %, con vencimiento el 28/05/2042	12.379
United Kingdom Gilt, 1,250 %, con vencimiento el 31/07/2051	11.502
General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, con vencimiento el 06/04/2026	11.316
Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, con vencimiento el 20/05/2053	9.137
Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2053	9.118
Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, con vencimiento el 18/05/2026	9.111
Ginnie Mae II Pool 'MA9171', 5,500 %, con vencimiento el 20/09/2053	7.515
Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000 %, con vencimiento el 20/06/2053	6.707
Bono del Estado de la República de Sudáfrica, Serie 2048, 8,750 %, con vencimiento el 28/02/2048	6.604
Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500 %, con vencimiento el 20/06/2053	5.296
Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500 %, con vencimiento el 20/02/2053	5.046
Petroleos Mexicanos, 6,950 %, con vencimiento el 28/01/2060	4.602
Ginnie Mae II Pool 'MA9306', 6,000 %, con vencimiento el 20/11/2053	4.466
Ginnie Mae II Pool 'MA9106', 5,500 %, con vencimiento el 20/08/2053	1.703
Colombian TES, Series B, 7,250 %, con vencimiento el 26/10/2050	1.237

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	257.032
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 2,750 %, con vencimiento el 15/08/2032	118.763
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025	59.092
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 3,334 %, con vencimiento el 31/07/2024	46.137
Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2033	34.368
Goldman Sachs USD Liquid Reserves Fund – Clase Institucional	31.630
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 5,418 %, con vencimiento el 30/04/2025	31.300
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2031	31.072
Bono del Estado de la República de Polonia, Serie 0432, 1,750 %, con vencimiento el 25/04/2032	26.079
Colombian TES, Serie B, 9,250 %, con vencimiento el 28/05/2042	23.363
Bono del Estado de Perú, 6,150 %, con vencimiento el 12/08/2032	21.672
Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, con vencimiento el 31/07/2053	18.794
Colombian TES, Series B, 7,250 %, con vencimiento el 26/10/2050	17.556
Bono del Estado de la República de Sudáfrica, Serie 2048, 8,750 %, con vencimiento el 28/02/2048	15.610
Commonwealth Bank of Australia, 144A, 6,094 %, con vencimiento el 14/03/2025	12.791
Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	12.736
Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	11.007
Bono del Estado de Nueva Zelanda, Serie 0551, 2,750 %, con vencimiento el 15/05/2051	10.860
Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207 %, con vencimiento el 22/11/2024	10.651
COMM 2017-COR2 Mortgage Trust, Serie 2017 COR2, Clase A3, 3,510 %, con vencimiento el 10/09/2050	10.608

FTGF Brandywine Global High Yield Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	22.763
Valvoline Inc, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 15/02/2030	1.256
Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 01/06/2028	1.137
Petroleos Mexicanos, 5,950 %, con vencimiento el 28/01/2031	1.048
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,000 %, con vencimiento el 15/04/2024	1.046
Cargo Aircraft Management Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2028	999
Sabre GLBL Inc, 144A, 9,250 %, con vencimiento el 15/04/2025	945
Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 01/02/2029	944
Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 01/05/2029	928
IRB Holding Corp, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/06/2025	899
Uber Technologies Inc, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 15/05/2025	870
FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 01/01/2030	791
Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 01/10/2026	774
TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/03/2026	766
Vector Group Ltd, 144A, 10,500 %, con vencimiento el 01/11/2026	701
Lindblad Expeditions LLC, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 15/02/2027	698
Arko Corp, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 15/11/2029	680
Athabasca Oil Corp, 144A, 9,750 %, con vencimiento el 01/11/2026	666
Walgreens Boots Alliance Inc, 3,800 %, con vencimiento el 18/11/2024	655
PRA Group Inc, 144A, 5,000 %, con vencimiento el 01/10/2029	652

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	22.046
Cargo Aircraft Management Inc, 144A, 4,750 %, con vencimiento el 01/02/2028	1.142
Uber Technologies Inc, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 15/05/2025	1.026
Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp, 144A, 4,875 %, con vencimiento el 01/05/2029	866
Arko Corp, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 15/11/2029	790
Petroleos Mexicanos, 5,950 %, con vencimiento el 28/01/2031	725
Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125 %, con vencimiento el 01/06/2028	695
LCPR Secured Financing DAC, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 15/10/2027	682
FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 01/01/2030	671
Minerva Luxembourg SA, 144A, 8,875 %, con vencimiento el 13/09/2033	657
Allwyn Entertainment Financing UK Plc, 7,250 %, con vencimiento el 30/04/2030	650
Station Casinos LLC, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 01/12/2031	636
Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, con vencimiento el 15/05/2025	629
ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2028	627
Sabre GLBL Inc, 144A, 7,375 %, con vencimiento el 01/09/2025	611
Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 01/10/2026	602
Lindblad Expeditions Holdings Inc, 144A, 9,000 %, con vencimiento el 15/05/2028	600
Travel + Leisure Co, 144A, 6,625 %, con vencimiento el 31/07/2026	596
Sabre GLBL Inc, 144A, 9,250 %, con vencimiento el 15/04/2025	591
Nordstrom Inc, 4,250 %, con vencimiento el 01/08/2031	584

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

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado) *(continuación)*

FFTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	134.207
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2033	60.329
Bono del Estado de Australia, Serie 137, 2,750 %, con vencimiento el 21/04/2024	29.444
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 5,501 %, con vencimiento el 31/10/2025	25.192
Bono del Estado de Noruega, Serie 476, 144A, 3,000 %, con vencimiento el 14/03/2024	22.920
United Kingdom Gilt, 3,250 %, con vencimiento el 31/01/2033	22.323
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025	21.069
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 4,353 %, con vencimiento el 31/07/2025	19.829
United Kingdom Gilt, 1,250 %, con vencimiento el 31/07/2051	15.591
German Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 20/09/2023	15.436
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2033	11.908
Bono del Tesoro alemán, cupón cero, con vencimiento el 17/04/2024	9.477
Bono del Estado de la República Francesa OAT, 1,886 %, con vencimiento el 25/05/2053	8.590
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2053	8.507
German Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 17/01/2024	8.036
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, con vencimiento el 15/02/2052	7.192
Bono del Estado de Canadá, 2,000 %, con vencimiento el 01/09/2023	4.561
Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2033	3.577
Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, con vencimiento el 31/07/2053	3.338
Bono del Estado de Nueva Zelanda, 0,632 %, 15/05/2024	2.876

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	130.627
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025	32.770
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2033	22.563
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 4,353 %, con vencimiento el 31/07/2025	19.825
Bono del Estado de Australia, Serie 137, 2,750 %, con vencimiento el 21/04/2024	19.749
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, con vencimiento el 15/02/2052	17.472
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 5,501 %, con vencimiento el 31/10/2025	17.087
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 1,875 %, con vencimiento el 15/11/2051	16.082
German Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 20/09/2023	15.182
Bono del Estado de Noruega, Serie 476, 144A, 3,000 %, con vencimiento el 14/03/2024	13.848
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, con vencimiento el 15/08/2032	10.807
Bonos del Tesoro coreano, Serie 3106, 2,000 %, con vencimiento el 10/06/2031	10.611
United Kingdom Gilt, 3,250 %, con vencimiento el 31/01/2033	10.434
Bono del Estado de la República de Polonia, Serie 0432, 1,750 %, con vencimiento el 25/04/2032	9.640
Bono del Estado de la República Francesa OAT, 1,886 %, con vencimiento el 25/05/2053	8.759
German Treasury Bill, cupón cero, con vencimiento el 17/01/2024	8.239
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 3,334 %, con vencimiento el 31/07/2024	7.073
Mexican Bonos, Serie M, 8,500 %, con vencimiento el 31/05/2029	6.869
Bono del Estado de Canadá, 2,000 %, con vencimiento el 01/09/2023	6.410
United Kingdom Gilt, 1,250 %, con vencimiento el 31/07/2051	5.644
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 1,875 %, con vencimiento el 15/02/2032	4.859

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	829.015
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025	227.318
United Kingdom Gilt, 3,750 %, con vencimiento el 22/10/2053	97.663
Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, con vencimiento el 31/07/2053	59.076
Mexican Bonos, Series M, 7,500 %, con vencimiento el 26/05/2033	39.916
International Bank for Reconstruction & Development, 4,625 %, con vencimiento el 01/08/2028	38.575
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,375 %, con vencimiento el 18/07/2025	37.616
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2033	35.584
International Bank for Reconstruction & Development, 0,500 %, con vencimiento el 28/10/2025	34.432
Bono del Estado de España, 144A, 1,900 %, con vencimiento el 31/10/2052	34.324
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2027	27.584
Goldman Sachs USD Liquid Reserves Fund – Clase Institucional	23.883
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2,125 %, 07/08/2023	23.248
Bono del Estado de Perú, 6,150 %, con vencimiento el 12/08/2032	22.929
Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2053	20.748
Colombian TES, Series B, 7,250 %, con vencimiento el 26/10/2050	20.320
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,250 %, 08/03/2024	19.029
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2,625 %, con vencimiento el 28/02/2024	18.813
Colombian TES, Series B, 7,000 %, con vencimiento el 26/03/2031	17.776
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2053	16.747

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	808.554
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025	227.312
Goldman Sachs USD Liquid Reserves Fund – Clase Institucional	109.237
Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, con vencimiento el 31/07/2053	74.810
Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2033	57.129
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,500 %, con vencimiento el 15/02/2033	33.298
United Kingdom Gilt, 3,750 %, con vencimiento el 22/10/2053	31.802
Colombian TES, Series B, 7,000 %, con vencimiento el 26/03/2031	28.599
Ginnie Mae II Pool 'MA8646', 4,500 %, con vencimiento el 20/02/2053	23.647
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2,125 %, 07/08/2023	23.315
Bono del Estado de Perú, 6,150 %, con vencimiento el 12/08/2032	20.739
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,800 %, con vencimiento el 15/08/2053	20.600
Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	20.519
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 0,250 %, 08/03/2024	19.670
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA2, Serie 2021 DNA2, Clase M2, 144A, 7,622 %, con vencimiento el 25/08/2033	19.391
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 2,625 %, con vencimiento el 28/02/2024	19.137
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, con vencimiento el 15/08/2053	17.523
Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 01/03/2025	15.707
Bono del Estado de España, 3,550 %, con vencimiento el 31/10/2033	14.505
Towd Point Mortgage Trust 2018-2, serie 2018 2, clase B1, 144A, 3,480 %, con vencimiento el 25/03/2058	13.291

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	26.757
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025	9.515
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 5,543 %, con vencimiento el 31/07/2025	4.727
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 5,418 %, con vencimiento el 30/04/2025	3.884
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, serie 2020 DNA3, clase B1, 144A, 10,536 %, con vencimiento el 25/06/2050	2.008
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, serie 2020 DNA3, clase B1, 144A, 10,367 %, con vencimiento el 25/07/2050	1.659
Home RE 2023-1 Ltd, Serie 2023 1, Clase M2, 144A, 11,322 %, con vencimiento el 25/10/2033	1.060
PDC Energy Inc, 5,750 %, con vencimiento el 15/05/2026	1.030

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	25.493
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025	9.516
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 5,538 %, con vencimiento el 31/07/2025	4.727
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 5,418 %, con vencimiento el 30/04/2025	3.882
Goldman Sachs USD Liquid Reserves Fund – Clase Institucional	2.216
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC15, Serie 2013 GC15, Clase C, 5,170 %, con vencimiento el 10/09/2046	2.091
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, Serie 2021 DNA3, Clase M2, 144A, 6,584 %, con vencimiento el 25/10/2033	1.863
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7, Serie 2021 DNA7, Clase M1, 144A, 5,334 %, con vencimiento el 25/11/2041	1.833

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

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado) *(continuación)*

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^ (continuación)

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R02, Serie 2020 R02, Clase 2B1, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 25/09/2043	1.030
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2023-DNA1, Serie 2023 DNA1, Clase B1, 144A, 13,472 %, con vencimiento el 25/03/2043	975
Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R02, Serie 2020 R02, Clase 2B1, 144A, 0,000 %, con vencimiento el 25/04/2043	780
Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, con vencimiento el 31/07/2053	660
Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R02, Serie 2020 R02, Clase 2B1, 144A, 8,436 %, con vencimiento el 25/01/2040	640
Colombian TES, Series B, 7,250 %, con vencimiento el 26/10/2050	602
IRB Holding Corp, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/06/2025	511
Mexican Bonos, Series M, 7,500 %, con vencimiento el 26/05/2033	415
Dream Finders Homes Inc, 144A, 8,250 %, con vencimiento el 15/08/2028	415
Ginnie Mae II Pool 'MA9306', 6,000 %, con vencimiento el 20/11/2053	404
Fannie Mae – CAS Floating Rate Note, 0,000 %, con vencimiento el 25/06/2043	370
FirstCash Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 01/09/2028	358

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C14, Serie 2014 C14, Clase A5, 4,064 %, con vencimiento el 15/02/2047	1.805
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA3, 144A, 10,770 %, con vencimiento el 25/07/2050	1.673
GC Pastor Hipotecario 5 FTA 5, Clase A2, 2,233 %, con vencimiento el 21/06/2046	1.658
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Clase 1M2, 6,867 %, con vencimiento el 25/07/2030	1.642
Fannie Mae Pool 'MA4876', 6,000 %, con vencimiento el 01/12/2052	1.523
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C03, Clase 1B1, 9,186 %, con vencimiento el 25/10/2030	1.500
Freddie Mac Pool 'SD8278', 6,000 %, con vencimiento el 01/12/2052	1.479
Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	1.455
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Clase 1B1, 8,986 %, con vencimiento el 25/07/2030	1.369
Colombian TES, Series B, 7,250 %, con vencimiento el 26/10/2050	1.356
Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2033	1.243
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC17, Serie 2013 GC17, Clase AS, 5,110 %, con vencimiento el 10/11/2046	1.226
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Serie 2019 R07, Clase 1B1, 144A, 8,836 %, con vencimiento el 25/10/2039	1.173
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R06, Serie 2019 R06, Clase 2B1, 144A, 8,367 %, con vencimiento el 25/09/2039	1.171
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, serie 2020 DNA3, clase B1, 144A, 10,536 %, con vencimiento el 25/06/2050	1.115
STACR 2018-HRP2, Serie 2018 HRP2, Clase B1, 144A, 9,636 %, con vencimiento el 25/02/2047	1.086
Home RE 2023-1 Ltd, Serie 2023 1, Clase M2, 144A, 11,322 %, con vencimiento el 25/10/2033	1.065

FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	1.058
Openlane inc, 5,125 %, con vencimiento el 01/06/2025	97
Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 01/10/2026	63
Sabre GLBL Inc, 144A, 9,250 %, con vencimiento el 15/04/2025	61
Brundage-Bone Concrete Bomping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 01/02/2026	60
FirstCash Inc, 144A, 4,625 %, con vencimiento el 01/09/2028	39
Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 30/03/2028	18
Nordstrom Inc, 4,250 %, con vencimiento el 01/08/2031	18

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	1.058
Goldman Sachs USD Liquid Reserves Fund – Clase Institucional	411
Uber Technologies Inc, 7,500 %, con vencimiento el 15/05/2025	366
Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625 %, con vencimiento el 01/09/2028	309
TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 15/03/2026	272
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2.800 %, con vencimiento el 21/07/2023	248
Horizon Therapeutics USA Inc, 5,500 %, con vencimiento el 01/08/2027	227
Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, con vencimiento el 01/02/2029	227
Affinity Gaming, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/12/2027	218
Freedom Mortgage Corp, 144A, 7,625 %, con vencimiento el 01/05/2026	206
Arko Corp, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 15/11/2029	201
First Quantum Minerals Ltd, 6,500 %, con vencimiento el 01/03/2024	199
Lenovo Group Ltd, 144A, 6,536 %, con vencimiento el 27/07/2032	198
Turning Point Brands Inc, 144A, 5,625 %, con vencimiento el 15/02/2026	196
MercadoLibre Inc, 3,125 %, con vencimiento el 14/01/2031	187
LCPR Secured Financing DAC, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 15/10/2027	183
Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 01/08/2026	178
ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2028	174
Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 01/10/2026	172
Glaytika Holding Corp, 144A, 4,250 %, con vencimiento el 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 %, con vencimiento el 15/03/2023	167
Penn Virginia Holdings LLC, 144A, 9.250 %, con vencimiento el 15/08/2026	153
Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 15/02/2026	151
Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 6,750 %, con vencimiento el 01/10/2026	148
Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, con vencimiento el 15/11/2029	146
United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 15/04/2029	140
Credit Acceptance Corp, 144A, 5,125 %, con vencimiento el 31/12/2024	134
PDC Energy Inc, 5,750 %, con vencimiento el 15/05/2026	129
Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, con vencimiento el 30/06/2030	126
Brundage-Bone Concrete Bomping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, con vencimiento el 01/02/2026	120
Freedom Mortgage Corp, 144A, 6,625 %, con vencimiento el 15/01/2027	117
Carnival Corp, 4,000 %, con vencimiento el 01/08/2028	107
Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, con vencimiento el 30/03/2028	102
Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, con vencimiento el 15/08/2027	101
Ciramex Energy Co, 4,375 %, con vencimiento el 15/03/2029	98
Home BancShares Inc/AR, 3,125 %, con vencimiento el 30/01/2032	98
Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, con vencimiento el 15/04/2029	98

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

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado) *(continuación)*

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025	16.878
Petroleos Mexicanos, 6,950 %, con vencimiento el 28/01/2060	2.126
Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2053	1.605
General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, con vencimiento el 06/04/2026	1.416
Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, con vencimiento el 18/05/2026	1.298
Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000 %, con vencimiento el 20/06/2053	1.294
Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, con vencimiento el 20/05/2053	1.108
Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500 %, con vencimiento el 20/06/2053	910
Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500 %, con vencimiento el 20/02/2053	891
Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, con vencimiento el 13/11/2042	230
Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2029	138
Goldman Sachs Group Inc/The, 5,700 %, con vencimiento el 01/11/2024	121
Bono del Estado de la República de Sudáfrica, Serie 2048, 8,750 %, con vencimiento el 28/02/2048	111
Colombian TES, Series B, 7,000 %, con vencimiento el 30/06/2032	105
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2031	102
Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	93
Bono del Estado de la República Checa, Serie 138, 1,750 %, con vencimiento el 23/06/2032	92
Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207 %, con vencimiento el 22/11/2024	71
Freddie Mac Pool 'RA7790', 5,000 %, con vencimiento el 01/08/2052	67

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025	11.076
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 3,334 %, con vencimiento el 31/07/2024	7.556
Bonos del Tesoro coreano, Serie 3106, 2,000 %, con vencimiento el 10/06/2031	3.468
Mexican Bonos, Serie M, 8,500 %, con vencimiento el 31/05/2029	2.269
Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207 %, con vencimiento el 22/11/2024	1.439
Goldman Sachs Group Inc/The, 5,700 %, con vencimiento el 01/11/2024	1.383
Jackson National Life Global Funding, 144A, 5,613 %, con vencimiento el 28/06/2024	1.341
Bonos del Tesoro coreano, Serie 5103, 1,875 %, con vencimiento el 10/03/2051	1.146
Bono del Estado de Malasia, Serie 0313, 3,480 %, con vencimiento el 15/03/2023	910
Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, con vencimiento el 13/11/2042	840
Bono del Estado de Malasia, Serie 0417, 3,899 %, con vencimiento el 16/11/2027	703
Colombian TES, Series B, 7,000 %, con vencimiento el 30/06/2032	448
Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2029	380
Bono del Estado de la República de Sudáfrica, Serie 2048, 8,750 %, con vencimiento el 28/02/2048	365
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2031	332
Bono del Estado de la República Checa, Serie 138, 1,750 %, con vencimiento el 23/06/2032	290
Bono del Estado de Malasia, Serie 0115, 3,955 %, con vencimiento el 15/09/2025	210
Colombian TES, Series B, 6,000 %, con vencimiento el 28/04/2028	183
Mexican Bonos, Series M, 8,500 %, con vencimiento el 18/11/2038	155
Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	133

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	9.361
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025	3.946
United Kingdom Gilt, 3,750 %, con vencimiento el 22/10/2053	857
Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, con vencimiento el 31/07/2053	667
Mexican Bonos, Series M, 7,500 %, con vencimiento el 26/05/2033	552
Bono del Estado de España, 144A, 1,900 %, con vencimiento el 31/10/2052	461
European Bank for Reconstruction & Development, 6,300 %, con vencimiento el 26/10/2027	428
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2027	352
Mexican Bonos, Serie MS, 8,000 %, con vencimiento el 24/05/2035	311
Colombian TES, Series B, 7,250 %, con vencimiento el 26/10/2050	282
Colombian TES, Series B, 7,000 %, con vencimiento el 26/03/2031	215
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA5, Serie 2022 DNA5, Clase M2, 144A, 12,072 %, vencimiento el 25/06/2042	209
Raizen Fuels Finance SA, 144A, 6,450 %, con vencimiento el 05/03/2034	199
Banco do Brasil SA/Cayman, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 18/04/2030	197
Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01, Serie 2024 R01, Clase 1M1, 144A, 6,372 %, con vencimiento el 25/01/2044	185
Bono del Estado de España, 3,550 %, con vencimiento el 31/10/2033	182
Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R04, serie 2023 R04, clase 1M2, 144A, 8,871 %, con vencimiento el 25/05/2043	181
Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R07, Serie 2023 R07, Clase 2M1, 144A, 7,271 %, con vencimiento el 25/09/2043	169
Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01, serie 2024 R01, Clase 1M2, 144A, 7,122 %, con vencimiento el 25/01/2044	160
Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2029	159

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	8.782
Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, con vencimiento el 31/07/2053	838
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 4,931 %, con vencimiento el 31/01/2025	800
Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Serie 2022 HQA2, Clase M1B, 144A, 8.484 %, con vencimiento el 25/07/2042	622
Brasil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, con vencimiento el 01/01/2033	591
Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01, serie 2022 R01, Clase 1M2, 144A, 6,384 %, con vencimiento el 25/12/2041	584
European Bank for Reconstruction & Development, 6,300 %, con vencimiento el 26/10/2027	430
Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	325
Colombian TES, Series B, 7,000 %, con vencimiento el 26/03/2031	292
Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, Serie 2022 R04, Clase 1M1, 144A, 6,484 %, con vencimiento el 25/03/2042	249
Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, con vencimiento el 01/09/2052	232
Var Energi ASA, 144A, 7,500 %, con vencimiento el 15/01/2028	211
World Acceptance Corp, 144A, 7,000 %, con vencimiento el 01/11/2026	206
UBS AG/London, 144A, 0.700 %, con vencimiento el 09/08/2024	205
Banco do Brasil SA/Cayman, 144A, 6,250 %, con vencimiento el 18/04/2030	203
BRF SA, 144A, 3,950 %, con vencimiento el 22/05/2023	200
NatWest Group Plc, 2,359 %, con vencimiento el 22/05/2024	200
Stellantis NV, 5.250 %, con vencimiento el 15/04/2023	200
Arab Petroleum Investments Corp, 144A, 1,483 %, con vencimiento el 06/10/2026	198
Export-Import Bank of India, 144A, 5,500 %, con vencimiento el 18/01/2033	196
Kenbourne Invest SA, 6,875 %, con vencimiento el 26/11/2024	186
Bono del Estado de España, 3,550 %, con vencimiento el 31/10/2033	183

FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 4,000 %, con vencimiento el 29/02/2028	9.170
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	7.410
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 4,875 %, con vencimiento el 31/10/2028	5.769
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 5,418 %, con vencimiento el 30/04/2025	3.342
Ginnie Mae II Pool 'MA9241', 5,500 %, con vencimiento el 20/10/2053	1.899
Ginnie Mae II Pool 'MA9171', 5,500 %, con vencimiento el 20/09/2053	1.878
Fannie Mae Pool 'MA4806', 5,000 %, con vencimiento el 01/11/2052	1.421
Ginnie Mae II Pool 'MA9362', 5,500 %, con vencimiento el 20/12/2053	1.395
Ginnie Mae II Pool 'MA9172', 6,000 %, con vencimiento el 20/09/2053	1.349
Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2053	1.144
Ginnie Mae II Pool 'MA9306', 6,000 %, con vencimiento el 20/11/2053	1.094
Ginnie Mae II Pool 'MA9305', 5,500 %, con vencimiento el 20/11/2053	1.091
Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, con vencimiento el 20/05/2053	1.008
Ginnie Mae II Pool 'MA8647', 5,000 %, con vencimiento el 20/02/2053	793
Ginnie Mae II Pool 'MA9106', 5,500 %, con vencimiento el 20/08/2053	715

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	6.370
United States Treasury Floating Rate Note – A la emisión 5,418 %, con vencimiento el 30/04/2025	3.341
Ginnie Mae II Pool 'MA9172', 6,000 %, con vencimiento el 20/09/2053	1.359
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 4,875 %, con vencimiento el 31/10/2028	1.173
Ginnie Mae II Pool 'MA9306', 6,000 %, con vencimiento el 20/11/2053	1.105
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, con vencimiento el 15/05/2052	634
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 4,000 %, con vencimiento el 29/02/2028	602
Ginnie Mae II Pool 'MA9107', 6,000 %, con vencimiento el 20/08/2053	529
Ginnie Mae II Pool 'MA9241', 5,500 %, con vencimiento el 20/10/2053	347
Ginnie Mae II Pool 'MA9171', 5,500 %, con vencimiento el 20/09/2053	319
Fannie Mae Pool 'MA4806', 5,000 %, con vencimiento el 01/11/2052	199
Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, con vencimiento el 20/04/2053	27
Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, con vencimiento el 20/05/2053	17
Ginnie Mae II Pool 'MA8647', 5,000 %, con vencimiento el 20/02/2053	14
Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500 %, con vencimiento el 20/02/2053	13

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

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado) *(continuación)*

FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^ (continuación)

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500 %, con vencimiento el 20/06/2053	696
Bono/Obligación del Tesoro de Estados Unidos, 3,875 %, con vencimiento el 15/08/2033	677
Fannie Mae Pool 'MA4869', 5,500 %, con vencimiento el 01/01/2053	628
Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, con vencimiento el 18/05/2026	609
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, con vencimiento el 15/05/2052	557
Ginnie Mae II Pool 'MA9488', 5,500 %, con vencimiento el 20/02/2054	526
Ginnie Mae II Pool 'MA9107', 6,000 %, con vencimiento el 20/08/2053	525
Ginnie Mae II Pool 'MA8648', 5,500 %, con vencimiento el 20/02/2053	471
Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000 %, con vencimiento el 20/06/2053	470

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Fannie Mae Pool 'MA4869', 5,500 %, con vencimiento el 01/01/2053	10
Ginnie Mae II Pool 'MA9305', 5,500 %, con vencimiento el 20/11/2053	6
Ginnie Mae II Pool 'MA8948', 5,500 %, con vencimiento el 20/06/2053	5
Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000 %, con vencimiento el 20/06/2053	4
Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, con vencimiento el 01/12/2052	2

FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	74
Amgen Inc	40
Norfolk Southern Corp	20
CSX Corp	18
Marathon Petroleum Corp	17
The Cigna Group	16
Williams Companies Inc	15
Chubb Ltd	10
3M Co	9
Exelon Corp	9
KLA Corp	9
Pioneer Natural Resources	9
Union Pacific Corp	9
Lyondellbasell Industries NV	8
Mosaic Co /The	5
Aflac Inc	4
American International Group Inc	4
Expeditors Intern of Washington Inc	4
Marathon Oil Corp.	4
Reinsurance Group Of America Inc	4
Travelers Cos Inc/The	4

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Cisco Systems Inc	111
Union Pacific Corp	84
Chubb Ltd	80
3M Co	79
Caterpillar Inc	76
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	74
Amgen Inc	71
KLA Corp	67
Aflac Inc	63
Kroger Co/The	63
Travelers Cos Inc/The	62
iShares Russell 1.000 Growth ETF	61
American International Group Inc	59
PIONEER NATURAL RESOURCES CO USD0.01	57
The Cigna Group	56
Ulta Beauty Inc.	52
Ameriprise Financial Inc	51
Marathon Petroleum Corp	51
CSX Corp	49
Laboratory Corp. of America Holdings	48
Fed Ex Corporation	47
Quest Diagnostics, Inc.	47
Exelon Corp	42
Target Corp	42
Goldman Sachs USD 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 (en miles) USD
Johnson & Johnson	40.784
Bank of America Corp	30.409
Hess Corp	24.702
Pioneer Natural Resources Co	23.039
United Parcel Service Inc 'B'	21.843
Block Inc	21.006
ConocoPhillips	19.917
Gilead Sciences Inc	19.700
Eastman Chemical Co	19.633
American Tower Corp	19.062
Union Pacific Corp	18.087
Apollo Global Management Inc	17.909
PPL Corp	17.660
CVS Health Corp	17.513
First Horizon Corp	17.286
Everest Group Ltd	17.226
Corebridge Financial Inc	16.436
Tapestry Inc	15.356
Teck Resources Ltd	13.118
Target Corp	12.593
Micron Technology Inc	12.465
Argenx SE ADR	12.408
Marvell Technology Inc	12.406
Kellanova	12.312

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Meta Platforms Inc 'A'	36.259
Wells Fargo & Co	26.108
Bank of America Corp	26.037
UnitedHealth Group Inc	25.699
Pioneer Natural Resources Co	24.806
Uber Technologies Inc	20.317
Equitable Holdings Inc	20.069
BioMarin Pharmaceutical Inc	19.519
Hess Corp	18.336
Zimmer Biomet Holdings Inc.	17.968
Royal Gold Inc	17.805
MGM Resorts International	17.041
Vertex Pharmaceuticals Inc	15.570
APA Corp	15.202
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	15.180
Everest Re Group Ltd	14.862
Airbus SE	14.599
EQT Corp	14.395
AstraZeneca plc, ADR	14.183
SolarEdge Technologies Inc	14.013
T-Mobile US Inc	13.949
Schlumberger NV	13.875
Ross Stores Inc.	12.935
M&T Bank Corp	12.654

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

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado) *(continuación)*

FTGF ClearBridge Value Fund (continuación)

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
NextEra Energy Inc	12.237
Atkore Inc	12.170
Flowserve Corp	12.161
Clean Harbors Inc	11.986
UnitedHealth Group Inc	11.771
Microsoft Corp	11.732
United Utilities Group Plc	11.567
OneMain Holdings Inc	11.541
AGNC Investment Corp	11.485
ICON Plc	11.218
Canadian Pacific Kansas City Ltd	11.049
Ross Stores Inc.	10.976
Teck Resources Ltd., B	10.018
Alibaba Group Holding Ltd	9.097
Alibaba Group Holding Ltd	9.052
TotalEnergies SE ADR	9.018
Performance Food Group Co	8.831

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Oracle Corp	12.624
Constellation Energy Corp	12.432
American Electric Power Co. Inc.	11.918
CVS Health Corp	11.742
AGNC Investment Corp	11.014
Black Knight Inc.	10.969
Teck Resources Ltd., B	10.018
Air Liquide SA	9.744
Teck Resources Ltd., B	9.349
Coty Inc	9.298
United Airlines Holdings, Inc.	9.264
Tenet Healthcare Corp	9.231
Alibaba Group Holding Ltd	9.097
Sensata Technologies Holding plc	8.741
Haleon Plc	8.242
Enbridge Inc	8.171
TotalEnergies SE ADR	8.046
Mosaic Co. (The)	8.045
Signature Bank/New York NY	7.998
Micron Technology Inc	7.723
Alcoa Corp	7.548

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
AbbVie Inc	2.308
Netflix Inc	2.211
Crown Holdings Inc	1.719
Meta Platforms Inc 'A'	1.697
Amazon.com Inc	1.533
Apple Inc	1.462
Microsoft Corp	1.345
US Bancorp	1.310
Emerson Electric Co	1.260
Linde Plc	1.061
Marvell Technology Inc	1.048
Synopsys Inc	1.027
Bank of America Corp	985
Becton Dickinson & Co	968
NVIDIA Corp	889
Intel Corp	783
Hartford Financial Services Group Inc/The	766
Progressive Corp/The	707
ASML Holding NV	568
Stryker Corp	551
Intercontinental Exchange Inc	543
UnitedHealth Group Inc	437
Visa Inc 'A'	428
Merck & Co Inc	389
Walt Disney Co/The	364
JPMorgan Chase & Co	358

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Microsoft Corp	3.780
Air Products & Chemicals Inc	3.369
Apple Inc	3.328
UnitedHealth Group Inc	2.466
ArcelorMittal SA	2.071
Pfizer Inc	1.997
Home Depot Inc/The	1.720
T-Mobile US Inc	1.457
JPMorgan Chase & Co	1.452
Amazon.com Inc	1.421
Progressive Corp/The	1.410
Bank of America Corp	1.314
Verizon Communications Inc	1.287
TJX Cos Inc/The	1.284
Thermo Fisher Scientific Inc	1.214
Pioneer Natural Resources Co	1.134
Ball Corp	1.104
Travelers Cos Inc/The	1.073
Johnson & Johnson	973
Visa Inc 'A'	966
Becton Dickinson & Co	905
Merck & Co Inc	863
NVIDIA Corp	847
Automatic Data Processing Inc	828
Alphabet Inc 'A'	808
Alphabet Inc	789
General Motors Co.	745
Honeywell International Inc	745
Marriott International Inc/MD	744
Comcast Corp	698
Eli Lilly & Co	631
United Parcel Service Inc 'B'	629
Eaton Corp Plc	598
Waste Management Inc	579

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
S&P Global Inc	27.173
Union Pacific Corp	25.180
Target Corp	24.429
Atlassian Corp	22.058
Meta Platforms Inc 'A'	20.401
Eli Lilly & Co	19.713
Intuit Inc	18.491
Thermo Fisher Scientific Inc	16.112
Microsoft Corp	13.465
Estee Lauder Cos., Inc. (The) 'A'	11.458
Amazon.com Inc	11.436
Intercontinental Exchange Inc	10.552
NVIDIA Corp	9.770
NextEra Energy Inc	9.426
Apple Inc	9.327
Netflix Inc	9.261
Adobe Inc	9.067
Visa Inc 'A'	8.757

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
NVIDIA Corp	35.339
Splunk Inc	27.390
S&P Global Inc	26.035
Atlassian Corp	21.384
Dexcom Inc	19.532
Visa Inc 'A'	14.111
S&P Global Inc	13.306
Advance Auto Parts Inc	11.180
Monster Beverage Corp	11.095
Honeywell International Inc	9.015
Zoetis Inc	8.830
Eaton Corp Plc	8.685
Palo Alto Networks Inc	8.385
Uber Technologies Inc	8.239
Microsoft Corp	8.061
WW Grainger Inc	7.881
Thermo Fisher Scientific Inc	7.204
Amazon.com Inc	7.060

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado) *(continuación)*

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund (continuación)

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Honeywell International Inc	8.699
Sherwin-Williams Co/The	8.015
Stryker Corp	6.601
UnitedHealth Group Inc	5.818
Intel Corp	4.812
WW Grainger Inc	4.337
Palo Alto Networks Inc	4.237
Salesforce Inc	3.983

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
United Parcel Service Inc 'B'	7.004
Netflix Inc	6.815
Salesforce Inc	6.676
UnitedHealth Group Inc	6.107
Sea Ltd ADR	5.709
Stryker Corp	5.609
Meta Platforms Inc 'A'	4.950
Apple Inc	4.367
NIKE Inc	4.322
Marsh & McLennan Cos Inc	3.996
Unity Software Inc	3.818

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
AbbVie Inc	4.162
Airbnb Inc	3.942
TJX Companies, Inc/The	3.671
ServiceNow Inc	3.197
Pinterest Inc	3.080
Starbucks Corp	2.504
Broadcom Inc	2.476
Cintas Corp	2.171
WW Grainger Inc	1.960
MongoDB Inc 'A'	1.884
Accenture Plc 'A'	1.843
Paylocity Holding Corp	992
Freeport-McMoRan Inc	872
Diageo Plc ADR	613
Tractor Supply Co	447
elf Beauty Inc	405
elf Beauty Inc	405
Etsy Inc	349
Airbnb Inc	312
Old Dominion Freight Line Inc	309

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Broadcom Inc	12.577
Vertex Pharmaceuticals Inc	7.519
Broadcom Inc	5.967
UnitedHealth Group Inc	5.341
TE Connectivity Ltd	5.183
AbbVie Inc	4.162
Airbnb Inc	3.942
Comcast Corp	3.884
Seagate Technology Holdings Plc	2.959
HubSpot Inc	2.590
Crowdstrike Holdings Inc	2.547
Liberty Broadband Corp	2.540
Meta Platforms Inc 'A'	2.213
Johnson Controls International plc	2.166
Biogen Inc	2.023
Autodesk Inc	1.983
Ionis Pharmaceuticals Inc	1.806
Liberty Media Corp-Liberty Formula One	1.802
Liberty Broadband Corp	1.433
Madison Square Garden Entertainment Corp	1.380
Warner Bros Discovery, Inc.	1.330
Etsy Inc	1.275
Guardant Health Inc.	1.165
Charles River Laboratories International Inc	1.161
AbbVie Inc	1.054
Lyft Inc	965
Madison Square Garden Sports Corp	894

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Apollo Global Management Inc	831
NextEra Energy Partners LP	664
NextEra Energy Inc	644
American Homes 4 Rent 'A'	624
Blackstone Inc	606
Extra Space Storage Inc	560
Digital Realty Trust Inc	538
US Bancorp	538
Union Pacific Corp	507
AbbVie Inc	502
American Tower Corp	501
McCormick & Co Inc/MD	498
Sempra	465
Prologis Inc	441
Equity LifeStyle Properties Inc	436
Boston Properties Inc	418
T-Mobile US Inc	415
Marvell Technology Inc	377
PPL Corp	353
Colgate-Palmolive Co	341
Apartment Income REIT Corp	333
ONEOK Inc	322
Pioneer Natural Resources Co	275
Meta Platforms Inc 'A'	271
Amphenol Corp 'A'	265
AGNC Investment Corp	264
Target Corp	264
Eli Lilly & Co	260
Abbott Laboratories	250
Chubb Ltd	230
Starwood Retail Property Trust Inc	195
ConocoPhillips	193
L3Harris Technologies Inc	187
Goldman Sachs Group Inc/The	185
Ares Capital Corp	152

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Microsoft Corp	1.665
Broadcom Inc	1.121
KKR & Co Inc, Series C	1.003
Apple Inc	760
NextEra Energy Inc	662
Raytheon Technologies Corp	621
Activision Blizzard Inc	608
Bank of America Corp	593
Danaher Corp	586
American Airlines Group Inc, 6,500 %, con vencimiento el 01/07/2025	513
Cisco Systems Inc	508
AGNC Investment Corp	472
Chubb Ltd	463
Pfizer Inc	454
Brookfield Renewable Energy Partners LP/CA, MLP	442
Air Products & Chemicals Inc	411
Aptiv Plc, Serie A	411
Verizon Communications Inc	411
ConocoPhillips	407
Kimberly-Clark Corp.	402
Alexandria Real Estate Equities Inc.	387
Texas Instruments Inc	368
TC Energy Corp	358
DT Midstream Inc	353
American Tower Corp	326
Equitrans Midstream Corp	302
US Bancorp	300
NextEra Energy Partners LP	296
Otis Worldwide Corp	296
Apollo Global Management Inc	255
QUALCOMM Inc	211
Goldman Sachs Group Inc/The	208

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado) *(continuación)*

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
JPMorgan Chase & Co	51.925
Procter & Gamble Co/The	29.342
Colgate-Palmolive Co	28.684
American Water Works Co Inc	26.694
Travelers Cos Inc/The	23.286
Hologic Inc	22.459
ASML Holding NV	21.911
Lam Research Corp	21.607
Brookfield Renewable Corporation	20.697
Broadcom Inc	20.456
Ormat Technologies Inc	17.115
Veralto Corp	16.762
LKQ Corp	13.647
Marvell Technology Inc	10.698
Dell Technologies Inc	10.467
Alphabet Inc 'A'	9.538
Microsoft Corp	8.411
SolarEdge Technologies Inc	8.060
Danaher Corp	7.704
Enphase Energy Inc	7.448
CVS Health Corp	5.998
Apple Inc	5.852
NextEra Energy Partners LP	5.128

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Microsoft Corp	52.153
Apple Inc	43.877
Progressive Corp/The	37.872
ON Semiconductor Corp	37.734
Bank of America Corp	37.054
TE Connectivity Ltd	33.484
Keysight Technologies Inc	28.845
Thermo Fisher Scientific Inc	28.707
ASML Holding NV	26.595
Brookfield Renewable Corp	26.548
Charles Schwab Corp/The	25.838
Deere & Co	25.647
Booking Holdings Inc	23.527
UnitedHealth Group Inc	22.248
Progyny Inc	19.247
Novo Nordisk A/S, ADR	18.008
Costco Wholesale Corp	17.481
Trane Technologies Plc	17.165
Hartford Financial Services Group Inc/The	15.935
Brookfield Renewable Corporation	15.660
Visa Inc 'A'	15.227
Salesforce Inc	14.329
Cisco Systems Inc	14.312
McCormick & Co Inc/MD	14.294
BioMarin Pharmaceutical Inc	14.178
Regal Rexnord Corp	13.873
Alphabet Inc 'A'	13.727
JPMorgan Chase & Co	13.507
NextEra Energy Partners LP	13.189
Morgan Stanley	13.068
Eaton Corp Plc	12.877
Synopsys Inc	12.484
Etsy Inc	10.594
ASML Holding NV	10.391
Cooper Cos Inc/The	10.137
Home Depot Inc/The	10.097
Williams-Sonoma Inc	9.970

FTGF ClearBridge Global Growth Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Marvell Technology Inc	320
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	299
Meta Platforms Inc 'A'	280
Visa Inc 'A'	250
Novo Nordisk A/S	249
CRH Plc	229
HDFC Bank Ltd ADR	227
Apple Inc	225
Adobe Inc	215
MercadoLibre Inc	214
Walt Disney Co/The	213
Tokyo Electron Ltd.	202
Netflix Inc	188
Trex Co Inc	184
Waste Connections Inc.	178
Intuit Inc	174
Kering SA	169
London Stock Exchange Group Plc	166
Haleon Plc	162
ASML Holding NV	158
TransDigm Group Inc	158
Target Corp	155
Amazon.com Inc	154
CRH Plc ADR	147
Uber Technologies Inc	146
Hoya Corp	142
Estee Lauder Cos., Inc. (The) 'A'	140
SMC Corp	139
RELX Plc	134
Arista Networks Inc	124
Chubb Ltd	124
Ferrari NV	124
Industria de Diseno Textil SA	112
Pinterest Inc	111
Amphenol Corp 'A'	108
Grupo Bimbo SAB de CV	107
Guidewire Software Inc	106
Alphabet Inc 'A'	105

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Tesla Inc	328
Kroger Co/The	279
Deutsche Boerse AG	227
Tokyo Electron Ltd.	218
Daiichi Sankyo Co Ltd	211
Procter & Gamble Co/The	206
Waste Connections Inc.	196
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	187
EDP – Energias de Portugal SA	186
UnitedHealth Group Inc	186
Deere & Co	185
Estee Lauder Cos., Inc. (The) 'A'	181
CRH Plc ADR	179
Eli Lilly & Co	176
Pliant Therapeutics Inc	174
BNP Paribas SA	172
Marvell Technology Inc	170
Nestle SA	170
Rentokil Initial Plc	170
London Stock Exchange Group Plc	167
Marriott International Inc/MD	167
Microsoft Corp	166
Diageo Plc ADR	162
Raymond James Financial Inc	161
Arista Networks Inc	147
NVIDIA Corp	146
Thomson Reuters Corp	146
Straumann Holding AG	144
RELX Plc	143
Tencent Holdings Ltd	138
Keyence Corp	133
Sysco Corp.	132
Computershare Ltd	131
CRH Plc ADR	127
Alibaba Group Holding Ltd	126
Kering SA	125
United Parcel Service Inc 'B'	122
Sandvik AB	121

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

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado) *(continuación)*

FTGF ClearBridge Global Growth Fund^ (continuación)

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
SAP SE	102
Salesforce Inc	100
Hexagon AB	99
Edenred SE	98
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	96
McKesson Corp	96
Shopify Inc 'A'	95

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Sensient Technologies Corp	120
Target Corp	120
Apple Inc	119
United Rentals Inc	112
Avantor Inc	111
Iberdrola SA ADR	109
SAP SE	108
Old Dominion Freight Line Inc	96
S&P Global Inc	95
Trex Co Inc	93
Deutsche Telekom AG	92

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) EUR
CenterPoint Energy Inc	40.646
Enel SpA	39.213
Dominion Energy Inc	32.795
Aeroports de Paris SA	29.633
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	27.302
Norfolk Southern Corp	26.642
Crown Castle Inc	22.928
Severn Trent Plc	22.012
Orsted AS, 144A	21.552
Union Pacific Corp	19.973
E.ON SE	19.529
Rumo SA	19.101
Entergy Corp	17.581
Redeia Corp SA	17.385
PG&E Corp	15.593
Ferrovial SA	14.662
CSX Corp	14.332
United Utilities Group Plc	14.142
Centrais Eletricas Brasileiras SA	10.631
EDP – Energias de Portugal SA	9.866
American Tower Corp	8.970
PPL Corp	8.848
Ferrovial SE	8.253
Terna – Rete Elettrica Nazionale	6.328
NextEra Energy Inc	5.800

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) EUR
SSE Plc	48.286
PPL Corp	43.422
Iberdrola SA	39.128
TC Energy Corp	34.797
Union Pacific Corp	31.042
Cellnex Telecom SA, 144A	28.255
East Japan Railway Co	27.784
Vinci SA	25.884
Aena SME SA, 144A	25.787
Ferrovial SE	24.507
Severn Trent Plc	24.021
CenterPoint Energy Inc	23.606
Constellation Energy Corp	22.228
PG&E Corp	22.033
Terna – Rete Elettrica Nazionale	22.014
American Water Works Co Inc	20.459
Southwest Gas Holdings, Inc.	19.545
Public Service Enterprise Group Inc	17.008
Transurban Group	16.496
Enel SpA	15.396
NextEra Energy Inc	14.385
United Utilities Group Plc	14.347
Atlas Arteria Ltd	14.055
CSX Corp	13.803
Getlink SE	13.218
American Tower Corp	13.014
Cheniere Energy Inc	11.945
Centrais Eletricas Brasileiras SA	11.806
East Japan Railway Co	10.856
EDP – Energias de Portugal SA	10.524
Gibson Energy Inc	9.876
Entergy Corp	9.580
Pembina Pipeline Corp	7.877
OGE Energy Corp	7.526

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Enbridge Inc	28.165
Enel SpA	27.221
Williams Cos Inc/The	22.914
Iberdrola SA	17.515
NextEra Energy Inc	16.368
Dominion Energy Inc	14.183
National Grid Plc	13.268
Eversource Energy	11.859
Union Pacific Corp	10.563
NextEra Energy Partners LP	10.320
Entergy Corp	9.847
Redeia Corp SA	9.644
Edison International	9.528
Brookfield Renewable Corporation	9.241
Snam SpA	8.431
Aeroports de Paris SA	7.341
Severn Trent Plc	7.112
Crown Castle Inc	6.339
TC Energy Corp	6.157
E.ON SE	5.592
SSE Plc	5.575
Centrais Eletricas Brasileiras SA	5.425
China Resources Gas Group Ltd	4.459
American Tower Corp	3.910
West Japan Railway Co	3.653
Southern Co/The	3.368
OGE Energy Corp	3.092

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Iberdrola SA	31.323
Enbridge Inc	29.551
Williams Cos Inc/The	28.905
SSE Plc	26.091
TC Energy Corp	20.566
Enel SpA	16.171
Edison International	15.764
National Grid Plc	14.819
APA Group	14.265
Public Service Enterprise Group Inc	11.715
Brookfield Renewable Corp	10.163
Enagas SA	9.442
Snam SpA	9.127
United Utilities Group Plc	8.495
West Japan Railway Co	7.603
Transurban Group	6.841
Southwest Gas Holdings, Inc.	6.699
Italgas SpA	6.610
Clearway Energy Inc 'C'	6.231
Redeia Corp SA	5.670
Centrais Eletricas Brasileiras SA	5.653
Union Pacific Corp	5.416
Gibson Energy Inc	5.013
CPFL Energia SA	4.883
EDP – Energias de Portugal SA	4.085
Engie Brasil Energia SA	3.937

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

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado) *(continuación)*

FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
TotalEnergies SE	364
Compass Group Plc	320
AstraZeneca Plc	277
Unilever Plc	270
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	264
Oracle Corp	260
Johnson & Johnson	253
Wells Fargo & Co	240
Fiserv Inc	238
BNP Paribas SA	237
Hitachi Ltd	231
American International Group Inc	231
Chesapeake Energy Corp	230
Meta Platforms Inc 'A'	222
UnitedHealth Group Inc	184
Eastman Chemical Co	184
Freeport-McMoRan Inc	183
Siemens AG	183
Coty Inc	179
Nexans SA	177
Veolia Environnement SA	176
Schneider Electric SE	176
AES Corp/The	161
Uber Technologies Inc	150
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT ADR	144
Gerresheimer AG	138
Charles Schwab Corp/The	133
Vertiv Holdings Co 'A'	121
General Motors Co.	108
AIA Group Ltd	105
United Utilities Group Plc	104
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	102
Brookfield Renewable Corp	100
NextEra Energy Inc	98
Biogen Inc	93
CNH Industrial NV	85
Fluence Energy Inc	84

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Eastman Chemical Co	201
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT ADR	147
TotalEnergies SE	116
Compass Group Plc	105
General Motors Co.	90
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	89
AstraZeneca Plc	88
Oracle Corp	86
Unilever Plc	85
Fiserv Inc	79
Johnson & Johnson	79
Wells Fargo & Co	77
American International Group Inc	76
Meta Platforms Inc 'A'	75
Chesapeake Energy Corp	75
BNP Paribas SA	73
Fluence Energy Inc	62
UnitedHealth Group Inc	62
Schneider Electric SE	59
Siemens AG	59
Freeport-McMoRan Inc	55
Veolia Environnement SA	54
Coty Inc	53
AES Corp/The	53
Uber Technologies Inc	53
Nexans SA	53
Charles Schwab Corp/The	43
Gerresheimer AG	41
Brookfield Renewable Corp	30
Biogen Inc	28
CNH Industrial NV	24

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	170.374
Alpha & Omega Semiconductor Ltd	5.348
WNS Holdings Ltd ADR	4.436
IPG Photonics Corp	4.032
Clearfield Inc	3.752
Mativ Holdings Inc	3.630
Canaccord Genuity Group Inc	3.356
CECO Environmental Corp	3.266
Patterson-UTI Energy Inc	3.217
Udemy Inc	3.052
Brighthouse Financial Inc	2.903
Select Water Solutions Inc	2.836
Digi International Inc	2.802
Xerox Holdings Corp	2.781
Gentherm Inc	2.713
Chart Industries Inc	2.670
TTEC Holdings Inc	2.611
Fabrinet	2.606
Customers Bancorp Inc	2.588
Coherent Corp	2.554

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	185.377
Modine Manufacturing Co	8.197
Earthstone Energy Inc 'A'	5.769
Limbach Holdings Inc	5.423
CIRCOR International Inc	5.221
Onto Innovation Inc	4.616
BlueLinx Holdings Inc	4.598
Heritage-Crystal Clean Inc	4.331
Carrols Restaurant Group Inc	4.323
Chesapeake Energy Corp	4.270
Griffon Corp	4.234
Haynes International Inc	4.144
Hexcel Corp	4.142
Daseke Inc	4.039
Avid Technology Inc	3.919
Dorian LPG Ltd	3.850
PCTEL Inc	3.840
Sterling Infrastructure Inc	3.811
Option Care Health Inc	3.671
Coherent Corp	3.566

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	30.313
FormFactor Inc	2.597
ETF iShares Russell 2000 Value – ETF	2.523
Kennedy-Wilson Holdings Inc	1.825
Catalyst Pharmaceuticals Inc	1.722
Enpro Inc	1.706
Lazard Inc 'A'	1.498
Ziff Davis Inc	1.440
John Bean Technologies Corp	1.243
Bio-Techne Corp	1.236
Cass Information Systems Inc	1.235
Korn Ferry	1.221
Valvoline Inc	1.211

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	29.733
FormFactor Inc	3.250
Onto Innovation Inc	2.404
ETF iShares Russell 2000 Value – ETF	2.260
Avid Technology Inc	1.776
MKS Instruments Inc	1.488
Lazard Inc	1.449
Inter Parfums Inc	1.434
White Mountains Insurance Group Ltd	1.298
John Bean Technologies Corp	1.180
Computer Task Group Inc	1.123
AMN Healthcare Services Inc	1.103
Ironwood Pharmaceuticals Inc 'A'	988

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

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado) *(continuación)*

FTGF Royce US Smaller Companies Fund (continuación)

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Marcus & Millichap Inc	1.183
Lazard Ltd 'A'	1.177
Ryerson Holding Corp	1.164
Inter Parfums Inc	1.132
MKS Instruments Inc	1.115
Forrester Research Inc	1.090
Cirrus Logic Inc	1.062
Brunswick Corp/DE	999
Vishay Precision Group Inc	981
AMN Healthcare Services Inc	979
Dun & Bradstreet Holdings Inc	937
Arcosa Inc	919
Brady Corp 'A'	861
ESCO Technologies Inc	857

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Houlihan Lokey Inc 'A'	979
Harmony Biosciences Holdings Inc	973
Heritage-Crystal Clean Inc	956
Forward Air Corp	951
Kadant Inc	940
Wolverine World Wide Inc	939
Louisiana-Pacific Corp	852
LCI Industries	845
Skyline Champion Corp	832
Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	808
Enovis Corp	798

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	684
FirstService Corp	111
Colliers International Group Inc	99
Auction Technology Group Plc	86
Valvoline Inc	70
Hirose Electric Co Ltd	61
Miura Co Ltd	51
Azelis Group NV	46
Fox Factory Holding Corp	46
Marlowe Plc	44
Rogers Corp	37
MKS Instruments Inc	35
TOTVS SA	35
Haemonetics Corp	33
Lectra	33
Littelfuse Inc	31
New Work SE	31
JTC Plc, 144A	30
NICE Information Service Co Ltd	27
Installed Building Products Inc	25
Cognex Corp	23
Enpro Inc	22
Esab Corp	22
Restore Plc	21

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	656
FirstService Corporation	103
Colliers International Group Inc	86
OBIC Business Consultants Co Ltd	72
Dorman Products Inc	65
New Work SE	61
Forward Air Corp	59
FormFactor Inc	50
Brunswick Corp/DE	46
Ralph Lauren Corp 'A'	45
Inter Parfums Inc	43
RB Global Inc	42
MKS Instruments Inc	40
LCI Industries	36
Avid Technology Inc	35
Marel hf, 144A	33
Quaker Chemical Corp	33
UFP Industries Inc	33
Douzone Bizon Co Ltd	29
Meitec Corp	27
LKQ Corp	26
Marlowe Plc	26
VZ Holding AG	26
Fox Factory Holding Corp	24
Fukui Computer Holdings Inc	24
Esab Corp	23
Kadant Inc	23
Gentex Corp	20

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

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	3.356
NTPC Ltd	240
Hon Hai Precision Industry Co Ltd	174

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	3.356
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.262
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

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

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado) *(continuación)*

Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^ (continuación)

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
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 (en miles) USD
Innox Advanced Materials Co Ltd	35
LG Chem Ltd	30
Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	21
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	17

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	302
Samsung Electronics Co Ltd	255
Tencent Holdings Ltd	238
HDFC Bank Limited	209
AIA Group Limited	186
LG Chem Ltd	170
Alibaba Group Holding Limited	164
United Overseas Bank Limited	156
Singapore Telecommunications Ltd	153
Ishares Core Msci Asia E-HKD	149
Singapore Technologies Engineering Ltd	131
Venture Corporation Limited	131
Accton Technology Corporation	130
ENN Energy Holdings Limited	117
CSPC Pharmaceutical Group LTD	115
Minth Group Ltd	112
Hansol Chemical Co Ltd	103
Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	97
Ping An Insurance Group	94
Techtronic Industries Company Limited	89
Guangdong Investment Limited	86
LG Energy Solution Ltd	84
Tongcheng Travel Holdings Ltd	79
Telkom Indonesia Persero Tbk	76
TravelSky Technology Limited	76
Shenzhou International Group Holdings Limited	63
LEENO Industrial Inc	60
JD.com, Inc	57
TATA Consultancy Services Limited	53
Innox Advanced Materials Co Ltd	43

FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	28.851
Adyen NV, 144A	6.155
Estee Lauder Cos., Inc. (The) 'A'	5.238
Mettler-Toledo International Inc	5.037
Sartorius Stedim Biotech	4.479
Cadence Design Systems Inc	4.009
Illumina Inc	3.756
IDEXX Laboratories Inc	2.787
Croda International Plc	2.504
CSL Ltd	1.467
Moncler SpA	974
NVIDIA Corp	874
ASML Holding NV	834
Microsoft Corp	799
Linde Plc	697
Pernod Ricard SA	690
Kering SA	628
Ferrari NV	627
L'Oreal SA	616
Atlas Copco AB	572

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	27.231
NVIDIA Corp	10.687
Adobe Inc	5.793
ANSYS Inc	4.598
AIA Group Ltd	4.417
Microsoft Corp	4.255
ASML Holding NV	3.964
Linde Plc	3.688
Ferrari NV	3.253
Kerry Group Plc	3.252
Moncler SpA	3.054
L'Oreal SA	3.044
Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	3.003
Atlas Copco AB	2.839
Mastercard Inc	2.836
Kingspan Group Plc	2.603
Masimo Corp	2.436
Coloplast A/S	2.206
CSL Ltd	2.127
ResMed Inc	2.120
Zoetis Inc	2.054
Veeva Systems Inc 'A'	1.918
NIKE Inc	1.844
Pernod Ricard SA	1.841
Assa Abloy AB	1.789
Hexagon AB	1.777
Croda International Plc	1.693
Autodesk Inc	1.689
Estee Lauder Cos., Inc. (The) 'A'	1.526
Illumina Inc	1.495
Kering SA	1.471
Mettler-Toledo International Inc	1.389
Adyen NV, 144A	1.260

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

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado) *(continuación)*

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	1.262
Link REIT	706
Indus Towers Ltd	647
Wharf Real Estate Investment Co Ltd	620
Aurizon Holdings Ltd	539
Chorus Ltd	508
CLP Holdings Ltd	433
Guangdong Investment Ltd	388
China Tower Corp Ltd, 144A	349
GPT Group/The	348
Vicinity Ltd	294
Scentre Group	274
Contact Energy Ltd	249
APA Group	226
Charter Hall Retail REIT	203
Digital Telecommunications Infrastructure Fund	197
Embassy Office Parks REIT	194
AGL Energy Ltd	190
NETLINK NBN TRUST	189
Region RE Ltd	123
Manila Electric Co	121
Capitaland India Trust	109
Transurban Group	93
Westports Holdings Bhd	93
Charter Hall Long Wale REIT	87

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	1.119
AGL Energy Ltd	872
NHPC Ltd	848
Power Grid Corp of India Ltd	813
Indus Towers Ltd	734
CLP Holdings Ltd	730
Transurban Group	622
CapitaLand Integrated Commercial Trust	578
Contact Energy Ltd	497
Link REIT	441
HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd	402
Region RE Ltd	398
Vicinity Ltd	394
Charter Hall Retail REIT	386
China Tower Corp Ltd, 144A	319
Scentre Group	312
GPT Group/The	279
Chorus Ltd	239
NETLINK NBN TRUST	211
China Merchants Port Holdings Co Ltd	208
Guangdong Investment Ltd	184
Aurizon Holdings Ltd	178
Embassy Office Parks REIT	165
Charter Hall Long Wale REIT	159
Fortune Real Estate Investment Trust	143

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	5.877
HDFC Bank Ltd	575
Tata Consultancy Services Ltd	492
MercadoLibre Inc	397
Capitec Bank Holdings Ltd	319
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	314
Globant SA	304
Proya Cosmetics Co., Ltd	250
Tencent Holdings Ltd	223
Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co	209
Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	197
Minth Group Ltd	196
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co.,Ltd.	153
Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	146
China Merchants Bank Co Ltd	112
Samsung Electronics Co Ltd	112
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	111
SK Hynix Inc	48
Alibaba Group Holding Ltd	38
ICICI Bank Ltd	36

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Clase WA (distribución)	5.457
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.005
Samsung Electronics Co Ltd	583
ICICI Bank Ltd	559
Tencent Holdings Ltd	401
Titan Co Ltd	343
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	317
SK Hynix Inc	294
Ping An Bank Co Ltd	280
WEG SA	252
EPAM Systems Inc	223
ENN Energy Holdings Ltd	219
Credicorp Ltd	217
HDFC Bank Ltd	215
Globalwafers Co Ltd	196
AIA Group Ltd	195
B3 SA – Brasil Bolsa Balcao	166
Reliance Industries Ltd	165
Alibaba Group Holding Ltd ADR	162
Meituan 'B', 144A	119

FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) EUR
Adyen NV, 144A	7.807
BE Semiconductor Industries NV	4.442
Croda International Plc	3.799
Sartorius Stedim Biotech	2.714
Moncler SpA	2.468
ASML Holding NV	1.175
L'Oreal SA	915
Linde Plc	861
Mettler-Toledo International Inc	774
Assa Abloy AB	759
Hexagon AB	713
Kingspan Group Plc	702
Nemetschek SE	698
Atlas Copco AB	696
Kering SA	641
Coloplast A/S	627
Partners Group Holding AG	619
Ferrari NV	618
Dassault Systemes SE	596
Pernod Ricard SA	471
Infineon Technologies AG	391
Oxford Nanopore Technologies Plc	340

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) EUR
Ferrari NV	9.544
ASML Holding NV	7.336
Infineon Technologies AG	6.089
Kerry Group Plc	5.337
Mettler-Toledo International Inc	3.709
Allfunds Group Plc	3.283
Atlas Copco AB	3.029
Assa Abloy AB	2.329
Moncler SpA	2.293
Dassault Systemes SE	2.203
L'Oreal SA	1.983
Linde Plc	1.916
Kingspan Group Plc	1.662
Nemetschek SE	1.549
Partners Group Holding AG	1.497
Sartorius Stedim Biotech	1.451
Hexagon AB	1.425
Kering SA	1.345
Coloplast A/S	1.327
Dr Martens Plc	1.295
Croda International Plc	1.142
Adyen NV, 144A	1.005
Pernod Ricard SA	993
BE Semiconductor Industries NV	970
Oxford Nanopore Technologies Plc	719

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

Estado de cambios importantes en la cartera (no auditado) *(continuación)*

FTGF Martin Currie Improving Society Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) USD
Intuitive Surgical Inc	390
Xylem Inc/NY	373
HDFC Bank Ltd ADR	365
Revvity Inc	333
Valmont Industries Inc	322
Ecolab Inc	309
Novozymes A/S	308
Croda International Plc	305
Illumina Inc	305
Veolia Environnement SA	296
Amplifon SpA	287
Airtel Africa Plc, 144A	275
Deere & Co	266
MercadoLibre Inc	258
Veeva Systems Inc 'A'	255
Masimo Corp	254
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	185
Vistry Group Plc	142
Energy Recovery Inc	124
MIPS AB	122
Verra Mobility Corp 'A'	122
Emirates Central Cooling Systems Corp	111
Planet Fitness Inc 'A'	101
Coursera Inc	86
FDM Group Holdings Plc	78
Everbridge Inc	71
Stride Inc	68
LITALICO Inc	62

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) USD
Ecolab Inc	69
Verra Mobility Corp 'A'	35

Franklin Responsible Income 2028 Fund^

PRINCIPALES COMPRAS	COSTE (en miles) EUR
Logicor Financing Sarl, 4,625 %, con vencimiento el 25/07/2028	1.500
ING Groep NV, 4,875 %, con vencimiento el 14/11/2027	1.317
Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,375 %, con vencimiento el 21/06/2028	1.313
Thermo Fisher Scientific Inc, 0,500 %, con vencimiento el 01/03/2028	1.309
Schneider Electric SE, 1,500 %, con vencimiento el 15/01/2028	1.297
Abertis Infraestructuras SA, 4,125 %, con vencimiento el 31/01/2028	1.296
Telenor ASA, 0,250 %, con vencimiento el 14/02/2028	1.295
BNP Paribas SA, 0.500 %, con vencimiento el 19/02/2028	1.294
UBS Group AG, 4,625 %, con vencimiento el 17/03/2028	1.293
Werfen SA/Spain, 4,625 %, con vencimiento el 06/06/2028	1.290
Werfen SA/Spain, 4,625 %, con vencimiento el 06/06/2028	1.290
Tele2 AB, 2,125 %, con vencimiento el 15/05/2028	1.286
Teleperformance SE, 0.250 %, con vencimiento el 26/11/2027	1.284
TenneT Holding BV, 1,375 %, con vencimiento el 05/06/2028	1.280
NTT Finance Corp, 0,399 %, con vencimiento el 13/12/2028	1.270
Motability Operations Group Plc, 0,125 %, con vencimiento el 20/07/2028	1.264
Holding d'Infrastructures de Transport SASU, 1,625 %, con vencimiento el 27/11/2027	1.255
H Lundbeck A/S, 0,875 %, con vencimiento el 14/10/2027	1.223
Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, con vencimiento el 27/01/2028	1.217
HSBC Holdings PLC, 4,725 %, con vencimiento el 10/03/2028	1.202
TDF Infrastructure SASU, 5,625 %, con vencimiento el 21/07/2028	1.198
LKQ European Holdings BV, 4,125 %, con vencimiento el 01/04/2028	1.183
Credit Agricole SA, 0,375 %, con vencimiento el 20/04/2028	1.168
ALD SA, 3,875 %, con vencimiento el 24/01/2028	1.099
Verizon Communications Inc, 1,375 %, con vencimiento el 02/11/2028	1.073
UBS Group AG, 4,625 %, con vencimiento el 17/03/2028	1.001
Crown European Holdings SA, 5,000 %, con vencimiento el 15/05/2028	1.000
Danske Bank A/S, 4,500 %, con vencimiento el 09/11/2028	999
Santander UK Group Holdings Plc, 3,530 %, con vencimiento el 25/08/2028	974
Romanian Government International Bond, 2,125 %, con vencimiento el 07/03/2028	947
Deutsche Lufthansa AG, 3,750 %, con vencimiento el 11/02/2028	919
Azelis Finance NV, 5,750 %, con vencimiento el 15/03/2028	908
Bank of Ireland Group Plc, 4,875 %, con vencimiento el 16/07/2028	904
Cloverie Plc for Zurich Insurance Co Ltd, 1,500 %, con vencimiento el 15/12/2028	881
Volvo Car AB, 4,250 %, con vencimiento el 31/05/2028	855
Svenska Handelsbanken AB, 3,750 %, con vencimiento el 01/11/2027	798
DXC Capital Funding DAC, 0,450 %, con vencimiento el 15/09/2027	793
Societe Generale SA, 0,125 %, con vencimiento el 18/02/2028	764
National Grid Plc, 0,163 %, con vencimiento el 20/01/2028	760
Macquarie Group Ltd, 0,350 %, con vencimiento el 03/03/2028	744
PVH Corp, 3,125 %, con vencimiento el 15/12/2027	727
OP Corporate Bank plc, 0,375 %, con vencimiento el 16/06/2028	667

PRINCIPALES VENTAS	INGRESOS (en miles) EUR
Teleperformance SE, 0,250 %, con vencimiento el 26/11/2027	1.333
Tele2 AB, 2,125 %, con vencimiento el 15/05/2028	1.322
Werfen SA/Spain, 4,625 %, con vencimiento el 06/06/2028	1.290
HSBC Holdings PLC, 4,752 %, con vencimiento el 10/03/2028	1.231
International Business Machines Corp, 0,300 %, con vencimiento el 11/02/2028	1.130
Banco Santander SA, 3,875 %, con vencimiento el 17/03/2028	1.091
UBS Group AG, 4,625 %, con vencimiento el 17/03/2028	999
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,000 %, con vencimiento el 04/05/2028	935
TenneT Holding BV, 1,375 %, con vencimiento el 05/06/2028	928
Thames Water Utilities Finance Plc, 0,875 %, con vencimiento el 31/01/2028	924
Vonovia Finance BV, 1,500 %, con vencimiento el 14/01/2028	768
Abanca Corp Bancaria SA, 5,250 %, con vencimiento el 14/09/2028	689
UBS Group AG, 0,650 %, con vencimiento el 14/01/2028	630
Autostrade per l'Italia SpA, 2,000 %, con vencimiento el 04/12/2028	545
United Group BV, 4,625 %, con vencimiento el 15/08/2028	515
Apple Inc, 2,000 %, con vencimiento el 17/09/2027	477
Schneider Electric SE, 1,500 %, con vencimiento el 15/01/2028	461
NTT Finance Corp, 0,399 %, con vencimiento el 13/12/2028	437
Eurobank SA, 2,250 %, con vencimiento el 14/03/2028	425
Kleopatra Finco Sarl, 4,250 %, con vencimiento el 01/03/2026	412
Natwest Group Plc, 1,375 %, con vencimiento el 02/03/2027	371
Cloverie Plc for Zurich Insurance Co Ltd, 1,500 %, con vencimiento el 15/12/2028	369
SANEF SA, 0,950 %, con vencimiento el 19/10/2028	359
SBB Treasury Oyj, 0,750 %, con vencimiento el 14/12/2028	241
Matterhorn Telecom SA, 4,000 %, con vencimiento el 15/11/2027	232
RCI Banque SA, 4,875 %, con vencimiento el 21/09/2028	208

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

Política de remuneración del OICVM V (no auditada)

Remuneración

Franklin Templeton International Services S.à.r.l. ("FTIS"), como sociedad gestora con licencia de OICVM (la "Sociedad Gestora"), tiene una política de remuneración (la "Política") vigente que se aplica a todos los fondos OICVM (cada uno de ellos, un "OICVM" y conjuntamente, los "OICVM") bajo su gestión. La Política ha sido diseñada para desincentivar la asunción de riesgos excesiva e integra criterios de riesgo específicos para las unidades de negocios que cubre en sus sistemas de gestión de rentabilidad. La política tiene una estructura de gobernanza dirigida a prevenir los conflictos de intereses internos.

Existen determinados procedimientos establecidos para la creación, la actualización, la revisión y la aprobación de la Política, así como para su divulgación y su aplicación. En este proceso participan tanto el equipo directivo superior como los departamentos de recursos humanos y de cumplimiento, entre otros, al mismo tiempo que el equipo directivo superior y el Consejo de Administración de la Sociedad Gestora son los encargados de aprobar la Política.

Se define una remuneración fija como salario básico junto con otros beneficios, como pueden ser las contribuciones de pensiones, las primas de seguros de vida o las primas de seguros médicos privados. Los niveles de remuneración fija se establecen en función de la complejidad del trabajo, del grado de responsabilidad, del desempeño y de los datos de referencia del mercado. Estos niveles se revisan con regularidad.

La remuneración variable puede adoptar la forma de pluses anuales, bonificaciones a largo plazo mediante la adjudicación de acciones por desempeño o pagos de incentivos por ventas. Los niveles de remuneración variable se fijan en función del desempeño general de la empresa y de la unidad de negocio, así como del desempeño personal.

La Política está íntegramente disponible en el domicilio social de la Sociedad Gestora. La información cuantitativa pertinente sobre los Fondos se describe a continuación:

Importe total de la remuneración fija pagada por FTIS y sus delegados durante el ejercicio finalizado el 30 de septiembre de 2023*,**,***	11.355.206 €
Importe total de la remuneración variable pagada por FTIS y sus delegados durante el ejercicio finalizado el 30 de septiembre de 2023*,**,***	9.207.100 €
Número de empleados de FTIS y sus delegados a 30 de septiembre de 2023	601
Importe total de la remuneración abonada por FTIS y sus delegados a altos directivos durante el ejercicio finalizado el 30 de septiembre de 2023*,**,***	5.755.423 €
Importe total pagado por FTIS y sus delegados a otros miembros del personal que tengan un impacto sustancial en el perfil de OICVM durante el ejercicio finalizado el 30 de septiembre de 2023*,**,***	cero €

* El importe total de las retribuciones abonadas por FTIS ha sido asignado a cada OICVM sobre la base de su proporción prorrateada en el promedio del patrimonio neto total a final de mes de FTIS durante el ejercicio cerrado el 30 de septiembre de 2023,

** El importe total de las retribuciones abonadas por las filiales de FTIS se ha asignado a cada uno de los OICVM en función de su participación proporcional del promedio de los activos netos a final de mes de las filiales de FTIS para el ejercicio finalizado el 30 de septiembre de 2023.

*** Las delegaciones son entidades de gestión de inversiones que están sujetas a unos requisitos normativos tan efectivos como los que figuran en el artículo 69(3)(a) de la Directiva relativa a los OICVM.

Apéndice: Reglamento sobre operaciones de financiación de valores (SFTR) (sin auditar)

En las tablas siguientes se detallan el valor teórico 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 29 de febrero de 2024:

Acuerdos de recompra inversa

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

Contraparte	País de constitución	Valor nocional bruto agregado (en miles) $	Absolute fair Valor (en miles) $	% del valor neto de los activos
Canadian Imperial Bank of Commerce	Canadá	70.000	70.000	6,28
HSBC Bank (USA)	Reino Unido	55.000	55.000	4,94
J.P. Morgan Securities LLC	Estados Unidos	95.000	95.000	8,52
Royal Bank of Canada	Canadá	50.000	50.000	4,49
TD Securities (USA) LLC	Canadá	39.597	39.597	3,55
		309.597	309.597	27,78

En la siguiente tabla se enumeran los diez mayores emisores de garantías sobre la base del valor de las garantías no monetarias recibidas y la divisa de las garantías no monetarias recibidas a 29 de febrero de 2024:

Fondo	Emisor del colateral*	Moneda	Valor agregado de la garantía real mantenida (en miles)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	Estados Unidos**	Dólar estadounidense	315.822 $

* Cuando hay menos de diez emisores colaterales a 29 de febrero de 2024, se han incluido todos los emisores.

** Los bonos y pagarés subyacentes mantenidos como garantía son emitidos por el Tesoro de los Estados Unidos.

La siguiente tabla ofrece un análisis del tipo y la calidad de las garantías no dinerarias recibidas a 29 de febrero de 2024:

Fondo	Tipo de garantía	Calidad de la garantía	Valor agregado de la garantía real mantenida (en miles)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	Bonos y obligaciones del Estado	Investment Grade	315.822 $

El análisis del plazo de vencimiento inferior se ha basado en la fecha de vencimiento contractual de los Contratos de Recompra Inversa y la garantía asociada recibida/(aportada) a 29 de febrero de 2024:

Fondo	Tipo de garantía	Menos de 1 día (en miles)	1 día hasta 1 semana (en miles)	1 semana a 1 mes (en miles)	1-3 meses (en miles)	3 meses a 1 año (en miles)	Arriba 1 año (en miles)	vencimiento abierto (en miles)	Total (en miles)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	Acuerdos de recompra inversa	–	309.597 $	–	–	–	–	–	309.597 $
	Garantía no en efectivo recibida	–	–	749 $	33.004 $	31.100 $	250.969 $	–	315.822 $

Los acuerdos de recompra inversa mantenidos sobre 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 29 de febrero de 2024, se mantienen en The Bank of New York Mellon, en cuentas segregadas a nombre de la Sociedad. La garantía recibida no se reutiliza.

Todos los costos y rendimientos de los Contratos de recompra inversa se acumulan al Fondo en su totalidad.

Apéndice: Divulgación de personas vinculadas (sin auditar)

Durante el ejercicio cerrado el 29 de febrero de 2024, Pershing Limited, filial de The Bank of New York Mellon Corporation y persona vinculada del Depositario, prestó servicios de corretaje en relación con la negociación de valores con los Fondos registrados de Hong Kong, promulgados a través de los Gestores de Subinversiones de los respectivos Fondos. El valor total agregado de las transacciones con las personas vinculadas del Depositario en relación con la negociación de valores ascendió a 365 millones de dólares estadounidenses, lo que representa el 0,19 % del valor total de dichas transacciones realizadas por estos Fondos. Los honorarios y comisiones de corretaje pagados por los Fondos a Pershing Limited en relación con dichas operaciones de valores para el ejercicio financiero que finalizó el 29 de febrero de 2024 ascendieron a USD 63.130 con una tasa media de comisión de 2 puntos básicos. Se han incluido en los costes de transacción de las compras y ventas de valores relevantes y se presentan en la Nota 4 de estos Estados Financieros.

Durante el ejercicio cerrado el 29 de febrero de 2024, The Bank of New York Mellon (Institutional Bank) y The Bank of New York Mellon SA/NV, ambas personas vinculadas del Depositario, actuaron bajo custodia en operaciones de cambio de divisas y en programas de Administración de Divisas / Cobertura, respectivamente, para los Fondos registrados de Hong Kong. Las comisiones totales pagadas en relación con estas transacciones ascendieron a USD 1.024.021 con una tasa de comisión promedio de 0,22 puntos básicos. El valor total agregado de las transacciones con las personas vinculadas del Depositario por este concepto ascendió a USD 45.706 millones, lo que representa el 1,89 % del valor total de dichas transacciones realizadas por los Fondos.

Todas las transacciones con partes vinculadas se llevaron a cabo en el marco del desarrollo corriente de la actividad empresarial y en condiciones comerciales normales.

Apéndice: Reglamento sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad (no auditado)

El Reglamento (UE) 2019/2088 sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (SFDR) exige que la Sociedad incluya una descripción en sus informes periódicos de la medida en que cualquier Fondo clasificado en virtud del artículo 8 del SFDR (un "Fondo del artículo 8") y el artículo 9 del SFDR (un "Fondo del artículo 9") ha cumplido con sus características ambientales o sociales. Además, el SFDR facultó a la Autoridad Bancaria Europea, la Autoridad Europea de Seguros y Pensiones de Jubilación y la Autoridad Europea de Valores y Mercados (denominadas conjuntamente "AES") a elaborar proyectos de normas técnicas de regulación ("RTS") para especificar el formato de presentación e información en los informes periódicos.

El siguiente apéndice incluye las divulgaciones periódicas de cada Fondo del Artículo 8 y del Artículo 9 del SFDR, que se han preparado utilizando el conjunto común de divulgaciones de sostenibilidad o requisitos de información de las NTR que entraron en vigor el 1 de enero de 2023, Las clasificaciones de activos que figuran en la siguiente información se basan en MSCI y pueden diferir de la clasificación de los valores de las carteras de inversión.

FTGF Western Asset US Core Bond Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
549300WRHLJECFCSP797

FRANKLIN TEMPLETON

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 3,55% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☐ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

El Fondo promovió las siguientes características ambientales o sociales:

- Alineación con uno o más Objetivos de Desarrollo Sostenible de la ONU (ODS) en comparación con el índice de referencia del Fondo, a través de la inversión en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad, y a través de las mejores inversiones en su clase.

- Conformidad con los siguientes indicadores de las PIA:

  - Intensidad de GEI (PIA n.º 3 y n.º 15).
  - Asuntos sociales y de los empleados (PIA n.º 10).
  - Armas controvertidas (PIA n.º 14).

No se han utilizado instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Los indicadores de sostenibilidad utilizados para medir la consecución de cada una de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo fueron:

- Los indicadores de las PIA mencionados en la respuesta anterior. Consulte los valores mostrados en la sección «¿Cómo consideró este producto financiero los principales impactos adversos en los factores de sostenibilidad?» de los indicadores durante el período de referencia.

- A 29 de febrero de 2024, la asignación a bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad era del 3,55 %.

¿...y en comparación con períodos anteriores?

Los indicadores generales en materia de sostenibilidad se ajustan a los del período anterior.

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura	Valor	Cobertura
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	109,18	64,62%	121,00	95,90%
Intensidad de GEI de los países participados USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	203,33	100,00%	235,40	100,00%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	65,42%	0,00%	95,00%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	65,42%	0,00%	95,00%

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

Las inversiones sostenibles del Fondo eran en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad, que se conseguían mediante una asignación mínima a emisores alineados con los ODS en comparación con el índice de referencia del Fondo, y con emisores que cumplían los umbrales de los mejores de su categoría. Dichos bonos tenían KPI vinculados a la sostenibilidad o ingresos que se utilizaron para proyectos que incluían, entre otros:

- Proyectos verdes: energías renovables, eficiencia energética, prevención y control de la contaminación, gestión sostenible desde el punto de vista ambiental de los recursos naturales vivos y del uso de la tierra, biodiversidad, transporte limpio, gestión sostenible del agua y de las aguas residuales, adaptación al cambio climático, economía circular y edificios verdes.
- Proyectos sociales: viviendas e infraestructuras asequibles (agua potable, saneamiento), programas de empleo y avances socioeconómicos, como la educación, la diversidad, la igualdad y la inclusión, entre otros.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

El gestor de inversiones empleó sus investigaciones propias y las PIA para garantizar que las inversiones sostenibles no causaran daño significativo a ningún objetivo importante de inversión sostenible ambiental o social. La investigación propia, junto con el uso de herramientas desarrolladas internamente, incluidas, entre otras, la selección, permitió a los gestores de cartera identificar emisores que el gestor de inversiones no cree que causen daños significativos.

Como resultado, el gestor de inversiones pudo invertir en emisores que se ajustaban a los indicadores de las PIA y evitar los emisores que no se ajustaban. Como parte de la inversión del Fondo en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad, el gestor de inversiones aplicó este enfoque para determinar si un bono cumplía los criterios de sostenibilidad.

Además, los emisores soberanos se sometieron a pruebas basadas en sus libertades políticas o en la corrupción.

A la hora de destinar fondos a inversiones sostenibles, especialmente el 1 % mínimo del Fondo comprometido con objetivos ambientales, si procede, el gestor de inversiones aplicó una evaluación cualitativa adicional (basada en la investigación interna o en la opinión de terceros externos) de la elegibilidad de los emisores y de los proyectos conforme al principio «no causar un perjuicio significativo».

Además, se aplicaron una serie de exclusiones al Fondo para excluir a los emisores que podían causar un perjuicio significativo, como se detalla más adelante.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

El gestor de inversiones desarrolló una herramienta propia de PIA que pudiera tener en cuenta las PIA importantes y ayudara a medir la alineación del Fondo con respecto a los indicadores de PIA que se consideraban importantes para el Fondo.

Las PIA sirvieron de barómetro útil para calibrar en qué emisores invertir: Concretamente, la PIA n.º 3 se utilizó para la evaluación de la intensidad de GEI corporativos y la PIA n.º 15 para la intensidad de los GEI soberanos, respectivamente. La PIA n.º 10 se utilizó para identificar emisores que no cumplían con los Principios del PMNU y las Directrices de la OCDE, mientras que la PIA n.º 14 servía para identificar emisores que no cumplían los criterios en cuanto a armas controvertidas en todo el Fondo en comparación con los del universo de inversión.

Aunque el Fondo no se comprometió a tener una media de PIA mejor que la de su índice de referencia, la diferencia entre las dos métricas ayudó a informar sobre el éxito del Fondo en la gestión de los impactos adversos.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

El Fondo se adhirió a las directrices explícitas que excluían a los emisores que fallaban según los Principios del PMNU y las Directrices de la OCDE. El compromiso del gestor de inversiones con los emisores se basaba en los principios del PMNU y de las Directrices de la OCDE. Los emisores que se consideraron deficientes según los Principios del PMNU y las Directrices de la OCDE se añadieron a la lista roja de ESG del gestor de inversiones, que servía para excluir a los emisores de la inversión del Fondo. Si procedía, el gestor de inversiones intentaría participar con los emisores que le preocupaban, que podían haber fallado explícitamente según las directrices subyacentes.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.

¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

La forma en que se consideraron y se tuvieron en cuenta las PIA se detalla previamente.

Las métricas de las PIA que se presentan a continuación se basan en el cálculo promedio de las síntesis trimestrales durante el período de referencia. El cálculo de las métricas pertinentes se refiere a las inversiones para las que se dispone de los datos ESG subyacentes y no a todas las inversiones mantenidas por el Fondo. Tenga en cuenta que esta información está sujeta a cambios y debe utilizarse solo con fines informativos.

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	109,18	64,62%
Intensidad de GEI de los países participados USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	203,33	100,00%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	65,42%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	65,42%



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
Federal National Mortgage Association	Sector financiero	15,48%	Estados Unidos
United States of America	Bonos del Estado	14,97%	Estados Unidos
Government National Mortgage Association	Sector financiero	9,83%	Estados Unidos
Freddie Mac	Sector financiero	9,66%	Estados Unidos
FRANKLIN RESOURCES, INC.	Sector financiero	4,17%	Estados Unidos
UBS Group AG	Sector financiero	2,08%	Estados Unidos
BANK OF AMERICA CORPORATION	Sector financiero	1,93%	Estados Unidos
WELLS FARGO & COMPANY	Sector financiero	1,77%	Estados Unidos
CITIGROUP INC.	Sector financiero	1,59%	Estados Unidos
THE GOLDMAN SACHS GROUP, INC.	Sector financiero	1,48%	Estados Unidos
MORGAN STANLEY	Sector financiero	1,16%	Estados Unidos
JPMORGAN CHASE & CO.	Sector financiero	1,12%	Estados Unidos
VERIZON COMMUNICATIONS INC.	Servicios de comunicación	0,80%	Estados Unidos
Estados Unidos Mexicanos	Bonos del Estado	0,79%	México
RITHM CAPITAL CORP.	Sector financiero	0,74%	Estados Unidos

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

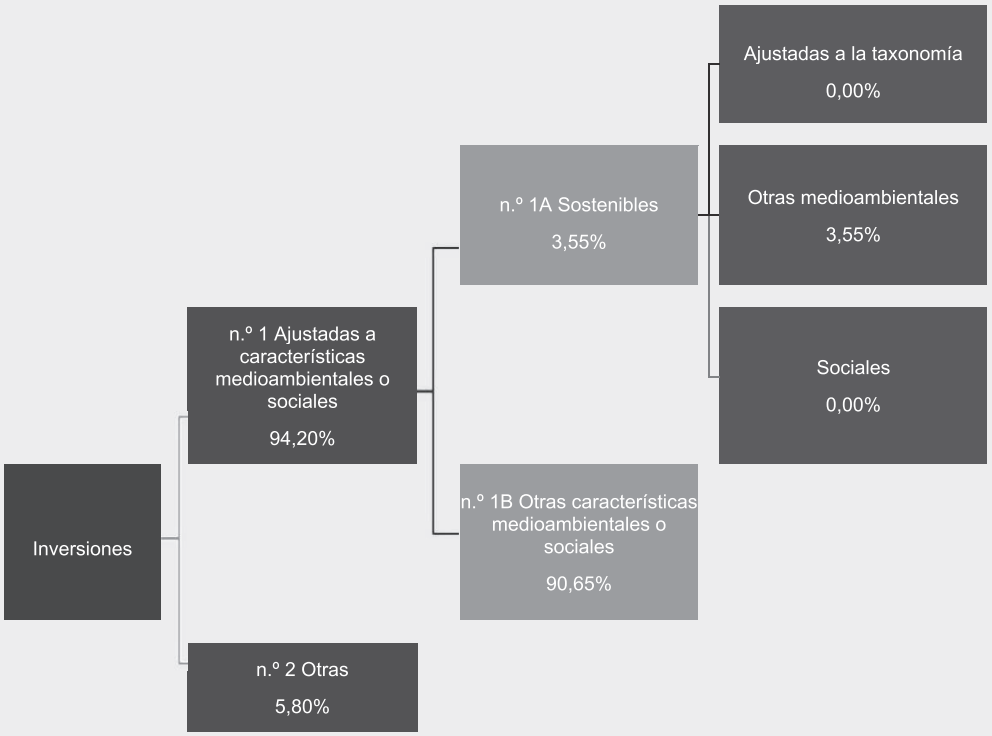
A 29 de febrero de 2024, la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 3,55 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

A 29 de febrero de 2024, el 94,20 % del Fondo se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas por este. La parte restante (5,80 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos o emisores para los que no había una calificación ESG.

Del segmento del Fondo que se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo destinó el 3,55 % de sus activos a inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

Sector principal	% de activos
Sector financiero	55,16%
Bonos del Estado	26,97%
Energía	4,16%
Servicios de comunicación	3,40%
Sector sanitario	2,66%
Consumo discrecional	1,85%
Materiales	1,57%
Tecnología de la información	1,56%
Sector industrial	1,14%
Bienes básicos de consumo	0,88%
Servicios públicos	0,84%
Sector inmobiliario	0,37%

Principales subsectores	% de activos
Servicios financieros	42,98%
Bonos del Estado	26,97%
Bancos	8,75%
Petróleo, gas y combustibles de consumo	3,93%
Mercados de capitales	2,41%
Medios de comunicación	1,39%
Proveedores y servicios sanitarios	1,28%
Servicios de telecomunicaciones diversificados	1,27%
Metales y minería	0,88%
Venta al por menor	0,83%
Semiconductores y equipos semiconductores	0,76%
Biotecnología	0,67%
Papel y productos forestales	0,53%
Industria farmacéutica	0,53%
Hoteles, restaurantes y actividades de ocio	0,51%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la Taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

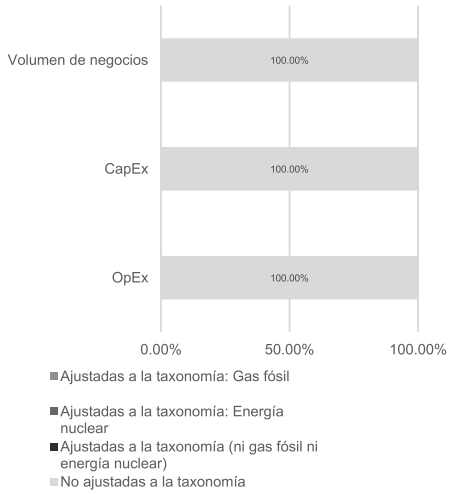
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

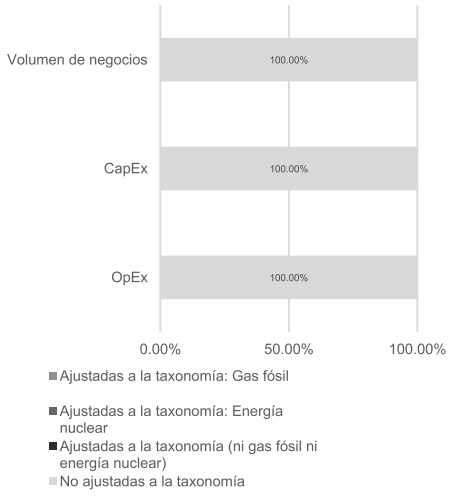
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transició facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

En línea con la estrategia de inversión, a saber, el compromiso del Fondo de mantener una exposición mínima a las «inversiones sostenibles» con un objetivo ambiental según el Reglamento sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (art. 2 [17]) que no pueden considerarse sostenibles desde el punto de vista ambiental con arreglo al Reglamento sobre la taxonomía de la UE, el 3,55 % del Fondo estaba compuesto por «inversiones sostenibles» con un objetivo ambiental que no pueden considerarse sostenibles desde el punto de vista ambiental con arreglo a la Taxonomía de la UE, a 29 de febrero de 2024.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

No se aplica.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

A 29 de febrero de 2024, la proporción de inversiones en «N.º 2 Otros» era del 5,80 % e incluía el efectivo y los derivados u otros emisores para los que no había salvaguardias ambientales o sociales mínimas.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

Western Asset cree que los factores ESG importantes desde el punto de vista financiero pueden afectar a la solvencia de los valores de los emisores de renta fija y, por lo tanto, al rendimiento de las carteras de inversión de renta fija. Estos factores son totalmente coherentes con la filosofía de inversión a largo plazo y orientados al valor fundamental de la empresa. Los analistas de investigación de Western Asset se encargaron de proporcionar un análisis fundamental en el ámbito del sector y del emisor, y de opinar sobre las características de riesgo/recompensa del sector y del emisor mediante la incorporación de consideraciones ESG importantes desde el punto de vista financiero. Con el respaldo de este enfoque más amplio, el Fondo pretendía cumplir con sus características ambientales y sociales e invertir en emisores para que la cartera general cumpliera con las calificaciones mínimas de ESG, lograra su descarbonización y alineación con los ODS, y evitara los emisores identificados mediante la aplicación de exclusiones SRI asignadas a sectores e invertidas en emisores objetivo.

Para cumplir las características ambientales o sociales durante el período de referencia:

A. El Fondo buscó una calificación media MSCI ESG de BBB o superior.

B. El Fondo buscó una intensidad de carbono promedio ponderada («WACI») general que estuviera al menos un 20 % por debajo del índice de referencia. Esto ayudó a ajustar el Fondo con las PIA n.º 3 y n.º 15 (Intensidad de GEI).

C. El Fondo intentó alinearse, mejor que el índice de referencia, con respecto a las inversiones en valores de emisores cuyas actividades contribuyeron a al menos uno de los ocho ODS seleccionados.

D. El Fondo excluyó a los emisores que fracasaron en una variedad de objetivos de SRI, como se describe a continuación:

a. Emisores que obtengan más del 5 % de sus ingresos de la producción y/o distribución de tabaco y de la producción de armas nucleares.

b. Emisores que obtengan más del 10 % de los ingresos de armas de fuego civiles (fabricación o suministro), armas convencionales o la minería del carbón térmico (producción o distribución).

c. Emisores que fabriquen armas controvertidas (minas terrestres antipersona, armas bioquímicas, armas láser cegadoras, uranio empobrecido, armas incendiarias y fragmentos no detectables), sean propietarios de una empresa de armas controvertidas o de una empresa de armas controvertidas, en consonancia con el indicador de la PIA n.º 14 (Exposición a armas controvertidas).

d. Emisores que «no superen» los principios del PMNU y de la OCDE, sobre la base de una investigación interna que pretende identificar las deficiencias en el cumplimiento de los objetivos por parte de los emisores, en consonancia con la PIA n.º 10 (Asuntos sociales y de los empleados).

Como parte de la inversión mínima del 1 % en inversiones sostenibles (definidas como bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad), el Fondo tenía un 3,55 % invertido por valor de mercado a 29 de febrero de 2024.

El Fondo cumplió con sus pautas ambientales y sostenibles como se indica a continuación:

A. El Fondo recibió la calificación A según ESG MSCI.

B. El WACI general del Fondo fue el 63,6 % del índice de referencia.

C. La asignación del Fondo a emisores y emisiones alineadas con los ODS fue del 28,3 % frente al 20,7 % del índice de referencia.

D. El Fondo tenía un 3,55 % invertido por valor de mercado en inversiones sostenibles a 29 de febrero de 2024.

E. Según las definiciones de Western Asset con respecto al Pacto Mundial de las Naciones Unidas, el Fondo no mantuvo ningún emisor que incumpliera las directrices del SRI.

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
472PNIHDHJOEBNUD0P21

FRANKLIN TEMPLETON

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 3,68% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☐ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

El Fondo promovió las siguientes características ambientales o sociales:

- Alineación con uno o más Objetivos de Desarrollo Sostenible de la ONU (ODS) en comparación con el índice de referencia del Fondo, a través de la inversión en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad, y a través de las mejores inversiones en su clase.

- Conformidad con los siguientes indicadores de las PIA:

  - Intensidad de GEI (PIA n.º 3 y n.º 15).
  - Asuntos sociales y de los empleados (PIA n.º 10).
  - Armas controvertidas (PIA n.º 14).

No se han utilizado instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Los indicadores de sostenibilidad utilizados para medir la consecución de cada una de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo fueron:

- Los indicadores de las PIA mencionados en la respuesta anterior. Consulte los valores mostrados en la sección «¿Cómo consideró este producto financiero los principales impactos adversos en los factores de sostenibilidad?» de los indicadores durante el período de referencia.

- A 29 de febrero de 2024, la asignación a bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad era del 3,68 %.

¿...y en comparación con períodos anteriores?

Los indicadores generales en materia de sostenibilidad se ajustan a los del período anterior.

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura	Valor	Cobertura
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	151,54	72,43%	149,90	93,20%
Intensidad de GEI de los países participados USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	183,19	100,00%	232,10	100,00%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	72,48%	0,00%	92,00%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	72,52%	0,00%	92,00%

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

Las inversiones sostenibles del Fondo eran en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad, que se conseguían mediante una asignación mínima a emisores alineados con los ODS en comparación con el índice de referencia del Fondo, y con emisores que cumplían los umbrales de los mejores de su categoría. Dichos bonos tenían KPI vinculados a la sostenibilidad o ingresos que se utilizaron para proyectos que incluían, entre otros:

- Proyectos verdes: energías renovables, eficiencia energética, prevención y control de la contaminación, gestión sostenible desde el punto de vista ambiental de los recursos naturales vivos y del uso de la tierra, biodiversidad, transporte limpio, gestión sostenible del agua y de las aguas residuales, adaptación al cambio climático, economía circular y edificios verdes.
- Proyectos sociales: viviendas e infraestructuras asequibles (agua potable, saneamiento), programas de empleo y avances socioeconómicos, como la educación, la diversidad, la igualdad y la inclusión, entre otros.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

El gestor de inversiones empleó sus investigaciones propias y las PIA para garantizar que las inversiones sostenibles no causaran daño significativo a ningún objetivo importante de inversión sostenible ambiental o social. La investigación propia, junto con el uso de herramientas desarrolladas internamente, incluidas, entre otras, la selección, permitió a los gestores de cartera identificar emisores que el gestor de inversiones no cree que causen daños significativos.

Como resultado, el gestor de inversiones pudo invertir en emisores que se ajustaban a los indicadores de las PIA y evitar los emisores que no se ajustan. Como parte de la inversión del Fondo en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad, el gestor de inversiones aplica este enfoque para determinar si un bono cumplía los criterios de sostenibilidad.

Además, los emisores soberanos se sometieron a pruebas basadas en sus libertades políticas o en la corrupción.

A la hora de destinar fondos a inversiones sostenibles, especialmente el 1 % mínimo del Fondo comprometido con objetivos ambientales, si procede, el gestor de inversiones aplicó una evaluación cualitativa adicional (basada en la investigación interna o en la opinión de terceros externos) de la elegibilidad de los emisores y de los proyectos conforme al principio «no causar un perjuicio significativo».

Además, se aplicaron una serie de exclusiones al Fondo para excluir a los emisores que podían causar un perjuicio significativo, como se detalla más adelante.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

El gestor de inversiones desarrolló una herramienta propia de PIA que pudiera tener en cuenta las PIA importantes y ayudara a medir la alineación del Fondo con respecto a los indicadores de PIA que se consideraban importantes para el Fondo.

Las PIA sirvieron de barómetro útil para calibrar en qué emisores invertir: Concretamente, la PIA n.º 3 se utilizó para la evaluación de la intensidad de GEI corporativos y la PIA n.º 15 para la intensidad de los GEI soberanos, respectivamente. La PIA n.º 10 se utilizó para identificar emisores que no cumplían con los Principios del PMNU y las Directrices de la OCDE, mientras que la PIA n.º 14 servía para identificar emisores que no cumplían los criterios en cuanto a armas controvertidas en todo el Fondo en comparación con los del universo de inversión.

Aunque el Fondo no se comprometió a tener una media de PIA mejor que la de su índice de referencia, la diferencia entre las dos métricas ayudó a informar sobre el éxito del Fondo en la gestión de los impactos adversos.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

El Fondo se adhirió a las directrices explícitas que excluían a los emisores que fallaban según los Principios del PMNU y las Directrices de la OCDE. El compromiso del gestor de inversiones con los emisores se basaba en los principios del PMNU y de las Directrices de la OCDE. Los emisores que se consideraron deficientes según los Principios del PMNU y las Directrices de la OCDE se añadieron a la lista roja de ESG del gestor de inversiones, que servía para excluir a los emisores de la inversión del Fondo. Si procedía, el gestor de inversiones intentaría participar con los emisores que le preocupaban, que podían haber fallado explícitamente según las directrices subyacentes.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.

¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

La forma en que se consideraron y se tuvieron en cuenta las PIA se detalla previamente.

Las métricas de las PIA que se presentan a continuación se basan en el cálculo promedio de las síntesis trimestrales durante el período de referencia. El cálculo de las métricas pertinentes se refiere a las inversiones para las que se dispone de los datos ESG subyacentes y no a todas las inversiones mantenidas por el Fondo. Tenga en cuenta que esta información está sujeta a cambios y debe utilizarse solo con fines informativos.

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	151,54	72,43%
Intensidad de GEI de los países participados USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	183,19	100,00%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	72,48%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	72,52%

¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
Federal National Mortgage Association	Sector financiero	15,25%	Estados Unidos
Government National Mortgage Association	Sector financiero	9,97%	Estados Unidos
Freddie Mac	Sector financiero	9,72%	Estados Unidos
United States of America	Bonos del Estado	6,49%	Estados Unidos
Estados Unidos Mexicanos	Bonos del Estado	3,74%	México
UBS Group AG	Sector financiero	2,22%	Estados Unidos
CITIGROUP INC.	Sector financiero	2,16%	Estados Unidos
BANK OF AMERICA CORPORATION	Sector financiero	2,04%	Estados Unidos
WELLS FARGO & COMPANY	Sector financiero	1,87%	Estados Unidos
THE GOLDMAN SACHS GROUP, INC.	Sector financiero	1,82%	Estados Unidos
JPMORGAN CHASE & CO.	Sector financiero	1,15%	Estados Unidos
BNP PARIBAS SA	Sector financiero	1,01%	Francia
Republica Federativa do Brasil	Bonos del Estado	0,90%	Brasil
VERIZON COMMUNICATIONS INC.	Servicios de comunicación	0,81%	Estados Unidos
ABBVIE INC.	Sector sanitario	0,69%	Estados Unidos

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

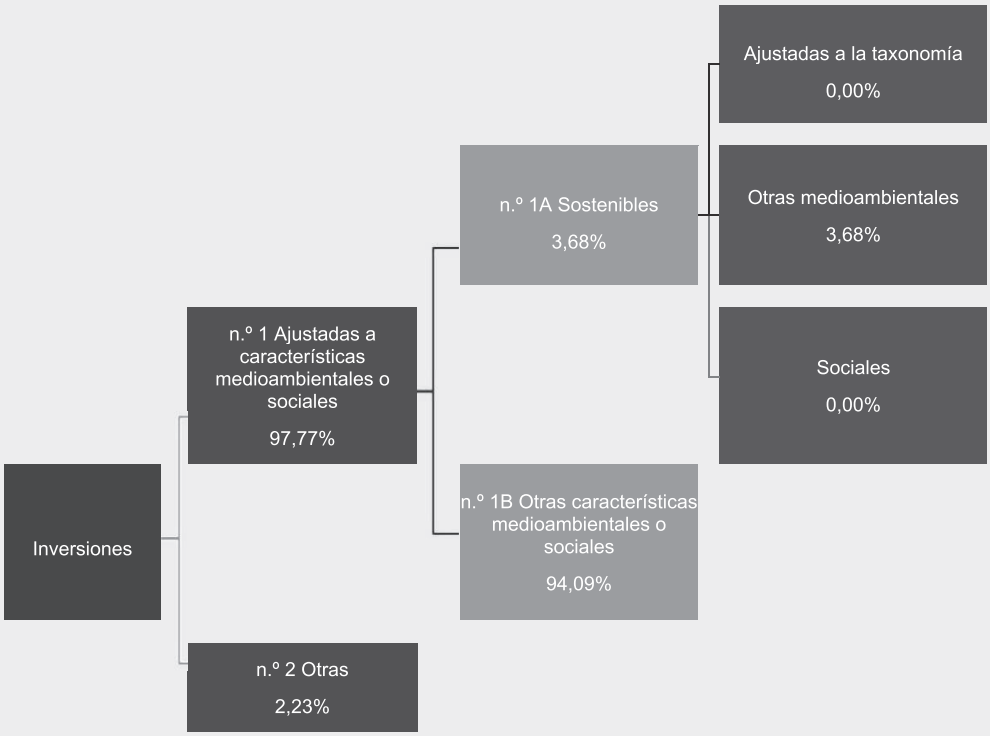
A 29 de febrero de 2024, la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 3,68 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

A 29 de febrero de 2024, el 97,77 % del Fondo se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas por este. La parte restante (2,23 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos o emisores para los que no había una calificación ASG.

Del segmento de la cartera del Fondo que se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo destinó el 3,68 % de sus activos a inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

Sector principal	% de activos
Sector financiero	55,16%
Bonos del Estado	26,97%
Energía	4,16%
Servicios de comunicación	3,40%
Sector sanitario	2,66%
Consumo discrecional	1,85%
Materiales	1,57%
Tecnología de la información	1,56%
Sector industrial	1,14%
Bienes básicos de consumo	0,88%
Servicios públicos	0,84%
Sector inmobiliario	0,37%

Principales subsectores	% de activos
Servicios financieros	38,25%
Bonos del Estado	22,62%
Bancos	9,22%
Petróleo, gas y combustibles de consumo	4,89%
Mercados de capitales	3,17%
Proveedores y servicios sanitarios	1,93%
Medios de comunicación	1,75%
Servicios de telecomunicaciones diversificados	1,35%
Hoteles, restaurantes y actividades de ocio	1,19%
Industria farmacéutica	0,97%
Venta al por menor	0,83%
Biotecnología	0,73%
Servicios inalámbricos de telecomunicaciones	0,66%
Productos financieros al consumo	0,64%
Bebidas	0,61%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la Taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

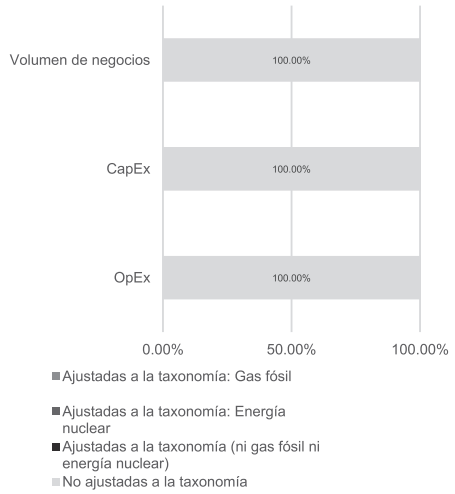
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

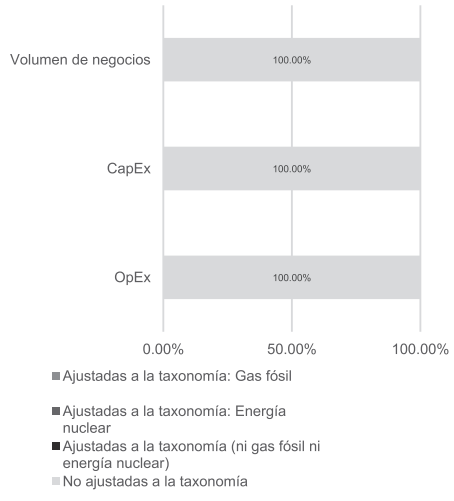
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transició facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

En línea con la estrategia de inversión, a saber, el compromiso del Fondo de mantener una exposición mínima a las «inversiones sostenibles» con un objetivo ambiental según el Reglamento sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (art. 2 [17]) que no pueden considerarse sostenibles desde el punto de vista ambiental con arreglo al Reglamento sobre la taxonomía de la UE, el 3,68 % del Fondo estaba compuesto por «inversiones sostenibles» con un objetivo ambiental que no pueden considerarse sostenibles desde el punto de vista ambiental con arreglo a la Taxonomía de la UE, a 29 de febrero de 2024.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

No se aplica.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

A 29 de febrero de 2024, la proporción de inversiones en «N.º 2 Otros» era del 2,23 % e incluía el efectivo, los derivados y los emisores para los que no había calificaciones ESG ni salvaguardias ambientales o sociales mínimas.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

Western Asset cree que los factores ESG importantes desde el punto de vista financiero pueden afectar a la solvencia de los valores de los emisores de renta fija y, por lo tanto, al rendimiento de las carteras de inversión de renta fija. Estos factores son totalmente coherentes con la filosofía de inversión a largo plazo y orientados al valor fundamental de la empresa. Los analistas de investigación de Western Asset se encargaron de proporcionar un análisis fundamental en el ámbito del sector y del emisor, y de opinar sobre las características de riesgo/recompensa del sector y del emisor mediante la incorporación de consideraciones ESG importantes. Con el respaldo de este enfoque más amplio, el Fondo pretendía cumplir con sus características ambientales y sociales e invertir en emisores para que la cartera general cumpliera con las calificaciones mínimas de ESG, lograra su descarbonización y alineación con los ODS, y evitara los emisores identificados mediante la aplicación de exclusiones SRI asignadas a sectores e invertidas en emisores objetivo.

Para cumplir las características ambientales o sociales durante el período de referencia:

A. El Fondo buscó una calificación media MSCI ESG de BBB o superior.

B. El Fondo buscó una intensidad de carbono promedio ponderada («WACI») general que estuviera al menos un 20 % por debajo del índice de referencia. Esto ayudó a ajustar el Fondo con las PIA n.º 3 y n.º 15 (Intensidad de GEI).

C. El Fondo intentó alinearse, mejor que el índice de referencia, con respecto a las inversiones en valores de emisores cuyas actividades contribuyeron a al menos uno de los ocho ODS seleccionados.

D. El Fondo excluyó a los emisores que fracasaron en una variedad de objetivos de SRI, como se describe a continuación:

a. Emisores que obtengan más del 5 % de sus ingresos de la producción y/o distribución de tabaco y de la producción de armas nucleares.

b. Emisores que obtengan más del 10 % de los ingresos de armas de fuego civiles (fabricación o suministro), armas convencionales o la minería del carbón térmico (producción o distribución).

c. Emisores que fabriquen armas controvertidas (minas terrestres antipersona, armas bioquímicas, armas láser cegadoras, uranio empobrecido, armas incendiarias y fragmentos no detectables), sean propietarios de una empresa de armas controvertidas o de una empresa de armas controvertidas, en consonancia con el indicador de la PIA n.º 14 (Exposición a armas controvertidas).

d. Emisores que «no superen» los principios del PMNU y de la OCDE, sobre la base de una investigación interna que pretende identificar las deficiencias en el cumplimiento de los objetivos por parte de los emisores, en consonancia con la PIA n.º 10 (Asuntos sociales y de los empleados).

Como parte de la inversión mínima del 1 % en inversiones sostenibles (definidas como bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad), el Fondo tenía un 3,68 % invertido por valor de mercado a 29 de febrero de 2024.

El Fondo cumplió con sus pautas ambientales y sostenibles como se indica a continuación:

A. El Fondo recibió la calificación A según ESG MSCI.

B. El WACI general del Fondo fue el 63,5 % del índice de referencia.

C. La asignación del Fondo a emisores y emisiones alineadas con los ODS fue del 30,2 % frente al 20,7 % del índice de referencia.

D. El Fondo tenía un 3,68 % invertido por valor de mercado en inversiones sostenibles a 29 de febrero de 2024.

E. Según las definiciones de Western Asset con respecto al Pacto Mundial de las Naciones Unidas, el Fondo no mantuvo ningún emisor que incumpliera las directrices del SRI.

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
5493004ZO0T2R3JB1A61

FRANKLIN TEMPLETON

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 4,39% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☐ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

El Fondo promovió las siguientes características ambientales o sociales:

- Alineación con uno o más Objetivos de Desarrollo Sostenible de la ONU (ODS) en comparación con el índice de referencia del Fondo, a través de la inversión en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad, y a través de las mejores inversiones en su clase.

- Conformidad con los siguientes indicadores de las PIA:

  - Intensidad de GEI (PIA n.º 3 y n.º 15).
  - Asuntos sociales y de los empleados (PIA n.º 10).
  - Armas controvertidas (PIA n.º 14).

No se han utilizado instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Los indicadores de sostenibilidad utilizados para medir la consecución de cada una de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo fueron:

- Los indicadores de las PIA mencionados en la respuesta anterior. Consulte los valores mostrados en la sección «¿Cómo consideró este producto financiero los principales impactos adversos en los factores de sostenibilidad?» de los indicadores durante el período de referencia.

- A 29 de febrero de 2024, la asignación a bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad era del 4,39 %.

¿...y en comparación con períodos anteriores?

Los indicadores generales en materia de sostenibilidad se ajustan a los del período anterior.

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura	Valor	Cobertura
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	152,74	48,45%	184,30	80,40%
Intensidad de GEI de los países participados USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	211,94	100,00%	245,00	100,00%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	50,04%	0,00%	83,00%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	50,04%	0,00%	83,00%

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

Las inversiones sostenibles del Fondo eran en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad, que se conseguían mediante una asignación mínima a emisores alineados con los ODS en comparación con el índice de referencia del Fondo, y con emisores que cumplían los umbrales de los mejores de su categoría. Dichos bonos tenían KPI vinculados a la sostenibilidad o ingresos que se utilizaron para proyectos que incluían, entre otros:

- Proyectos verdes: energías renovables, eficiencia energética, prevención y control de la contaminación, gestión sostenible desde el punto de vista ambiental de los recursos naturales vivos y del uso de la tierra, biodiversidad, transporte limpio, gestión sostenible del agua y de las aguas residuales, adaptación al cambio climático, economía circular y edificios verdes.
- Proyectos sociales: viviendas e infraestructuras asequibles (agua potable, saneamiento), programas de empleo y avances socioeconómicos, como la educación, la diversidad, la igualdad y la inclusión, entre otros.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

El gestor de inversiones empleó sus investigaciones propias y las PIA para garantizar que las inversiones sostenibles no causaran daño significativo a ningún objetivo de inversión sostenible ambiental o social. La investigación propia, junto con el uso de herramientas desarrolladas internamente, incluidas, entre otras, la selección, permitió a los gestores de cartera identificar emisores que el gestor de inversiones no cree que causen daños significativos.

Como resultado, el gestor de inversiones pudo invertir en emisores que se ajustaban a los indicadores de las PIA y evitar los emisores que no se ajustaban. Como parte de la inversión del Fondo en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad, el gestor de inversiones aplicó este enfoque para determinar si un bono cumplía los criterios de sostenibilidad.

Además, los emisores soberanos se sometieron a pruebas basadas en sus libertades políticas o en la corrupción.

A la hora de destinar fondos a inversiones sostenibles, especialmente el 1 % mínimo de la cartera del Fondo comprometido con objetivos ambientales, si procede, el gestor de inversiones aplicó una evaluación cualitativa adicional (basada en la investigación interna o en la opinión de terceros externos) de la elegibilidad de los emisores y de los proyectos conforme al principio «no causar un perjuicio significativo».

Además, se aplicaron una serie de exclusiones al Fondo para excluir a los emisores que podían causar un perjuicio significativo, como se detalla más adelante.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

El gestor de inversiones desarrolló una herramienta propia de PIA que pudiera tener en cuenta las PIA importantes y ayudara a medir la alineación del Fondo con respecto a los indicadores de PIA que se consideraban importantes para el Fondo.

Las PIA sirvieron de barómetro útil para calibrar en qué emisores invertir: Concretamente, la PIA n.º 3 se utilizó para la evaluación de la intensidad de GEI corporativos y la PIA n.º 15 para la intensidad de los GEI soberanos, respectivamente. La PIA n.º 10 se utilizó para identificar emisores que no cumplían con los Principios del PMNU y las Directrices de la OCDE, mientras que la PIA n.º 14 servía para identificar emisores que no cumplían los criterios en cuanto a armas controvertidas en todo el Fondo en comparación con los del universo de inversión.

Aunque el Fondo no se comprometió a tener una media de PIA mejor que la de su índice de referencia, la diferencia entre las dos métricas ayudó a informar sobre el éxito del Fondo en la gestión de los impactos adversos.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

El Fondo se adhirió a las directrices explícitas que excluían a los emisores que fallaban según los Principios del PMNU y las Directrices de la OCDE. El compromiso del gestor de inversiones con los emisores se basaba en los principios del PMNU y de las Directrices de la OCDE. Los emisores que se consideraron deficientes según los Principios del PMNU y las Directrices de la OCDE se añadieron a la lista roja de ESG del gestor de inversiones, que servía para excluir a los emisores de la inversión del Fondo. Si procedía, el gestor de inversiones intentaría participar con los emisores que le preocupaban, que podían haber fallado explícitamente según las directrices subyacentes.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.

¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

La forma en que se consideraron y se tuvieron en cuenta las PIA se detalla previamente.

Las métricas de las PIA que se presentan a continuación se basan en el cálculo promedio de las síntesis trimestrales durante el período de referencia. El cálculo de las métricas pertinentes se refiere a las inversiones para las que se dispone de los datos ESG subyacentes y no a todas las inversiones mantenidas por el Fondo. Tenga en cuenta que esta información está sujeta a cambios y debe utilizarse solo con fines informativos.

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	152,74	48,45%
Intensidad de GEI de los países participados USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	211,94	100,00%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	50,04%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	50,04%

¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
United States of America	Bonos del Estado	19,25%	Estados Unidos
Pemerintah Republik Indonesia	Bonos del Estado	2,41%	Indonesia
Rzeczpospolita Polska	Bonos del Estado	1,76%	Polonia
Republic of South Africa	Bonos del Estado	1,59%	Sudáfrica
FRANKLIN RESOURCES, INC.	Sector financiero	1,35%	Estados Unidos
Republica Federativa do Brasil	Bonos del Estado	1,23%	Brasil
FORD MOTOR CREDIT COMPANY LLC	Sector financiero	1,14%	Estados Unidos
UBS Group AG	Sector financiero	1,10%	Estados Unidos
WELLS FARGO & COMPANY	Sector financiero	0,94%	Estados Unidos
SPRINT CAPITAL CORPORATION	Servicios de comunicación	0,87%	Estados Unidos
JPMORGAN CHASE & CO.	Sector financiero	0,83%	Estados Unidos
TESCO PLC	Sector financiero	0,77%	Reino Unido
RANGE RESOURCES CORPORATION	Energía	0,75%	Estados Unidos
UNITED RENTALS (NORTH AMERICA), INC.	Sector industrial	0,73%	Estados Unidos
LLOYDS BANKING GROUP PLC	Sector financiero	0,72%	Reino Unido

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

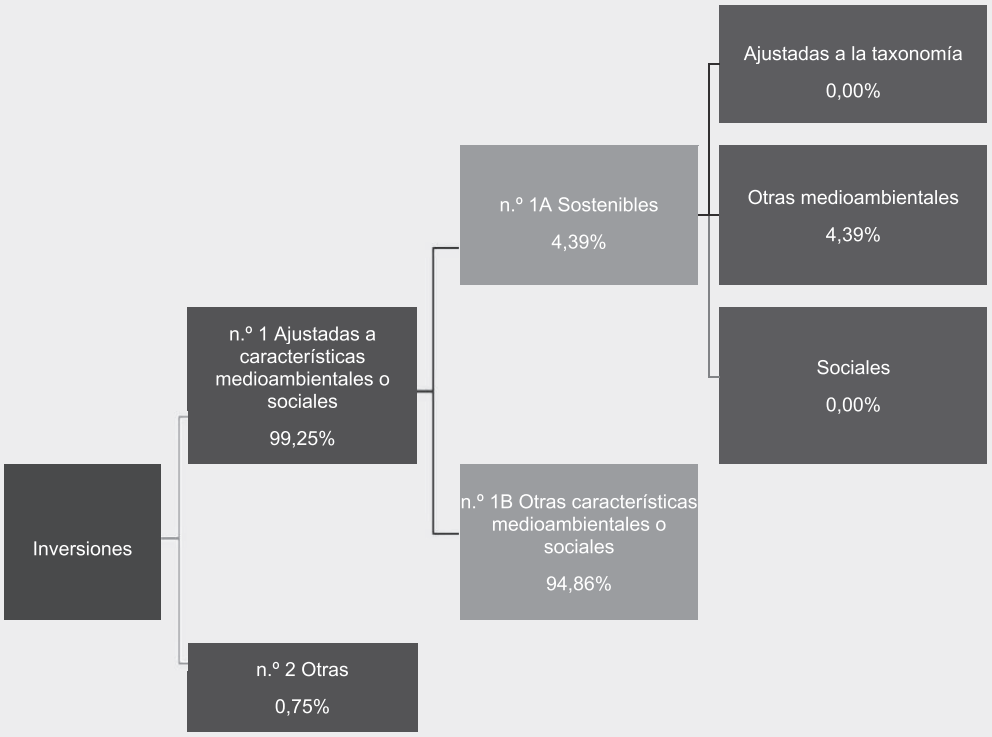
A 29 de febrero de 2024, la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 4,39 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

A 29 de febrero de 2024, el 99,25 % del Fondo se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas por este. La parte restante (0,75 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos o emisores sin una calificación ESG.

Del segmento del Fondo que se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo destinó el 4,39 % de sus activos a inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

Sector principal	% de activos
Bonos del Estado	34,84%
Sector financiero	24,20%
Servicios de comunicación	7,29%
Energía	7,06%
Sector industrial	5,17%
Consumo discrecional	5,02%
Materiales	3,52%
Sector sanitario	2,43%
Sector inmobiliario	1,43%
Tecnología de la información	1,19%
Bienes básicos de consumo	0,91%
Servicios públicos	0,10%

Principales subsectores	% de activos
Bonos del Estado	34,84%
Bancos	9,42%
Servicios financieros	8,92%
Petróleo, gas y combustibles de consumo	5,99%
Medios de comunicación	3,28%
Hoteles, restaurantes y actividades de ocio	3,09%
Mercados de capitales	2,50%
Servicios de telecomunicaciones diversificados	1,95%
Seguros	1,74%
Servicios y suministros comerciales	1,60%
Aerolíneas de pasajeros	1,57%
Servicios inalámbricos de telecomunicaciones	1,52%
Productos financieros al consumo	1,52%
Envases y envoltorios	1,27%
Industria farmacéutica	1,15%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la Taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

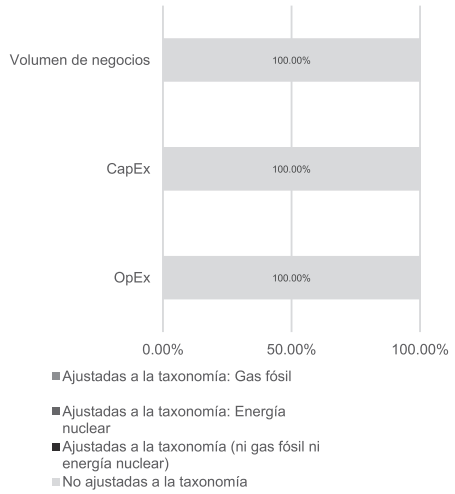
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

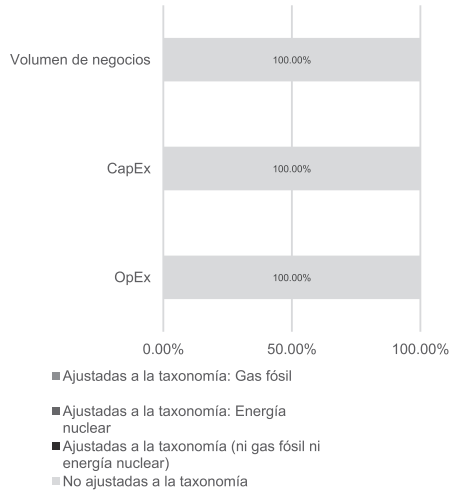
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transició facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

En línea con la estrategia de inversión, a saber, el compromiso del Fondo de mantener una exposición mínima a las «inversiones sostenibles» con un objetivo ambiental según el Reglamento sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (art. 2 [17]) que no pueden considerarse sostenibles desde el punto de vista ambiental con arreglo al Reglamento sobre la taxonomía de la UE, el 4,39 % del Fondo estaba compuesto por «inversiones sostenibles» con un objetivo ambiental que no pueden considerarse sostenibles desde el punto de vista ambiental con arreglo a la Taxonomía de la UE, a 29 de febrero de 2024.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

No se aplica.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

A 29 de febrero de 2024, la proporción de inversiones en «N.º 2 Otros» era del 0,75 % e incluía el efectivo, los derivados y los emisores sin calificaciones ESG para los que no había salvaguardias ambientales o sociales mínimas.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

Western Asset cree que los factores ESG importantes desde el punto de vista financiero pueden afectar a la solvencia de los valores de los emisores de renta fija y, por lo tanto, al rendimiento de las carteras de inversión de renta fija. Estos factores son totalmente coherentes con la filosofía de inversión a largo plazo y orientados al valor fundamental de la empresa. Los analistas de investigación de Western Asset se encargaron de proporcionar un análisis fundamental en el ámbito del sector y del emisor, y de opinar sobre las características de riesgo/recompensa del sector y del emisor mediante la incorporación de consideraciones ESG importantes. Con el respaldo de este enfoque más amplio, el Fondo pretendía cumplir con sus características ambientales y sociales e invertir en emisores para que la cartera general cumpliera con las calificaciones mínimas de ESG, lograra su descarbonización y alineación con los ODS, y evitara los emisores identificados mediante la aplicación de exclusiones SRI asignadas a sectores e invertidas en emisores objetivo.

Para cumplir las características ambientales o sociales durante el período de referencia:

A. El Fondo buscó una calificación media MSCI ESG de BBB o superior.

B. El Fondo buscó una intensidad de carbono promedio ponderada («WACI») general que esté al menos un 20 % por debajo del índice de referencia del indicador. Esto ayudó a ajustar el Fondo con las PIA n.º 3 y n.º 15 (Intensidad de GEI).

C. El Fondo intentó invertir un mínimo del 20 % en valores de emisores cuyas actividades contribuyeran a al menos uno de los ocho ODS seleccionados.

D. El Fondo excluyó a los emisores que fracasaron en una variedad de objetivos de SRI, como se describe a continuación:

a. Emisores que obtengan más del 5 % de sus ingresos de la producción y/o distribución de tabaco y de la producción de armas nucleares.

b. Emisores que obtengan más del 10 % de los ingresos de armas de fuego civiles (fabricación o suministro), armas convencionales o la minería del carbón térmico (producción o distribución).

c. Emisores que fabriquen armas controvertidas (minas terrestres antipersona, armas bioquímicas, armas láser cegadoras, uranio empobrecido, armas incendiarias y fragmentos no detectables), sean propietarios de una empresa de armas controvertidas o de una empresa de armas controvertidas, en consonancia con el indicador de la PIA n.º 14 (Exposición a armas controvertidas).

d. Emisores que «no superen» los principios del PMNU y de la OCDE, sobre la base de una investigación interna que pretende identificar las deficiencias en el cumplimiento de los objetivos por parte de los emisores, en consonancia con la PIA n.º 10 (Asuntos sociales y de los empleados).

Como parte de la inversión mínima del 1 % en inversiones sostenibles (definidas como bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad), el Fondo tenía un 4,39 % invertido por valor de mercado a 29 de febrero de 2024.

El Fondo cumplió con sus pautas ambientales y sostenibles como se indica a continuación:

A. El Fondo recibió la calificación BBB según ESG MSCI.

B. El WACI general del Fondo fue el 74,9 % del índice de referencia del indicador.

C. La asignación del Fondo a emisores y emisiones alineadas con los ODS fue del 28,8 %.

D. Según las definiciones de Western Asset con respecto al Pacto Mundial de las Naciones Unidas, el Fondo no mantuvo ningún emisor que incumpliera las directrices del SRI.

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica

FTGF Western Asset US High Yield Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
5493005YY2WWVLYH2080

Características medioambientales o sociales

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 3,08% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☐ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

El Fondo promovió las siguientes características ambientales o sociales:

- Alineación con uno o más Objetivos de Desarrollo Sostenible de la ONU (ODS) en comparación con el índice de referencia del Fondo, a través de la inversión en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad, y a través de las mejores inversiones en su clase.

- Conformidad con los siguientes indicadores de las PIA:

  - Intensidad de GEI (PIA n.º 3 y n.º 15).
  - Asuntos sociales y de los empleados (PIA n.º 10).
  - Armas controvertidas (PIA n.º 14).
  - Países participados sujetos a violaciones sociales (PIA n.º 16).

No se han utilizado instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Los indicadores de sostenibilidad utilizados para medir la consecución de cada una de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo fueron:

- Los indicadores de las PIA mencionados en la respuesta anterior. Consulte los valores mostrados en la sección «¿Cómo consideró este producto financiero los principales impactos adversos en los factores de sostenibilidad?» de los indicadores durante el período de referencia.

- A 29 de febrero de 2024, la asignación a bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad era del 3,08 %.

¿...y en comparación con períodos anteriores?

Los indicadores generales en materia de sostenibilidad se ajustan a los del período anterior.

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura	Valor	Cobertura
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	189,05	75,09%	230,20	72,90%
Intensidad de GEI de los países participados USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	166,84	100,00%	175,30	100,00%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	73,78%	0,00%	72,00%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	73,78%	0,00%	73,00%
Número de países receptores de la inversión sujetos a infracciones sociales	Recuento de países en el Fondo	0,00	100,00%	0,00	100,00%

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

Las inversiones sostenibles del Fondo eran en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad, que se conseguían mediante una asignación mínima a emisores alineados con los ODS en comparación con el índice de referencia del Fondo, y con emisores que cumplían los umbrales de los mejores de su categoría. Dichos bonos tenían KPI vinculados a la sostenibilidad o ingresos que se utilizaron para proyectos que incluían, entre otros:

- Proyectos verdes: energías renovables, eficiencia energética, prevención y control de la contaminación, gestión sostenible desde el punto de vista ambiental de los recursos naturales vivos y del uso de la tierra, biodiversidad, transporte limpio, gestión sostenible del agua y de las aguas residuales, adaptación al cambio climático, economía circular y edificios verdes.
- Proyectos sociales: viviendas e infraestructuras asequibles (agua potable, saneamiento), programas de empleo y avances socioeconómicos, como la educación, la diversidad, la igualdad y la inclusión, entre otros.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

El gestor de inversiones empleó sus investigaciones propias y las PIA para garantizar que las inversiones sostenibles no causaran daño significativo a ningún objetivo de inversión sostenible ambiental o social. La investigación propia, junto con el uso de herramientas desarrolladas internamente, incluidas, entre otras, la selección, permitió a los gestores de cartera identificar emisores que el gestor de inversiones no cree que causen daños significativos.

Como resultado, el gestor de inversiones pudo invertir en emisores que se ajustaban a los indicadores de las PIA y evitar los emisores que no se ajustaban. Como parte de la inversión del Fondo en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad, el gestor de inversiones aplicó este enfoque para determinar si un bono cumplía los criterios de sostenibilidad.

Además, los emisores soberanos se sometieron a pruebas basadas en sus libertades políticas o en la corrupción.

A la hora de destinar fondos a inversiones sostenibles, especialmente el 1 % mínimo de la cartera del Fondo comprometido con objetivos ambientales, si procede, el gestor de inversiones aplicó una evaluación cualitativa adicional (basada en la investigación interna o en la opinión de terceros externos) de la elegibilidad de los emisores y de los proyectos conforme al principio «no causar un perjuicio significativo».

Además, se aplicaron una serie de exclusiones al Fondo para excluir a los emisores que podían causar un perjuicio significativo, como se detalla más adelante.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

El gestor de inversiones desarrolló una herramienta propia de PIA que pudiera tener en cuenta las PIA importantes y ayudara a medir la alineación del Fondo con respecto a los indicadores de PIA que se consideraban importantes para el Fondo.

Las PIA sirvieron de barómetro útil para calibrar en qué emisores invertir: Concretamente, la PIA n.º 3 se utilizó para la evaluación de la intensidad de GEI corporativos y la PIA n.º 15 para la intensidad de los GEI soberanos, respectivamente. La PIA n.º 10 se utilizó para identificar emisores que no cumplían con los Principios del PMNU y las Directrices de la OCDE, mientras que la PIA n.º 14 servía para identificar emisores que no cumplían los criterios en cuanto a armas controvertidas en todo el Fondo en comparación con los del universo de inversión. Por su parte, la PIA n.º 16 se utilizó para identificar países objeto de inversión que no fueron designados libres por Freedom House.

Aunque el Fondo no se comprometió a tener una media de las PIA mejor que la de su índice de referencia, la diferencia entre las dos métricas ayudó a informar sobre el éxito del Fondo en la gestión de los impactos adversos.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

El Fondo se adhirió a las directrices explícitas que excluían a los emisores que fallaban según los Principios del PMNU y las Directrices de la OCDE. El compromiso del gestor de inversiones con los emisores se basaba en los principios del PMNU y de las Directrices de la OCDE. Los emisores que se consideraron deficientes según los Principios del PMNU y las Directrices de la OCDE se añadieron a la lista roja de ESG del gestor de inversiones, que servía para excluir a los emisores de la inversión del Fondo. Si procedía, el gestor de inversiones intentaría participar con los emisores que le preocupaban, que podían haber fallado explícitamente según las directrices subyacentes.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.

¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

La forma en que se consideraron y se tuvieron en cuenta las PIA se detalla previamente.

Las métricas de las PIA que se presentan a continuación se basan en el cálculo promedio de las síntesis trimestrales durante el período de referencia. El cálculo de las métricas pertinentes se refiere a las inversiones para las que se dispone de los datos ESG subyacentes y no a todas las inversiones mantenidas por el Fondo. Tenga en cuenta que esta información está sujeta a cambios y debe utilizarse solo con fines informativos.

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	189,05	75,09%
Intensidad de GEI de los países participados USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	166,84	100,00%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	73,78%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	73,78%
Número de países receptores de la inversión sujetos a infracciones sociales	Recuento de países en el Fondo	0,00	100,00%



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
FORD MOTOR CREDIT COMPANY LLC	Sector financiero	1,69%	Estados Unidos
DISH DBS Corporation	Servicios de comunicación	1,68%	Estados Unidos
CSC HOLDINGS, LLC	Servicios de comunicación	1,65%	Estados Unidos
CCO HOLDINGS, LLC	Servicios de comunicación	1,65%	Estados Unidos
BARCLAYS PLC	Sector financiero	1,20%	Reino Unido
NCL CORPORATION LTD.	Consumo discrecional	1,18%	Estados Unidos
FIRST QUANTUM MINERALS LTD.	Materiales	1,13%	Canadá
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD.	Consumo discrecional	1,10%	Estados Unidos
UNITED RENTALS (NORTH AMERICA), INC.	Sector industrial	1,08%	Estados Unidos
CAESARS ENTERTAINMENT, INC.	Consumo discrecional	1,07%	Estados Unidos
Carnival Corporation	Consumo discrecional	1,01%	Estados Unidos
ALTICE FRANCE SA	Servicios de comunicación	0,97%	Luxemburgo
AMERICAN AIRLINES, INC.	Sector industrial	0,97%	Estados Unidos
BATH & BODY WORKS, INC.	Consumo discrecional	0,96%	Estados Unidos
ROCKET MORTGAGE, LLC	Sector financiero	0,95%	Estados Unidos

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

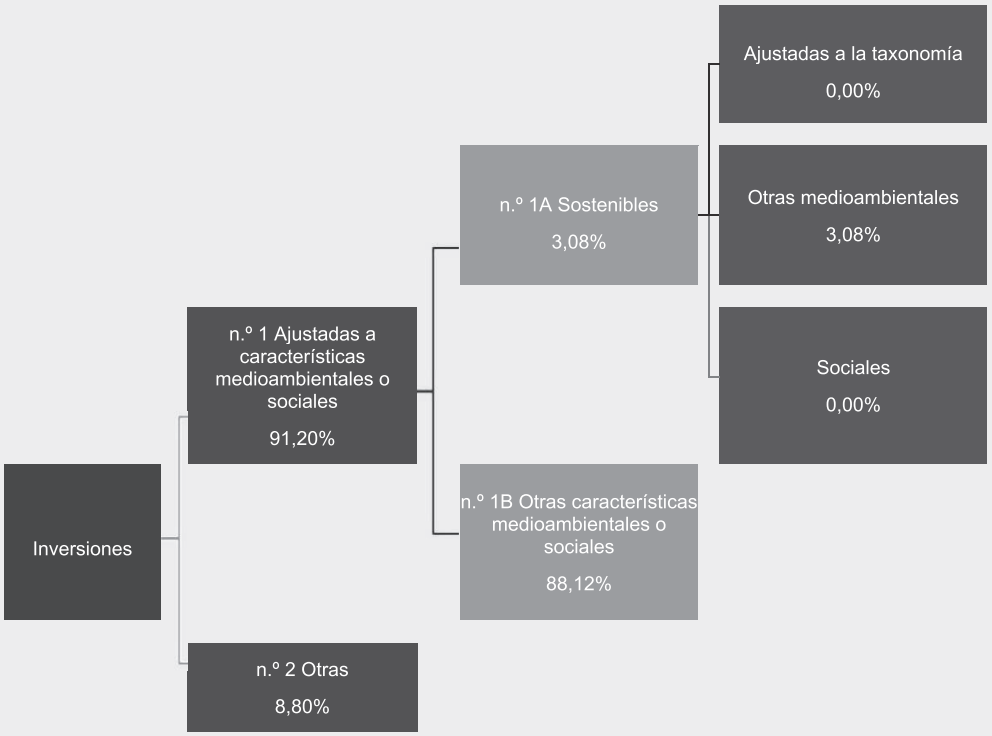
A 29 de febrero de 2024, la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 3,08 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

A 29 de febrero de 2024, el 91,20 % del Fondo se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas por este. La parte restante (8,80 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistió mayormente en activos líquidos o emisores para los que no existía una calificación ASG.

Del segmento del Fondo que se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo destinó el 3,08 % de sus activos a inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

Sector principal	% de activos
Sector financiero	26,02%
Consumo discrecional	19,46%
Sector industrial	13,11%
Servicios de comunicación	12,86%
Energía	7,19%
Sector sanitario	6,13%
Tecnología de la información	4,25%
Materiales	4,15%
Sector inmobiliario	2,50%
Servicios públicos	1,95%
Bienes básicos de consumo	0,69%
Bonos del Estado	0,25%

Principales subsectores	% de activos
Servicios financieros	15,93%
Hoteles, restaurantes y actividades de ocio	10,00%
Medios de comunicación	8,56%
Petróleo, gas y combustibles de consumo	6,36%
Bancos	4,98%
Venta minorista especializada	3,37%
Servicios y suministros comerciales	3,30%
Proveedores y servicios sanitarios	3,04%
Metales y minería	2,78%
Industria farmacéutica	2,53%
Aerolíneas de pasajeros	2,43%
Componentes de automóviles	2,29%
Productos financieros al consumo	2,25%
Maquinaria	2,03%
Servicios de consumo diversificados	1,99%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la Taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

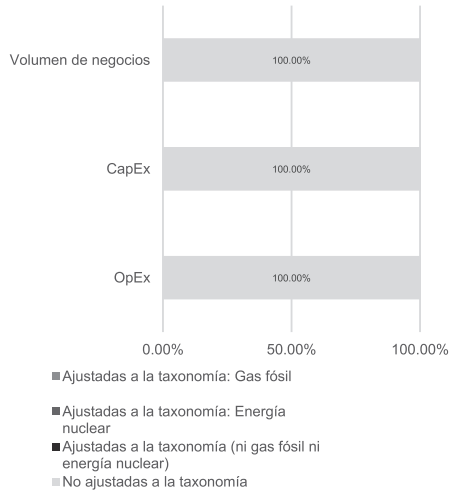
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

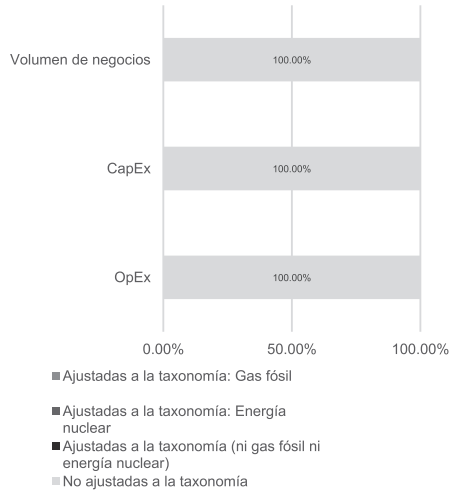
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transició facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

En línea con la estrategia de inversión, a saber, el compromiso del Fondo de mantener una exposición mínima a las «inversiones sostenibles» con un objetivo ambiental según el Reglamento sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (art. 2 [17]) que no pueden considerarse sostenibles desde el punto de vista ambiental con arreglo al Reglamento sobre la taxonomía de la UE, el 3,08 % del Fondo estaba compuesto por «inversiones sostenibles» con un objetivo ambiental que no pueden considerarse sostenibles desde el punto de vista ambiental con arreglo a la Taxonomía de la UE, a 29 de febrero de 2024.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

No se aplica.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

A 29 de febrero de 2024, la proporción de inversiones en «N.º 2 Otros» era del 8,80 % e incluía el efectivo y los derivados u otros emisores para los que no había salvaguardias ambientales o sociales mínimas.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

Western Asset cree que los factores ESG importantes desde el punto de vista financiero pueden afectar a la solvencia de los valores de los emisores de renta fija y, por lo tanto, al rendimiento de las carteras de inversión de renta fija. Estos factores son totalmente coherentes con la filosofía de inversión a largo plazo y orientados al valor fundamental de la empresa. Los analistas de investigación de Western Asset se encargaron de proporcionar un análisis fundamental en el ámbito del sector y del emisor, y de opinar sobre las características de riesgo/recompensa del sector y del emisor mediante la incorporación de consideraciones ESG importantes. Con el respaldo de este enfoque más amplio, el Fondo pretendía cumplir con sus características ambientales y sociales e invertir en emisores para que la cartera general cumpliera con las calificaciones mínimas de ESG, lograra su descarbonización y alineación con los ODS, y evitara los emisores identificados mediante la aplicación de exclusiones SRI asignadas a sectores e invertidas en emisores objetivo.

Para cumplir las características ambientales o sociales durante el período de referencia:

A. El Fondo buscó una intensidad de carbono promedio ponderada («WACI») general que estuviera al menos un 20 % por debajo del índice de referencia. Esto ayudó a ajustar el Fondo con las PIA n.º 3 y n.º 15 (Intensidad de GEI).

B. El Fondo intentó alinearse, mejor que el índice de referencia, con respecto a las inversiones en valores de emisores cuyas actividades contribuyeron a al menos uno de los ocho ODS seleccionados.

C. El Fondo excluyó a los emisores que fracasaron en una variedad de objetivos de SRI, como se describe a continuación:

a. Emisores que obtengan más del 5 % de sus ingresos de la producción y/o distribución de tabaco y de la producción de armas nucleares.

b. Emisores que obtengan más del 10 % de los ingresos de armas de fuego civiles (fabricación o suministro), armas convencionales o la minería del carbón térmico (producción o distribución).

c. Emisores que fabriquen armas controvertidas (minas terrestres antipersona, armas bioquímicas, armas láser cegadoras, uranio empobrecido, armas incendiarias y fragmentos no detectables), sean propietarios de una empresa de armas controvertidas o de una empresa de armas controvertidas, en consonancia con el indicador de la PIA n.º 14 (Exposición a armas controvertidas).

d. Emisores que «no superen» los principios del PMNU y de la OCDE, sobre la base de una investigación interna que pretende identificar las deficiencias en el cumplimiento de los objetivos por parte de los emisores, en consonancia con la PIA n.º 10 (Asuntos sociales y de los empleados).

e. Emisores estatales o soberanos que no logran ser designados como «libres» por el Freedom House Index y se ajustan a la PIA n.º 16 (Países participados sujetos a violaciones sociales).

Como parte de la inversión mínima del 1 % en inversiones sostenibles (definidas como bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad), el Fondo tenía un 3,08 % invertido por valor de mercado a 29 de febrero de 2024.

El Fondo cumplió con sus pautas ambientales y sostenibles como se indica a continuación:

A. El WACI general del Fondo fue el 71,8 % del índice de referencia.

B. La asignación del Fondo a emisores y emisiones alineadas con los ODS fue del 46,4 % frente al 43,1 % del índice de referencia.

C. El Fondo tenía un 3,08 % invertido por valor de mercado en inversiones sostenibles a 29 de febrero de 2024.

D. El Fondo no invirtió en ningún emisor que incumpliera las directrices del SRI.

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica

FTGF Western Asset Global High Yield Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
5493004GEBFENJC57G38

Características medioambientales o sociales

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 7,74% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☐ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

El Fondo promovió las siguientes características ambientales o sociales:

- Alineación con uno o más Objetivos de Desarrollo Sostenible de la ONU (ODS) en comparación con el índice de referencia del Fondo, a través de la inversión en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad, y a través de las mejores inversiones en su clase.

- Conformidad con los siguientes indicadores de las PIA:

  - Intensidad de GEI (PIA n.º 3 y n.º 15).
  - Asuntos sociales y de los empleados (PIA n.º 10).
  - Armas controvertidas (PIA n.º 14).

No se han utilizado instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Los indicadores de sostenibilidad utilizados para medir la consecución de cada una de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo fueron:

- Los indicadores de las PIA mencionados en la respuesta anterior. Consulte los valores mostrados en la sección «¿Cómo consideró este producto financiero los principales impactos adversos en los factores de sostenibilidad?» de los indicadores durante el período de referencia.

- A 29 de febrero de 2024, la asignación a bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad era del 7,74 %.

¿...y en comparación con períodos anteriores?

Los indicadores generales en materia de sostenibilidad se ajustan a los del período anterior.

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura	Valor	Cobertura
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	213,05	63,38%	287,10	83,60%
Intensidad de GEI de los países participados USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	176,32	100,00%	221,40	95,50%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	64,11%	0,02%	82,00%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	64,11%	0,00%	83,00%

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

Las inversiones sostenibles del Fondo eran en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad, que se conseguían mediante una asignación mínima a emisores alineados con los ODS en comparación con el índice de referencia del Fondo, y con emisores que cumplían los umbrales de los mejores de su categoría. Dichos bonos tenían KPI vinculados a la sostenibilidad o ingresos que se utilizaron para proyectos que incluían, entre otros:

- Proyectos verdes: energías renovables, eficiencia energética, prevención y control de la contaminación, gestión sostenible desde el punto de vista ambiental de los recursos naturales vivos y del uso de la tierra, biodiversidad, transporte limpio, gestión sostenible del agua y de las aguas residuales, adaptación al cambio climático, economía circular y edificios verdes.
- Proyectos sociales: viviendas e infraestructuras asequibles (agua potable, saneamiento), programas de empleo y avances socioeconómicos, como la educación, la diversidad, la igualdad y la inclusión, entre otros.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

El gestor de inversiones empleó sus investigaciones propias y las PIA para garantizar que las inversiones sostenibles no causaran daño significativo a ningún objetivo de inversión sostenible ambiental o social. La investigación propia, junto con el uso de herramientas desarrolladas internamente, incluidas, entre otras, la selección, permitió a los gestores de cartera identificar emisores que el gestor de inversiones no cree que causen daños significativos.

Como resultado, el gestor de inversiones pudo invertir en emisores que se ajustaban a los indicadores de las PIA y evitar los emisores que no se ajustaban. Como parte de la inversión del Fondo en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad, el gestor de inversiones aplicó este enfoque para determinar si un bono cumplía los criterios de sostenibilidad.

Además, los emisores soberanos se sometieron a pruebas basadas en sus libertades políticas o en la corrupción.

A la hora de destinar fondos a inversiones sostenibles, especialmente el 1 % mínimo de la cartera del Fondo comprometido con objetivos ambientales, si procede, el gestor de inversiones aplicó una evaluación cualitativa adicional (basada en la investigación interna o en la opinión de terceros externos) de la elegibilidad de los emisores y de los proyectos conforme al principio «no causar un perjuicio significativo».

Además, se aplicaron una serie de exclusiones al Fondo para excluir a los emisores que podían causar un perjuicio significativo, como se detalla más adelante.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

El gestor de inversiones desarrolló una herramienta propia de PIA que pudiera tener en cuenta las PIA importantes y ayudara a medir la alineación del Fondo con respecto a los indicadores de PIA que se consideraban importantes para el Fondo.

Las PIA sirvieron de barómetro útil para calibrar en qué emisores invertir: Concretamente, la PIA n.º 3 se utilizó para la evaluación de la intensidad de GEI corporativos y la PIA n.º 15 para la intensidad de los GEI soberanos, respectivamente. La PIA n.º 10 se utilizó para identificar emisores que no cumplían con los Principios del PMNU y las Directrices de la OCDE, mientras que la PIA n.º 14 servía para identificar emisores que no cumplían los criterios en cuanto a armas controvertidas en todo el Fondo en comparación con los del universo de inversión.

Aunque el Fondo no se comprometió a tener una media de PIA mejor que la de su índice de referencia, la diferencia entre las dos métricas ayudó a informar sobre el éxito del Fondo en la gestión de los impactos adversos.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

El Fondo se adhirió a las directrices explícitas que excluían a los emisores que fallaban según los Principios del PMNU y las Directrices de la OCDE. El compromiso del gestor de inversiones con los emisores se basaba en los principios del PMNU y de las Directrices de la OCDE. Los emisores que se consideraron deficientes según los Principios del PMNU y las Directrices de la OCDE se añadieron a la lista roja de ESG del gestor de inversiones, que servía para excluir a los emisores de la inversión del Fondo. Si procedía, el gestor de inversiones intentaría participar con los emisores que le preocupaban, que podían haber fallado explícitamente según las directrices subyacentes.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.

¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

La forma en que se consideraron y se tuvieron en cuenta las PIA se detalla previamente.

Las métricas de las PIA que se presentan a continuación se basan en el cálculo promedio de las síntesis trimestrales durante el período de referencia. El cálculo de las métricas pertinentes se refiere a las inversiones para las que se dispone de los datos ESG subyacentes y no a todas las inversiones mantenidas por el Fondo. Tenga en cuenta que esta información está sujeta a cambios y debe utilizarse solo con fines informativos.

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	213,05	63,38%
Intensidad de GEI de los países participados USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	176,32	100,00%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	64,11%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	64,11%

¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
United States of America	Bonos del Estado	3,49%	Estados Unidos
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III B.V.	Sector sanitario	2,64%	Israel
FORD MOTOR COMPANY	Consumo discrecional	2,36%	Estados Unidos
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD.	Consumo discrecional	2,15%	Estados Unidos
Estados Unidos Mexicanos	Bonos del Estado	2,14%	México
Altice Financing SA	Servicios de comunicación	2,01%	Luxemburgo
CSC HOLDINGS, LLC	Servicios de comunicación	1,94%	Estados Unidos
Gobierno de la Republica Dominicana	Bonos del Estado	1,86%	República Dominicana
GLOBAL AIRCRAFT LEASING CO., LTD	Sector financiero	1,81%	Islas Caimán
H&E EQUIPMENT SERVICES, INC.	Sector industrial	1,46%	Estados Unidos
DISH NETWORK CORPORATION	Servicios de comunicación	1,45%	Estados Unidos
INTESA SANPAOLO SPA	Sector financiero	1,42%	Italia
CCO HOLDINGS, LLC	Servicios de comunicación	1,38%	Estados Unidos
MERCADOLIBRE, INC.	Consumo discrecional	1,36%	Brasil
NCL CORPORATION LTD.	Consumo discrecional	1,33%	Estados Unidos

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

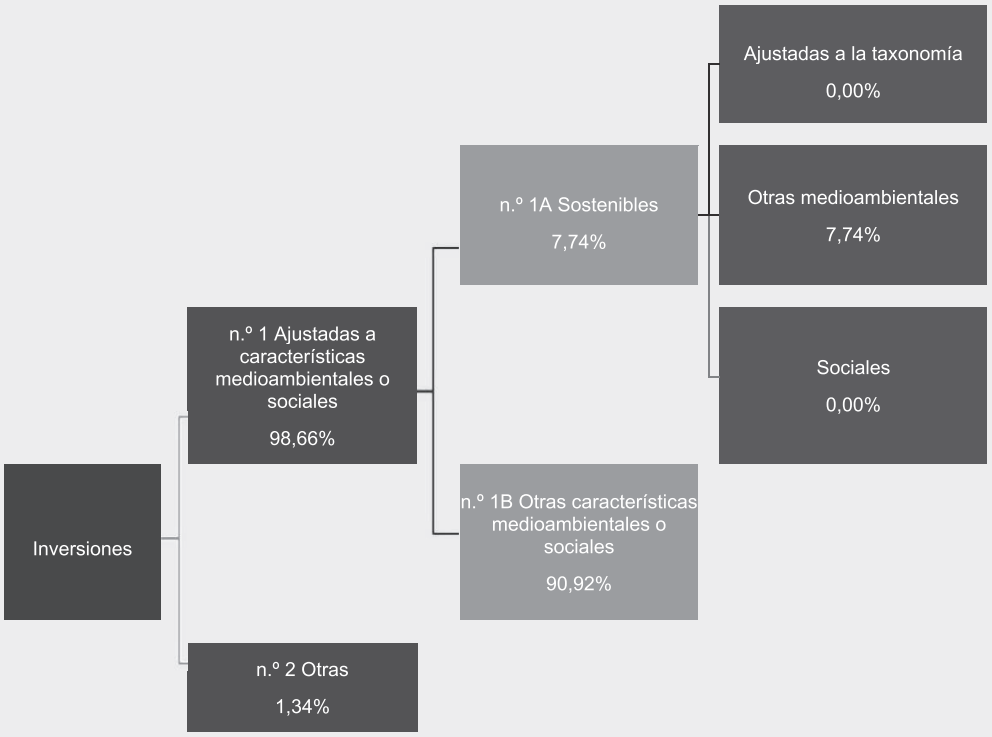
A 29 de febrero de 2024, la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 7,74 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

A 29 de febrero de 2024, el 98,66 % del Fondo se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas por este. La parte restante (1,34 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos o emisores para los que no había una calificación ESG.

Del segmento del Fondo que se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo destinó el 7,74 % de sus activos a inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

Sector principal	% de activos
Consumo discrecional	21,49%
Bonos del Estado	19,97%
Servicios de comunicación	16,54%
Sector financiero	11,93%
Sector industrial	11,72%
Sector sanitario	3,63%
Materiales	3,61%
Energía	2,88%
Bienes básicos de consumo	2,50%
Sector inmobiliario	2,31%
Servicios públicos	1,19%
Tecnología de la información	0,82%

Principales subsectores	% de activos
Bonos del Estado	19,97%
Hoteles, restaurantes y actividades de ocio	11,87%
Medios de comunicación	10,04%
Servicios financieros	5,67%
Servicios y suministros comerciales	4,72%
Bancos	4,39%
Automóviles	3,83%
Aerolíneas de pasajeros	3,36%
Servicios inalámbricos de telecomunicaciones	3,06%
Envases y envoltorios	2,91%
Industria farmacéutica	2,64%
Componentes de automóviles	2,29%
Servicios de telecomunicaciones diversificados	2,25%
Empresas comerciales y distribuidoras	2,20%
Servicios de consumo diversificados	2,05%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la Taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

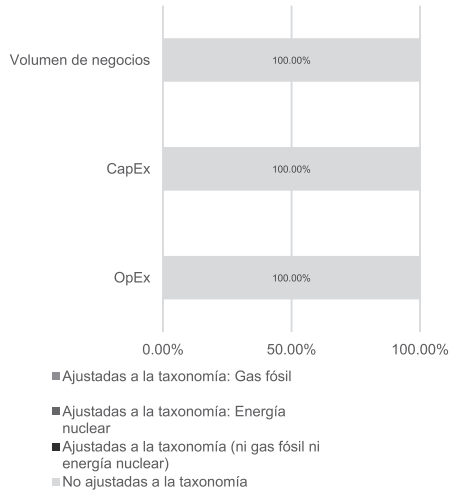
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

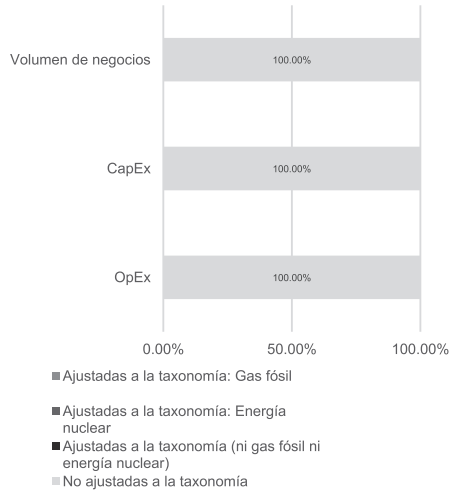
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transició facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

En línea con la estrategia de inversión, a saber, el compromiso del Fondo de mantener una exposición mínima a las «inversiones sostenibles» con un objetivo ambiental según el Reglamento sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (art. 2 [17]) que no pueden considerarse sostenibles desde el punto de vista ambiental con arreglo al Reglamento sobre la taxonomía de la UE, el 7,74 % del Fondo estaba compuesto por «inversiones sostenibles» con un objetivo ambiental que no pueden considerarse sostenibles desde el punto de vista ambiental con arreglo a la Taxonomía de la UE, a 29 de febrero de 2024.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

No se aplica.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

A 29 de febrero de 2024, la proporción de inversiones en «N.º 2 Otros» era del 1,34 % e incluía el efectivo y los derivados o emisores para los que no había salvaguardias ambientales o sociales mínimas.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

Western Asset cree que los factores ESG importantes desde el punto de vista financiero pueden afectar a la solvencia de los valores de los emisores de renta fija y, por lo tanto, al rendimiento de las carteras de inversión de renta fija. Estos factores son totalmente coherentes con la filosofía de inversión a largo plazo y orientados al valor fundamental de la empresa. Los analistas de investigación de Western Asset se encargaron de proporcionar un análisis fundamental en el ámbito del sector y del emisor, y de opinar sobre las características de riesgo/recompensa del sector y del emisor mediante la incorporación de consideraciones ESG importantes. Con el respaldo de este enfoque más amplio, el Fondo pretendía cumplir con sus características ambientales y sociales e invertir en emisores para que la cartera general cumpliera con las calificaciones mínimas de ESG, lograra su descarbonización y alineación con los ODS, y evitara los emisores identificados mediante la aplicación de exclusiones SRI asignadas a sectores e invertidas en emisores objetivo.

Para cumplir las características ambientales o sociales durante el período de referencia:

A. El Fondo buscó una intensidad de carbono promedio ponderada («WACI») general que estuviera al menos un 20 % por debajo del índice de referencia. Esto ayudó a ajustar el Fondo con las PIA n.º 3 y n.º 15 (Intensidad de GEI).

B. El Fondo intentó alinearse, mejor que el índice de referencia, con respecto a las inversiones en valores de emisores cuyas actividades contribuyeron a al menos uno de los ocho ODS seleccionados.

C. El Fondo excluyó a los emisores que fracasaron en una variedad de objetivos de SRI, como se describe a continuación:

a. Emisores que obtengan más del 5 % de sus ingresos de la producción y/o distribución de tabaco y de la producción de armas nucleares.

b. Emisores que obtengan más del 10 % de los ingresos de armas de fuego civiles (fabricación o suministro), armas convencionales o la minería del carbón térmico (producción o distribución).

c. Emisores que fabriquen armas controvertidas (minas terrestres antipersona, armas bioquímicas, armas láser cegadoras, uranio empobrecido, armas incendiarias y fragmentos no detectables), sean propietarios de una empresa de armas controvertidas o de una empresa de armas controvertidas, en consonancia con el indicador de la PIA n.º 14 (Exposición a armas controvertidas).

d. Emisores que «no superen» los principios del PMNU y de la OCDE, sobre la base de una investigación interna que pretende identificar las deficiencias en el cumplimiento de los objetivos por parte de los emisores, en consonancia con la PIA n.º 10 (Asuntos sociales y de los empleados).

Como parte de la inversión mínima del 1 % en inversiones sostenibles (definidas como bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad), el Fondo tenía un 7,74 % invertido por valor de mercado a 29 de febrero de 2024.

El Fondo cumplió con sus pautas ambientales y sostenibles como se indica a continuación:

A. El WACI general del Fondo fue el 68,1 % del índice de referencia.

B. La asignación del Fondo a emisores y emisiones alineadas con los ODS fue del 44,0 % frente al 37,5 % del índice de referencia.

C. El Fondo tenía un 7,74 % invertido por valor de mercado en inversiones sostenibles a 29 de febrero de 2024.

D. Según las definiciones de Western Asset con respecto al Pacto Mundial de las Naciones Unidas, el Fondo no tenía ningún emisor que se considerase que incumple las directrices del SRI.

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
5493000382HJNRHILX42

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 15,65% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☐ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

El Fondo promovió las siguientes características ambientales o sociales:

- Alineación con uno o más Objetivos de Desarrollo Sostenible de la ONU (ODS) en comparación con el índice de referencia del Fondo, a través de la inversión en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad, y a través de las mejores inversiones en su clase.

- Conformidad con los siguientes indicadores de las PIA:

  - Intensidad de GEI (PIA n.º 3 y n.º 15).
  - Asuntos sociales y de los empleados (PIA n.º 10).
  - Armas controvertidas (PIA n.º 14).
  - Países participados sujetos a violaciones sociales (PIA n.º 16).

No se han utilizado instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Los indicadores de sostenibilidad utilizados para medir la consecución de cada una de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo fueron:

- Los indicadores de las PIA mencionados en la respuesta anterior. Consulte los valores mostrados en la sección «¿Cómo consideró este producto financiero los principales impactos adversos en los factores de sostenibilidad?» de los indicadores durante el período de referencia.

- A 29 de febrero de 2024, la asignación a bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad era del 15,65 %.

¿...y en comparación con períodos anteriores?

Los indicadores generales en materia de sostenibilidad se ajustan a los del período anterior.

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	**Unidad de medida**	**Valor**	**Cobertura**	**Valor**	**Cobertura**
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	64,03	90,31%	63,20	94,60%
Intensidad de GEI de los países participados USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	200,01	100,00%	247,50	100,00%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	89,84%	0,00%	95,00%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	90,09%	0,00%	95,00%
Número de países receptores de la inversión sujetos a infracciones sociales	Recuento de países en el Fondo	0,00	100,00%	0,00	100,00%

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

Las inversiones sostenibles del Fondo eran en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad, que se conseguían mediante una asignación mínima a emisores alineados con los ODS en comparación con el índice de referencia del Fondo, y con emisores que cumplían los umbrales de los mejores de su categoría. Los ingresos de estos bonos se utilizaron para proyectos o tenían KPI vinculados a la sostenibilidad, incluidos, sin limitación:

- Proyectos verdes: energías renovables, eficiencia energética, prevención y control de la contaminación, gestión sostenible desde el punto de vista ambiental de los recursos naturales vivos y del uso de la tierra, biodiversidad, transporte limpio, gestión sostenible del agua y de las aguas residuales, adaptación al cambio climático, economía circular y edificios verdes.
- Proyectos sociales: viviendas e infraestructuras asequibles (agua potable, saneamiento), programas de empleo y avances socioeconómicos, como la educación, la diversidad, la igualdad y la inclusión, entre otros.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

El gestor de inversiones empleó sus investigaciones propias y las PIA para garantizar que las inversiones sostenibles no causaran daño significativo a ningún objetivo de inversión sostenible ambiental o social. La investigación propia, junto con el uso de herramientas desarrolladas internamente, incluidas, entre otras, la selección, permitió a los gestores de cartera identificar emisores que el gestor de inversiones no cree que causen daños significativos.

Como resultado, el gestor de inversiones pudo invertir en emisores que se ajustaban a los indicadores de las PIA y evitar los emisores que no se ajustaban. Como parte de la inversión del Fondo en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad, el gestor de inversiones aplicó este enfoque para determinar si un bono cumplía los criterios de sostenibilidad.

Además, los emisores soberanos se sometieron a pruebas basadas en sus libertades políticas o en la corrupción.

A la hora de destinar fondos a inversiones sostenibles, especialmente el 1 % mínimo del Fondo comprometido con objetivos ambientales, si procede, el gestor de inversiones aplicó una evaluación cualitativa adicional (basada en la investigación interna o en la opinión de terceros externos) de la elegibilidad de los emisores y de los proyectos conforme al principio «no causar un perjuicio significativo».

Además, se aplicaron una serie de exclusiones al Fondo para excluir a los emisores que podían causar un perjuicio significativo, como se detalla más adelante.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

El gestor de inversiones desarrolló una herramienta propia de PIA que pudiera tener en cuenta las PIA importantes y ayudara a medir la alineación del Fondo con respecto a los indicadores de PIA que se consideraban importantes para el Fondo.

Concretamente, la PIA n.º 3 se utilizó para la evaluación de la intensidad de GEI corporativos y la PIA n.º 15 para la intensidad de los GEI soberanos, respectivamente. La PIA n.º 10 se utilizó para identificar emisores que no cumplían con los Principios del PMNU y las Directrices de la OCDE, mientras que la PIA n.º 14 servía para identificar emisores que no cumplían los criterios en cuanto a armas controvertidas en todo el Fondo en comparación con los del universo de inversión. Por su parte, la PIA n.º 16 se utilizó para identificar países objeto de inversión que no fueron designados libres por Freedom House.

Aunque el Fondo no se comprometió a tener una media de las PIA mejor que la de su índice de referencia, la diferencia entre las dos métricas ayudó a informar sobre el éxito del Fondo en la gestión de los impactos adversos.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

El Fondo se adhirió a las directrices explícitas que excluían a los emisores que fallaban según los Principios del PMNU y las Directrices de la OCDE. El compromiso del gestor de inversiones con los emisores se basaba en los principios del PMNU y de las Directrices de la OCDE. Los emisores que se consideraron deficientes según los Principios del PMNU y las Directrices de la OCDE se añadieron a la lista roja de ESG del gestor de inversiones, que servía para excluir a los emisores de la inversión del Fondo. Si procedía, el gestor de inversiones intentaría participar con los emisores que le preocupaban, que podían haber fallado explícitamente según las directrices subyacentes.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.

¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

La forma en que se consideraron y se tuvieron en cuenta las PIA se detalla previamente.

Las métricas de las PIA que se presentan a continuación se basan en el cálculo promedio de las síntesis trimestrales durante el período de referencia. El cálculo de las métricas pertinentes se refiere a las inversiones para las que se dispone de los datos ESG subyacentes y no a todas las inversiones mantenidas por el Fondo. Tenga en cuenta que esta información está sujeta a cambios y debe utilizarse solo con fines informativos.

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	64,03	90,31%
Intensidad de GEI de los países participados USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	200,01	100,00%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	89,84%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	90,09%
Número de países receptores de la inversión sujetos a infracciones sociales	Recuento de países en el Fondo	0,00	100,00%

¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
United States of America	Bonos del Estado	3,01%	Estados Unidos
ABN AMRO Bank N.V.	Sector financiero	1,79%	Países Bajos
BANCO SANTANDER, S.A.	Sector financiero	1,68%	España
BNP PARIBAS SA	Sector financiero	1,62%	Francia
Nederlandse Waterschapsbank N.V.	Bonos del Estado	1,61%	Países Bajos
BANK OF AMERICA CORPORATION	Sector financiero	1,60%	Estados Unidos
NATWEST MARKETS PLC	Sector financiero	1,47%	Reino Unido
DNB BANK ASA	Sector financiero	1,43%	Noruega
CREDIT AGRICOLE S.A. LONDON BRANCH	Sector financiero	1,38%	Francia
JPMORGAN CHASE & CO.	Sector financiero	1,35%	Estados Unidos
HSBC HOLDINGS PLC	Sector financiero	1,34%	Reino Unido
SANOFI SA	Sector sanitario	1,31%	Francia
Aktiebolaget Svensk Exportkredit	Bonos del Estado	1,26%	Suecia
Siemens Financieringsmaatschappij N.V.	Sector industrial	1,26%	Alemania
CITIGROUP INC.	Sector financiero	1,24%	Estados Unidos

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

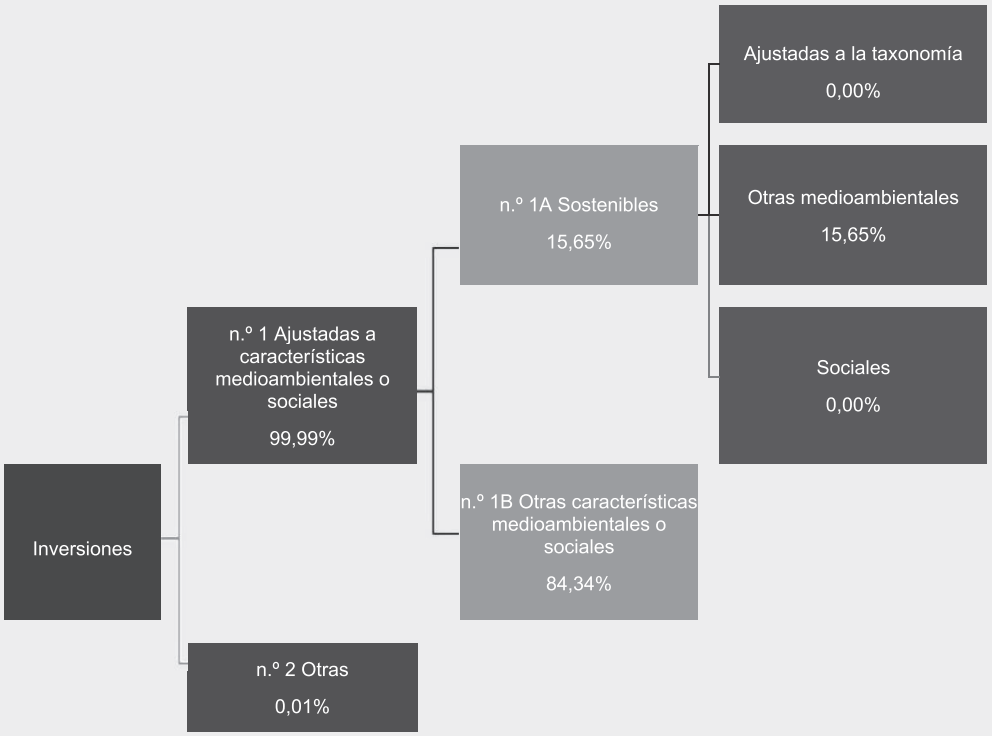
A 29 de febrero de 2024, la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 15,65 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

A 29 de febrero de 2024, el 99,99 % del Fondo se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas por este. La parte restante (0,01 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistió mayormente en efectivo o derivados para los que no existía una calificación ASG.

Del segmento del Fondo que se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo destinó el 15,65 % de sus activos a inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

Sector principal	% de activos
Sector financiero	39,30%
Sector sanitario	11,61%
Sector industrial	9,85%
Bonos del Estado	9,60%
Bienes básicos de consumo	7,62%
Consumo discrecional	4,57%
Sector inmobiliario	3,14%
Tecnología de la información	3,10%
Energía	2,94%
Servicios públicos	2,74%
Materiales	2,24%
Servicios de comunicación	1,81%

Principales subsectores	% de activos
Bancos	22,73%
Bonos del Estado	9,60%
Industria farmacéutica	9,42%
Servicios financieros	6,32%
Mercados de capitales	5,74%
Productos financieros al consumo	3,04%
Petróleo, gas y combustibles de consumo	2,71%
Servicios públicos eléctricos	2,26%
Productos químicos	2,24%
Bebidas	2,06%
Transporte por tierra	2,02%
Comercio minorista y distribución de bienes básicos de consumo	1,87%
Gestión y desarrollo del mercado inmobiliario	1,65%
Productos de cuidado personal	1,64%
Maquinaria	1,60%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la Taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

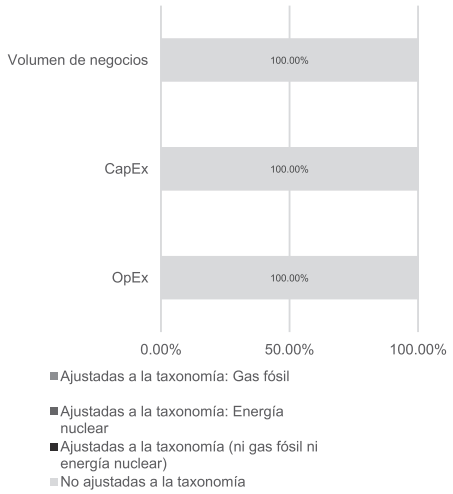
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

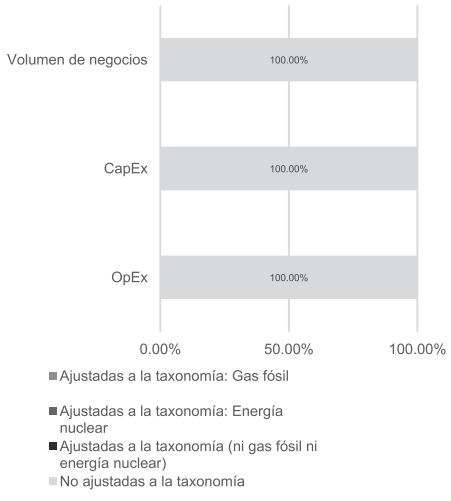
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transició facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

En línea con la estrategia de inversión, a saber, el compromiso del Fondo de mantener una exposición mínima a las «inversiones sostenibles» con un objetivo ambiental según el Reglamento sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (art. 2 [17]) que no pueden considerarse sostenibles desde el punto de vista ambiental con arreglo al Reglamento sobre la taxonomía de la UE, el 15,65 % del Fondo estaba compuesto por «inversiones sostenibles» con un objetivo ambiental que no pueden considerarse sostenibles desde el punto de vista ambiental con arreglo a la Taxonomía de la UE, a 29 de febrero de 2024.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

No se aplica.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

A 29 de febrero de 2024, la proporción de inversiones en «N.º 2 Otros» era del 0,01 % e incluía el efectivo y los derivados para los que no había salvaguardias ambientales o sociales mínimas.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

Western Asset cree que los factores ESG importantes desde el punto de vista financiero pueden afectar a la solvencia de los valores de los emisores de renta fija y, por lo tanto, al rendimiento de las carteras de inversión de renta fija. Estos factores son totalmente coherentes con la filosofía de inversión a largo plazo y orientados al valor fundamental de la empresa. Los analistas de investigación de Western Asset se encargaron de proporcionar un análisis fundamental en el ámbito del sector y del emisor, y de opinar sobre las características de riesgo/recompensa del sector y del emisor mediante la incorporación de consideraciones ESG importantes. Con el respaldo de este enfoque más amplio, el Fondo pretendía cumplir con sus características ambientales y sociales e invertir en emisores para que la cartera general cumpliera con las calificaciones mínimas de ESG, lograra su descarbonización y alineación con los ODS, y evitara los emisores identificados mediante la aplicación de exclusiones SRI asignadas a sectores e invertidas en emisores objetivo.

Para cumplir las características ambientales o sociales durante el período de referencia:

A. El Fondo buscó una calificación media MSCI ESG de BBB o superior.

B. El Fondo buscó una intensidad de carbono promedio ponderada («WACI») general que estuviera al menos un 20 % por debajo del índice de referencia del indicador. Esto ayudó a ajustar el Fondo con las PIA n.º 3 y n.º 15 (Intensidad de GEI).

C. El Fondo intentó invertir un mínimo del 20 % en valores de emisores cuyas actividades contribuyeran a al menos uno de los ocho ODS seleccionados.

D. El Fondo excluyó a los emisores que fracasaron en una variedad de objetivos de SRI, como se describe a continuación:

a. Emisores que obtengan más del 5 % de sus ingresos de la producción y/o distribución de tabaco y de la producción de armas nucleares.

b. Emisores que obtengan más del 10 % de los ingresos de armas de fuego civiles (fabricación o suministro), armas convencionales o la minería del carbón térmico (producción o distribución).

c. Emisores que fabriquen armas controvertidas (minas terrestres antipersona, armas bioquímicas, armas láser cegadoras, uranio empobrecido, armas incendiarias y fragmentos no detectables), sean propietarios de una empresa de armas controvertidas o de una empresa de armas controvertidas, en consonancia con el indicador de la PIA n.º 14 (Exposición a armas controvertidas).

d. Emisores que «no superen» los principios del PMNU y de la OCDE, sobre la base de una investigación interna que pretende identificar las deficiencias en el cumplimiento de los objetivos por parte de los emisores, en consonancia con la PIA n.º 10 (Asuntos sociales y de los empleados).

e. Emisores estatales o soberanos que no logran ser designados como «libres» por el Freedom House Index y se ajustan a la PIA n.º 16 (Países participados sujetos a violaciones sociales).

Como parte de la inversión mínima del 1 % en inversiones sostenibles (definidas como bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad), el Fondo tenía un 15,65 % invertido por valor de mercado a 29 de febrero de 2024.

El Fondo promovió las opciones ambientales y sostenibles mediante las pautas demostradas anteriormente, como se destaca a continuación:

A. El Fondo recibió la calificación AA según ESG MSCI.

B. El WACI general del Fondo fue el 45,5 % del índice de referencia del indicador.

C. La asignación del Fondo a emisores y emisiones alineadas con los ODS fue del 87,6 %.

D. El Fondo tenía un 15,65 % invertido por valor de mercado al 29 de febrero de 2024.

E. El Fondo no mantuvo ningún emisor que incumpliera las directrices del SRI.

F. El Fondo mantuvo una calificación ESG de la cartera superior a la de su universo de inversión.

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
54930030VHR7UP4BBZ30

FRANKLIN TEMPLETON

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 3,71% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☐ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

El Fondo promovió las siguientes características ambientales o sociales:

- Alineación con uno o más Objetivos de Desarrollo Sostenible de la ONU (ODS) en comparación con el índice de referencia del Fondo, a través de la inversión en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad, y a través de las mejores inversiones en su clase.

- Conformidad con los siguientes indicadores de las PIA:

  - Intensidad de GEI (PIA n.º 3 y n.º 15).
  - Asuntos sociales y de los empleados (PIA n.º 10).
  - Armas controvertidas (PIA n.º 14).

No se han utilizado instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Los indicadores de sostenibilidad utilizados para medir la consecución de cada una de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo fueron:

- Los indicadores de las PIA mencionados en la respuesta anterior. Consulte los valores mostrados en la sección «¿Cómo consideró este producto financiero los principales impactos adversos en los factores de sostenibilidad?» de los indicadores durante el período de referencia.

- A 29 de febrero de 2024, la asignación a bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad era del 3,71 %.

¿...y en comparación con períodos anteriores?

Los indicadores generales en materia de sostenibilidad se ajustan a los del período anterior.

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura	Valor	Cobertura
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	64,51	30,03%	67,50	88,80%
Intensidad de GEI de los países participados USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	197,16	100,00%	231,40	100,00%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	30,89%	0,00%	87,00%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	30,89%	0,00%	87,00%

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

El objetivo de las inversiones sostenibles del Fondo era reducir las emisiones de GEI medidas a través de la intensidad media ponderada de carbono. Las inversiones sostenibles del Fondo eran en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad, que se conseguían mediante una asignación mínima a emisores alineados con los ODS en comparación con el índice de referencia del Fondo, y con emisores que cumplían los umbrales de los mejores de su categoría. Dichos bonos tenían KPI vinculados a la sostenibilidad o ingresos que se utilizaron para proyectos que incluían, entre otros:

- Proyectos verdes: energías renovables, eficiencia energética, prevención y control de la contaminación, gestión sostenible desde el punto de vista ambiental de los recursos naturales vivos y del uso de la tierra, biodiversidad, transporte limpio, gestión sostenible del agua y de las aguas residuales, adaptación al cambio climático, economía circular y edificios verdes.
- Proyectos sociales: viviendas e infraestructuras asequibles (agua potable, saneamiento), programas de empleo y avances socioeconómicos, como la educación, la diversidad, la igualdad y la inclusión, entre otros.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

El gestor de inversiones empleó sus investigaciones propias y las PIA para garantizar que las inversiones sostenibles no causaran daño significativo a ningún objetivo de inversión sostenible ambiental o social. La investigación propia, junto con el uso de herramientas desarrolladas internamente, incluidas, entre otras, la selección, permitió a los gestores de cartera identificar emisores que el gestor de inversiones no cree que causen daños significativos.

Como resultado, el gestor de inversiones pudo invertir en emisores que se ajustaban a los indicadores de las PIA y evitar los emisores que no se ajustaban. Como parte de la inversión del Fondo en bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad, el gestor de inversiones aplicó este enfoque para determinar si un bono cumplía los criterios de sostenibilidad.

Además, los emisores soberanos se sometieron a pruebas basadas en sus libertades políticas o en la corrupción.

A la hora de destinar fondos a inversiones sostenibles, especialmente el 1 % mínimo de la cartera del Fondo comprometido con objetivos ambientales, si procede, el gestor de inversiones aplicó una evaluación cualitativa adicional (basada en la investigación interna o en la opinión de terceros externos) de la elegibilidad de los emisores y de los proyectos conforme al principio «no causar un perjuicio significativo».

Además, se aplicaron una serie de exclusiones al Fondo para excluir a los emisores que podían causar un perjuicio significativo, como se detalla más adelante.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

El gestor de inversiones desarrolló una herramienta propia de PIA que pudiera tener en cuenta las PIA importantes y ayudara a medir la alineación del Fondo con respecto a los indicadores de PIA que se consideraban importantes para el Fondo.

Las PIA sirvieron de barómetro útil para calibrar en qué emisores invertir: Concretamente, la PIA n.º 3 se utilizó para la evaluación de la intensidad de GEI corporativos y la PIA n.º 15 para la intensidad de los GEI soberanos, respectivamente. La PIA n.º 10 se utilizó para identificar emisores que no cumplían con los Principios del PMNU y las Directrices de la OCDE, mientras que la PIA n.º 14 servía para identificar emisores que no cumplían los criterios en cuanto a armas controvertidas en todo el Fondo en comparación con los del universo de inversión.

Aunque el Fondo no se comprometió a tener una media de PIA mejor que la de su índice de referencia, la diferencia entre las dos métricas ayudó a informar sobre el éxito del Fondo en la gestión de los impactos adversos.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

El Fondo se adhirió a las directrices explícitas que excluían a los emisores que fallaban según los Principios del PMNU y las Directrices de la OCDE. El compromiso del gestor de inversiones con los emisores se basaba en los principios del PMNU y de las Directrices de la OCDE. Los emisores que se consideraron deficientes según los Principios del PMNU y las Directrices de la OCDE se añadieron a la lista roja de ESG del gestor de inversiones, que servía para excluir a los emisores de la inversión del Fondo. Si procedía, el gestor de inversiones intentaría participar con los emisores que le preocupaban, que podían haber fallado explícitamente según las directrices subyacentes.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.

¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

La forma en que se consideraron y se tuvieron en cuenta las PIA se detalla previamente.

Las métricas de las PIA que se presentan a continuación se basan en el cálculo promedio de las síntesis trimestrales durante el período de referencia. El cálculo de las métricas pertinentes se refiere a las inversiones para las que se dispone de los datos ESG subyacentes y no a todas las inversiones mantenidas por el Fondo. Tenga en cuenta que esta información está sujeta a cambios y debe utilizarse solo con fines informativos.

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	64,51	30,03%
Intensidad de GEI de los países participados USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	197,16	100,00%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	30,89%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	30,89%



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
United States of America	Bonos del Estado	18,53%	Estados Unidos
Federal National Mortgage Association	Sector financiero	8,27%	Estados Unidos
Bundesrepublik Deutschland	Bonos del Estado	7,96%	Alemania
FRANKLIN RESOURCES, INC.	Sector financiero	7,50%	Estados Unidos
United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland	Bonos del Estado	4,82%	Reino Unido
Government National Mortgage Association	Sector financiero	4,52%	Estados Unidos
Estados Unidos Mexicanos	Bonos del Estado	3,60%	México
Freddie Mac	Sector financiero	2,36%	Estados Unidos
Republique Francaise	Bonos del Estado	2,17%	Francia
Japan	Bonos del Estado	1,60%	Japón
Republica Federativa do Brasil	Bonos del Estado	1,49%	Brasil
Rzeczpospolita Polska	Bonos del Estado	1,26%	Polonia
Republic of South Africa	Bonos del Estado	1,19%	Sudáfrica
Government of the Republic of Korea	Bonos del Estado	1,15%	Corea del Sur
Pemerintah Republik Indonesia	Bonos del Estado	1,05%	Indonesia

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

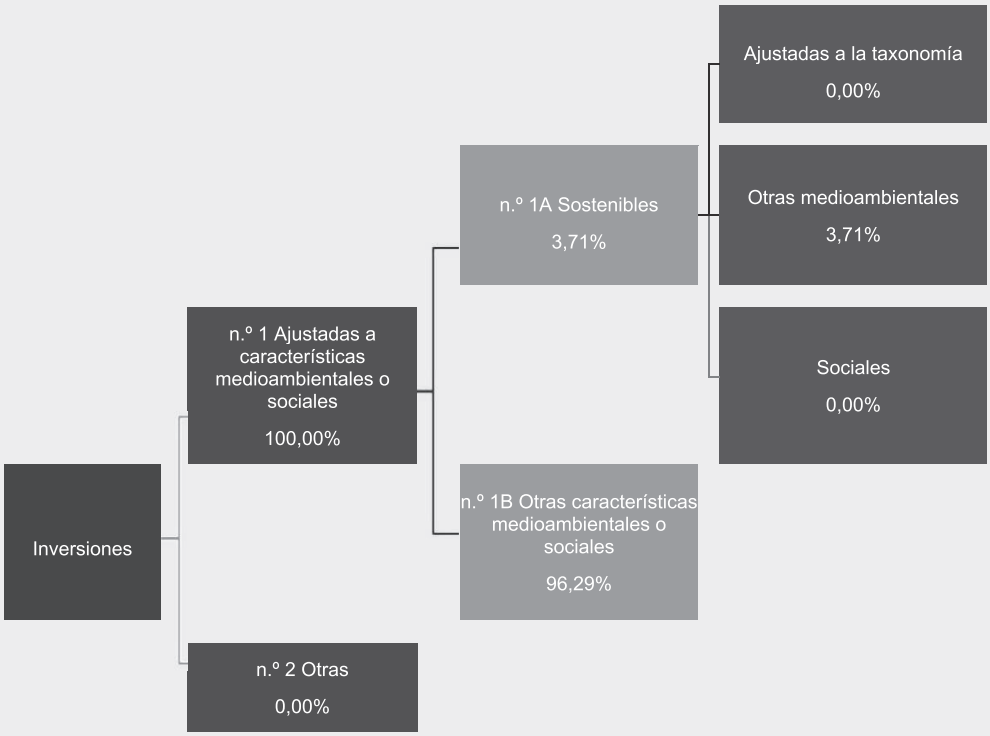
A 29 de febrero de 2024, la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 3,71 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

A 29 de febrero de 2024, el 99,998 % del Fondo se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas por este. La parte restante (0,002 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos o emisores sin una calificación ESG.

Del segmento del Fondo que se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo destinó el 3,71 % de sus activos a inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

Sector principal	% de activos
Bonos del Estado	54,43%
Sector financiero	30,91%
Servicios de comunicación	3,12%
Sector sanitario	2,66%
Energía	1,17%
Consumo discrecional	1,02%
Sector inmobiliario	0,81%
Materiales	0,76%
Bienes básicos de consumo	0,43%
Sector industrial	0,39%
Servicios públicos	0,17%
Tecnología de la información	0,14%

Principales subsectores	% de activos
Bonos del Estado	54,43%
Servicios financieros	18,60%
Bancos	8,50%
Mercados de capitales	2,22%
Proveedores y servicios sanitarios	1,72%
Medios de comunicación	1,40%
Petróleo, gas y combustibles de consumo	1,17%
Seguros	0,99%
Gestión y desarrollo del mercado inmobiliario	0,73%
Servicios inalámbricos de telecomunicaciones	0,68%
Entretenimiento	0,56%
Industria farmacéutica	0,49%
Servicios de telecomunicaciones diversificados	0,48%
Papel y productos forestales	0,47%
Biotecnología	0,43%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la Taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

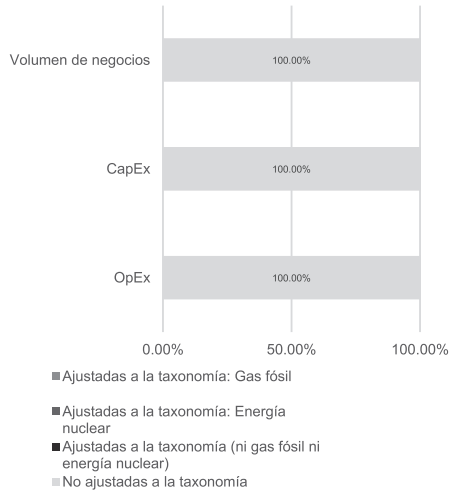
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

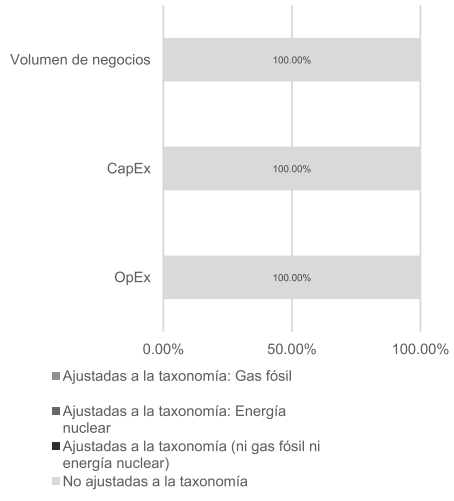
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transició facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

En línea con la estrategia de inversión, a saber, el compromiso del Fondo de mantener una exposición mínima a las «inversiones sostenibles» con un objetivo ambiental según el Reglamento sobre la divulgación de información relativa a la sostenibilidad en el sector de los servicios financieros (art. 2 [17]) que no pueden considerarse sostenibles desde el punto de vista ambiental con arreglo al Reglamento sobre la taxonomía de la UE, el 3,71 % del Fondo estaba compuesto por «inversiones sostenibles» con un objetivo ambiental que no pueden considerarse sostenibles desde el punto de vista ambiental con arreglo a la Taxonomía de la UE, a 29 de febrero de 2024.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

No se aplica.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

A 29 de febrero de 2024, la proporción de inversiones en «N.º 2 Otros» era del 0,002 % e incluía el efectivo, los derivados y los emisores sin calificaciones ESG para los que no había salvaguardias ambientales o sociales mínimas.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

Western Asset cree que los factores ESG importantes desde el punto de vista financiero pueden afectar a la solvencia de los valores de los emisores de renta fija y, por lo tanto, al rendimiento de las carteras de inversión de renta fija. Estos factores son totalmente coherentes con la filosofía de inversión a largo plazo y orientados al valor fundamental de la empresa. Los analistas de investigación de Western Asset se encargaron de proporcionar un análisis fundamental en el ámbito del sector y del emisor, y de opinar sobre las características de riesgo/recompensa del sector y del emisor mediante la incorporación de consideraciones ESG importantes. Con el respaldo de este enfoque más amplio, el Fondo pretendía cumplir con sus características ambientales y sociales e invertir en emisores para que la cartera general cumpliera con las calificaciones mínimas de ESG, lograra su descarbonización y alineación con los ODS, y evitara los emisores identificados mediante la aplicación de exclusiones SRI asignadas a sectores e invertidas en emisores objetivo.

Para cumplir las características ambientales o sociales durante el período de referencia:

A. El Fondo buscó una calificación media MSCI ESG de BBB o superior.

B. El Fondo buscó una intensidad de carbono promedio ponderada («WACI») general que estuviera al menos un 20 % por debajo del índice de referencia. Esto ayudó a ajustar el Fondo con las PIA n.º 3 y n.º 15 (Intensidad de GEI).

C. El Fondo intentó alinearse, mejor que el índice de referencia, con respecto a las inversiones en valores de emisores cuyas actividades contribuyen a al menos uno de los ocho ODS seleccionados.

D. El Fondo excluyó a los emisores que fracasan en una variedad de objetivos de SRI, como se describe a continuación:

a. Emisores que obtengan más del 5 % de sus ingresos de la producción y/o distribución de tabaco y de la producción de armas nucleares.

b. Emisores que obtengan más del 10 % de los ingresos de armas de fuego civiles (fabricación o suministro), armas convencionales o la minería del carbón térmico (producción o distribución).

c. Emisores que fabriquen armas controvertidas (minas terrestres antipersona, armas bioquímicas, armas láser cegadoras, uranio empobrecido, armas incendiarias y fragmentos no detectables), sean propietarios de una empresa de armas controvertidas o de una empresa de armas controvertidas, en consonancia con el indicador de la PIA n.º 14 (Exposición a armas controvertidas).

d. Emisores que «no superen» los principios del PMNU y de la OCDE, sobre la base de una investigación interna que pretende identificar las deficiencias en el cumplimiento de los objetivos por parte de los emisores, en consonancia con la PIA n.º 10 (Asuntos sociales y de los empleados).

Como parte de la inversión mínima del 1 % en inversiones sostenibles (definidas como bonos verdes, sociales, sostenibles y vinculados a la sostenibilidad), el Fondo tenía un 3,71 % invertido por valor de mercado a 29 de febrero de 2024.

El Fondo cumplió con sus pautas ambientales y sostenibles como se indica a continuación:

A. El Fondo recibió la calificación A según ESG MSCI.

B. El WACI general del Fondo fue el 75,9 % del índice de referencia.

C. La asignación del Fondo a emisores y emisiones alineadas con los ODS fue del 22,1 % frente al 17,8 % del índice de referencia.

D. El Fondo tenía un 3,71 % invertido por valor de mercado en bonos verdes, sociales, sostenibles o vinculados a la sostenibilidad a 29 de febrero de 2024.

E. Según las definiciones de Western Asset con respecto al Pacto Mundial de las Naciones Unidas, el Fondo no mantuvo ningún emisor que incumpliera las directrices del SRI.

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
549300TFZOEP7EEQG432

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☐ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 0,00% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☐ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☒ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

No todas las características ambientales o sociales enumeradas a continuación fueron promovidas por cada inversión o por el Fondo en un momento dado.

Las características ambientales promovidas por el Fondo con respecto a sus inversiones en bonos del Estado fueron:

- Calidad del aire
- Biodiversidad y áreas protegidas (marinas)
- Biodiversidad y áreas protegidas (terrestres)
- Capacidad de adaptación al cambio climático
- Exposición al cambio climático
- Sensibilidad al cambio climático
- Vulnerabilidad al cambio climático
- Emisiones de CO2 por el uso de energía
- Emisiones de CO2 por el cambio de uso del suelo y la silvicultura
- Política de carbono (soberana)
- Dependencia de las exportaciones de combustibles fósiles
- Deforestación
- Peligro de sequía
- Seguridad energética
- Presión ambiental
- Emisiones totales de GEI
- Reducción de las emisiones de GEI: Avances con respecto a los objetivos
- Economía con bajas emisiones de carbono
- Seguridad de los recursos
- Gestión de residuos
- Contaminación del agua
- Seguridad hídrica

Las características sociales promovidas por el Fondo con respecto a sus inversiones en bonos del Estado fueron:

- Riesgo de acceso a la reparación
- Trabajo infantil
- Disturbios civiles
- Discriminación en el lugar de trabajo
- Salarios decentes
- Educación
- Libertad de asociación y negociación colectiva

- Seguridad alimentaria
- Capacidad sanitaria
- Capital humano
- Derechos de los pueblos indígenas
- Mano de obra informal
- Trabajadores migrantes
- Derechos de las minorías
- Esclavitud moderna
- Salud y seguridad en el trabajo
- Pobreza
- Minorías sexuales
- Tendencias de la población en edad de trabajar
- Derechos de las mujeres y las niñas
- Trabajadores jóvenes

Los emisores situados en el 10 % con la calificación más baja (el decil inferior) quedaron excluidos del universo de inversión durante el período analizado.

Los emisores situados en el 10 % y el 20 % con peor calificación (segundo decil más bajo) se trataron como candidatos a la participación durante el período analizado.

No se utilizaron instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Los indicadores de sostenibilidad utilizados para medir la consecución de cada una de las características ambientales o sociales promovidas por el fondo eran:

A. Aportaciones específicas a la metodología de calificación ESG empleada por el gestor de inversiones que se ajustaban a las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo. Estas aportaciones se derivan de:

1. La aplicación de las exclusiones ESG.

El Fondo se compromete a excluir a los emisores situados en el decil de puntuación más bajo del universo de inversión. No se realizaron desinversiones, ya que ninguna de las tenencias se situaba en el decil inferior. Se siguió excluyendo el decil inferior.

2. El Fondo trata a aquellos emisores cuya puntuación se sitúa en el segundo percentil más bajo como candidatos a la participación. En consecuencia, se llevaron a cabo las siguientes interacciones: República de Sudáfrica.

B. Seguimiento de los indicadores relativos a las principales incidencias adversas (PIA). Consulte los valores que se muestran en la sección «¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?»

¿...y en comparación con períodos anteriores?

El Fondo se compromete a excluir a los emisores situados en el decil de puntuación más bajo del universo de inversión. Como consecuencia, se realizaron las siguientes desinversiones:

Período anterior: No se realizaron desinversiones, ya que ninguna de las tenencias se situaba en el decil inferior. Se siguió excluyendo el decil inferior.

Período actual: No se realizaron desinversiones, ya que ninguna de las tenencias se situaba en el decil inferior. Se siguió excluyendo el decil inferior.

El Fondo trata a aquellos emisores cuya puntuación se sitúa en el segundo percentil más bajo como candidatos a la participación. En consecuencia, se llevaron a cabo las siguientes interacciones:

Período anterior: Malasia

Período actual: República de Sudáfrica

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura	Valor	Cobertura
Intensidad de GEI de los países participados USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	386,70	83,31%	488,87	86,14%

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura	Valor	Cobertura
Número de países receptores de la inversión sujetos a infracciones sociales	Recuento de países en el Fondo	0,00	83,31%	0,00	86,14%

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

No se aplica. El Fondo no se compromete a tener inversiones sostenibles.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

No se aplica. El Fondo no se compromete a tener inversiones sostenibles.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

No se aplica. El Fondo no se compromete a tener inversiones sostenibles.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

No se aplica. El Fondo no se compromete a tener inversiones sostenibles.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.

¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Las PIA obligatorias de los países serán objeto de seguimiento, medición y notificación; el gestor de inversiones también utilizará los cambios en las PIA y los KPI relacionados para evaluar tanto las oportunidades de mejora como las mejoras realizadas, en las que se basan las inversiones y el tamaño de las posiciones. El gestor de inversiones evaluará los umbrales de «no causar un perjuicio significativo» a nivel fundamental, de sector/industria, de país y de cartera para tomar decisiones de inversión. Las dos PIA soberanas (PIA n.º 15 [Intensidad de GEI] y PIA n.º 16 [Países receptores de inversiones sujetos a violaciones sociales]) se incluyen en la metodología de calificación ESG propia del gestor de inversiones.

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Intensidad de GEI de los países participados USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	386,70	83,31%
Número de países receptores de la inversión sujetos a infracciones sociales	Recuento de países en el Fondo	0,00	83,31%

¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
United States of America	Bonos del Estado	36,23%	Estados Unidos
Estados Unidos Mexicanos	Bonos del Estado	11,13%	México
International Bank for Reconstruction and Development	Bonos del Estado	9,90%	Supranacional
United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland	Bonos del Estado	6,19%	Reino Unido
Republica Federativa do Brasil	Bonos del Estado	5,18%	Brasil
Republica de Colombia	Bonos del Estado	5,07%	Colombia
Bundesrepublik Deutschland	Bonos del Estado	4,19%	Alemania
Statsministerens Kontor	Bonos del Estado	3,93%	Noruega
Republic of South Africa	Bonos del Estado	3,45%	Sudáfrica
KfW	Bonos del Estado	3,20%	Alemania
Commonwealth of Australia	Bonos del Estado	3,09%	Australia
Gobierno de Chile	Bonos del Estado	2,60%	Chile
Province of Manitoba	Bonos del Estado	1,46%	Canadá
New Zealand	Bonos del Estado	1,32%	Nueva Zelanda
France	Bonos del Estado	1,00%	Francia

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

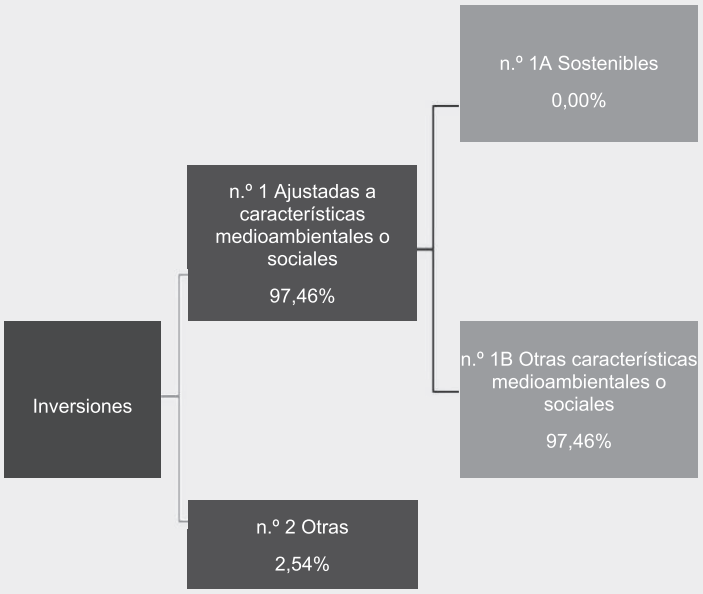
La proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 0 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 97,46 % de la cartera se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo. La parte restante (2,54 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos.

El Fondo no realizó ninguna inversión sostenible.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

Sector principal	% de activos
Bonos del Estado	98,83%
Principales subsectores	**% de activos**
Soberano	84,27%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental ajustado a la taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

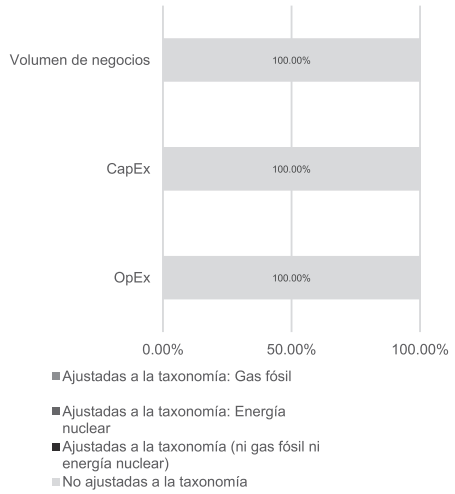
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

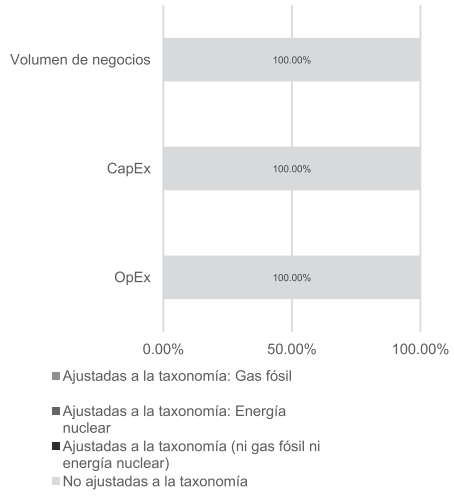
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transició facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica.

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

El producto financiero tenía una cuota de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustado a la taxonomía de la UE del 0,00%.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

El producto financiero tenía una cuota de inversiones con un objetivo social del 0,00%.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

El producto financiero tenía una 2,54%__ % de inversiones que no se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse inversiones sostenibles.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

1. El Fondo se compromete a excluir a los emisores situados en el decil de puntuación más bajo del universo de inversión. No se realizaron desinversiones, ya que ninguna de las tenencias se situaba en el decil inferior. Se siguió excluyendo el decil inferior.

2. El Fondo trata a aquellos emisores cuya puntuación se sitúa en el segundo percentil más bajo como candidatos a la participación. En consecuencia, se llevaron a cabo las siguientes interacciones: República de Sudáfrica

3. Hasta el 90 % de las inversiones son objeto de seguimiento y control para detectar el deterioro o las mejoras de los factores ambientales y sociales.

4. El Fondo mantuvo una calificación ESG de la cartera superior a la del universo de inversión.

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica.

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
549300373IZ316KVU890

FRANKLIN TEMPLETON

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 5,52% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☒ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

Dado que el Fondo buscó una estrategia sin restricciones, las características ambientales o sociales que promueve reflejan múltiples sectores de renta fija y se contabilizan a escalas fundamental, sectorial y de país. No todas las características ambientales o sociales enumeradas a continuación fueron promovidas por cada inversión o por el Fondo en un momento dado.

Las características ambientales soberanas promovidas por el Fondo con respecto a sus inversiones en bonos del Estado fueron:

- Calidad del aire
- Biodiversidad y áreas protegidas (marinas)
- Biodiversidad y áreas protegidas (terrestres)
- Capacidad de adaptación al cambio climático
- Exposición al cambio climático
- Sensibilidad al cambio climático
- Vulnerabilidad al cambio climático
- Emisiones de CO2 por el uso de energía
- Emisiones de CO2 por el cambio de uso del suelo y la silvicultura
- Política de carbono (soberana)
- Dependencia de las exportaciones de combustibles fósiles
- Deforestación
- Peligro de sequía
- Seguridad energética
- Presión ambiental
- Emisiones totales de GEI
- Reducción de las emisiones de GEI: Avances con respecto a los objetivos
- Economía con bajas emisiones de carbono
- Seguridad de los recursos
- Gestión de residuos
- Contaminación del agua
- Seguridad hídrica

Las características sociales soberanas promovidas por el Fondo con respecto a sus inversiones en bonos del Estado fueron:

- Riesgo de acceso a la reparación
- Trabajo infantil
- Disturbios civiles
- Discriminación en el lugar de trabajo
- Salarios decentes
- Educación

- Libertad de asociación y negociación colectiva
- Seguridad alimentaria
- Capacidad sanitaria
- Capital humano
- Derechos de los pueblos indígenas
- Mano de obra informal
- Trabajadores migrantes
- Derechos de las minorías
- Esclavitud moderna
- Salud y seguridad en el trabajo
- Pobreza
- Minorías sexuales
- Tendencias de la población en edad de trabajar
- Derechos de las mujeres y las niñas
- Trabajadores jóvenes

Las características ambientales y sociales de las empresas promovidas por el Fondo con respecto a sus inversiones en bonos corporativos fueron:

- Emisiones de GEI
- Huella de carbono
- Intensidad de GEI de las empresas participadas
- Exposición a empresas del sector de los combustibles fósiles
- Porcentaje de consumo y producción de energías no renovables
- Intensidad del consumo de energía por sector de alto impacto climático
- Actividades que afectan negativamente a las zonas sensibles a la biodiversidad
- Emisiones al agua
- Proporción de residuos peligrosos
- Violación de los principios del Pacto Mundial de la ONU y de las Directrices de la Organización para la Cooperación y el Desarrollo Económico (OCDE) para empresas multinacionales
- Falta de procesos y mecanismos de cumplimiento para supervisar el cumplimiento de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y las Directrices de la OCDE para empresas multinacionales
- Brecha salarial entre hombres y mujeres, sin ajustar
- Diversidad de género de la junta directiva
- Exposición a armas controvertidas (minas antipersona, bombas de racimo, armas químicas y biológicas)

Los emisores situados en el 10 % con la calificación más baja (el decil inferior) quedaron excluidos del universo de inversión durante el período analizado.

Los emisores situados en el 10 % y el 20 % con peor calificación (segundo decil más bajo) se trataron como candidatos a la participación durante el período analizado.

No se utilizaron instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Los indicadores de sostenibilidad utilizados para medir la consecución de cada una de las características ambientales o sociales promovidas por el fondo eran:

A. Aportaciones específicas a la metodología de calificación ESG empleada por el gestor de inversiones que se ajustaban a las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo. Estas aportaciones se derivan de:

1. La aplicación de las exclusiones ESG.

El Fondo se compromete a excluir a los emisores situados en el decil de puntuación más bajo del universo de inversión. Como consecuencia, se realizaron las siguientes desinversiones: World Acceptance Corp.

2. El Fondo trata a aquellos emisores cuya puntuación se sitúa en el segundo percentil más bajo como candidatos a la participación. En consecuencia, se llevaron a cabo las siguientes interacciones: Civitas Resources Inc, Taseko Mines Ltd., México, Devon Energy Corporation, Colombia, Leviathan Bond Ltd, Texas Capital Bancshares, Mileage Plus Holdings LLC, Continental Airlines, United Airlines, República de Sudáfrica, Ford Motor Credit Co LLC, Vici Properties, Brasil, Dream Finders Homes Inc., Ero Copper Corp.

B. Seguimiento de los indicadores relativos a las principales incidencias adversas (PIA) relevantes para cada emisor. Consulte los valores que se muestran en la sección «¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?»

C. Exposición a los bonos verdes, sociales y de sostenibilidad (GSS) del 5,52 %. El uso de los ingresos de dichos bonos fue especificado por el emisor (y verificado por un tercero o por el gestor de inversiones) y benefició a proyectos ambientales o sociales subyacentes como, por ejemplo:

- Transporte limpio y control de la contaminación
- Agua reciclada
- Energía asequible y limpia
- Reducción de la pobreza y las desigualdades
- Trabajo decente y crecimiento económico

¿...y en comparación con períodos anteriores?

El Fondo se compromete a excluir a los emisores situados en el decil de puntuación más bajo del universo de inversión. Como consecuencia, se realizaron las siguientes desinversiones:

Período anterior: Hercules Capital, Weibo Corp, Meta Platforms

Período actual: World Acceptance Corp.

El Fondo trata a aquellos emisores cuya puntuación se sitúa en el segundo percentil más bajo como candidatos a la participación. En consecuencia, se llevaron a cabo las siguientes interacciones:

Período anterior: Carnival Cruise Corp., Dish Network Corp., Taseko Mines Ltd., Owl Rock Capital Corporation y Brasil.

Período actual: Civitas Resources Inc, Taseko Mines Ltd., México, Devon Energy Corporation, Colombia, Leviathan Bond Ltd, Texas Capital Bancshares, Mileage Plus Holdings LLC, Continental Airlines, United Airlines, República de Sudáfrica, Ford Motor Credit Co LLC, Vici Properties, Brasil, Dream Finders Homes Inc., Ero Copper Corp.

Exposición a los bonos verdes, sociales y de sostenibilidad (GSS)

Período anterior: 1,18 %. El uso de los ingresos de dichos bonos fue especificado por el emisor (y verificado por un tercero o por el gestor de inversiones) y benefició a proyectos ambientales o sociales subyacentes como, por ejemplo:

- Reducción de las emisiones de GEI
- Mayor disponibilidad de los productos en los países de ingresos bajos y medios
- Creación de ciudades y comunidades sostenibles mediante la financiación de la energía, el agua, el saneamiento y el transporte limpios
- Iniciativas centradas en la diversidad, la equidad y la inclusión

Período actual: 5,52 %. El uso de los ingresos de dichos bonos fue especificado por el emisor (y verificado por un tercero o por el gestor de inversiones) y benefició a proyectos ambientales o sociales subyacentes como, por ejemplo:

- Transporte limpio y control de la contaminación
- Agua reciclada
- Energía asequible y limpia
- Reducción de la pobreza y las desigualdades
- Trabajo decente y crecimiento económico

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	**Unidad de medida**	**Valor**	**Cobertura**	**Valor**	**Cobertura**
Emisiones de GEI: Alcance 1 USD	Toneladas de CO2eq	53 490,50	55,78%	N/A	N/A
Emisiones de GEI: Alcance 2 USD	Toneladas de CO2eq	7 045,43	55,78%	N/A	N/A
Emisiones de GEI: Alcance 3 USD	Toneladas de CO2eq	291 970,00	55,68%	N/A	N/A
Emisiones de GEI: Emisiones totales en USD	Toneladas de CO2eq	352 506,00	55,78%	N/A	N/A
Huella de carbono en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares invertidos	547,83	55,78%	353,95	60,85%
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	1 130,77	68,20%	N/A	N/A
Exposición a empresas del sector de los combustibles fósiles.	Porcentaje invertido del Fondo	7,53%	58,36%	4,57%	56,49%
Porcentaje de consumo y producción de energías no renovables.	Porcentaje invertido del Fondo	79,28%	28,23%	74,19%	26,47%
Intensidad de consumo de energía: Agricultura USD	GWh por millón de dólares de ventas	0,00	24,63%	0,00	22,03%
Intensidad de consumo de	GWh por millón de dólares de ventas	1,72	24,63%	2,21	22,03%

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura	Valor	Cobertura
energía: Minería USD					
Intensidad de consumo de energía: Fabricación USD	GWh por millón de dólares de ventas	1,56	24,63%	0,50	22,03%
Intensidad de consumo de energía: Electricidad USD	GWh por millón de dólares de ventas	6,24	24,63%	6,02	22,03%
Intensidad de consumo de energía: Agua USD	GWh por millón de dólares de ventas	0,73	24,63%	0,66	22,03%
Intensidad de consumo de energía: Construcción USD	GWh por millón de dólares de ventas	15,78	24,63%	0,00	22,03%
Intensidad de consumo de energía: Comercio y vehículos USD	GWh por millón de dólares de ventas	0,03	24,63%	0,04	22,03%
Intensidad de consumo de energía: Transporte y logística USD	GWh por millón de dólares de ventas	0,99	24,63%	3,12	22,03%
Intensidad de consumo de energía: Sector inmobiliario USD	GWh por millón de dólares de ventas	0,00	24,63%	0,00	22,03%
Actividades que afectan negativamente a las zonas sensibles a la biodiversidad	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	58,36%	0,00%	56,49%
Emisiones al agua USD	Toneladas métricas USD	0,00	0,10%	210,48	1,86%
Residuos peligrosos USD	Toneladas métricas USD	1,27	9,28%	433,96	9,94%
Violaciones de los principios del Pacto Mundial de la ONU y las Directrices de la OCDE	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	59,78%	0,00%	59,25%
Falta de procesos y mecanismos de cumplimiento para supervisar el cumplimiento de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y las Directrices de la OCDE para empresas multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	48,12%	58,36%	44,00%	54,74%

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura	Valor	Cobertura
Diferencias salariales entre hombres y mujeres sin ajustar	Porcentaje invertido del Fondo	20,02%	8,43%	18,47%	5,64%
Diversidad de género en los consejos de administración	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	28,21%	50,44%	29,84%	56,02%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	58,36%	0,00%	56,49%
Intensidad de GEI de los países participados USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	437,25	24,40%	481,49	10,54%
Número de países receptores de la inversión sujetos a infracciones sociales	Recuento de países en el Fondo	0,00	24,40%	0,00	10,54%

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

El Fondo invirtió al menos el 1 % de sus activos netos en bonos verdes o sociales que son inversiones sostenibles. El Fondo realizó este tipo de inversiones únicamente cuando el uso de los ingresos de dichos bonos estaba especificado por el emisor (y verificado por un tercero o por el gestor de inversiones) y benefició a proyectos ambientales o sociales subyacentes como, por ejemplo:

- Reducción de las emisiones de GEI
- Mayor disponibilidad de los productos en los países de ingresos bajos y medios
- Creación de ciudades y comunidades sostenibles mediante la financiación de la energía, el agua, el saneamiento y el transporte limpios
- Iniciativas centradas en la diversidad, la equidad y la inclusión

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

A la hora de evaluar el principio de «no causar un perjuicio significativo», el gestor de inversiones se basó en una combinación de estudios fundamentales internos, estudios de venta, noticias, PIA y datos ESG de proveedores externos.

El gestor de inversiones examinó las sanciones públicas señaladas a través de los estudios realizados por un proveedor externo, en relación con los incumplimientos del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU), así como las mediciones y los KPI relacionados con las PIA obligatorias tanto para las empresas como para los países. En el caso de las inversiones sostenibles en valores emitidos por empresas, el gestor de inversiones evaluó el principio de «no causar un perjuicio significativo» en el ámbito del emisor corporativo. En el caso de las inversiones sostenibles en valores emitidos por gobiernos u organizaciones supranacionales (que dicha organización supranacional no tiene una declaración de misión específica que indique que todas las actividades o proyectos que se financian son sostenibles), el gestor de inversiones evaluó el principio de «no causar un perjuicio significativo» en el ámbito de uso de los ingresos.

El Fondo realizó un seguimiento de las PIA obligatorias para identificar las exposiciones a incidencias adversas.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Las PIA obligatorias de las empresas y los países fueron objeto de seguimiento, medición y notificación. El gestor de inversiones evaluó los umbrales relativos a «no causar un perjuicio significativo» en el ámbito fundamental, de sector/industria, de país y de cartera para tomar decisiones de inversión. La política del gestor de inversiones es interactuar con los emisores y desprenderse de ellos como último recurso. El gestor de inversiones de desprendió inmediatamente cuando se descubría un riesgo importante a corto plazo.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

El gestor de inversiones realizó un seguimiento de las infracciones de la OCDE y el PNMU (obtenidas de un tercero de forma automatizada desde enero de 2022) y de los incumplimientos. Las empresas que incumplieron este criterio se excluyeron de la cartera o el universo de inversión.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.

¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Las PIA obligatorias de las empresas y los países fueron objeto de seguimiento, medición y notificación. El gestor de inversiones también utilizará los cambios en las PIA y los KPI relacionados para evaluar tanto las oportunidades de mejora como las mejoras realizadas, en las que se basan las inversiones y el tamaño de las posiciones.

El gestor de inversiones evaluó los umbrales relativos a «no causar un perjuicio significativo» en el ámbito fundamental, de sector/industria, de país y de cartera para tomar decisiones de inversión.

Las PIA obligatorias no se incluyeron inherentemente en la calificación ESG propia de este Fondo. No obstante, el gestor de inversiones realizó un seguimiento y un control de las PIA.

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Emisiones de GEI: Alcance 1 USD	Toneladas de CO2eq	53 490,50	55,78%
Emisiones de GEI: Alcance 2 USD	Toneladas de CO2eq	7 045,43	55,78%
Emisiones de GEI: Alcance 3 USD	Toneladas de CO2eq	291 970,00	55,68%
Emisiones de GEI: Emisiones totales en USD	Toneladas de CO2eq	352 506,00	55,78%
Huella de carbono en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares invertidos	547,83	55,78%
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	1 130,77	68,20%
Exposición a empresas del sector de los combustibles fósiles.	Porcentaje invertido del Fondo	7,53%	58,36%
Porcentaje de consumo y producción de energías no renovables.	Porcentaje invertido del Fondo	79,28%	28,23%
Intensidad de consumo de energía: Agricultura USD	GWh por millón de dólares de ventas	0,00	24,63%
Intensidad de consumo de energía: Minería USD	GWh por millón de dólares de ventas	1,72	24,63%
Intensidad de consumo de energía: Fabricación USD	GWh por millón de dólares de ventas	1,56	24,63%
Intensidad de consumo de energía: Electricidad USD	GWh por millón de dólares de ventas	6,24	24,63%
Intensidad de consumo de energía: Agua USD	GWh por millón de dólares de ventas	0,73	24,63%
Intensidad de consumo de energía: Construcción USD	GWh por millón de dólares de ventas	15,78	24,63%
Intensidad de consumo de energía: Comercio y vehículos USD	GWh por millón de dólares de ventas	0,03	24,63%
Intensidad de consumo de energía: Transporte y logística USD	GWh por millón de dólares de ventas	0,99	24,63%
Intensidad de consumo de energía: Sector inmobiliario USD	GWh por millón de dólares de ventas	0,00	24,63%

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Actividades que afectan negativamente a las zonas sensibles a la biodiversidad	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	58,36%
Emisiones al agua USD	Toneladas métricas USD	0,00	0,10%
Residuos peligrosos USD	Toneladas métricas USD	1,27	9,28%
Violaciones de los principios del Pacto Mundial de la ONU y las Directrices de la OCDE	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	59,78%
Falta de procesos y mecanismos de cumplimiento para supervisar el cumplimiento de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y las Directrices de la OCDE para empresas multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	48,12%	58,36%
Diferencias salariales entre hombres y mujeres sin ajustar	Porcentaje invertido del Fondo	20,02%	8,43%
Diversidad de género en los consejos de administración	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	28,21%	50,44%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	58,36%
Intensidad de GEI de los países participados USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	437,25	24,40%
Número de países receptores de la inversión sujetos a infracciones sociales	Recuento de países en el Fondo	0,00	24,40%

¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
COLOMBIA TES 7% 03/26/31	Bonos del Estado	4,72%	Colombia
US TREASURY FRN FLT 01/31/25	Bonos del Estado	3,00%	Estados Unidos
UK TSY GILT 3.75% 10/22/53	Bonos del Estado	2,95%	Reino Unido
KFW 0.375% 07/18/25	Bonos del Estado	2,48%	Alemania
BRAZIL NTN-F 10% 01/01/33	Bonos del Estado	2,24%	Brasil
MEXICAN BONOS 8% 07/31/53	Bonos del Estado	2,19%	México
INT BK RECON&DEV 4.625% 08/01/28	Bonos del Estado	1,71%	Supranacional
NEW FORTRESS 6.75% 09/15/25 144A	Energía	1,57%	Estados Unidos
INT BK RECON&DEV 0.5% 10/28/25	Bonos del Estado	1,53%	Supranacional
G2SF MA8646 4.5% 02/20/53	Valores hipotecarios	1,47%	Estados Unidos
G2SF MA8801 5.5% 04/20/53	Valores hipotecarios	1,32%	Estados Unidos
DISH NETWORK 3.375% 08/15/26	Servicios de comunicación	1,26%	Estados Unidos
BRAZIL NTN-F 10% 01/01/27	Bonos del Estado	1,23%	Brasil
FIRST QUANTUM 6.875% 10/15/27 144A	Materiales	1,11%	Canadá
XP INC 3.25% 07/01/26 144A	Sector financiero	1,09%	Brasil

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

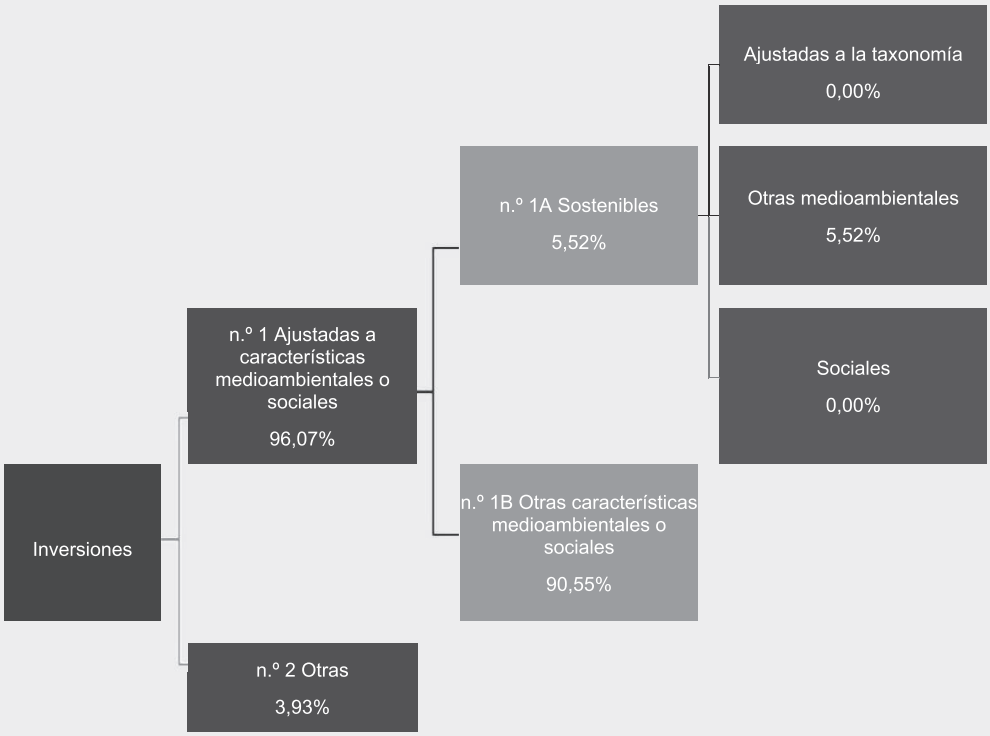
La proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 5,52 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 96,07 % de la cartera se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo. La parte restante (3,93 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos.

Del segmento de la cartera del Fondo adaptado a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo invirtió el 5,52 % de su cartera en inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

Sector principal	% de activos
Gobierno	24,45%
Sector financiero	21,73%
Valores hipotecarios	12,30%
Energía	9,43%
Bienes de consumo cíclico	8,10%
Comunicaciones	6,53%
Sector industrial	5,80%
Materiales básicos	4,18%
Bienes de consumo no cíclico	1,94%
Tecnología	1,19%
Servicios públicos	0,29%
Valores respaldados por hipotecas	0,12%

Principales subsectores	% de activos
Soberano	20,66%
Empresas de inversión	7,43%
Mezzanine de obligaciones con garantía hipotecaria para toda la vida	6,00%
Petroleras-exploración y producción	5,46%
Bancos con fines especiales	4,09%
Banco supranacional	3,79%
GNMA2 de viviendas unifamiliares 30 años	3,48%
Metal-cobre	3,30%
Tuberías	3,08%
Aerolíneas	2,55%
Subord. de obligaciones con garantía hipotecaria para toda la vida	2,30%
Contenedores-papel/plástico	1,94%
Automóviles/camiones ligeros	1,68%
Telecomunicaciones móviles	1,64%
Instituciones bancarias diversificadas	1,51%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental ajustado a la taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

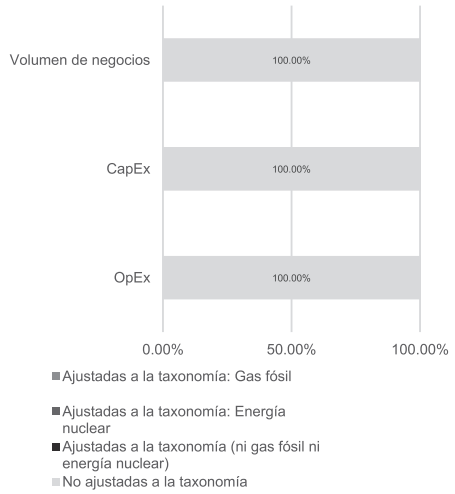
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

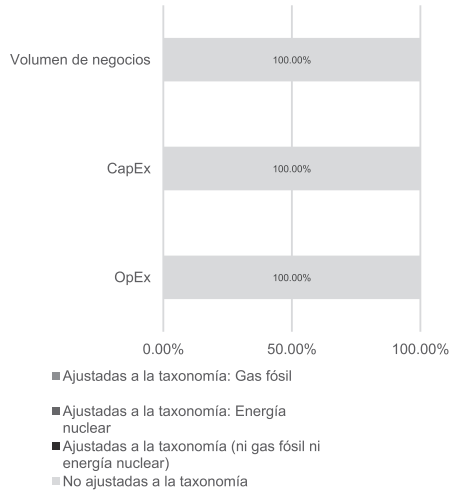
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transició facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica.

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

El producto financiero tenía una cuota de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustado a la taxonomía de la UE del 5,52%.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

El producto financiero tenía una cuota de inversiones con un objetivo social del 0,00%.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

El producto financiero tenía una 3,93%__ % de inversiones que no se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse inversiones sostenibles.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

1. El Fondo se compromete a excluir a los emisores situados en el decil de puntuación más bajo del universo de inversión. Como consecuencia, se realizaron las siguientes desinversiones: World Acceptance Corp.

2. El Fondo trata a aquellos emisores cuya puntuación se sitúa en el segundo percentil más bajo como candidatos a la participación. En consecuencia, se llevaron a cabo las siguientes interacciones: Civitas Resources Inc, Taseko Mines Ltd., México, Devon Energy Corporation, Colombia, Leviathan Bond Ltd, Texas Capital Bancshares, Mileage Plus Holdings LLC, Continental Airlines, United Airlines, República de Sudáfrica, Ford Motor Credit Co LLC, Vici Properties, Brasil, Dream Finders Homes Inc., Ero Copper Corp.

3. Hasta el 80 % de las inversiones son objeto de seguimiento y control para detectar el deterioro o las mejoras de los factores ambientales y sociales.

4. El Fondo invirtió al menos el 1 % de sus activos netos en inversiones sostenibles con objetivos ambientales o sociales, tal y como se señaló más arriba.

5. El Fondo mantuvo una calificación ESG de la cartera superior a la del universo de inversión.

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica.

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
254900QDA77XG4LVMI92

FRANKLIN TEMPLETON

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 18,88% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☐ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

El Fondo promovió una serie de características ambientales y sociales, entre las que se incluyen:

medioambientales,

- Mitigación del cambio climático
- Adaptación al cambio climático
- Agua
- Biodiversidad

Sociales:

- Equidad

Los emisores situados en el 10 % con la calificación más baja (el decil inferior) quedaron excluidos del universo de inversión durante el período analizado.

Los emisores situados en el 10 % y el 20 % con peor calificación (segundo decil más bajo) se trataron como candidatos a la participación durante el período analizado.

Utilice los indicadores clave de rendimiento (KPI) para evaluar si el emisor tiene potencial o está demostrando progresos en un área actual de sostenibilidad.

No se utilizaron instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Los indicadores de sostenibilidad utilizados para medir la consecución de cada una de las características ambientales o sociales promovidas por el fondo eran:

A. Aportaciones específicas a la metodología de calificación ESG empleada por el gestor de inversiones que se ajustaban a las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo. Estas aportaciones se derivan de:

1. La aplicación de las exclusiones ESG.

El Fondo se compromete a excluir a los emisores situados en el decil de puntuación más bajo del universo de inversión. Como consecuencia, se realizaron las siguientes desinversiones: JBS Foods, Concrete Pumping Holdings, Inc.

2. El Fondo trata a aquellos emisores cuya puntuación se sitúa en el segundo percentil más bajo como candidatos a la participación. En consecuencia, se llevaron a cabo las siguientes interacciones: Civitas Resources Inc, Taseko Mines Ltd., México, Devon Energy Corporation, Colombia, Leviathan Bond Ltd, Texas Capital Bancshares, Mileage Plus Holdings LLC, Continental Airlines, United Airlines, República de Sudáfrica, Ford Motor Credit Co LLC, Vici Properties, Brasil, Dream Finders Homes Inc., Ero Copper Corp.

B. Seguimiento de los indicadores clave de rendimiento relevantes para cada emisor. Consulte los valores que se muestran en la sección «¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?»

C. Exposición a los bonos verdes, sociales y de sostenibilidad (GSS) del 18,88 %. El uso de los ingresos de dichos bonos fue especificado por el emisor (y verificado por un tercero o por el gestor de inversiones) y benefició a proyectos ambientales o sociales subyacentes como, por ejemplo:

- Transporte limpio y control de la contaminación
- Agua reciclada
- Energía asequible y limpia
- Reducción de la pobreza y las desigualdades
- Trabajo decente y crecimiento económico

KPI de sostenibilidad Nombre	Valor
CO2 Alcance 1 -> Inferior	1,18%
Consumo de electricidad -> Inferior	1,21%
Emisiones mundiales -> Inferiores	0,40%
Energía por unidad de producción -> Inferior	1,32%
Diferencias salariales entre hombres y mujeres/Aplicación (S/N)	1,83%
Intensidad de GEI por ventas -> Inferior	9,23%
GEI Alcance 1 -> Inferior	1,28%
Política de derechos humanos/Aplicación (S/N)	0,77%
Porcentaje de diferencia salarial entre hombres y mujeres, incluidos los directivos -> Inferior	1,24%
Porcentaje de directivos pertenecientes a minorías -> Superior	0,96%
Uso de energías renovables -> Superior	1,90%
Activos ESG sostenibles gestionados -> Superior	1,25%
Consumo total de agua -> Inferior	0,96%
CDN de los Gobiernos frente al escenario de la NGFS para 2030	47,49%

¿...y en comparación con períodos anteriores?

El Fondo se compromete a excluir a los emisores situados en el decil de puntuación más bajo del universo de inversión. Como consecuencia, se realizaron las siguientes desinversiones:

Período anterior: No se realizaron desinversiones, ya que ninguna de las tenencias se situaba en el decil inferior. Se siguió excluyendo el decil inferior.

Período actual: JBS Foods, Concrete Pumping Holdings, Inc.

El Fondo trata a aquellos emisores cuya puntuación se sitúa en el segundo percentil más bajo como candidatos a la participación. En consecuencia, se llevaron a cabo las siguientes interacciones:

Período anterior: Malasia

Período actual: Civitas Resources Inc, Taseko Mines Ltd., México, Devon Energy Corporation, Colombia, Leviathan Bond Ltd, Texas Capital Bancshares, Mileage Plus Holdings LLC, Continental Airlines, United Airlines, República de Sudáfrica, Ford Motor Credit Co LLC, Vici Properties, Brasil, Dream Finders Homes Inc., Ero Copper Corp.

Utilice los indicadores clave de rendimiento (KPI) para evaluar si el emisor tiene potencial o está demostrando progresos en un área actual de sostenibilidad.

Período anterior: N. d.

Período actual: Continuamos realizando el seguimiento y la supervisión de los KPI de cada emisor. Se buscarán mejoras en los KPI durante un período de dos años. Este Fondo se constituyó en diciembre de 2022.

Exposición a los bonos verdes, sociales y de sostenibilidad (GSS)

Período anterior: N. d.

Período actual: 18,88 %. El uso de los ingresos de dichos bonos fue especificado por el emisor (y verificado por un tercero o por el gestor de inversiones) y benefició a proyectos ambientales o sociales subyacentes como, por ejemplo:

- Transporte limpio y control de la contaminación
- Agua reciclada

- Energía asequible y limpia
- Reducción de la pobreza y las desigualdades
- Trabajo decente y crecimiento económico

	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
KPI de sostenibilidad Nombre	**Valor**	**Valor**
CO2 Alcance 1 -> Inferior	1,18%	1,21%
Consumo de electricidad -> Inferior	1,21%	1,22%
Emisiones mundiales -> Inferiores	0,40%	N/A
Energía por unidad de producción -> Inferior	1,32%	2,38%
Diferencias salariales entre hombres y mujeres/Aplicación (S/N)	1,83%	2,33%
Intensidad de GEI por ventas -> Inferior	9,23%	11,16%
GEI Alcance 1 -> Inferior	1,28%	9,44%
Política de derechos humanos/Aplicación (S/N)	0,77%	0,76%
Porcentaje de diferencia salarial entre hombres y mujeres, incluidos los directivos -> Inferior	1,24%	1,24%
Porcentaje de directivos pertenecientes a minorías -> Superior	0,96%	0,97%
Uso de energías renovables -> Superior	1,90%	4,15%
Activos ESG sostenibles gestionados -> Superior	1,25%	2,57%
Consumo total de agua -> Inferior	0,96%	0,97%
CDN de los Gobiernos frente al escenario de la NGFS para 2030	47,49%	N/A

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	**Unidad de medida**	**Valor**	**Cobertura**	**Valor**	**Cobertura**
Emisiones de GEI: Alcance 1 USD	Toneladas de CO2eq	614,21	52,01%	736,47	66,42%
Emisiones de GEI: Alcance 2 USD	Toneladas de CO2eq	96,93	52,01%	141,25	66,42%
Emisiones de GEI: Alcance 3 USD	Toneladas de CO2eq	4 528,73	52,01%	4 911,81	66,42%
Emisiones de GEI: Emisiones totales en USD	Toneladas de CO2eq	5 239,87	52,01%	5 789,53	66,42%
Huella de carbono en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares invertidos	659,07	52,01%	600,19	66,42%
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	1 264,74	59,27%	1 311,56	72,02%
Exposición frente a empresas activas en el sector de los combustibles fósiles	Porcentaje invertido del Fondo	6,17%	53,69%	6,82%	68,33%
Proporción de producción y consumo de	Porcentaje invertido del Fondo	77,91%	28,22%	69,14%	36,63%

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura	Valor	Cobertura
energía no renovable.					
Intensidad de consumo de energía: Agricultura USD	GWh por millón de dólares de ventas	150,63	26,89%	0,00	35,55%
Intensidad de consumo de energía: Minería USD	GWh por millón de dólares de ventas	2,28	26,89%	2,22	35,55%
Intensidad de consumo de energía: Fabricación USD	GWh por millón de dólares de ventas	0,39	26,89%	0,27	35,55%
Intensidad de consumo de energía: Electricidad USD	GWh por millón de dólares de ventas	6,24	26,89%	6,02	35,55%
Intensidad de consumo de energía: Agua USD	GWh por millón de dólares de ventas	0,00	26,89%	0,00	35,55%
Intensidad de consumo de energía: Construcción USD	GWh por millón de dólares de ventas	32,12	26,89%	0,00	35,55%
Intensidad de consumo de energía: Comercio y vehículos USD	GWh por millón de dólares de ventas	0,06	26,89%	0,08	35,55%
Intensidad de consumo de energía: Transporte y logística USD	GWh por millón de dólares de ventas	0,97	26,89%	1,68	35,55%
Intensidad de consumo de energía: Sector inmobiliario USD	GWh por millón de dólares de ventas	0,00	26,89%	0,00	35,55%
Actividades que afectan negativamente a zonas sensibles en cuanto a la biodiversidad	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	53,69%	0,00%	68,33%
Emisiones al agua USD	Toneladas métricas USD	1 675,15	0,25%	0,23	1,03%
Residuos peligrosos USD	Toneladas métricas USD	0,73	11,82%	0,79	16,57%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	54,56%	0,00%	70,21%

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura	Valor	Cobertura
Ausencia de procesos y mecanismos de cumplimiento para realizar un seguimiento del cumplimiento de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	42,84%	53,69%	47,75%	67,29%
Brecha salarial entre hombres y mujeres, sin ajustar	Porcentaje invertido del Fondo	24,79%	10,60%	24,63%	8,16%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	33,17%	50,64%	33,83%	65,83%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	53,69%	0,00%	68,33%
Intensidad de GEI de los países participados USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	385,27	35,82%	369,41	12,58%
Países receptores de inversiones sujetos a violaciones sociales	Recuento de países en el Fondo	0,00	35,82%	N/A	N/A

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

El Fondo invirtió al menos el 15 % de sus activos netos en bonos verdes, sociales, sostenibles o relacionados con la sostenibilidad que son inversiones sostenibles, así como en algunos emisores que el gestor identificó como tales. El Fondo realizó este tipo de inversiones únicamente cuando el uso de los ingresos de dichos bonos estaba especificado por el emisor (y verificado por un tercero o por el gestor de inversiones) y benefició a proyectos ambientales o sociales subyacentes como, por ejemplo:

- medioambientales,

○ Mitigación del cambio climático

○ Adaptación al cambio climático

○ Conservación del agua

○ Conservación, utilización y reciclaje

○ Seguimiento y protección de la biodiversidad

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes

de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

A la hora de evaluar el principio de «no causar un perjuicio significativo», el gestor de inversiones se basó en una combinación de estudios fundamentales internos, estudios de venta, noticias, PIA y datos ESG de proveedores externos. En el caso de las inversiones sostenibles en valores emitidos por empresas, el gestor de inversiones evaluó el principio de «no causar un perjuicio significativo» en el ámbito del emisor corporativo. En el caso de las inversiones sostenibles en valores emitidos por gobiernos u organizaciones supranacionales (que dicha organización supranacional no tiene una declaración de misión específica que indique que todas las actividades o proyectos que se financian son sostenibles), el gestor de inversiones evaluó el principio de «no causar un perjuicio significativo» en el ámbito de uso de los ingresos.

El gestor de inversiones examinó las sanciones públicas señaladas a través de las evaluaciones proporcionadas por un proveedor externo, en relación con los incumplimientos del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU), así como las mediciones y los indicadores clave de rendimiento (KPI) relacionados con las PIA obligatorias tanto para las empresas como para los países.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Las PIA obligatorias de las empresas y los países fueron objeto de seguimiento, medición y notificación. El gestor de inversiones también utilizó los cambios en las PIA y los KPI relacionados para evaluar las oportunidades de mejora y el impacto, que sirvieron para informar sobre las inversiones y el tamaño de las posiciones.

Se estudiaron las PIA obligatorias en el contexto de la identificación de inversiones sostenibles o cuando fue necesario mejorar el perfil de sostenibilidad. Con la excepción de la PIA n.º 10 (Incumplimiento de los principios del PMNU y de las Directrices de la OCDE para empresas multinacionales) y de la PIA n.º 14 (Exposición a armas controvertidas), los indicadores de las PIA se utilizaron como KPI para realizar un seguimiento y supervisar el progreso de los emisores objeto de inversión, como se describe más adelante en este anexo. El deterioro o la falta de mejoras de los indicadores relativos a las PIA conducen a un compromiso obligatorio y, si es necesario, a la desinversión o exclusión del universo de inversión.

Se excluyen del universo de inversión las empresas de la PIA n.º 10 o con exposición a la PIA n.º 14, y los países soberanos sujetos a violaciones sociales (PIA n.º 16).

El gestor de inversiones evaluó los umbrales relativos a «no causar un perjuicio significativo» en el ámbito fundamental, de sector/industria, de país y de cartera para tomar decisiones de inversión. Las PIA opcionales y los datos relacionados con la taxonomía de la UE se incluyen en la evaluación de criterio de «no causar un perjuicio significativo» a medida que estas métricas estuvieron disponibles con una cobertura adecuada.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

El gestor de inversiones realizó un seguimiento de las infracciones de la OCDE y el PNMU (obtenidas de un tercero de forma automatizada) y de los incumplimientos. Las empresas que incumplieron este criterio se excluyeron de la cartera o el universo de inversión.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.

¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Las PIA obligatorias de las empresas y los países fueron objeto de seguimiento, medición y notificación.

El gestor de inversiones evaluó los umbrales relativos a «no causar un perjuicio significativo» en el ámbito fundamental, de sector/industria, de país y de cartera para tomar decisiones de inversión.

Las PIA obligatorias no se incluyeron inherentemente en la calificación ESG propia de este Fondo. No obstante, el gestor de inversiones realizó un seguimiento y un control de las PIA.

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Emisiones de GEI: Alcance 1 USD	Toneladas de CO2eq	614,21	52,01%
Emisiones de GEI: Alcance 2 USD	Toneladas de CO2eq	96,93	52,01%
Emisiones de GEI: Alcance 3 USD	Toneladas de CO2eq	4 528,73	52,01%
Emisiones de GEI: Emisiones totales en USD	Toneladas de CO2eq	5 239,87	52,01%
Huella de carbono en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares invertidos	659,07	52,01%

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	1 264,74	59,27%
Exposición frente a empresas activas en el sector de los combustibles fósiles	Porcentaje invertido del Fondo	6,17%	53,69%
Proporción de producción y consumo de energía no renovable.	Porcentaje invertido del Fondo	77,91%	28,22%
Intensidad de consumo de energía: Agricultura USD	GWh por millón de dólares de ventas	150,63	26,89%
Intensidad de consumo de energía: Minería USD	GWh por millón de dólares de ventas	2,28	26,89%
Intensidad de consumo de energía: Fabricación USD	GWh por millón de dólares de ventas	0,39	26,89%
Intensidad de consumo de energía: Electricidad USD	GWh por millón de dólares de ventas	6,24	26,89%
Intensidad de consumo de energía: Agua USD	GWh por millón de dólares de ventas	0,00	26,89%
Intensidad de consumo de energía: Construcción USD	GWh por millón de dólares de ventas	32,12	26,89%
Intensidad de consumo de energía: Comercio y vehículos USD	GWh por millón de dólares de ventas	0,06	26,89%
Intensidad de consumo de energía: Transporte y logística USD	GWh por millón de dólares de ventas	0,97	26,89%
Intensidad de consumo de energía: Sector inmobiliario USD	GWh por millón de dólares de ventas	0,00	26,89%
Actividades que afectan negativamente a zonas sensibles en cuanto a la biodiversidad	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	53,69%
Emisiones al agua USD	Toneladas métricas USD	1 675,15	0,25%
Residuos peligrosos USD	Toneladas métricas USD	0,73	11,82%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	54,56%
Ausencia de procesos y mecanismos de cumplimiento para realizar un seguimiento del cumplimiento de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	42,84%	53,69%
Brecha salarial entre hombres y mujeres, sin ajustar	Porcentaje invertido del Fondo	24,79%	10,60%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	33,17%	50,64%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	53,69%
Intensidad de GEI de los países participados USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	385,27	35,82%
Países receptores de inversiones sujetos a violaciones sociales	Recuento de países en el Fondo	0,00	35,82%



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
US TREASURY FRN FLT 01/31/25	Bonos del Estado	20,69%	Estados Unidos
COLOMBIA TES 7% 03/26/31	Bonos del Estado	4,64%	Colombia
STACR 2021-DNA7 M2 FLT 11/25/41 144A	Valores hipotecarios	3,81%	Estados Unidos
UK TSY GILT 3.75% 10/22/53	Bonos del Estado	2,89%	Reino Unido
MEXICAN BONOS 8% 07/31/53	Bonos del Estado	2,17%	México
BRAZIL NTN-F 10% 01/01/33	Bonos del Estado	1,84%	Brasil
FNCL MA4733 4.5% 09/01/52	Valores hipotecarios	1,54%	Estados Unidos
INT BK RECON&DEV 5% 01/22/26	Bonos del Estado	1,41%	Supranacional
INT BK RECON&DEV 4.25% 01/22/26	Bonos del Estado	1,37%	Supranacional
XP INC 3.25% 07/01/26 144A	Sector financiero	1,34%	Brasil
FIRST QUANTUM 6.875% 10/15/27 144A	Materiales	1,33%	Canadá
GOLDMAN SACHS GP VAR 02/12/26	Sector financiero	1,33%	Estados Unidos
AES PANAMA GENER 4.375% 05/31/30	Servicios públicos	1,31%	Panamá
FEDEX CORP 0.45% 05/04/29	Sector industrial	1,29%	Estados Unidos
VOLVO CAR AB 2.5% 10/07/27	Bienes de consumo cíclico	1,27%	Bienes de consumo cíclico

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

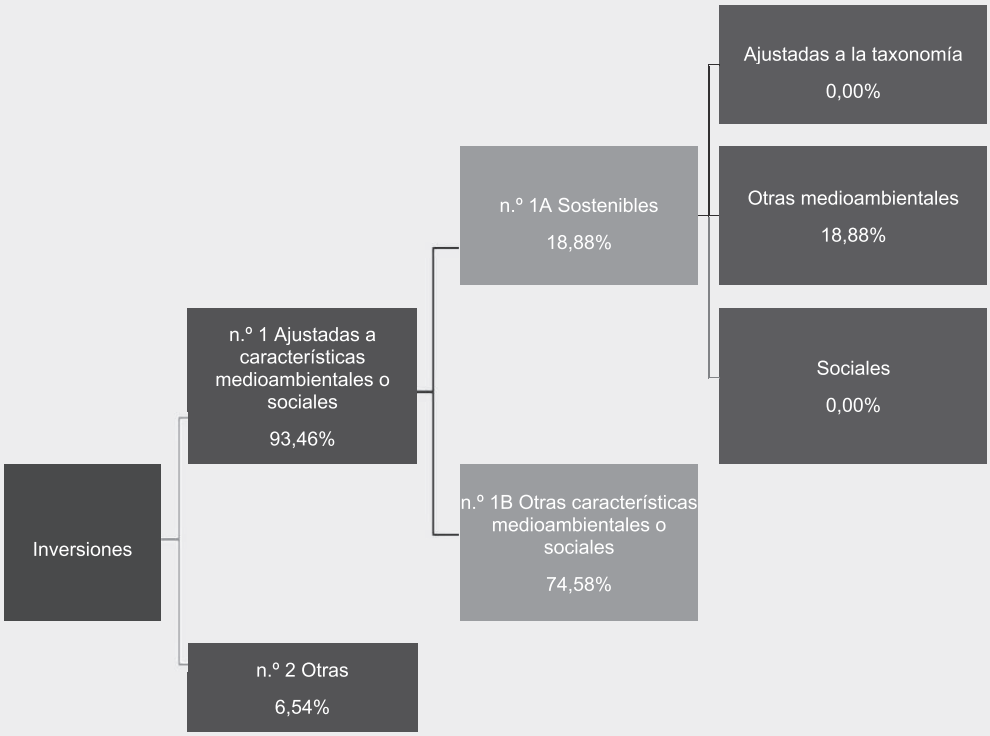
La proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 18,88 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 93,46 % de la cartera se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo. La parte restante (6,54 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos.

Del segmento de la cartera del Fondo que se ajusta a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo invirtió el 18,88 % de su cartera en inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

Sector principal	% de activos
Gobierno	39,90%
Valores hipotecarios	12,39%
Energía	11,79%
Sector financiero	10,18%
Bienes de consumo cíclico	5,03%
Sector industrial	4,71%
Bienes de consumo no cíclico	3,68%
Materiales básicos	3,48%
Servicios públicos	1,31%
Tecnología	1,23%
Comunicaciones	0,29%

Principales subsectores	% de activos
Petroleras-exploración y producción	6,35%
Instituciones bancarias diversificadas	5,47%
Mezzanine de obligaciones con garantía hipotecaria para toda la vida	4,74%
Subord. de obligaciones con garantía hipotecaria para toda la vida	4,27%
Automóviles/camiones ligeros	3,51%
Valores respaldados por hipotecas de viviendas unifamiliares 30 años	3,39%
Banco supranacional	2,77%
Metal-cobre	2,49%
Tuberías	2,19%
Sector médico-hospitales	1,85%
Aerolíneas	1,53%
Contenedores-papel/plástico	1,52%
Bancos comerciales no estadounidenses	1,50%
Banco/Agente de finanzas/inversiones	1,38%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental ajustado a la taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

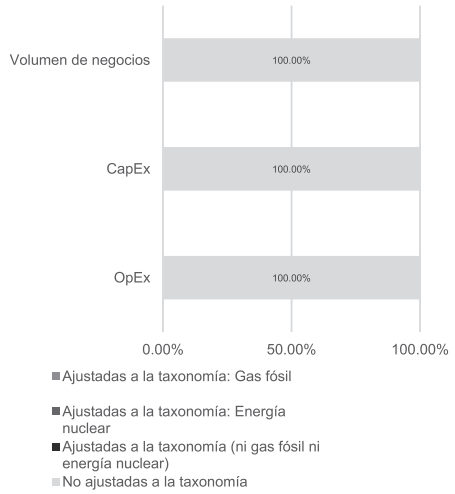
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

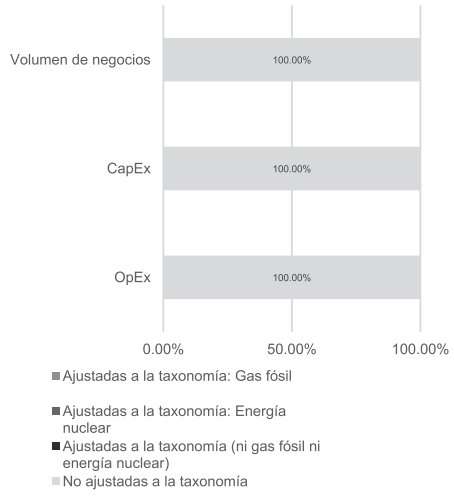
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transició facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica.

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

El producto financiero tenía una cuota de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustado a la taxonomía de la UE del 18,88%.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

El producto financiero tenía una cuota de inversiones con un objetivo social del 0,00%.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

El producto financiero tenía una 6,54%__ % de inversiones que no se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse inversiones sostenibles.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

1. El Fondo se compromete a excluir a los emisores situados en el decil de puntuación más bajo del universo de inversión. Como consecuencia, se realizaron las siguientes desinversiones: JBS Foods, Concrete Pumping Holdings, Inc.

2. El Fondo trata a aquellos emisores cuya puntuación se sitúa en el segundo percentil más bajo como candidatos a la participación. En consecuencia, se llevaron a cabo las siguientes interacciones: Civitas Resources Inc, Taseko Mines Ltd., México, Devon Energy Corporation, Colombia, Leviathan Bond Ltd, Texas Capital Bancshares, Mileage Plus Holdings LLC, Continental Airlines, United Airlines, República de Sudáfrica, Ford Motor Credit Co LLC, Vici Properties, Brasil, Dream Finders Homes Inc., Ero Copper Corp.

3. El Fondo invirtió más del 15 % de sus activos netos en inversiones sostenibles con objetivos ambientales o sociales, tal y como se señaló más arriba.

4. Continuamos realizando el seguimiento y la supervisión de los KPI de cada emisor. Se buscarán mejoras en los KPI durante un período de dos años. Este Fondo se constituyó en diciembre de 2022.

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica.

FTGF ClearBridge Value Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
549300OZGGIQZ97B7W66

FRANKLIN TEMPLETON

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 30,40% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☒ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

A la hora de seleccionar los valores durante el período del informe, el gestor de inversiones empleó un proceso propio de investigación y compromiso para determinar el perfil de una empresa en cuestiones ambientales, sociales y de gobernanza («ESG»). Este proceso exclusivo generó un sistema de calificación ESG que utilizaba un mapa de prioridades para identificar características ESG específicas relacionadas con la inversión.

Las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo fueron:

- Factores ambientales como las prácticas ambientales de la empresa, las emisiones de gases de efecto invernadero («GEI») y las iniciativas de eficiencia energética.
- Factores sociales como el enfoque de la empresa sobre las relaciones con la comunidad, la seguridad y salud ocupacional, la fiabilidad y el precio de los servicios.

Entre sus inversiones, el Fondo mantuvo el mínimo prometido de «inversión sostenible» del 5 %.

No se han utilizado instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Los indicadores de sostenibilidad utilizados para medir la consecución de cada una de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo fueron:

- El 30,4 % del Fondo mantenido en inversiones sostenibles, tal y como se define en la metodología de inversiones sostenibles propia del gestor de inversiones, que incluye el ajuste de productos o servicios a los Objetivos de Desarrollo Sostenible («ODS») de las Naciones Unidas y la consideración de «no causar un perjuicio significativo»;
- Todos los indicadores relativos a las principales incidencias adversas (PIA) que fuesen relevantes para la empresa objeto de la calificación, en concreto las PIA n.º 1 (Emisiones de GEI), n.º 2 (Huella de carbono), n.º 3 (Intensidad de GEI), n.º 10 (Incumplimiento del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU) y de las Directrices de la OCDE), n.º 13 (Diversidad de género en los consejos de administración) y n.º 14 (Exposición a armas controvertidas). Consulte los valores divulgados en la sección «¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?»;
- El porcentaje de la cartera con una puntuación de B según la calificación ESG propia del gestor de inversiones que era igual al 1 %
- Metodologías propias para evaluar el progreso de las reuniones de colaboración en materia ESG del gestor de

inversiones. ClearBridge celebró compromisos de ESG periódicos con las empresas de su cartera. Los puntos de vista del equipo de inversión sobre el progreso debatido en estas reuniones se reflejaron en las calificaciones de ESG patentadas, las decisiones de voto por poder y las decisiones de inversión.

- El Fondo se considera incluido en el objetivo de cero emisiones netas de ClearBridge y se midió con respecto a la proporción de empresas que son proveedores de soluciones climáticas o que han establecido, y se han comprometido a establecer, objetivos basados en la ciencia para la reducción de las emisiones de GEI: 45 %

KPI de sostenibilidad Nombre	Valor
Ajuste a cero neto	34,79%
Compromiso con objetivo de ajuste a cero neto	10,25%

¿...y en comparación con períodos anteriores?

Los indicadores generales en materia de sostenibilidad se ajustan a los del período anterior.

	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
KPI de sostenibilidad Nombre	**Valor**	**Valor**
Ajuste a cero neto	34,79%	20,65%
Compromiso con objetivo de ajuste a cero neto	10,25%	16,06%

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	**Unidad de medida**	**Valor**	**Cobertura**	**Valor**	**Cobertura**
Emisiones de GEI: Emisiones totales en USD	Toneladas de CO2eq	827 154,00	96,33%	747 211,99	96,45%
Huella de carbono en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares invertidos	869,81	96,33%	877,12	96,45%
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	1 708,04	96,33%	1 977,90	98,96%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	96,75%	0,00%	98,96%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	36,65%	92,03%	34,34%	94,40%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	92,03%	0,00%	94,40%

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

Las inversiones sostenibles realizadas por el Fondo fueron en valores de renta variable emitidos por empresas que contribuyeron a uno o ambos de los siguientes:

- A través de sus productos y servicios, a uno o varios de los factores ambientales o sociales de los Objetivos de Desarrollo Sostenible de la ONU (ODS) y a sus metas e indicadores subyacentes determinados mediante la evaluación de la contribución del gestor de inversiones; 7,2 % de la cartera
- Objetivos de reducción de emisiones e intensidad de GEI en las actividades económicas de una empresa determinada a través de un objetivo de descarbonización verificado por terceros y alineado con el Acuerdo de París o es un proveedor de soluciones climáticas. Supervisamos el progreso de los emisores con respecto a los objetivos a través de nuestro proceso de compromiso; 27 % de la cartera

Además de contribuir a uno de los objetivos ambientales o sociales indicados anteriormente, las empresas fueron evaluadas mediante el examen de la buena gobernanza propio del gestor de inversiones y superaron los criterios de «no causar un perjuicio significativo», tal y como se detalla a continuación.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

El gestor de inversiones utilizó una combinación de calificaciones de controversia sobre los riesgos graves de terceros, una selección basada en normas mundiales de terceros, incluido el cumplimiento del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU), la consideración de las PIA* y otros factores ambientales, sociales y de gobernanza importantes, que estaban integrados en la investigación fundamental del gestor de inversiones y en el proceso de calificación ESG propio, que incluía una evaluación de buena gobernanza, para examinar si las inversiones causaban un perjuicio significativo a los objetivos de inversión sostenible.

Además, el gestor de inversiones utilizó el proceso de compromiso para identificar los mejores valores.

*Los PAI que se tomaron en consideración dependían de la evaluación de materialidad ASG por subsector propia del gestor de inversiones que se aplicaba durante su proceso de calificación ASG o de la disponibilidad de datos.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Todas las PIA que eran importantes para la empresa calificada se tuvieron en cuenta como parte de la calificación ESG del gestor de inversiones que se aplicó en el proceso de selección de valores.

La forma en que se consideraron y se tuvieron en cuenta las PIA se detalla a continuación.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

El gestor de inversiones apoya los principios del PMNU. Así, el Fondo no invirtió en empresas que infringiesen alguno de los diez principios de cada una de las cuatro áreas (derechos humanos, trabajo, medioambiente y lucha contra la corrupción) del PMNU.

El gestor de inversiones utilizó un proveedor de datos externo para supervisar el cumplimiento de los principios del PMNU. Si existían discrepancias o desacuerdos entre la investigación del gestor de inversiones y la evaluación del proveedor sobre una controversia específica, el gestor de inversiones, junto con el equipo de cumplimiento y los miembros del equipo de ESG, trataron la cuestión con la empresa. Si el gestor de inversiones llegaba a la conclusión de que la empresa había tomado las medidas necesarias para abordar la controversia o había subsanado de manera eficaz el problema debía proporcionar una explicación detallada de por qué se podía seguir invirtiendo en la empresa.

Para garantizar que las inversiones sostenibles se ajustaban a las directrices de la OCDE, el gestor de inversiones recurrió a un proveedor externo para supervisar el cumplimiento y las posibles infracciones.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.

¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Todas las PIA que eran importantes para la empresa calificada se tuvieron en cuenta como parte de la calificación ASG del Gestor de Inversiones que se aplicó en el proceso de selección de valores, concretamente:

PAI núm. 1 (Emisiones de GEI), PAI núm. 2 (Huella de carbono), PAI núm. 3 (Intensidad de GEI)

El gestor de inversiones evaluó los riesgos específicos relacionados con el clima y las oportunidades de las empresas como parte del proceso de selección de existencias, que integró tanto estas como otras consideraciones medioambientales, sociales y de gobernanza.

Aunque el gestor de inversiones evaluó cada sector en función de una serie de criterios específicos que eran pertinentes para sus operaciones comerciales, la evaluación solía incluir una cuidadosa consideración de factores relacionados con el clima como: el entorno normativo/político, la ubicación geográfica de los activos y las operaciones, la capacidad de trasladar los costes a los clientes,

las alternativas y los avances tecnológicos, los cambios en las preferencias de los clientes, los precios de las materias primas, los gastos de capital futuros y los planes de I+D, la estrategia comercial a largo plazo, la calidad general del equipo de gestión, entre otros factores.

El gestor de inversiones utilizó la herramientas Carbon Portfolio Analytics de MSCI para evaluar la exposición a empresas con reservas de combustibles fósiles. El gestor de inversiones llevó a cabo un análisis de la intensidad del carbono en las inversiones de la empresa en su conjunto para comprender la intensidad del carbono de los activos totales de la empresa en relación con los mercados de valores mundiales. También llevó a cabo un análisis de la intensidad del carbono en el contexto de la cartera.

PAI núm. 10 (Incumplimiento de las Directrices del PMNU/OCDE)

Consulte «¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos?».

PAI núm. 13 (Diversidad de género en el consejo de administración)

El gestor de inversiones utilizó datos de terceros para el seguimiento de la diversidad de género en los consejos de administración. Además, tiene una disposición en su política de voto por delegación para votar en contra de los miembros y el presidente del comité de nombramientos si la empresa no cuenta con al menos una mujer en el consejo. El gestor de inversiones también tuvo en cuenta la diversidad, la igualdad y la inclusión como un componente de su análisis y calificación ESG, así como un tema de toda la empresa para el compromiso de la empresa.

PIA n.º 14 (Exposición a armas controvertidas)

El Fondo no invirtió en empresas que generaban ingresos a partir de: a) armas prohibidas según i) la Convención sobre la prohibición del empleo, almacenamiento, producción y transferencia de minas antipersonal y sobre su destrucción, y ii) la Convención sobre la prohibición de las municiones en racimo, y b) armas clasificadas como armas B o C de conformidad con la Convención sobre armas biológicas de las Naciones Unidas y la Convención sobre armas químicas de las Naciones Unidas, respectivamente.

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Emisiones de GEI: Emisiones totales en USD	Toneladas de CO2eq	827 154,00	96,33%
Huella de carbono en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares invertidos	869,81	96,33%
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	1 708,04	96,33%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	96,75%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	36,65%	92,03%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	92,03%

¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP, INC.	Sector financiero	2,83%	Estados Unidos
JOHNSON & JOHNSON	Sector sanitario	2,69%	Estados Unidos
ORACLE CORPORATION	Tecnología de la información	2,48%	Estados Unidos
FREEPORT-MCMORAN INC.	Materiales	2,34%	Estados Unidos
NOBLE CORPORATION PLC	Energía	2,32%	Estados Unidos
MICRON TECHNOLOGY, INC.	Tecnología de la información	2,24%	Estados Unidos
META PLATFORMS, INC.	Servicios de comunicación	2,12%	Estados Unidos
UBER TECHNOLOGIES, INC.	Sector industrial	2,10%	Estados Unidos
VISTRA CORP.	Servicios públicos	2,10%	Estados Unidos
EQT CORPORATION	Energía	2,02%	Estados Unidos
FISERV, INC.	Sector financiero	1,99%	Estados Unidos
THE GOLDMAN SACHS GROUP, INC.	Sector financiero	1,82%	Estados Unidos
UNITEDHEALTH GROUP INCORPORATED	Sector sanitario	1,81%	Estados Unidos
CAPITAL ONE FINANCIAL CORPORATION	Sector financiero	1,78%	Estados Unidos
CONSTELLATION ENERGY CORPORATION.	Servicios públicos	1,78%	Estados Unidos

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

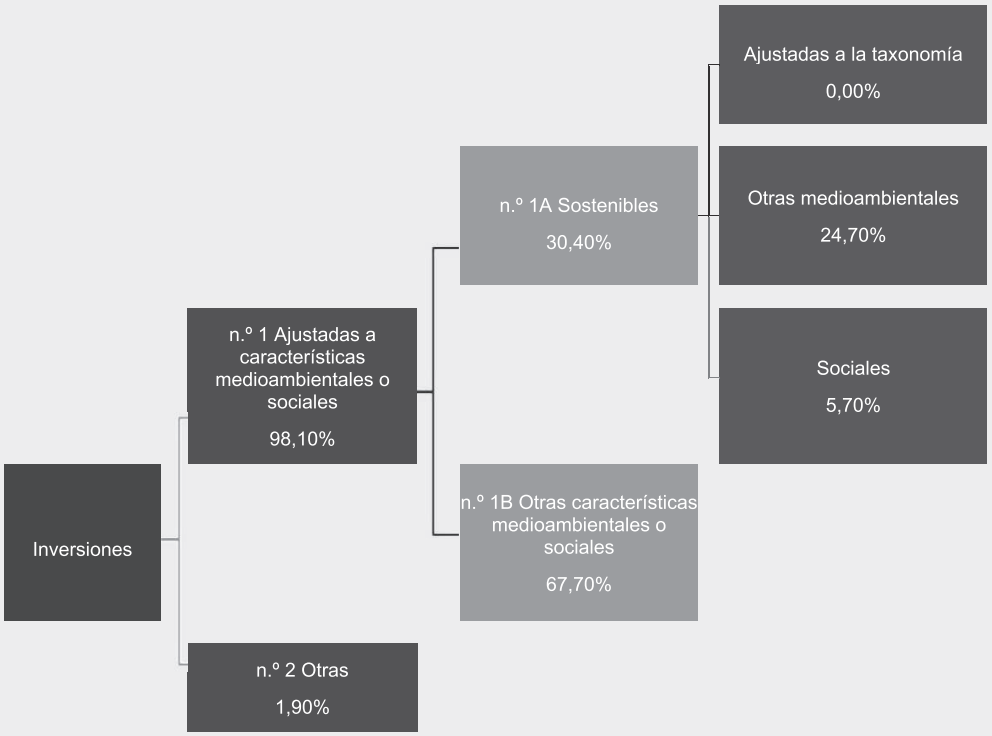
La proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 30,4 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 98,1 % de la cartera del Fondo se ajusta a las características ambientales o sociales promovidas por este. La parte restante (1,9 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos.

Del segmento de la cartera del Fondo que se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo destinó el 30,4 % de su cartera a inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Sector principal	% de activos
Sector financiero	21,31%
Energía	13,90%
Sector industrial	13,51%
Sector sanitario	13,19%
Tecnología de la información	8,16%
Servicios públicos	7,75%
Materiales	6,63%
Consumo discrecional	4,69%
Bienes básicos de consumo	4,12%
Servicios de comunicación	2,54%
Sector inmobiliario	2,07%

Principales subsectores	% de activos
Petróleo, gas y combustibles de consumo	8,94%
Servicios financieros	8,57%
Biotecnología	5,79%
Equipos y servicios energéticos	4,96%
Seguros	4,52%
Metales y minería	4,23%
Semiconductores y equipos semiconductores	4,12%
Bancos	4,11%
Transporte por tierra	4,10%
Software	4,04%
Servicios públicos eléctricos	3,86%
Industria farmacéutica	3,78%
Productores de energía y electricidad renovable independientes	3,64%
Hoteles, restaurantes y actividades de ocio	3,18%
Proveedores y servicios sanitarios	2,79%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental ajustado a la taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

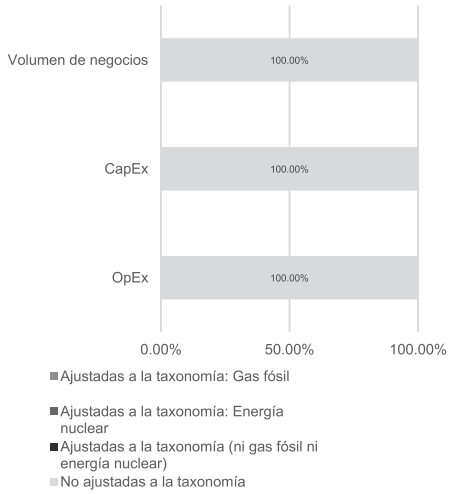
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

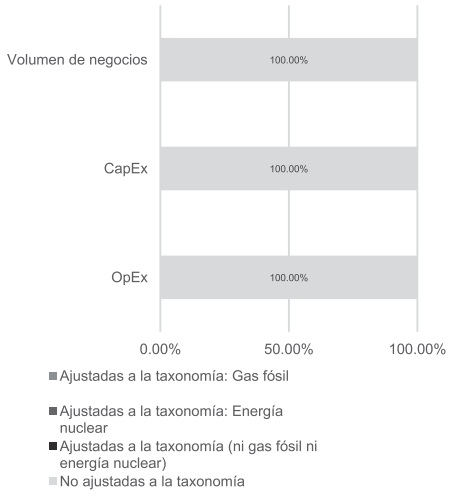
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transició facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica.

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

Como resultado de la estrategia de inversión, el Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la Taxonomía de la UE. Por lo tanto, a finales de febrero de 2024, el 24,7 % de la cartera del Fondo estaba formada por inversiones con un objetivo ambiental no ajustado a la Taxonomía de la UE.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

La proporción de inversiones socialmente sostenibles fue del 5,7 %.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

La proporción de inversiones en «N.º 2 Otros» era del 1,9 % e incluía el efectivo mantenido en depósito y los instrumentos derivados utilizados para la cobertura, así como los derivados para los que no había salvaguardias ambientales o sociales mínimas.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

1. El gestor de inversiones utilizó su sistema de calificación patentado y la investigación fundamental para evaluar cómo una empresa gestionaba los riesgos y las oportunidades ESG, incluido un examen de la buena gobernanza. El sistema de calificación constaba de cuatro niveles de calificación: AAA, AA, A y B, que se asignaban a las empresas en función de su estrategia de sostenibilidad y rendimiento en las cuestiones ESG clave. Se calificaron todas las empresas del Fondo. La distribución de la calificación del Fondo a 29 de febrero de 2024 era:

AAA: 12 %

AA: 60 %

A: 25 %

B: 1 %

2. El Gestor de Inversiones colaboró constantemente con las empresas de su cartera. El compromiso ESG en ClearBridge solía tener dos objetivos que se solapaban:

- Análisis: Comprender mejor las cuestiones ESG que podían influir en la tesis de inversión.
- Incidencia: Alentar cambios específicos en la empresa que podrían influir positivamente el mundo real.

Además, el gestor de inversiones se comprometió directamente con las empresas con calificación «B» participadas por el Fondo de forma regular, con el objetivo de mejorar las características ambientales o sociales materiales de dichas empresas.

Para obtener más información sobre el enfoque en el compromiso, consulte nuestra política de compromiso y administración aquí: https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshippolicy.pdf

3. El Fondo no invirtió en los umbrales de ingresos establecidos, tal y como se describe en el prospecto, para las siguientes industrias:

- Tabaco
- Armas controvertidas

4. El Fondo no invirtió en empresas que infringían uno o varios de los diez principios de las cuatro áreas cubiertas por el PMNU (derechos humanos, trabajo, medioambiente y lucha contra la corrupción).

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica.

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
549300SQ18HYQNQ20536

FRANKLIN TEMPLETON

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 65,31% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☒ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

A la hora de seleccionar los valores durante el período del informe, el gestor de inversiones empleó un proceso propio de investigación y compromiso para determinar el perfil de una empresa en cuestiones ambientales, sociales y de gobernanza («ESG»). Este proceso exclusivo generó un sistema de calificación ESG que utilizaba un mapa de prioridades para identificar características ESG específicas relacionadas con la inversión. Las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo eran cuestiones (ESG) clave consideradas importantes para la empresa específica y el sector en el que opera la empresa, que incluían, entre otras, la salud y la seguridad, la diversidad de género, el riesgo climático, el riesgo de gobernanza corporativa y la seguridad de los datos.

Además, el Fondo ha mantenido su compromiso mínimo de «inversión sostenible» del 5 %.

No se han utilizado instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Los indicadores de sostenibilidad utilizados para medir la consecución de cada una de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo fueron:

- El 65,3 % del Fondo mantenida en inversiones sostenibles, tal y como se define en la metodología de inversiones sostenibles propia del gestor de inversiones, que incluye el ajuste de productos o servicios a los Objetivos de Desarrollo Sostenible («ODS») de las Naciones Unidas (25 %) y la consideración de «no causar un perjuicio significativo».
- Indicadores específicos de las principales incidencias adversas (PAI), a saber: PIA n.º 1 (Emisiones de GEI), PIA n.º 2 (Huella de carbono), PIA n.º 3 (Intensidad de GEI), PIA n.º 10 (Violaciones del Pacto Mundial de la ONU y de las Directrices de la OCDE), PIA n.º 13 (Diversidad de género en los consejos de administración) y PIA n.º 14 (Exposición a armas controvertidas). Consulte los valores divulgados en la sección «¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?»;
- Metodologías propias para evaluar el progreso de las reuniones de colaboración en materia ESG del gestor de inversiones. ClearBridge celebró compromisos de ESG periódicos con las empresas de su cartera. Los puntos de vista del equipo de inversión sobre el progreso debatido en estas reuniones se reflejaron en las calificaciones de ESG patentadas, las decisiones de voto por poder y las decisiones de inversión.
- exposición de la cartera a las mejores empresas de su categoría, según la calificación ESG propia del gestor de inversiones. La distribución de la calificación del fondo a 29 de febrero de 2024 es:

- AAA: 38 %
- AA: 43 %
- A: 17 %
- B: 0 %

¿...y en comparación con períodos anteriores?

Los indicadores generales en materia de sostenibilidad se ajustan a los del período anterior.

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	**Unidad de medida**	**Valor**	**Cobertura**	**Valor**	**Cobertura**
Emisiones de GEI: Emisiones totales en USD	Toneladas de CO2eq	74 995,40	98,83%	67 906,15	95,72%
Huella de carbono en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares invertidos	377,30	98,83%	381,67	95,72%
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	1 066,81	98,83%	886,78	95,72%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,16%	98,83%	0,00%	95,72%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	36,13%	98,83%	35,65%	95,72%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	98,83%	0,00%	95,72%

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

Las inversiones sostenibles realizadas por el Fondo fueron en valores de renta variable emitidos por empresas que contribuyeron a al menos uno de los siguientes:

- A través de sus productos y servicios, a uno o varios de los factores ambientales o sociales de los ODS y a sus metas e indicadores subyacentes determinados mediante la evaluación de la contribución del gestor de inversiones; 25,08 % de la cartera
- Objetivos de reducción de emisiones e intensidad de GEI en las actividades económicas de una empresa determinada a través de un objetivo de descarbonización verificado por terceros y alineado con el Acuerdo de París o es un proveedor de soluciones climáticas. Supervisamos el progreso de los emisores con respecto a los objetivos a través de nuestro proceso de compromiso; 47 % de la cartera

Además de contribuir a uno de los objetivos ambientales o sociales indicados anteriormente, las empresas fueron evaluadas mediante el examen de la buena gobernanza propio del gestor de inversiones y superaron los criterios de «no causar un perjuicio significativo», tal y como se detalla a continuación.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

El gestor de inversiones utilizó una combinación de calificaciones de controversia sobre riesgos graves de terceros, una selección basada en normas mundiales de terceros, incluido el cumplimiento del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU), la consideración de la PIA* y otros factores ambientales, sociales y de gobernanza importantes, que estaban integrados en la investigación fundamental del gestor de inversiones y en el proceso de calificación ESG propio, que incluía una evaluación de gobernanza, para revisar si las inversiones causan un perjuicio significativo a cualquier objetivo de inversión sostenible.

Además, el gestor de inversiones utilizó el proceso de compromiso para identificar los mejores valores.

*Los PAI que se tomaron en consideración dependían de la evaluación de materialidad ASG por subsector propia del gestor de inversiones que se aplicaba durante su proceso de calificación ASG o de la disponibilidad de datos.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Todas las PIA que eran importantes para la empresa calificada se tuvieron en cuenta como parte de la calificación ESG del gestor de inversiones que se aplicó en el proceso de selección de valores.

La forma en que se consideraron y se tuvieron en cuenta las PIA se detalla a continuación.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

El gestor de inversiones apoya los principios del PMNU. Así, el Fondo no invirtió en empresas que infringiesen alguno de los diez principios de cada una de las cuatro áreas (derechos humanos, trabajo, medioambiente y lucha contra la corrupción) del PMNU.

El gestor de inversiones utilizó un proveedor de datos externo para supervisar el cumplimiento de los principios del PMNU. Si existían discrepancias o desacuerdos entre la investigación del gestor de inversiones y la evaluación del proveedor sobre una controversia específica, el gestor de inversiones, junto con el equipo de cumplimiento y los miembros del equipo de ESG, trataron la cuestión con la empresa. Si el gestor de inversiones llegaba a la conclusión de que la empresa había tomado las medidas necesarias para abordar la controversia o había subsanado de manera eficaz el problema debía proporcionar una explicación detallada de por qué se podía seguir invirtiendo en la empresa.

Para garantizar que las inversiones sostenibles se ajustaban a las directrices de la OCDE, el gestor de inversiones recurrió a un proveedor externo para supervisar el cumplimiento y las posibles infracciones.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.

¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Todas las PIA que eran importantes para la empresa calificada se tuvieron en cuenta como parte de la calificación ASG del Gestor de Inversiones que se aplicó en el proceso de selección de valores, concretamente:

PAI núm. 1 (Emisiones de GEI), PAI núm. 2 (Huella de carbono), PAI núm. 3 (Intensidad de GEI)

El gestor de inversiones evaluó los riesgos específicos relacionados con el clima y las oportunidades de las empresas como parte del proceso de selección de existencias, que integró tanto estas como otras consideraciones medioambientales, sociales y de gobernanza.

Aunque el gestor de inversiones evaluó cada sector en función de una serie de criterios específicos que eran pertinentes para sus operaciones comerciales, la evaluación solía incluir una cuidadosa consideración de factores relacionados con el clima como: el entorno normativo/político, la ubicación geográfica de los activos y las operaciones, la capacidad de trasladar los costes a los clientes, las alternativas y los avances tecnológicos, los cambios en las preferencias de los clientes, los precios de las materias primas, los gastos de capital futuros y los planes de I+D, la estrategia comercial a largo plazo, la calidad general del equipo de gestión, entre otros factores.

El gestor de inversiones utilizó la herramientas Carbon Portfolio Analytics de MSCI para evaluar la exposición a empresas con reservas de combustibles fósiles. El gestor de inversiones llevó a cabo un análisis de la intensidad del carbono en las inversiones de la empresa en su conjunto para comprender la intensidad del carbono de los activos totales de la empresa en relación con los mercados de valores mundiales. También puede llevar a cabo un análisis de la intensidad del carbono en el contexto de la cartera.

PAI núm. 10 (Incumplimiento de las Directrices del PMNU/OCDE)

Consulte «¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos?».

PAI núm. 13 (Diversidad de género en el consejo de administración)

El gestor de inversiones utiliza datos de terceros para el seguimiento de la diversidad de género en los consejos de administración. Además, tiene una disposición en su política de voto por delegación para votar en contra de los miembros y el presidente del comité de nombramientos si la empresa no cuenta con al menos una mujer en el consejo. El gestor de inversiones también tuvo en cuenta la diversidad, la igualdad y la inclusión como un componente de su análisis y calificación ESG, así como un tema de toda la empresa para el compromiso de la empresa.

PIA n.º 14 (Exposición a armas controvertidas)

El Fondo no invirtió en empresas que generen parte de su volumen de negocio a través de la producción o distribución de armas controvertidas (es decir, minas antipersona, armamento nuclear, armamento biológico y químico y armas de racimo).

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Emisiones de GEI: Emisiones totales en USD	Toneladas de CO2eq	74 995,40	98,83%
Huella de carbono en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares invertidos	377,30	98,83%
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	1 066,81	98,83%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,16%	98,83%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	36,13%	98,83%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	98,83%



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
MICROSOFT CORPORATION	Tecnología de la información	8,84%	Estados Unidos
APPLE INC.	Tecnología de la información	6,29%	Estados Unidos
ALPHABET INC.	Servicios de comunicación	3,58%	Estados Unidos
AMAZON.COM, INC.	Consumo discrecional	3,17%	Estados Unidos
VISA INC.	Sector financiero	2,99%	Estados Unidos
BERKSHIRE HATHAWAY INC.,	Sector financiero	2,72%	Estados Unidos
MERCK & CO., INC.	Sector sanitario	2,67%	Estados Unidos
UNITEDHEALTH GROUP INCORPORATED	Sector sanitario	2,65%	Estados Unidos
THE TJX COMPANIES, INC.	Consumo discrecional	2,43%	Estados Unidos
JPMORGAN CHASE & CO.	Sector financiero	2,43%	Estados Unidos
NVIDIA CORPORATION	Tecnología de la información	2,25%	Estados Unidos
HONEYWELL INTERNATIONAL INC.	Sector industrial	2,25%	Estados Unidos
JOHNSON & JOHNSON	Sector sanitario	2,10%	Estados Unidos
The Travelers Companies, Inc.	Sector financiero	2,02%	Estados Unidos
ELI LILLY AND COMPANY	Sector sanitario	1,88%	Estados Unidos

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

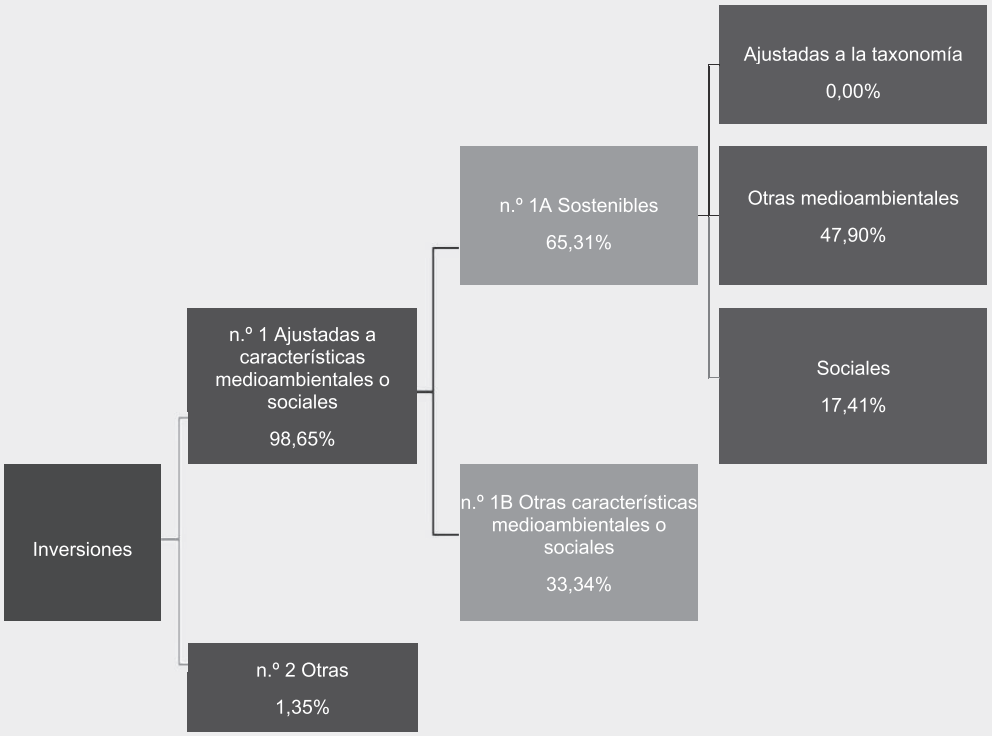
La proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 65,31 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 98,65 % de la cartera del Fondo se ajusta a las características ambientales o sociales promovidas por este. La parte restante (1,35 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos.

Del segmento de la cartera del Fondo que se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo destinó el 65,31 % de su cartera a inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Sector principal	% de activos
Tecnología de la información	23,01%
Sector financiero	16,89%
Sector sanitario	14,98%
Sector industrial	10,62%
Servicios de comunicación	8,62%
Bienes básicos de consumo	7,25%
Consumo discrecional	6,85%
Materiales	6,26%
Energía	1,99%
Servicios públicos	1,20%
Sector inmobiliario	1,17%

Principales subsectores	% de activos
Software	12,17%
Industria farmacéutica	7,25%
Servicios financieros	6,77%
Hardware, almacenamiento y periféricos de tecnología	6,29%
Medios de comunicación y servicios interactivos	5,01%
Bancos	4,29%
Productos químicos	4,15%
Seguros	4,02%
Semiconductores y equipos semiconductores	3,80%
Venta minorista especializada	3,68%
Venta al por menor	3,17%
Proveedores y servicios sanitarios	2,65%
Bebidas	2,59%
Equipos y suministros sanitarios	2,44%
Equipos eléctricos	2,33%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental ajustado a la taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

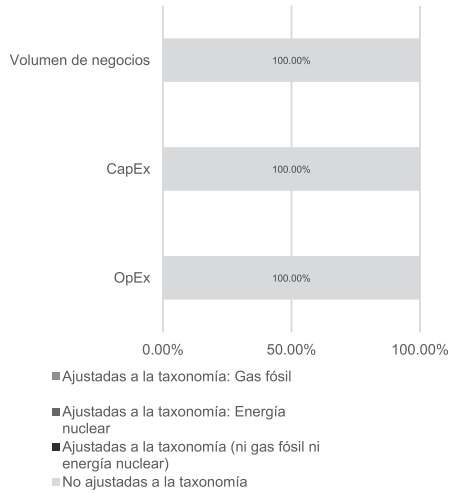
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

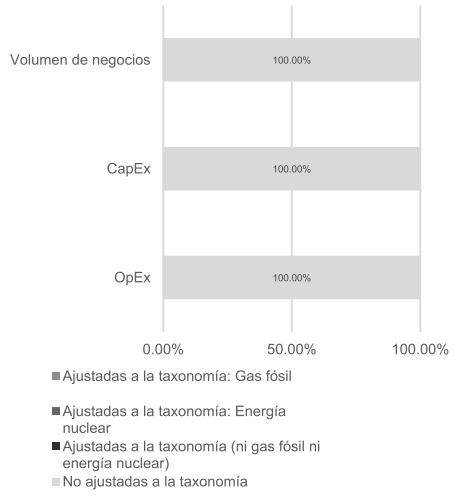
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transició facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica.

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

Como resultado de la estrategia de inversión, el Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la Taxonomía de la UE. Por lo tanto, a finales de febrero de 2024, el 47,9 % de la cartera del Fondo estaba formada por inversiones con un objetivo ambiental no ajustado a la Taxonomía de la UE.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

La proporción de inversiones socialmente sostenibles fue del 17,41 %.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

La proporción de inversiones en «N.º 2 Otros» era del 1,35 % e incluía el efectivo mantenido en depósito y los instrumentos derivados utilizados para la cobertura, así como los derivados para los que no había salvaguardias ambientales o sociales mínimas.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

1. El gestor de inversiones utilizó su sistema de calificación patentado y la investigación fundamental para evaluar cómo una empresa gestiona los riesgos y las oportunidades de ESG, incluida la buena gobernanza. El sistema de calificación constaba de cuatro niveles de calificación: AAA, AA, A y B, que se asignaban a las empresas en función de su estrategia de sostenibilidad y rendimiento en las cuestiones ESG clave. Se calificaron todas las empresas del Fondo. La distribución de la calificación del Fondo a 31 de diciembre de 2022 era:

AAA: 38 %

AA: 43 %

A: 17 %

B: 0 %

2. El Gestor de Inversiones colaboró constantemente con las empresas de su cartera. El compromiso ESG en ClearBridge solía tener dos objetivos que se solapaban:

- Análisis: Comprender mejor las cuestiones ESG que podían influir en la tesis de inversión.
- Incidencia: Alentar cambios específicos en la empresa que podrían influir positivamente el mundo real.

Para obtener más información sobre el enfoque en el compromiso, consulte nuestra política de compromiso y administración aquí: https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshippolicy.pdf

3. El Fondo no invirtió en los umbrales de ingresos establecidos, tal y como se describe en el prospecto, para las siguientes industrias:

- Tabaco
- Armas controvertidas
- Juegos de azar
- Entretenimiento para adultos

4. El Fondo no invirtió en empresas que infringían uno o varios de los diez principios de las cuatro áreas cubiertas por el PMNU (derechos humanos, trabajo, medioambiente y lucha contra la corrupción).

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica.

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
5493003YRBLHS9UVBW79

FRANKLIN TEMPLETON

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 79,00% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☒ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

A la hora de seleccionar los valores durante el período del informe, el gestor de inversiones empleó un proceso propio de investigación y compromiso para determinar el perfil de una empresa en cuestiones ambientales, sociales y de gobernanza («ESG»). Este proceso exclusivo generó un sistema de calificación ESG que utilizaba un mapa de prioridades para identificar características ESG específicas relacionadas con la inversión. Las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo eran cuestiones (ESG) clave consideradas importantes para la empresa específica y el sector en el que opera la empresa, que incluían, entre otras, la salud y la seguridad, la diversidad de género, el riesgo climático, el riesgo de gobernanza corporativa y la seguridad de los datos.

Además, el fondo ha mantenido su compromiso mínimo de «inversión sostenible» del 20 %.

No se han utilizado instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Los indicadores de sostenibilidad utilizados para medir la consecución de cada una de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo fueron:

- El 79 % del Fondo mantenido en inversiones sostenibles, tal y como se define en la metodología de inversiones sostenibles propia del gestor de inversiones, que incluye el ajuste de productos o servicios a los Objetivos de Desarrollo Sostenible («ODS») de las Naciones Unidas y la consideración de «no causar un perjuicio significativo»;
- Los indicadores específicos de Principales Impactos Adversos (PAI), en concreto PAI n.º 1 (Emisiones de GEI), PAI n.º 2 (Huella de carbono), PAI n.º 3 (Intensidad de GEI), PAI n.º 10 (Incumplimiento del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Directrices de la OCDE), PAI n.º 13 (Diversidad de género en el Consejo de Administración) y PAI n.º 14 (Exposición a armas controvertidas). Consulte los valores divulgados en la sección «¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?»;
- Metodologías propias para evaluar el progreso de las reuniones de compromiso ASG del gestor de inversiones. ClearBridge celebró compromisos ESG periódicos con las empresas de su cartera. Los puntos de vista del equipo de inversión sobre el progreso debatido en estas reuniones se reflejaron en las calificaciones de ESG patentadas, las decisiones de voto por poder y las decisiones de inversión.
- exposición de la cartera a las mejores empresas de su categoría, según la calificación ESG propia del gestor de inversiones. La distribución de la calificación del Fondo a 20 de febrero de 2024 era:

- AAA: 46 %
- AA: 39 %
- A: 13 %
- B: 0 %

El Fondo se consideró en el alcance del objetivo de cero emisiones netas de ClearBridge y se midió frente a la proporción de empresas que son proveedores de soluciones climáticas o que han establecido, y se han comprometido a establecer, objetivos basados en la ciencia para la reducción de GEI; 76 %

KPI de sostenibilidad Nombre	Valor
Ajuste a cero neto	59,73%
Compromiso con objetivo de ajuste a cero neto	16,36%

¿...y en comparación con períodos anteriores?

Los indicadores generales en materia de sostenibilidad se ajustan a los del período anterior.

	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
KPI de sostenibilidad Nombre	Valor	Valor
Ajuste a cero neto	59,73%	44,24%
Compromiso con objetivo de ajuste a cero neto	16,36%	23,62%

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura	Valor	Cobertura
Emisiones de GEI: Emisiones totales en USD	Toneladas de CO2eq	151 372,00	97,27%	106 503,87	95,26%
Huella de carbono en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares invertidos	94,84	97,27%	97,02	95,26%
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	379,30	97,27%	465,22	95,26%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	97,27%	0,00%	95,26%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	35,78%	96,64%	34,89%	95,26%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	96,64%	0,00%	95,26%

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

Las inversiones sostenibles realizadas por el Fondo fueron en valores de renta variable emitidos por empresas que contribuyeron a al menos uno de los siguientes:

- A través de sus productos y servicios, a uno o varios de los factores ambientales o sociales de los ODS y a sus metas e indicadores subyacentes determinados mediante la evaluación de la contribución del gestor de inversiones; 44 % de la cartera
- Objetivos de reducción de emisiones e intensidad de GEI en las actividades económicas de una empresa determinada a través de un objetivo de descarbonización verificado por terceros y alineado con el Acuerdo de París o es un proveedor de soluciones climáticas. Supervisamos el progreso de los emisores con respecto a los objetivos a través de nuestro proceso de compromiso; 52 % de la cartera

Además de contribuir a uno de los objetivos ambientales o sociales indicados anteriormente, las empresas fueron evaluadas mediante el examen de la buena gobernanza propio del gestor de inversiones y superaron los criterios de «no causar un perjuicio significativo», tal y como se detalla a continuación.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

El gestor de inversiones utilizó una combinación de calificaciones de controversia sobre riesgos graves de terceros, una selección basada en normas mundiales de terceros, incluido el cumplimiento del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU), la consideración de la PIA* y otros factores ambientales, sociales y de gobernanza importantes, que estaban integrados en la investigación fundamental del gestor de inversiones y en el proceso de calificación ESG propio, que incluía una evaluación de gobernanza, para revisar si las inversiones causan un perjuicio significativo a cualquier objetivo de inversión sostenible.

Además, el gestor de inversiones utilizó el proceso de compromiso para identificar los mejores valores.

*Los PAI que se tomaron en consideración dependían de la evaluación de materialidad ASG por subsector propia del gestor de inversiones que se aplicaba durante su proceso de calificación ASG o de la disponibilidad de datos.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Todas las PIA que eran importantes para la empresa calificada se tuvieron en cuenta como parte de la calificación ESG del gestor de inversiones que se aplicó en el proceso de selección de valores.

La forma en que se consideraron y se tuvieron en cuenta las PIA se detalla a continuación.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

El gestor de inversiones apoya los principios del PMNU. Así, el Fondo no invirtió en empresas que infringiesen alguno de los diez principios de cada una de las cuatro áreas (derechos humanos, trabajo, medioambiente y lucha contra la corrupción) del PMNU.

El gestor de inversiones utilizó un proveedor de datos externo para supervisar el cumplimiento de los principios del PMNU. Si existían discrepancias o desacuerdos entre la investigación del gestor de inversiones y la evaluación del proveedor sobre una controversia específica, el gestor de inversiones, junto con el equipo de cumplimiento y los miembros del equipo de ESG, trataron la cuestión con la empresa. Si el gestor de inversiones llegaba a la conclusión de que la empresa había tomado las medidas necesarias para abordar la controversia o había subsanado de manera eficaz el problema debía proporcionar una explicación detallada de por qué se podía seguir invirtiendo en la empresa.

Para garantizar que las inversiones sostenibles se ajustaban a las directrices de la OCDE, el gestor de inversiones recurrió a un proveedor externo para supervisar el cumplimiento y las posibles infracciones.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.

¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Todas las PIA que eran importantes para la empresa calificada se tuvieron en cuenta como parte de la calificación ASG del Gestor de Inversiones que se aplicó en el proceso de selección de valores, concretamente:

PAI núm. 1 (Emisiones de GEI), PAI núm. 2 (Huella de carbono), PAI núm. 3 (Intensidad de GEI)

El gestor de inversiones evaluó los riesgos específicos relacionados con el clima y las oportunidades de las empresas como parte del proceso de selección de existencias, que integró tanto estas como otras consideraciones medioambientales, sociales y de gobernanza.

Aunque el gestor de inversiones evaluó cada sector en función de una serie de criterios específicos que eran pertinentes para sus operaciones comerciales, la evaluación solía incluir una cuidadosa consideración de factores relacionados con el clima como: el

entorno normativo/político, la ubicación geográfica de los activos y las operaciones, la capacidad de trasladar los costes a los clientes, las alternativas y los avances tecnológicos, los cambios en las preferencias de los clientes, los precios de las materias primas, los gastos de capital futuros y los planes de I+D, la estrategia comercial a largo plazo, la calidad general del equipo de gestión, entre otros factores.

El gestor de inversiones utilizó la herramientas Carbon Portfolio Analytics de MSCI para evaluar la exposición a empresas con reservas de combustibles fósiles. El gestor de inversiones llevó a cabo un análisis de la intensidad del carbono en las inversiones de la empresa en su conjunto para comprender la intensidad del carbono de los activos totales de la empresa en relación con los mercados de valores mundiales. También llevó a cabo un análisis de la intensidad del carbono en el contexto de la cartera.

PAI núm. 10 (Incumplimiento de las Directrices del PMNU/OCDE)

Consulte «¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos?».

PAI núm. 13 (Diversidad de género en el consejo de administración)

El gestor de inversiones utilizó datos de terceros para el seguimiento de la diversidad de género en los consejos de administración. Además, tiene una disposición en su política de voto por delegación para votar en contra de los miembros y el presidente del comité de nombramientos si la empresa no cuenta con al menos una mujer en el consejo. El gestor de inversiones también tuvo en cuenta la diversidad, la igualdad y la inclusión como un componente de su análisis y calificación ESG, así como un tema de toda la empresa para el compromiso de la empresa.

PIA n.º 14 (Exposición a armas controvertidas)

El Fondo no invirtió en empresas que generen parte de su volumen de negocio a través de la producción o distribución de armas controvertidas (es decir, minas antipersona, armamento nuclear, armamento biológico y químico y armas de racimo).

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Emisiones de GEI: Emisiones totales en USD	Toneladas de CO2eq	151 372,00	97,27%
Huella de carbono en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares invertidos	94,84	97,27%
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	379,30	97,27%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	97,27%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	35,78%	96,64%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	96,64%

¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
MICROSOFT CORPORATION	Tecnología de la información	8,30%	Estados Unidos
AMAZON.COM, INC.	Consumo discrecional	7,34%	Estados Unidos
NVIDIA CORPORATION	Tecnología de la información	7,13%	Estados Unidos
VISA INC.	Sector financiero	4,87%	Estados Unidos
META PLATFORMS, INC.	Servicios de comunicación	4,71%	Estados Unidos
APPLE INC.	Tecnología de la información	4,62%	Estados Unidos
NETFLIX, INC.	Servicios de comunicación	3,43%	Estados Unidos
UNITEDHEALTH GROUP INCORPORATED	Sector sanitario	3,18%	Estados Unidos
PALO ALTO NETWORKS, INC.	Tecnología de la información	2,51%	Estados Unidos
SALESFORCE, INC.	Tecnología de la información	2,46%	Estados Unidos
W.W. GRAINGER, INC.	Sector industrial	2,39%	Estados Unidos
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC.	Sector sanitario	2,26%	Estados Unidos
ADOBE INC.	Tecnología de la información	2,20%	Estados Unidos
EATON CORPORATION PUBLIC LIMITED COMPANY	Sector industrial	2,20%	Estados Unidos
S&P GLOBAL INC.	Sector financiero	2,13%	Estados Unidos

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

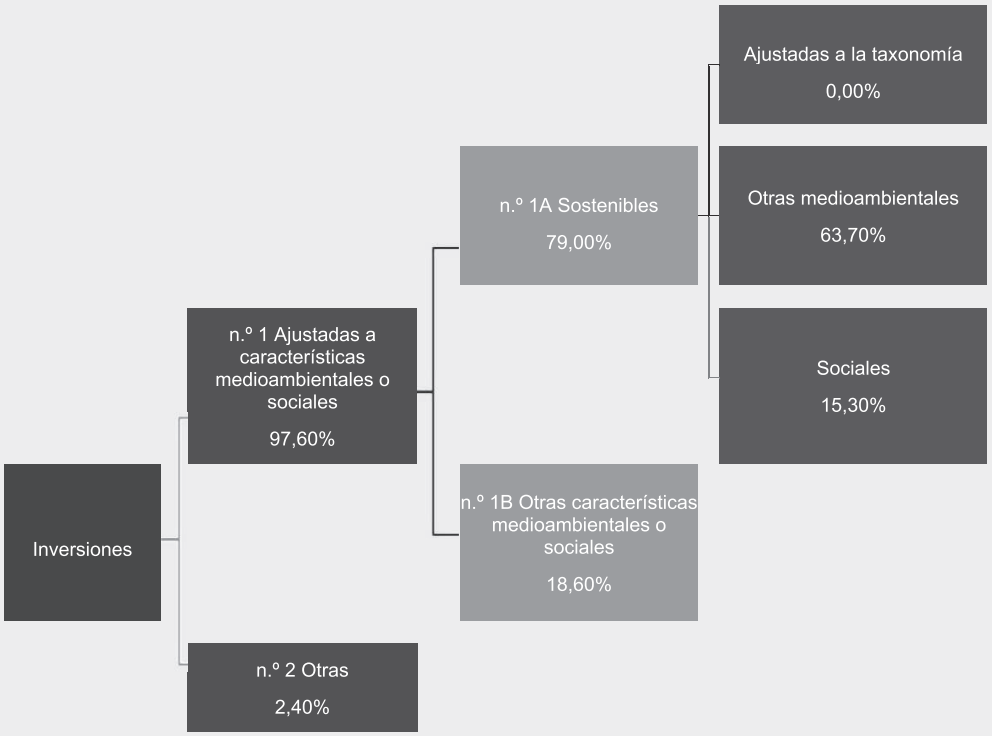
La proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 79,00 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 97,6 % de la cartera del Fondo se ajusta a las características ambientales o sociales promovidas por este. La parte restante (2,4 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos.

Del segmento de la cartera del Fondo que se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo destinó el 79,00 % de su cartera a inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Sector principal	% de activos
Tecnología de la información	34,87%
Sector sanitario	14,72%
Consumo discrecional	10,54%
Sector industrial	10,41%
Sector financiero	10,04%
Servicios de comunicación	8,34%
Bienes básicos de consumo	4,00%
Materiales	1,75%
Sector inmobiliario	1,57%
Servicios públicos	1,04%

Principales subsectores	% de activos
Software	20,34%
Semiconductores y equipos semiconductores	9,90%
Venta al por menor	7,34%
Equipos y suministros sanitarios	6,31%
Servicios financieros	6,03%
Medios de comunicación y servicios interactivos	4,71%
Hardware, almacenamiento y periféricos de tecnología	4,62%
Entretenimiento	3,64%
Proveedores y servicios sanitarios	3,18%
Industria farmacéutica	2,96%
Transporte por tierra	2,96%
Mercados de capitales	2,42%
Empresas comerciales y distribuidoras	2,39%
Herramientas y servicios de las ciencias biológicas	2,26%
Equipos eléctricos	2,20%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental ajustado a la taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

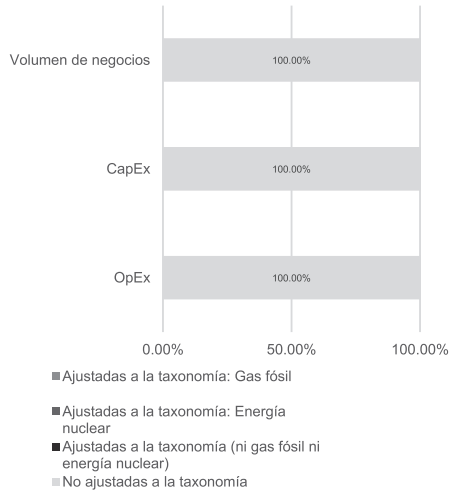
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

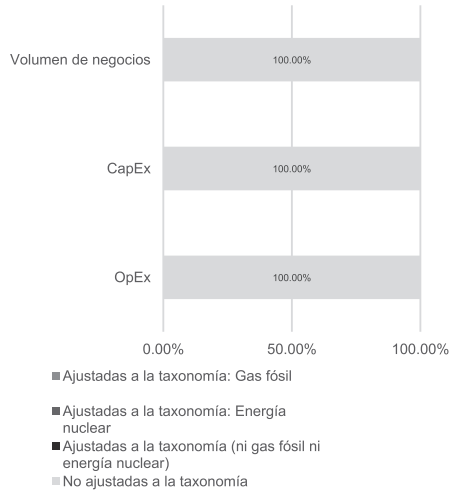
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transició facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica.

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

Como resultado de la estrategia de inversión, el Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la Taxonomía de la UE. Por lo tanto, a finales de febrero de 2024, el 63,7 % de la cartera del Fondo estaba formada por inversiones con un objetivo ambiental no ajustado a la Taxonomía de la UE.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

La proporción de inversiones socialmente sostenibles fue del 15,3 %.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

La proporción de inversiones en «N.º 2 Otros» era del 2,4 % e incluía el efectivo mantenido en depósito y los instrumentos derivados utilizados para la cobertura, así como los derivados para los que no había salvaguardias ambientales o sociales mínimas.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

1. El gestor de inversiones utilizó su sistema de calificación patentado y la investigación fundamental para evaluar cómo una empresa gestionaba los riesgos y las oportunidades ESG, incluido un examen de la buena gobernanza. El sistema de calificación constaba de cuatro niveles de calificación: AAA, AA, A y B, que se asignaban a las empresas en función de su estrategia de sostenibilidad y rendimiento en las cuestiones ESG clave. Se calificaron todas las empresas del Fondo. La distribución de la calificación del Fondo a 29 de febrero de 2024 era:

AAA: 46 %

AA: 39 %

A: 13 %

B: 0 %

2. El Gestor de Inversiones colaboró constantemente con las empresas de su cartera. El compromiso ESG en ClearBridge solía tener dos objetivos que se solapaban:

- Análisis: Comprender mejor las cuestiones ESG que podían influir en la tesis de inversión.
- Incidencia: Alentar cambios específicos en la empresa que podrían influir positivamente el mundo real.

Para obtener más información sobre el enfoque en el compromiso, consulte nuestra política de compromiso y administración aquí: https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshippolicy.pdf

3. El Fondo no invirtió en los umbrales de ingresos establecidos, tal y como se describe en el prospecto, para las siguientes industrias:

- Tabaco
- Armas controvertidas
- Entretenimiento para adultos

4. El Fondo no invirtió en empresas que infringían uno o varios de los diez principios de las cuatro áreas cubiertas por el PMNU (derechos humanos, trabajo, medioambiente y lucha contra la corrupción).

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica.

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
5493007ZJMPVPNDQMY52

FRANKLIN TEMPLETON

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 50,90% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☒ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

A la hora de seleccionar los valores durante el período del informe, el gestor de inversiones empleó un proceso propio de investigación y compromiso para determinar el perfil de una empresa en cuestiones ambientales, sociales y de gobernanza («ESG»). Este proceso exclusivo generó un sistema de calificación ESG que utilizaba un mapa de prioridades para identificar características ESG específicas relacionadas con la inversión. Las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo eran cuestiones (ESG) clave consideradas importantes para la empresa específica y el sector en el que opera la empresa, que incluían, entre otras, la salud y la seguridad, la diversidad de género, el riesgo climático, el riesgo de gobernanza corporativa y la seguridad de los datos.

Además, el Fondo ha mantenido su compromiso mínimo de «inversión sostenible» del 5 %.

No se han utilizado instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Los indicadores de sostenibilidad utilizados para medir la consecución de cada una de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo fueron:

- El 50,9 % del Fondo mantenido en inversiones sostenibles, tal y como se define en la metodología de inversiones sostenibles propia del gestor de inversiones, que incluye el ajuste de productos o servicios a los Objetivos de Desarrollo Sostenible («ODS») de las Naciones Unidas y la consideración de «no causar un perjuicio significativo»;
- Indicadores específicos de las principales incidencias adversas (PAI), a saber: PIA n.º 1 (Emisiones de GEI), PIA n.º 2 (Huella de carbono), PIA n.º 3 (Intensidad de GEI), PIA n.º 10 (Violaciones del Pacto Mundial de la ONU y de las Directrices de la OCDE), PIA n.º 13 (Diversidad de género en los consejos de administración) y PIA n.º 14 (Exposición a armas controvertidas). Consulte los valores divulgados en la sección «¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?»;
- Metodologías propias para evaluar el progreso de las reuniones de compromiso ASG del gestor de inversiones. ClearBridge celebró compromisos ESG periódicos con las empresas de su cartera. Los puntos de vista del equipo de inversión sobre el progreso debatido en estas reuniones se reflejaron en las calificaciones de ESG patentadas, las decisiones de voto por poder y las decisiones de inversión.
- exposición de la cartera a las mejores empresas de su categoría, según la calificación ESG propia del gestor de inversiones. La distribución de la calificación del Fondo a 29 de febrero de 2024 era:
- AAA: 27 %

- AA: 52 %
- A: 20 %
- B: 0 %

¿...y en comparación con períodos anteriores?

Los indicadores generales en materia de sostenibilidad se ajustan a los del período anterior.

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	**Unidad de medida**	**Valor**	**Cobertura**	**Valor**	**Cobertura**
Emisiones de GEI: Emisiones totales en USD	Toneladas de CO2eq	25 360,40	98,48%	137 578,85	98,79%
Huella de carbono en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares invertidos	121,15	98,48%	667,17	98,79%
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	330,68	98,48%	9 124,64	98,79%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	98,48%	0,00%	98,79%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	33,59%	97,85%	31,64%	98,79%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	97,85%	0,00%	98,79%

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

Las inversiones sostenibles realizadas por el Fondo fueron en valores de renta variable emitidos por empresas que contribuyeron a al menos uno de los siguientes:

- A través de sus productos y servicios, a uno o varios de los factores ambientales o sociales de los ODS y a sus metas e indicadores subyacentes determinados mediante la evaluación de la contribución del gestor de inversiones; 27,7 % de la cartera
- Objetivos de reducción de emisiones e intensidad de GEI en las actividades económicas de una empresa determinada a través de un objetivo de descarbonización verificado por terceros y alineado con el Acuerdo de París o es un proveedor de soluciones climáticas. Supervisamos el progreso de los emisores con respecto a los objetivos a través de nuestro proceso de compromiso; 41 % de la cartera

Además de contribuir a uno de los objetivos ambientales o sociales indicados anteriormente, las empresas fueron evaluadas mediante el examen de la buena gobernanza propio del gestor de inversiones y superaron los criterios de «no causar un perjuicio significativo», tal y como se detalla a continuación.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

El gestor de inversiones utilizó una combinación de calificaciones de controversia sobre riesgos graves de terceros, una selección basada en normas mundiales de terceros, incluido el cumplimiento del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU), la consideración de la PIA* y otros factores ambientales, sociales y de gobernanza importantes, que estaban integrados en la investigación fundamental del gestor de inversiones y en el proceso de calificación ESG propio, que incluía una evaluación de gobernanza, para revisar si las inversiones causan un perjuicio significativo a cualquier objetivo de inversión sostenible.

Además, el gestor de inversiones utilizó el proceso de compromiso para identificar los mejores valores.

*Los PAI que se tomaron en consideración dependían de la evaluación de materialidad ASG por subsector propia del gestor de inversiones que se aplicaba durante su proceso de calificación ASG o de la disponibilidad de datos.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Todas las PIA que eran importantes para la empresa calificada se tuvieron en cuenta como parte de la calificación ESG del gestor de inversiones que se aplicó en el proceso de selección de valores.

La forma en que se consideraron y se tuvieron en cuenta las PIA se detalla a continuación.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

El gestor de inversiones apoya los principios del PMNU. Así, el Fondo no invirtió en empresas que infringiesen alguno de los diez principios de cada una de las cuatro áreas (derechos humanos, trabajo, medioambiente y lucha contra la corrupción) del PMNU.

El gestor de inversiones utilizó un proveedor de datos externo para supervisar el cumplimiento de los principios del PMNU. Si existían discrepancias o desacuerdos entre la investigación del gestor de inversiones y la evaluación del proveedor sobre una controversia específica, el gestor de inversiones, junto con el equipo de cumplimiento y los miembros del equipo de ESG, trataron la cuestión con la empresa. Si el gestor de inversiones llegaba a la conclusión de que la empresa había tomado las medidas necesarias para abordar la controversia o había subsanado de manera eficaz el problema debía proporcionar una explicación detallada de por qué se podía seguir invirtiendo en la empresa.

Para garantizar que las inversiones sostenibles se ajustaban a las directrices de la OCDE, el gestor de inversiones recurrió a un proveedor externo para supervisar el cumplimiento y las posibles infracciones.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.

¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Todas las PIA que eran importantes para la empresa calificada se tuvieron en cuenta como parte de la calificación ASG del Gestor de Inversiones que se aplicó en el proceso de selección de valores, concretamente:

PAI núm. 1 (Emisiones de GEI), PAI núm. 2 (Huella de carbono), PAI núm. 3 (Intensidad de GEI)

El gestor de inversiones evaluó los riesgos específicos relacionados con el clima y las oportunidades de las empresas como parte del proceso de selección de existencias, que integró tanto estas como otras consideraciones medioambientales, sociales y de gobernanza.

Aunque el gestor de inversiones evaluó cada sector en función de una serie de criterios específicos que eran pertinentes para sus operaciones comerciales, la evaluación solía incluir una cuidadosa consideración de factores relacionados con el clima como: el entorno normativo/político, la ubicación geográfica de los activos y las operaciones, la capacidad de trasladar los costes a los clientes, las alternativas y los avances tecnológicos, los cambios en las preferencias de los clientes, los precios de las materias primas, los gastos de capital futuros y los planes de I+D, la estrategia comercial a largo plazo, la calidad general del equipo de gestión, entre otros factores.

El gestor de inversiones utilizó la herramientas Carbon Portfolio Analytics de MSCI para evaluar la exposición a empresas con reservas de combustibles fósiles. El gestor de inversiones llevó a cabo un análisis de la intensidad del carbono en las inversiones de la empresa en su conjunto para comprender la intensidad del carbono de los activos totales de la empresa en relación con los mercados de valores mundiales. También llevó a cabo un análisis de la intensidad del carbono en el contexto de la cartera.

PAI núm. 10 (Incumplimiento de las Directrices del PMNU/OCDE)

Consulte «¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos?».

PAI núm. 13 (Diversidad de género en el consejo de administración)

El gestor de inversiones utiliza datos de terceros para el seguimiento de la diversidad de género en los consejos de administración. Además, tiene una disposición en su política de voto por delegación para votar en contra de los miembros y el presidente del comité de nombramientos si la empresa no cuenta con al menos una mujer en el consejo. El gestor de inversiones también tuvo en cuenta la diversidad, la igualdad y la inclusión como un componente de su análisis y calificación ESG, así como un tema de toda la empresa para el compromiso de la empresa.

PIA n.º 14 (Exposición a armas controvertidas)

El Fondo no invirtió en empresas que generen parte de su volumen de negocio a través de la producción o distribución de armas controvertidas (es decir, minas antipersona, armamento nuclear, armamento biológico y químico y armas de racimo).

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Emisiones de GEI: Emisiones totales en USD	Toneladas de CO2eq	25 360,40	98,48%
Huella de carbono en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares invertidos	121,15	98,48%
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	330,68	98,48%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	98,48%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	33,59%	97,85%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	97,85%



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
BROADCOM INC.	Tecnología de la información	8,71%	Estados Unidos
VERTEX PHARMACEUTICALS INCORPORATED	Sector sanitario	7,68%	Estados Unidos
UNITEDHEALTH GROUP INCORPORATED	Sector sanitario	7,25%	Estados Unidos
AUTODESK, INC.	Tecnología de la información	5,73%	Estados Unidos
CROWDSTRIKE HOLDINGS, INC.	Tecnología de la información	5,38%	Estados Unidos
TE Connectivity Ltd.	Tecnología de la información	5,07%	Estados Unidos
HUBSPOT, INC.	Tecnología de la información	4,74%	Estados Unidos
COMCAST CORPORATION	Servicios de comunicación	4,56%	Estados Unidos
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	Sector industrial	3,19%	Estados Unidos
MADISON SQUARE GARDEN SPORTS CORP.	Servicios de comunicación	3,14%	Estados Unidos
BIOGEN INC.	Sector sanitario	3,00%	Estados Unidos
FORMULA ONE GROUP	Servicios de comunicación	2,17%	Estados Unidos
AIRBNB, INC.	Consumo discrecional	2,14%	Estados Unidos
SNOWFLAKE INC.	Tecnología de la información	2,14%	Estados Unidos
ABBVIE INC.	Sector sanitario	2,13%	Estados Unidos

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

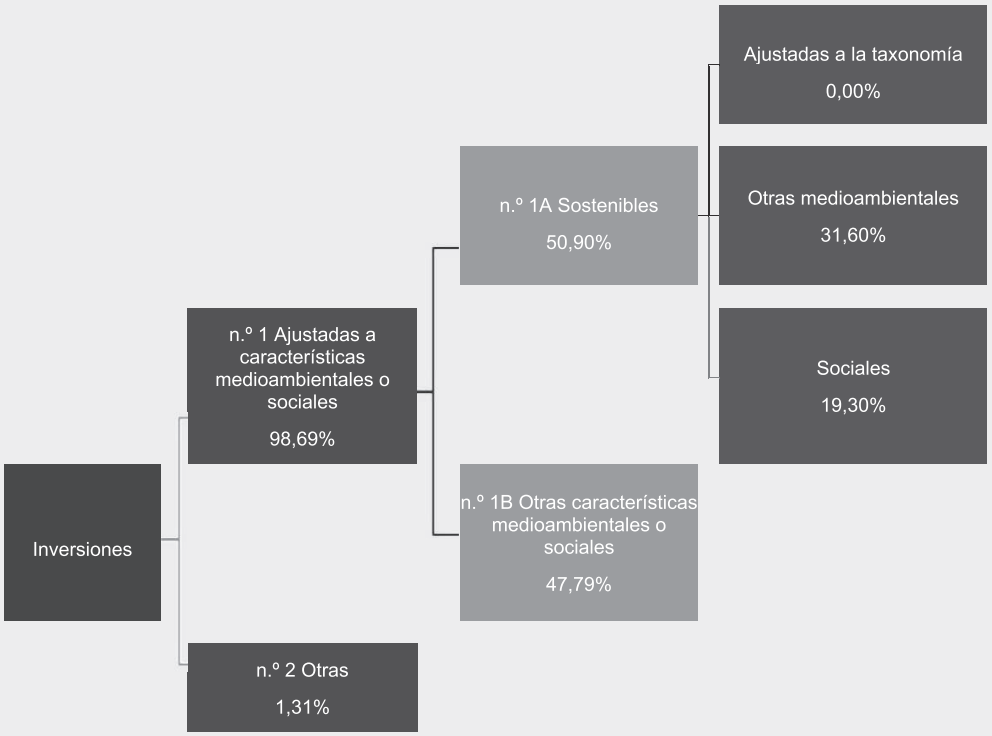
La proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 50,9 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 98,69 % de la cartera del Fondo se ajusta a las características ambientales o sociales promovidas por este. La parte restante (1,31 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos.

Del segmento de la cartera del Fondo que se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo destinó el 50,9 % de su cartera a inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Sector principal	% de activos
Tecnología de la información	41,62%
Sector sanitario	27,49%
Servicios de comunicación	14,64%
Consumo discrecional	6,06%
Sector industrial	4,34%
Materiales	1,87%
Bienes básicos de consumo	1,85%
Sector financiero	0,62%

Principales subsectores	% de activos
Software	19,30%
Biotecnología	15,82%
Semiconductores y equipos semiconductores	10,69%
Proveedores y servicios sanitarios	7,30%
Entretenimiento	6,92%
Equipos, instrumentos y componentes electrónicos	5,07%
Medios de comunicación	4,99%
Servicios informáticos	4,42%
Productos para la construcción	3,19%
Hoteles, restaurantes y actividades de ocio	2,90%
Medios de comunicación y servicios interactivos	2,74%
Hardware, almacenamiento y periféricos de tecnología	2,13%
Herramientas y servicios de las ciencias biológicas	1,99%
Metales y minería	1,87%
Bebidas	1,79%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental ajustado a la taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

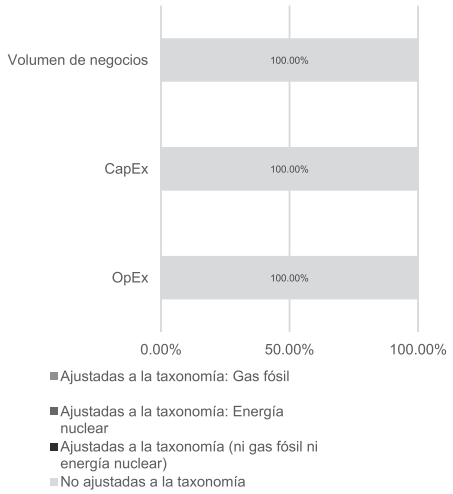
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

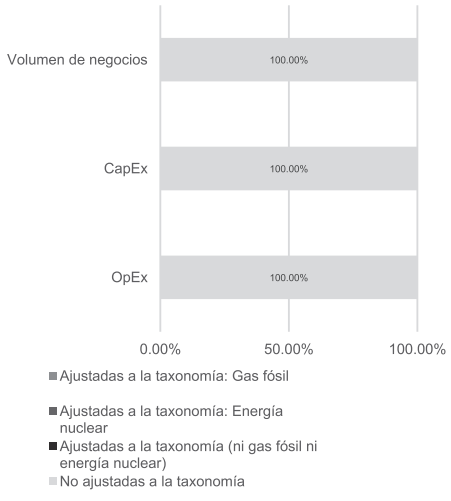
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transició facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica.

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

Como resultado de la estrategia de inversión, el Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la Taxonomía de la UE. Por lo tanto, a finales de febrero de 2024, el 31,6 % de la cartera del Fondo estaba formada por inversiones con un objetivo ambiental no ajustado a la Taxonomía de la UE.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

La proporción de inversiones socialmente sostenibles fue del 19,3 %.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

La proporción de inversiones en «N.º 2 Otros» era del 1,31 % e incluía el efectivo mantenido en depósito y los instrumentos derivados utilizados para la cobertura, así como los derivados para los que no había salvaguardias ambientales o sociales mínimas.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

1. El gestor de inversiones utilizó su sistema de calificación patentado y la investigación fundamental para evaluar cómo una empresa gestionaba los riesgos y las oportunidades ESG, incluido un examen de la buena gobernanza. El sistema de calificación constaba de cuatro niveles de calificación: AAA, AA, A y B, que se asignaban a las empresas en función de su estrategia de sostenibilidad y rendimiento en las cuestiones ESG clave. Se calificaron todas las empresas del Fondo. La distribución de la calificación del Fondo a 29 de febrero de 2024 era:

- AAA: 27 %
- AA: 52 %
- A: 20 %
- B: 0 %

2. El Gestor de Inversiones colaboró constantemente con las empresas de su cartera. El compromiso ESG en ClearBridge solía tener dos objetivos que se solapaban:

- Análisis: Comprender mejor las cuestiones ESG que podían influir en la tesis de inversión.
- Incidencia: Alentar cambios específicos en la empresa que podrían influir positivamente el mundo real.

Para obtener más información sobre el enfoque en el compromiso, consulte nuestra política de compromiso y administración aquí: https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshippolicy.pdf

3. El Fondo no invirtió en los umbrales de ingresos establecidos, tal y como se describe en el prospecto, para las siguientes industrias:

- Tabaco
- Armas controvertidas
- Juegos de azar
- Entretenimiento para adultos

4. El Fondo no invirtió en empresas que infringían uno o varios de los diez principios de las cuatro áreas cubiertas por el PMNU (derechos humanos, trabajo, medioambiente y lucha contra la corrupción).

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica.

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
549300RLIXEW79ZFOB12

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 85,40% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☒ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

Durante el período del informe, como parte de su política de inversión, el Gestor de inversiones invirtió en empresas de todas las capitalizaciones de mercado que promovían características ambientales, sociales y de gobernanza («ESG») sólidas o en proceso de mejora. El Fondo utilizó un proceso propio de investigación y compromiso para determinar si una empresa era líder en sostenibilidad. Este proceso exclusivo incluía la generación de un sistema de calificación ESG que utilizaba un mapa de prioridades para identificar características ESG específicas relacionadas con la inversión. Estas características incluían, entre otras:

- Eficiencia energética.
- Energía limpia.
- Tecnologías facilitadoras de la mitigación del carbono.
- Eficiencia del agua.
- Procesos de reducción de residuos materiales.
- Diversidad de la mano de obra.
- Salud y bienestar.
- Salarios justos.
- Seguimiento de la cadena de suministro.
- Participación de la comunidad.

Además, el Fondo ha mantenido su compromiso mínimo de «inversión sostenible» del 50 %.

No se han utilizado instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Los indicadores de sostenibilidad utilizados para medir la consecución de cada una de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo fueron:

- El 85,4 % del Fondo mantenido en inversiones sostenibles, tal y como se define en la metodología de inversiones sostenibles propia del gestor de inversiones, que incluye el ajuste de productos o servicios a los Objetivos de Desarrollo Sostenible («ODS») de las Naciones Unidas y la consideración de «no causar un perjuicio significativo»;
- los indicadores específicos de principales incidencias adversas (PAI), en concreto PAI n.º 1 (Emisiones de GEI), PAI n.º 2 (Huella de carbono), PAI n.º 3 (Intensidad de GEI), PAI n.º 4 (Incumplimiento del Pacto Mundial de las

Naciones Unidas y de las Directrices de la OCDE), PAI n.º 7 (actividades que afectan negativamente a zonas sensibles a la biodiversidad), PAI n.º 10 (Incumplimientos del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Directrices de la OCDE), PAI n.º 13 (Diversidad de género en el Consejo de Administración) y PAI n.º 14 (Exposición a armas controvertidas). Consulte los valores divulgados en la sección «¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?»;

- Metodologías propias para evaluar el progreso de las reuniones de colaboración en materia ESG del gestor de inversiones. ClearBridge celebró compromisos de ESG periódicos con las empresas de su cartera. Los puntos de vista del equipo de inversión sobre el progreso debatido en estas reuniones se reflejaron en las calificaciones de ESG patentadas, las decisiones de voto por poder y las decisiones de inversión.
- Exposición de la cartera a los mejores emisores de su categoría, según la calificación ESG propia. La distribución de la calificación del Fondo a 29 de febrero de 2024 era:
    - AAA: 64 %
    - AA: 35 %
    - A: 1 %
    - B: 0 %
- El Fondo se considera en el alcance del objetivo de cero emisiones netas de ClearBridge y se mide frente a la proporción de empresas que son proveedores de soluciones climáticas o que han establecido, y se han comprometido a establecer, objetivos basados en la ciencia para la reducción de las emisiones de GEI; 78 %

KPI de sostenibilidad Nombre	Valor
Ajuste a cero neto	57,41%
Compromiso con objetivo de ajuste a cero neto	20,46%

¿...y en comparación con períodos anteriores?

Los indicadores generales en materia de sostenibilidad se ajustan a los del período anterior.

	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
KPI de sostenibilidad Nombre	**Valor**	**Valor**
Ajuste a cero neto	57,41%	50,51%
Compromiso con objetivo de ajuste a cero neto	20,46%	12,07%

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	**Unidad de medida**	**Valor**	**Cobertura**	**Valor**	**Cobertura**
Emisiones de GEI: Emisiones totales en USD	Toneladas de CO2eq	818 685,00	98,78%	1 514 149,99	98,66%
Huella de carbono en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares invertidos	544,28	98,78%	973,99	98,66%
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	1 268,29	99,07%	1 881,15	98,66%
Exposición frente a empresas activas en el sector de los combustibles fósiles	Porcentaje invertido del Fondo	4,54%	98,39%	3,78%	98,66%
Actividades que afectan negativamente a las áreas sensibles a la biodiversidad	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	98,39%	0,00%	98,66%

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura	Valor	Cobertura
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	99,07%	0,00%	98,66%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	36,50%	98,39%	34,46%	98,66%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	98,39%	0,00%	98,66%

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

Las inversiones sostenibles realizadas por el Fondo fueron en valores de renta variable emitidos por empresas que contribuyeron a uno de los siguientes:

- A través de sus productos y servicios, a uno o varios de los factores ambientales o sociales de los ODS y a sus metas e indicadores subyacentes determinados mediante la evaluación de la contribución del gestor de inversiones; 59 % de la cartera
- Objetivos de reducción de emisiones e intensidad de GEI en las actividades económicas de una empresa determinada a través de un objetivo de descarbonización verificado por terceros y alineado con el Acuerdo de París o es un proveedor de soluciones climáticas. Supervisamos el progreso de los emisores con respecto a los objetivos a través de nuestro proceso de compromiso; 44 % de la cartera

Además de contribuir a uno de los objetivos ambientales o sociales indicados anteriormente, las empresas deben pasar por una evaluación propia de buena gobernanza y superar los criterios de «no causar un perjuicio significativo», tal y como se detalla a continuación.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

El gestor de inversiones utilizó una combinación de calificaciones de controversia sobre riesgos graves de terceros, una selección basada en normas mundiales de terceros, incluido el cumplimiento del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU), la consideración de la PIA* y otros factores ambientales, sociales y de gobernanza importantes, que estaban integrados en la investigación fundamental del gestor de inversiones y en el proceso de calificación ESG propio, que incluía una evaluación de gobernanza, para revisar si las inversiones causan un perjuicio significativo a cualquier objetivo de inversión sostenible.

Además, el gestor de inversiones utilizó el proceso de compromiso para identificar los mejores valores.

*Los PAI que se tomaron en consideración dependían de la evaluación de materialidad ASG por subsector propia del gestor de inversiones que se aplicaba durante su proceso de calificación ASG o de la disponibilidad de datos.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Todas las PIA que eran importantes para la empresa calificada se tuvieron en cuenta como parte de la calificación ESG del gestor de inversiones que se aplicó en el proceso de selección de valores.

La forma en que se consideraron y se tuvieron en cuenta las PIA se detalla a continuación.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

El gestor de inversiones apoya los principios del PMNU. Así, el Fondo no invirtió en empresas que infringiesen alguno de los diez principios de cada una de las cuatro áreas (derechos humanos, trabajo, medioambiente y lucha contra la corrupción) del PMNU.

El gestor de inversiones utilizó un proveedor de datos externo para supervisar el cumplimiento de los principios del PMNU. Si existían discrepancias o desacuerdos entre la investigación del gestor de inversiones y la evaluación del proveedor sobre una controversia específica, el gestor de inversiones, junto con el equipo de cumplimiento y los miembros del equipo de ESG, trataron la cuestión con la empresa. Si el gestor de inversiones llegaba a la conclusión de que la empresa había tomado las medidas necesarias para abordar la controversia o había subsanado de manera eficaz el problema debía proporcionar una explicación detallada de por qué se podía seguir invirtiendo en la empresa.

Para garantizar que las inversiones sostenibles se ajustaban a las directrices de la OCDE, el gestor de inversiones recurrió a un proveedor externo para supervisar el cumplimiento y las posibles infracciones.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.

¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Todas las PIA que eran importantes para la empresa calificada se tuvieron en cuenta como parte de la calificación ASG del Gestor de Inversiones que se aplicó en el proceso de selección de valores, concretamente:

PAI núm. 1 (Emisiones de GEI), PAI núm. 2 (Huella de carbono), PAI núm. 3 (Intensidad de GEI)

El gestor de inversiones evaluó los riesgos específicos relacionados con el clima y las oportunidades de las empresas como parte del proceso de selección de existencias, que integró tanto estas como otras consideraciones medioambientales, sociales y de gobernanza.

Aunque el gestor de inversiones evaluó cada sector en función de una serie de criterios específicos que eran pertinentes para sus operaciones comerciales, la evaluación solía incluir una cuidadosa consideración de factores relacionados con el clima como: el entorno normativo/político, la ubicación geográfica de los activos y las operaciones, la capacidad de trasladar los costes a los clientes, las alternativas y los avances tecnológicos, los cambios en las preferencias de los clientes, los precios de las materias primas, los gastos de capital futuros y los planes de I+D, la estrategia comercial a largo plazo, la calidad general del equipo de gestión, entre otros factores.

El gestor de inversiones utilizó la herramientas Carbon Portfolio Analytics de MSCI para evaluar la exposición a empresas con reservas de combustibles fósiles. El gestor de inversiones llevó a cabo un análisis de la intensidad del carbono en las inversiones de la empresa en su conjunto para comprender la intensidad del carbono de los activos totales de la empresa en relación con los mercados de valores mundiales. También llevó a cabo un análisis de la intensidad del carbono en el contexto de la cartera.

PAI núm. 4 (Exposición a empresas del sector de los combustibles fósiles)

El Fondo no invertía en una empresa si su actividad principal era la extracción de combustibles fósiles.

PAI núm. 7 (Actividades que afectan negativamente a las zonas sensibles a la biodiversidad)

Aunque, actualmente, el Fondo no tiene umbrales formales sobre exclusiones relacionadas con cuestiones de biodiversidad, se tuvo en cuenta entre la evaluación más amplia del impacto ambiental y climático para las inversiones y las inversiones potenciales del Fondo. El Fondo espera que todas las empresas en las que se invierte tengan un perfil de biodiversidad positivo y cualquier transgresión podría dar lugar a la exclusión de la inversión.

PAI núm. 10 (Incumplimiento de las Directrices del PMNU/OCDE)

Consulte «¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos?».

PAI núm. 13 (Diversidad de género en el consejo de administración)

El gestor de inversiones utiliza datos de terceros para el seguimiento de la diversidad de género en los consejos de administración. Además, tiene una disposición en su política de voto por delegación para votar en contra de los miembros y el presidente del comité de nombramientos si la empresa no cuenta con al menos una mujer en el consejo. El gestor de inversiones tuvo en cuenta la diversidad, la igualdad y la inclusión como un componente de su análisis y calificación ESG, así como un tema de toda la empresa para el compromiso de la empresa.

PIA n.º 14 (Exposición a armas controvertidas)

El Fondo invirtió en empresas que generen parte de su volumen de negocio a través de la producción o distribución de armas controvertidas (es decir, minas antipersona, armamento nuclear, armamento biológico y químico, armas de racimo y fósforo blanco).

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Emisiones de GEI: Emisiones totales en USD	Toneladas de CO2eq	818 685,00	98,78%
Huella de carbono en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares invertidos	544,28	98,78%

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	1 268,29	99,07%
Exposición frente a empresas activas en el sector de los combustibles fósiles	Porcentaje invertido del Fondo	4,54%	98,39%
Actividades que afectan negativamente a las áreas sensibles a la biodiversidad	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	98,39%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	99,07%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	36,50%	98,39%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	98,39%



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
MICROSOFT CORPORATION	Tecnología de la información	8,36%	Estados Unidos
APPLE INC.	Tecnología de la información	5,89%	Estados Unidos
JPMORGAN CHASE & CO.	Sector financiero	3,02%	Estados Unidos
ALPHABET INC.	Servicios de comunicación	2,97%	Estados Unidos
EATON CORPORATION PUBLIC LIMITED COMPANY	Sector industrial	2,93%	Estados Unidos
UNITEDHEALTH GROUP INCORPORATED	Sector sanitario	2,74%	Estados Unidos
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	Bienes básicos de consumo	2,71%	Estados Unidos
THE HOME DEPOT, INC.	Consumo discrecional	2,25%	Estados Unidos
VISA INC.	Sector financiero	2,13%	Estados Unidos
SALESFORCE, INC.	Tecnología de la información	1,98%	Estados Unidos
BOOKING HOLDINGS INC.	Consumo discrecional	1,96%	Estados Unidos
TRANE TECHNOLOGIES PLC	Sector industrial	1,91%	Estados Unidos
DANAHER CORPORATION	Sector sanitario	1,88%	Estados Unidos
NOVO NORDISK A/S	Sector sanitario	1,87%	Dinamarca
CISCO SYSTEMS, INC.	Tecnología de la información	1,83%	Estados Unidos

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

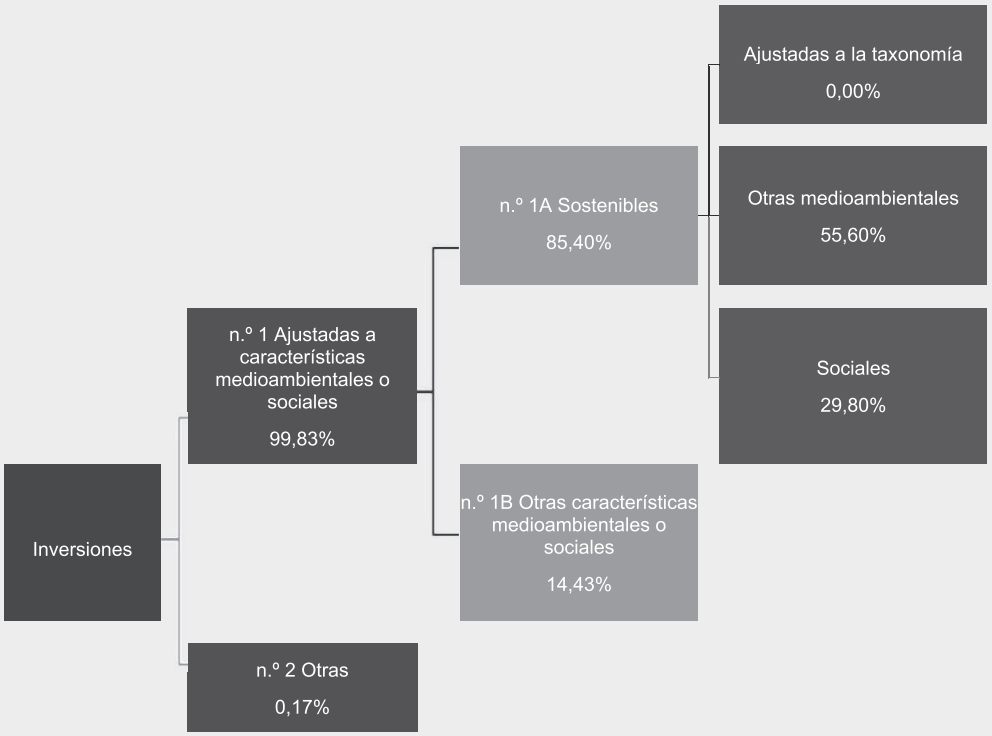
La proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 85,4 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 99,83 % de la cartera del Fondo se ajusta a las características ambientales o sociales promovidas por este. La parte restante (0,17 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos.

Del segmento de la cartera del Fondo que se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo destinó el 85,4 % de su cartera a inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Sector principal	% de activos
Tecnología de la información	27,72%
Sector sanitario	16,92%
Sector financiero	12,71%
Sector industrial	11,39%
Consumo discrecional	8,72%
Bienes básicos de consumo	7,55%
Servicios de comunicación	4,50%
Sector inmobiliario	3,32%
Materiales	3,15%
Servicios públicos	3,10%

Principales subsectores	% de activos
Software	11,95%
Hardware, almacenamiento y periféricos de tecnología	6,08%
Equipos eléctricos	5,92%
Proveedores y servicios sanitarios	5,16%
Semiconductores y equipos semiconductores	4,93%
Mercados de capitales	4,16%
Venta minorista especializada	3,76%
Industria farmacéutica	3,59%
Productos para la construcción	3,44%
Productos del hogar	3,41%
Seguros	3,40%
Herramientas y servicios de las ciencias biológicas	3,13%
Bancos	3,02%
Medios de comunicación y servicios interactivos	2,97%
Biotecnología	2,95%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental ajustado a la taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

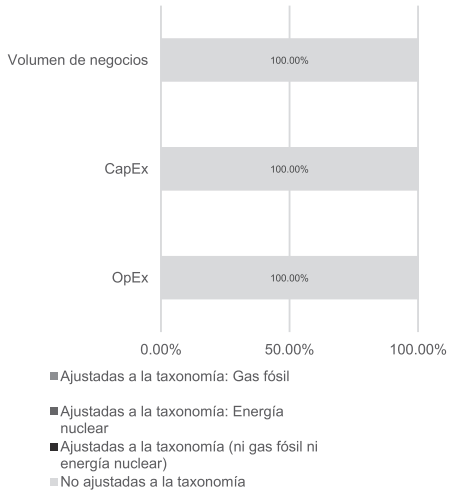
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

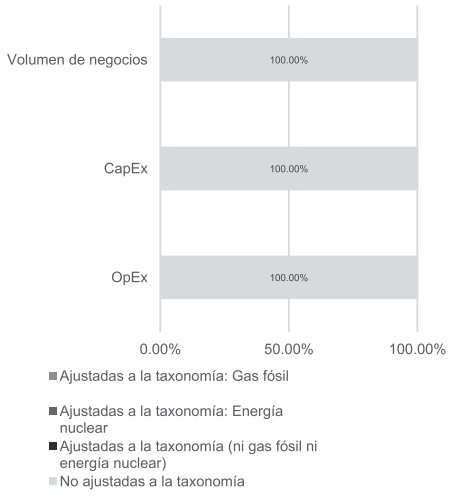
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transició facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica.

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

Como resultado de la estrategia de inversión, el Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la Taxonomía de la UE. Por lo tanto, a finales de febrero de 2023, el 55,6 % de la cartera del Fondo estaba formada por inversiones con un objetivo ambiental no ajustado a la Taxonomía de la UE.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

La proporción de inversiones socialmente sostenibles fue del 29,8 %.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

La proporción de inversiones en «N.º 2 Otros» era del 0,17 % e incluía el efectivo mantenido en depósito y los instrumentos derivados utilizados para la cobertura, así como los derivados para los que no había salvaguardias ambientales ni sociales mínimas.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

1. El gestor de inversiones utilizó su sistema de calificación patentado y la investigación fundamental para identificar líderes en sostenibilidad, incluido un examen de la buena gobernanza. El sistema de calificación constaba de cuatro niveles de calificación: AAA, AA, A y B, que se asignaban a las empresas en función de su estrategia de sostenibilidad y rendimiento en las cuestiones ESG clave. Se han calificado todas las empresas del Fondo. El gestor de inversiones considera que AAA y AA son los «mejores de su categoría». La distribución de la calificación del Fondo a 29 de febrero de 2024 era:

- AAA: 64 %
- AA: 35 %
- A: 1 %
- B: 0 %

2. El Gestor de Inversiones colaboró constantemente con las empresas de su cartera. El compromiso ESG en ClearBridge solía tener dos objetivos que se solapaban:

- Análisis: Comprender mejor las cuestiones ESG que podían influir en la tesis de inversión.
- Incidencia: Alentar cambios específicos en la empresa que podrían influir positivamente el mundo real.

Para obtener más información sobre el enfoque en el compromiso, consulte nuestra política de compromiso y administración aquí: https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshippolicy.pdf

3. El Fondo no invirtió en los umbrales de ingresos establecidos, tal y como se describe en el prospecto, para las siguientes industrias:

- Combustibles fósiles
- Tabaco
- Armas controvertidas
- Armas convencionales
- La energía nuclear
- Juegos de azar
- Entretenimiento para adultos

4. El Fondo no invirtió en empresas que infringían uno o varios de los diez principios de las cuatro áreas cubiertas por el PMNU (derechos humanos, trabajo, medioambiente y lucha contra la corrupción).

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica.

FTGF ClearBridge Global Growth Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
549300S2ND6DHQ60NF78

FRANKLIN TEMPLETON

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 63,60% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☒ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

A la hora de seleccionar los valores durante el período del informe, el gestor de inversiones empleó un proceso propio de investigación y compromiso para determinar el perfil de una empresa en cuestiones ambientales, sociales y de gobernanza («ESG»). Este proceso exclusivo generó un sistema de calificación ESG que utilizaba un mapa de prioridades para identificar características ESG específicas relacionadas con la inversión. Las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo eran cuestiones (ESG) clave consideradas importantes para la empresa específica y el sector en el que opera la empresa, que incluían, entre otras, la salud y la seguridad, la diversidad de género, el riesgo climático, el riesgo de gobernanza corporativa y la seguridad de los datos.

Además, el Fondo ha mantenido su compromiso mínimo de «inversión sostenible» del 5 %.

No se han utilizado instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Los indicadores de sostenibilidad utilizados para medir la consecución de cada una de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo fueron:

- El 63,6 % del Fondo mantenido en inversiones sostenibles, tal y como se define en la metodología de inversiones sostenibles propia del gestor de inversiones, que incluye el ajuste de productos o servicios a los Objetivos de Desarrollo Sostenible («ODS») de las Naciones Unidas y la consideración de «no causar un perjuicio significativo»;
- Indicadores específicos de las principales incidencias adversas (PAI), a saber: PIA n.º 1 (Emisiones de GEI), PIA n.º 2 (Huella de carbono), PIA n.º 3 (Intensidad de GEI), PIA n.º 10 (Violaciones del Pacto Mundial de la ONU y de las Directrices de la OCDE), PIA n.º 13 (Diversidad de género en los consejos de administración) y PIA n.º 14 (Exposición a armas controvertidas). Consulte los valores divulgados en la sección «¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?»;
- Metodologías propias para evaluar el progreso de las reuniones de colaboración en materia ESG del gestor de inversiones. ClearBridge celebró compromisos de ESG periódicos con las empresas de su cartera. Los puntos de vista del equipo de inversión sobre el progreso debatido en estas reuniones se reflejaron en las calificaciones de ESG patentadas, las decisiones de voto por poder y las decisiones de inversión.
- exposición de la cartera a las mejores empresas de su categoría, según la calificación ESG propia del gestor de inversiones. La distribución de la calificación del fondo a 29 de febrero de 2024 es:

○ AAA: 34 %

○ AA: 52 %

○ A: 12 %

○ B: 0 %

¿...y en comparación con períodos anteriores?

Los indicadores generales en materia de sostenibilidad se ajustan a los del período anterior.

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	**Unidad de medida**	**Valor**	**Cobertura**	**Valor**	**Cobertura**
Emisiones de GEI: Emisiones totales en USD	Toneladas de CO2eq	1 144,23	97,96%	1 295,82	96,85%
Huella de carbono en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares invertidos	76,68	97,96%	104,70	96,85%
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	314,95	97,96%	486,01	98,22%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	98,03%	0,00%	98,22%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	35,99%	97,20%	36,36%	95,59%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	97,20%	0,00%	95,59%

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

Las inversiones sostenibles del Fondo se han destinado a valores de renta variable emitidos por empresas que contribuyen a uno de los siguientes aspectos:

A través de sus productos y servicios, a uno o varios de los factores ambientales o sociales de los ODS y a sus metas e indicadores subyacentes determinados mediante la evaluación de la contribución del gestor de inversiones; 17,7 %.

Objetivos de intensidad de GEI y de reducción de emisiones en todas las actividades económicas de una empresa, determinados a través de un objetivo de descarbonización verificado por terceros y alineado con el Acuerdo de París. Supervisamos el progreso de los emisores con respecto a los objetivos a través de nuestro proceso de compromiso; 45,7 %

Además de contribuir a uno de los objetivos ambientales o sociales indicados anteriormente, las empresas deben pasar por una evaluación propia de buena gobernanza y superar los criterios de «no causar un perjuicio significativo», tal y como se detalla a continuación.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

El gestor de inversiones utilizó una combinación de calificaciones de controversia sobre riesgos graves de terceros, una selección basada en normas mundiales de terceros, incluido el cumplimiento del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU), la consideración de la PIA* y otros factores ambientales, sociales y de gobernanza importantes, que estaban integrados en la investigación fundamental del gestor de inversiones y en el proceso de calificación ESG propio, que incluía una evaluación de gobernanza, para revisar si las inversiones causan un perjuicio significativo a cualquier objetivo de inversión sostenible.

Además, el gestor de inversiones utilizó el proceso de compromiso para identificar los mejores valores.

*Los PAI que se tomaron en consideración dependían de la evaluación de materialidad ASG por subsector propia del gestor de inversiones que se aplicaba durante su proceso de calificación ASG o de la disponibilidad de datos.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Todas las PIA que eran importantes para la empresa calificada se tuvieron en cuenta como parte de la calificación ESG del gestor de inversiones que se aplicó en el proceso de selección de valores.

La forma en que se consideraron y se tuvieron en cuenta las PIA se detalla a continuación.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

El gestor de inversiones apoya los principios del PMNU. Así, el Fondo no invirtió en empresas que infringiesen alguno de los diez principios de cada una de las cuatro áreas (derechos humanos, trabajo, medioambiente y lucha contra la corrupción) del PMNU.

El gestor de inversiones utilizó un proveedor de datos externo para supervisar el cumplimiento de los principios del PMNU. Si existían discrepancias o desacuerdos entre la investigación del gestor de inversiones y la evaluación del proveedor sobre una controversia específica, el gestor de inversiones, junto con el equipo de cumplimiento y los miembros del equipo de ESG, trataron la cuestión con la empresa. Si el gestor de inversiones llegaba a la conclusión de que la empresa había tomado las medidas necesarias para abordar la controversia o había subsanado de manera eficaz el problema debía proporcionar una explicación detallada de por qué se podía seguir invirtiendo en la empresa.

Para garantizar que las inversiones sostenibles se ajustaban a las directrices de la OCDE, el gestor de inversiones recurrió a un proveedor externo para supervisar el cumplimiento y las posibles infracciones.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.

¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Todas las PIA que eran importantes para la empresa calificada se tuvieron en cuenta como parte de la calificación ASG del Gestor de Inversiones que se aplicó en el proceso de selección de valores, concretamente:

PAI núm. 1 (Emisiones de GEI), PAI núm. 2 (Huella de carbono), PAI núm. 3 (Intensidad de GEI)

El gestor de inversiones evaluó los riesgos específicos relacionados con el clima y las oportunidades de las empresas como parte del proceso de selección de existencias, que integró tanto estas como otras consideraciones medioambientales, sociales y de gobernanza.

Aunque el gestor de inversiones evaluó cada sector en función de una serie de criterios específicos que eran pertinentes para sus operaciones comerciales, la evaluación solía incluir una cuidadosa consideración de factores relacionados con el clima como: el entorno normativo/político, la ubicación geográfica de los activos y las operaciones, la capacidad de trasladar los costes a los clientes, las alternativas y los avances tecnológicos, los cambios en las preferencias de los clientes, los precios de las materias primas, los gastos de capital futuros y los planes de I+D, la estrategia comercial a largo plazo, la calidad general del equipo de gestión, entre otros factores.

El gestor de inversiones utilizó la herramientas Carbon Portfolio Analytics de MSCI para evaluar la exposición a empresas con reservas de combustibles fósiles. El gestor de inversiones llevó a cabo un análisis de la intensidad del carbono en las inversiones de la empresa en su conjunto para comprender la intensidad del carbono de los activos totales de la empresa en relación con los mercados de valores mundiales. También puede llevar a cabo un análisis de la intensidad del carbono en el contexto de la cartera.

PAI núm. 10 (Incumplimiento de las Directrices del PMNU/OCDE)

Consulte «¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos?».

PAI núm. 13 (Diversidad de género en el consejo de administración)

El gestor de inversiones utiliza datos de terceros para el seguimiento de la diversidad de género en los consejos de administración. Además, tiene una disposición en su política de voto por delegación para votar en contra de los miembros y el presidente del comité de nombramientos si la empresa no cuenta con al menos una mujer en el consejo. El gestor de inversiones también tuvo en cuenta la diversidad, la igualdad y la inclusión como un componente de su análisis y calificación ESG, así como un tema de toda la empresa para el compromiso de la empresa.

PIA n.º 14 (Exposición a armas controvertidas)

El Fondo no invirtió en empresas que generen parte de su volumen de negocio a través de la producción o distribución de armas controvertidas (es decir, minas antipersona, armamento nuclear, armamento biológico y químico y armas de racimo).

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Emisiones de GEI: Emisiones totales en USD	Toneladas de CO2eq	1 144,23	97,96%
Huella de carbono en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares invertidos	76,68	97,96%
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	314,95	97,96%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	98,03%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	35,99%	97,20%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	97,20%

¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
MICROSOFT CORPORATION	Tecnología de la información	5,02%	Estados Unidos
APPLE INC.	Tecnología de la información	4,61%	Estados Unidos
ELI LILLY AND COMPANY	Sector sanitario	3,20%	Estados Unidos
AMAZON.COM, INC.	Consumo discrecional	3,06%	Estados Unidos
ALPHABET INC.	Servicios de comunicación	2,82%	Estados Unidos
NVIDIA CORPORATION	Tecnología de la información	1,98%	Estados Unidos
SAP SE	Tecnología de la información	1,97%	Alemania
INTERCONTINENTAL EXCHANGE, INC.	Sector financiero	1,97%	Estados Unidos
MARVELL TECHNOLOGY, INC	Tecnología de la información	1,96%	Estados Unidos
UNION PACIFIC CORPORATION	Sector industrial	1,90%	Estados Unidos
S&P GLOBAL INC.	Sector financiero	1,84%	Estados Unidos
Deutsche Telekom AG	Servicios de comunicación	1,83%	Alemania
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC.	Sector sanitario	1,76%	Estados Unidos
SALESFORCE, INC.	Tecnología de la información	1,72%	Estados Unidos
UNITEDHEALTH GROUP INCORPORATED	Sector sanitario	1,72%	Estados Unidos

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

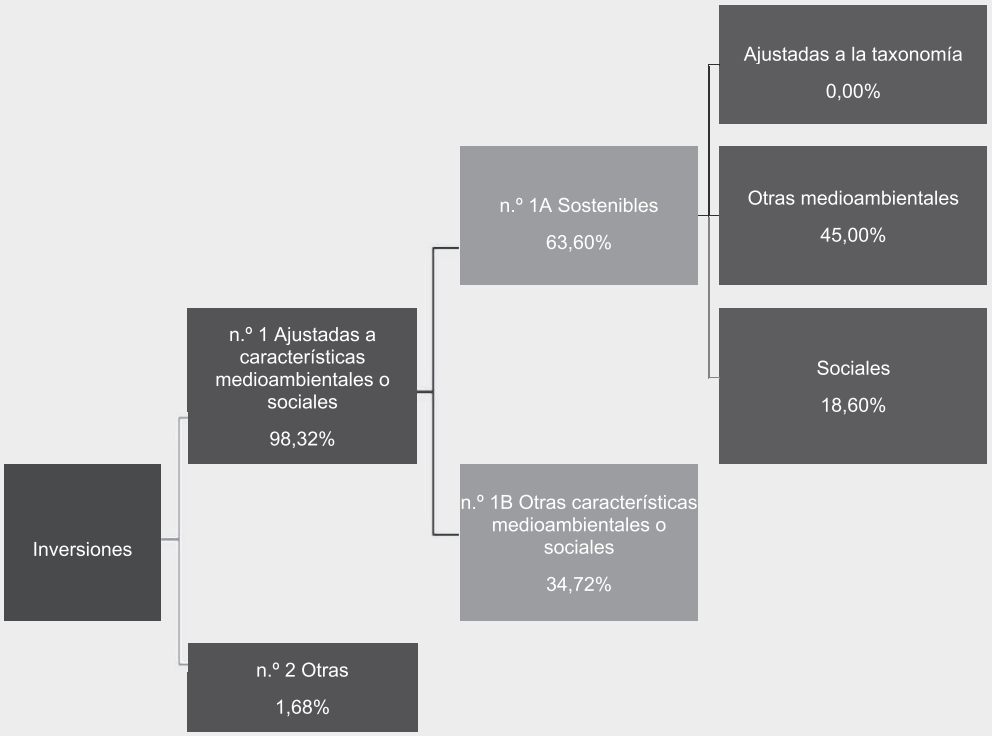
La proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 63,6 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 98,32 % de la cartera del Fondo se ajusta a las características ambientales o sociales promovidas por este. La parte restante (1,68 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos.

Del segmento de la cartera del Fondo que se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo destinó el 63,6 % de su cartera a inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Sector principal	% de activos
Tecnología de la información	30,40%
Sector sanitario	16,93%
Consumo discrecional	11,23%
Sector financiero	10,26%
Bienes básicos de consumo	9,68%
Servicios de comunicación	9,07%
Sector industrial	7,50%
Servicios públicos	2,02%
Materiales	0,93%

Principales subsectores	% de activos
Software	14,41%
Semiconductores y equipos semiconductores	7,32%
Mercados de capitales	7,03%
Industria farmacéutica	4,96%
Equipos y suministros sanitarios	4,71%
Hardware, almacenamiento y periféricos de tecnología	4,61%
Medios de comunicación y servicios interactivos	4,56%
Venta al por menor	4,21%
Productos de cuidado personal	4,14%
Biotecnología	3,62%
Entretenimiento	2,67%
Transporte por tierra	2,65%
Comercio minorista y distribución de bienes básicos de consumo	2,44%
Servicios informáticos	2,20%
Textiles, ropa y artículos de lujo	2,11%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental ajustado a la taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

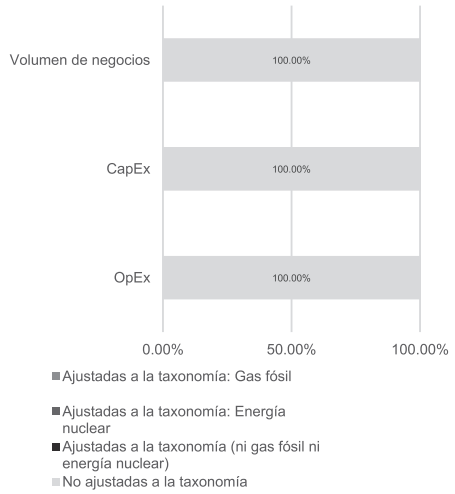
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

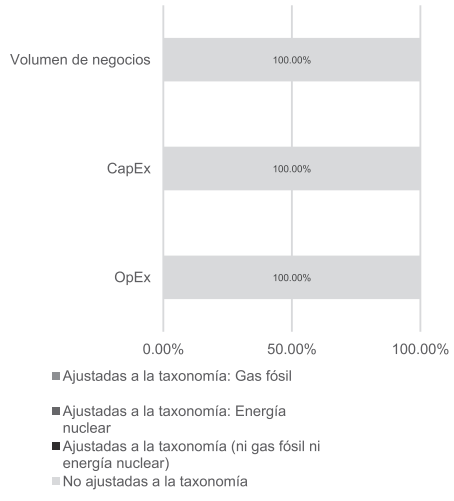
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transició facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica.

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

Como resultado de la estrategia de inversión, el Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la Taxonomía de la UE. Por lo tanto, a finales de febrero de 2024, el 45,00 % de la cartera del Fondo estaba formada por inversiones con un objetivo ambiental no ajustado a la Taxonomía de la UE.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

La proporción de inversiones socialmente sostenibles fue del 18,6 %.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

La proporción de inversiones en «N.º 2 Otros» era del 1,68 % e incluía el efectivo mantenido en depósito y los instrumentos derivados utilizados para la cobertura, así como los derivados para los que no había salvaguardias ambientales o sociales mínimas.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

1. El gestor de inversiones utilizó su sistema de calificación patentado y la investigación fundamental para evaluar cómo una empresa gestiona los riesgos y las oportunidades ESG, incluido un examen de la buena gobernanza. El sistema de calificación constaba de cuatro niveles de calificación: AAA, AA, A y B, que se asignaban a las empresas en función de su estrategia de sostenibilidad y rendimiento en las cuestiones ESG clave. Se calificaron todas las empresas del Fondo. La distribución de la calificación del Fondo a 29 de febrero de 2024 era:

AAA: 34 %

AA: 52 %

A: 12 %

B: 0 %

2. El Gestor de Inversiones colaboró constantemente con las empresas de su cartera. El compromiso ESG en ClearBridge solía tener dos objetivos que se solapaban:

- Análisis: Comprender mejor las cuestiones ESG que podían influir en la tesis de inversión.
- Incidencia: Alentar cambios específicos en la empresa que podrían influir positivamente el mundo real.

Para obtener más información sobre el enfoque en el compromiso, consulte nuestra política de compromiso y administración aquí: https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshippolicy.pdf

3. El Fondo no invirtió en los umbrales de ingresos establecidos, tal y como se describe en el prospecto, para las siguientes industrias:

- Tabaco
- Armas controvertidas
- Juegos de azar
- Entretenimiento para adultos

4. El Fondo no invirtió en empresas que infringían uno o varios de los diez principios de las cuatro áreas cubiertas por el PMNU (derechos humanos, trabajo, medioambiente y lucha contra la corrupción).

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica.

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
549300C63RJNQRH38W57

FRANKLIN TEMPLETON

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 61,70% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☐ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

El Fondo promueve un impacto positivo con respecto a:

- Mitigación del cambio climático
- Adaptación al cambio climático
- Impacto social

La promoción de un impacto positivo en las áreas anteriores hizo que el Fondo promoviera las siguientes características medioambientales o sociales durante el período de referencia:

- Inversiones que apoyen la transición hacia una economía con bajas emisiones de carbono, ya sea mediante la reducción directa de las emisiones, la habilitación de alternativas con menos emisiones o el suministro de productos o servicios sustitutivos con menos emisiones, como el transporte ferroviario frente a las alternativas aéreas o por carretera.
- Inversiones en infraestructuras que apoyen la adaptación al cambio climático.
- Infraestructuras que apoyen el impacto social, como la provisión de un acceso justo a los servicios esenciales, por ejemplo el acceso al agua, la energía y las comunicaciones.
- Cumplimiento de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU).

A la hora de seleccionar los valores durante el período del informe, el gestor de inversiones empleó un proceso propio de investigación y compromiso para determinar el perfil de una empresa en cuestiones ambientales, sociales y de gobernanza («ESG»). Este proceso exclusivo incluía un sistema de calificación ESG que utiliza un mapa de prioridades para identificar características ESG específicas relacionadas con la inversión.

El gestor de inversiones aplica su proceso ESG a todas las inversiones durante el período. Además, el Fondo mantuvo su compromiso mínimo de «inversión sostenible» del 15 %.

No se han utilizado instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Los indicadores de sostenibilidad utilizados para medir la consecución de cada una de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo fueron:

○ La proporción del Fondo mantenida en inversiones sostenibles, tal y como se define en la metodología de inversiones sostenibles propia del gestor de inversiones, era del 61,7 %.

○ La calificación ESG de la cartera del Fondo (7,35) en comparación con la calificación ESG del universo de inversión (6,58), como se ve en la siguiente tabla.

Las puntuaciones ESG se basan en datos de MSCI, ponderadas por igual para la «Calificación ESG del universo de inversión» y la cartera ponderada para la «Calificación ESG del Fondo». Además, observamos que el rendimiento del Fondo supera la calificación del universo de inversión si utilizamos otros proveedores de calificación ESG externos. El «universo de inversión» del Fondo incluye 200 valores de infraestructura denominados colectivamente RARE200, revisados trimestralmente como parte del proceso de inversión.

KPI de sostenibilidad Nombre	Valor
Calificación ESG del Fondo	7,35
Calificación ESG del universo de inversión	6,58

¿...y en comparación con períodos anteriores?

Los indicadores generales en materia de sostenibilidad se ajustan a los del período anterior.

	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
KPI de sostenibilidad Nombre	**Valor**	**Valor**
Calificación ESG del Fondo	7,35	7,31
Calificación ESG del universo de inversión	6,58	6,45

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	**Unidad de medida**	**Valor**	**Cobertura**	**Valor**	**Cobertura**
Emisiones de GEI: Emisiones totales en USD	Toneladas de CO2eq	376 657,00	97,18%	319 510,77	92,41%
Huella de carbono en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares invertidos	430,19	97,18%	313,64	92,41%
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	1 566,37	97,18%	2 125,77	95,98%
Exposición frente a empresas activas en el sector de los combustibles fósiles	Porcentaje invertido del Fondo	42,85%	95,77%	43,82%	92,41%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	97,18%	0,00%	95,98%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	95,77%	0,00%	92,41%

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

Dado el mandato del Fondo de invertir en activos de infraestructuras básicas y el importante papel que desempeñan las infraestructuras tanto en la prestación de servicios esenciales como en la transición energética, el Fondo mantuvo inversiones que contribuían a los objetivos sostenibles relacionados con la mitigación del cambio climático o los objetivos de adaptación, o que realizaban una contribución social positiva.

De las inversiones sostenibles, las contribuciones clave a los objetivos incluían:

- Empresas de servicios eléctricos y energías renovables que respaldan la transición a una economía baja en carbono y, por lo tanto, la mitigación del cambio climático (39 %)
- Infraestructura de movilidad con menos emisiones que respalda la transición a una economía con menos emisiones de carbono y, por lo tanto, la mitigación del cambio climático (39 %)
- Servicios de agua que apoyan la adaptación al cambio climático y el impacto social al proporcionar acceso a agua limpia y fiable esencial (15 %).
- Infraestructura de comunicaciones que puede proporcionar una alternativa al transporte, así como impacto social al brindar acceso a servicios esenciales (7 %)

Inicialmente, lo anterior se evaluó habida cuenta de las contribuciones a una de estas dos opciones o a ambas:

- Adecuación de los productos y servicios con los ODS (49,6 % de la cartera)
- Objetivos de reducción de emisiones e intensidad de GEI en las actividades económicas de una empresa determinada a través de un objetivo de descarbonización verificado por terceros y alineado con el Acuerdo de París (48 % de la cartera).

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

El gestor de inversiones utilizó una combinación de calificaciones de controversia sobre los riesgos graves de terceros, una selección basada en normas mundiales de terceros, incluido el cumplimiento del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU), la consideración de las PIA* y otros factores ambientales, sociales y de gobernanza importantes, que estaban integrados en la investigación fundamental del gestor de inversiones y en el proceso de calificación ESG propio, que incluía una evaluación de buena gobernanza, para examinar si las inversiones causaban un perjuicio significativo a los objetivos de inversión sostenible.

Además, el gestor de inversiones utilizó el proceso de compromiso para identificar los mejores valores.

*Los PAI que se tomaron en consideración dependían de la evaluación de materialidad ASG por subsector propia del gestor de inversiones que se aplicaba durante su proceso de calificación ASG o de la disponibilidad de datos.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

El proceso de inversión del gestor de inversiones integró las cuestiones ESG a través de un enfoque ascendente basado en la investigación que utilizaba numerosas fuentes de datos, incluidas las PIA. Las PIA se consideraron en el contexto del subsector de infraestructura pertinente.

La forma en que se consideraron y se tuvieron en cuenta las PIA se detalla a continuación.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

El gestor de inversiones apoya los principios del PMNU. Así, el Fondo no invirtió en empresas que infringiesen alguno de los diez principios de cada una de las cuatro áreas (derechos humanos, trabajo, medioambiente y lucha contra la corrupción) del PMNU.

El gestor de inversiones utilizó un proveedor de datos externo para supervisar el cumplimiento de los principios del PMNU. Si existían discrepancias o desacuerdos entre la investigación del gestor de inversiones y la evaluación del proveedor sobre una controversia específica, el gestor de inversiones, junto con el equipo de cumplimiento y los miembros del equipo de ESG, trataron la cuestión con la empresa. Si el gestor de inversiones llegaba a la conclusión de que la empresa había tomado las medidas necesarias para abordar la controversia o había subsanado de manera eficaz el problema debía proporcionar una explicación detallada de por qué se podía seguir invirtiendo en la empresa.

Para garantizar que las inversiones sostenibles se ajustaban a las directrices de la OCDE, el gestor de inversiones recurrió a un proveedor externo para supervisar el cumplimiento y las posibles infracciones.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.

¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Las PIA se consideraron como parte del amplio proceso ESG del gestor de inversiones, así como la consideración del principio de «no causar un perjuicio significativo». Los procesos de ESG donde se consideraron las PIA fueron: i) la puntuación ESG propia; ii) el seguimiento de la controversia y el compromiso continuo, y iii) las consideraciones ESG cualitativas.

Se tuvieron en cuenta las PIA siguientes:

PAI núm. 1 (Emisiones de GEI), PAI núm. 2 (Huella de carbono), PAI núm. 3 (Intensidad de GEI)

El gestor de inversiones evaluó los riesgos y las oportunidades específicos relacionados con el clima a los que se enfrentan las empresas individuales como parte de su proceso ascendente de selección de valores, que integraba estas consideraciones entre otras consideraciones medioambientales, sociales y de gobernanza. Cada subsector de infraestructuras se evaluó con arreglo a una ponderación de factores pertinentes para sus operaciones comerciales. La gestión de las emisiones de GEI por parte de las empresas, incluidos los planes de reducción creíbles, también se tiene en cuenta como parte de este proceso.

PAI núm. 5 (Porcentaje de producción de energía no renovable)

El gestor de inversiones evalúa la combinación de generación de energía como parte de su evaluación de investigación ascendente, en particular en lo que se refiere al cambio climático y los objetivos de cero emisiones netas. La Taxonomía de la UE establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la Taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la Taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE. El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas sostenibles desde el punto de vista ambiental. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas sostenibles desde el punto de vista ambiental. Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo ambiental o social.

PAI núm. 10 (Incumplimiento de las Directrices del PMNU/OCDE)

Consulte «¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos?».

PIA n.º 14 (Exposición a armas controvertidas)

El Fondo no invierte, ni invirtió, en empresas que generaban ingresos a partir de: a) armas prohibidas según i) la Convención sobre la prohibición del empleo, almacenamiento, producción y transferencia de minas antipersonal y sobre su destrucción, y ii) la Convención sobre la prohibición de las municiones en racimo, y b) armas clasificadas como armas B o C de conformidad con la Convención sobre armas biológicas de las Naciones Unidas y la Convención sobre armas químicas de las Naciones Unidas, respectivamente.

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Emisiones de GEI: Emisiones totales en USD	Toneladas de CO2eq	376 657,00	97,18%
Huella de carbono en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares invertidos	430,19	97,18%
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	1 566,37	97,18%
Exposición frente a empresas activas en el sector de los combustibles fósiles	Porcentaje invertido del Fondo	42,85%	95,77%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	97,18%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	95,77%



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
PG&E CORPORATION	Servicios públicos	5,00%	Estados Unidos
CSX Corporation	Sector industrial	4,44%	Estados Unidos
GETLINK S.E.	Sector industrial	4,41%	Francia
NEXTERA ENERGY, INC.	Servicios públicos	4,19%	Estados Unidos
AMERICAN TOWER CORPORATION	Sector inmobiliario	4,11%	Estados Unidos
SEVERN TRENT PLC	Servicios públicos	4,07%	Reino Unido
EDP - Energias de Portugal, S.A.	Servicios públicos	3,40%	Portugal
ENTERGY CORPORATION	Servicios públicos	3,33%	Estados Unidos
Ferrovial SE	Sector industrial	3,29%	España
TERNA - RETE ELETTRICA NAZIONALE SOCIETA PER AZIONI	Servicios públicos	3,15%	Italia
ENEL - SPA	Servicios públicos	3,05%	Italia
UNITED UTILITIES GROUP PLC	Servicios públicos	2,88%	Reino Unido
TRANSURBAN GROUP	Sector industrial	2,83%	Australia
UNION PACIFIC CORPORATION	Sector industrial	2,80%	Estados Unidos
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INCORPORATED	Servicios públicos	2,66%	Estados Unidos

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

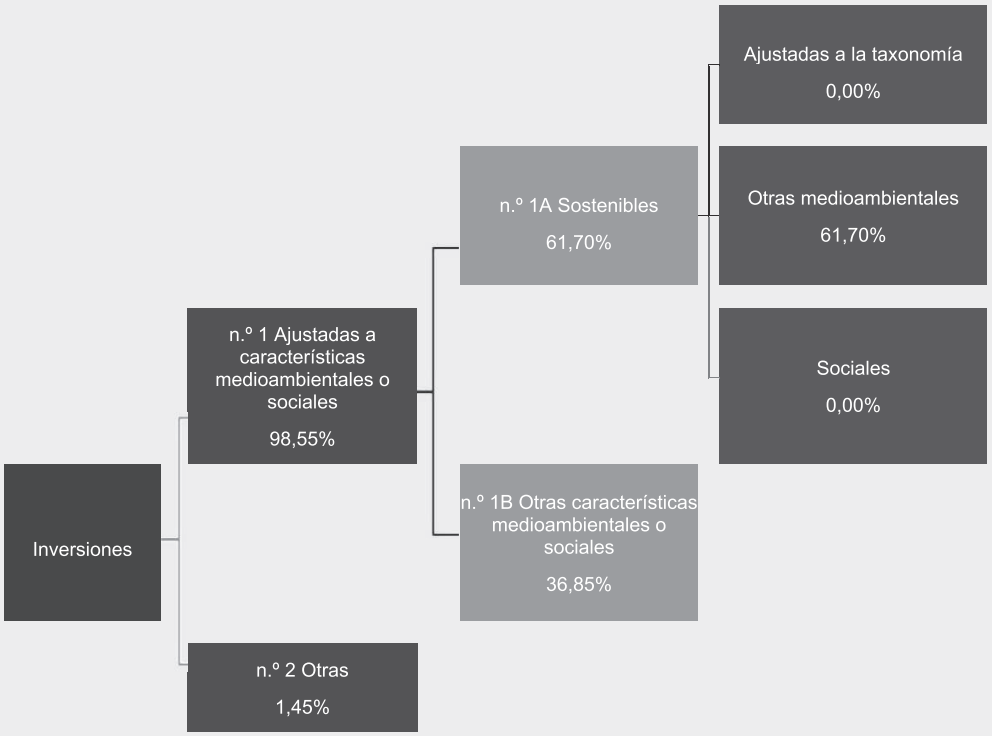
La proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 61,7 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 98,55 % de la cartera del Fondo se ajusta a las características ambientales o sociales promovidas por este. La parte restante (1,45 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos.

Del segmento de la cartera del Fondo que se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo destinó el 61,7 % de su cartera a inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

Sector principal	% de activos
Servicios públicos	51,35%
Sector industrial	32,04%
Energía	7,46%
Sector inmobiliario	4,70%
Servicios de comunicación	1,63%

Principales subsectores	% de activos
Servicios públicos eléctricos	35,59%
Transporte por tierra	14,77%
Infraestructura del transporte	12,99%
Servicios de suministro de agua	8,36%
Petróleo, gas y combustibles de consumo	7,46%
Servicios públicos múltiples	7,40%
Fondos de inversión inmobiliaria especializados	4,70%
Construcción e ingeniería	4,29%
Servicios de telecomunicaciones diversificados	1,63%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental ajustado a la taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

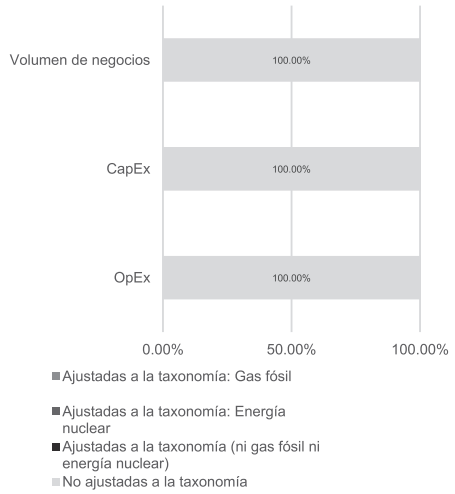
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

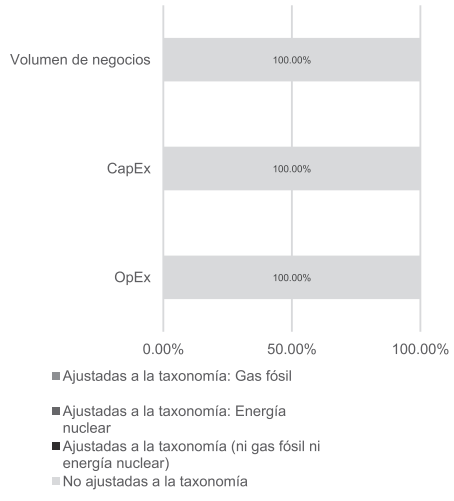
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transició facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica.

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

Como resultado de la estrategia de inversión, el Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la Taxonomía de la UE. Por lo tanto, a finales de febrero de 2023, el 61,7 % de la cartera del Fondo estaba formada por inversiones con un objetivo ambiental no ajustado a la Taxonomía de la UE.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

La proporción de inversiones socialmente sostenibles fue del 0,00 %.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

La proporción de inversiones en «N.º 2 Otros» era del 1,45 % e incluía el efectivo mantenido en depósito y los instrumentos derivados utilizados para la cobertura, así como los derivados para los que no había salvaguardias ambientales o sociales mínimas.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

1. El gestor de inversiones aplicó constantemente el proceso de ESG que se integraba y tenía en cuenta en todos los elementos clave del proceso de inversión.

Esto incluyó:

- Pantallas negativas en la construcción del universo de inversión para respetar los límites de extracción y producción de combustibles fósiles, tabaco, armas y fallos del PMNU
- Aplicación del proceso de tres pilares para la integración de ASG:
    - Ajustes de flujo de efectivo pronosticados basados en factores de ESG.
    - Ajuste del retorno requerido basado en el riesgo de ASG, según lo evaluado por las puntuaciones exclusivas de los gerentes (consulte a continuación)
    - Compromiso, incluido el control de controversias.
- Otros análisis y procesos ESG, como revisiones de sostenibilidad de las puntuaciones ESG de la empresa, análisis de combinación energética y planes de descarbonización, consideración de las PIA, etc.

Algunas de las acciones anteriores se describen detalladamente en los resultados a continuación.

2. El gestor de inversiones utilizó su sistema de calificación patentado y la investigación fundamental para evaluar cómo una empresa gestiona los riesgos y las oportunidades ESG. El sistema de calificación constaba de cuatro niveles de calificación: AAA, AA, A y B, que se asignan a las empresas en función de su estrategia de sostenibilidad y rendimiento en las cuestiones ESG clave. Se han calificado todas las empresas del Fondo. La distribución de la calificación del fondo a 29 de febrero de 2024 es:

- AAA: 22 %
- AA: 65 %
- A: 11 %
- B: 0 %

3. El gestor de inversiones se comprometía constantemente con las empresas de la cartera. El compromiso ESG en ClearBridge solía tener dos objetivos que se solapaban:

- Análisis: Comprender mejor las cuestiones ESG que podían influir en la tesis de inversión.
- Incidencia: Alentar cambios específicos en la empresa que podrían influir positivamente el mundo real.

Los compromisos del Fondo con respecto a la presentación de informes fueron los siguientes:

- medioambientales, 31 %
- sociales, 24 %
- Gobernanza: 44 %

4. El resultado fue que el Fondo respetaba los elementos vinculantes de su estrategia de inversión.

5. El Fondo mantuvo una calificación ESG de la cartera superior a la de su universo de inversión.

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica.

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
54930016JDVIT9OWQK33

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 50,10% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☐ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

El Fondo promueve un impacto positivo con respecto a:

- Mitigación del cambio climático
- Adaptación al cambio climático
- Impacto social

La promoción de un impacto positivo en las áreas anteriores hizo que el Fondo promoviera las siguientes características medioambientales o sociales durante el período de referencia:

- Inversiones que apoyen la transición hacia una economía con bajas emisiones de carbono, ya sea mediante la reducción directa de las emisiones, la habilitación de alternativas con menos emisiones o el suministro de productos o servicios sustitutivos con menos emisiones, como el transporte ferroviario frente a las alternativas aéreas o por carretera.
- Inversiones en infraestructuras que apoyen la adaptación al cambio climático.
- Infraestructuras que apoyen el impacto social, como la provisión de un acceso justo a los servicios esenciales, por ejemplo el acceso al agua, la energía y las comunicaciones.
- Cumplimiento de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU).

A la hora de seleccionar los valores durante el período del informe, el gestor de inversiones empleó un proceso propio de investigación y compromiso para determinar el perfil de una empresa en cuestiones ambientales, sociales y de gobernanza («ESG»). Este proceso exclusivo incluía un sistema de calificación ESG que utiliza un mapa de prioridades para identificar características ESG específicas relacionadas con la inversión.

El gestor de inversiones aplica su proceso ESG a todas las inversiones durante el período. Además, el Fondo mantuvo su compromiso mínimo de «inversión sostenible» del 15 %.

No se han utilizado instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

Los indicadores de sostenibilidad utilizados para medir la consecución de cada una de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo fueron:

○ La proporción del Fondo mantenida en inversiones sostenibles, tal y como se define en la metodología de inversiones sostenibles propia del gestor de inversiones, era del 50,1 %.

○ La calificación ESG de la cartera del Fondo (7,82) en comparación con la calificación ESG del universo de inversión (6,67), como se ve en la siguiente tabla;

Las puntuaciones ESG se basan en datos de MSCI, ponderadas por igual para la «Calificación ESG del universo de inversión» y la cartera ponderada para la «Calificación ESG del Fondo». Además, observamos que el rendimiento del Fondo supera la calificación del universo de inversión si utilizamos otros proveedores de calificación ESG externos.

KPI de sostenibilidad Nombre	Valor
Calificación ESG del Fondo	7,82
Calificación ESG del universo de inversión	6,67

¿...y en comparación con períodos anteriores?

Los indicadores generales en materia de sostenibilidad se ajustan a los del período anterior.

	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
KPI de sostenibilidad Nombre	**Valor**	**Valor**
Calificación ESG del Fondo	7,82	7,89
Calificación ESG del universo de inversión	6,67	6,58

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	**Unidad de medida**	**Valor**	**Cobertura**	**Valor**	**Cobertura**
Emisiones de GEI: Emisiones totales en USD	Toneladas de CO2eq	157 591,00	96,86%	139 114,60	96,67%
Huella de carbono en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares invertidos	444,57	96,86%	351,77	96,67%
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	1 803,46	96,86%	2 500,32	98,02%
Exposición a empresas del sector de los combustibles fósiles.	Porcentaje invertido del Fondo	54,13%	95,18%	61,11%	94,59%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	96,86%	0,00%	98,02%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	95,18%	0,00%	94,59%

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

Dado el mandato del Fondo de invertir en activos de infraestructuras básicas y el importante papel que desempeñan las infraestructuras tanto en la prestación de servicios esenciales como en la transición energética, el Fondo mantuvo inversiones que contribuían a los objetivos sostenibles relacionados con la mitigación del cambio climático o los objetivos de adaptación, o que realizaban una contribución social positiva.

De las inversiones sostenibles, las contribuciones clave a los objetivos incluían:

- Empresas de servicios eléctricos y energías renovables que respaldan la transición a una economía baja en carbono y, por lo tanto, la mitigación del cambio climático (60 %).
- Infraestructura de movilidad con menos emisiones que respalda la transición a una economía con menos emisiones de carbono y, por lo tanto, la mitigación del cambio climático (17 %)
- Servicios de agua que apoyan la adaptación al cambio climático y el impacto social al proporcionar acceso a agua limpia y fiable esencial (14 %)
- Infraestructura de comunicaciones que puede proporcionar una alternativa al transporte, así como impacto social al brindar acceso a servicios esenciales (9 %)

Inicialmente, lo anterior se evaluó habida cuenta de las contribuciones a una de estas dos opciones o a ambas:

- Adecuación de los productos y servicios a los ODS (32,3 % de la cartera)
- Objetivos de reducción de emisiones e intensidad de GEI en las actividades económicas de una empresa determinada a través de un objetivo de descarbonización verificado por terceros y alineado con el Acuerdo de París (38,8 % de la cartera)

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

El gestor de inversiones utilizó una combinación de calificaciones de controversia sobre los riesgos graves de terceros, una selección basada en normas mundiales de terceros, incluido el cumplimiento del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU), la consideración de las PIA* y otros factores ambientales, sociales y de gobernanza importantes, que estaban integrados en la investigación fundamental del gestor de inversiones y en el proceso de calificación ESG propio, que incluía una evaluación de buena gobernanza, para examinar si las inversiones causaban un perjuicio significativo a los objetivos de inversión sostenible.

Además, el gestor de inversiones utilizó el proceso de compromiso para identificar los mejores valores.

*Los PAI que se tomaron en consideración dependían de la evaluación de materialidad ASG por subsector propia del gestor de inversiones que se aplicaba durante su proceso de calificación ASG o de la disponibilidad de datos.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

El proceso de inversión del gestor de inversiones integró las cuestiones ESG a través de un enfoque ascendente basado en la investigación que utilizaba numerosas fuentes de datos, incluidas las PIA. Las PIA se consideraron en el contexto del subsector de infraestructura pertinente.

La forma en que se consideraron y se tuvieron en cuenta las PIA se detalla a continuación.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

El gestor de inversiones apoya los principios del PMNU. Así, el Fondo no invirtió en empresas que infringiesen alguno de los diez principios de cada una de las cuatro áreas (derechos humanos, trabajo, medioambiente y lucha contra la corrupción) del PMNU.

El gestor de inversiones utilizó un proveedor de datos externo para supervisar el cumplimiento de los principios del PMNU. Si existían discrepancias o desacuerdos entre la investigación del gestor de inversiones y la evaluación del proveedor sobre una controversia específica, el gestor de inversiones, junto con el equipo de cumplimiento y los miembros del equipo de ESG, trataron la cuestión con la empresa. Si el gestor de inversiones llegaba a la conclusión de que la empresa había tomado las medidas necesarias para abordar la controversia o había subsanado de manera eficaz el problema debía proporcionar una explicación detallada de por qué se podía seguir invirtiendo en la empresa.

Para garantizar que las inversiones sostenibles se ajustaban a las directrices de la OCDE, el gestor de inversiones recurrió a un proveedor externo para supervisar el cumplimiento y las posibles infracciones.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.

¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Las PIA se consideraron como parte del amplio proceso ESG del gestor de inversiones, así como la consideración del principio de «no causar un perjuicio significativo». Los procesos de ESG donde se consideraron las PIA fueron: i) la puntuación ESG propia; ii) el seguimiento de la controversia y el compromiso continuo, y iii) las consideraciones ESG cualitativas.

Se tuvieron en cuenta las PIA siguientes:

PAI núm. 1 (Emisiones de GEI), PAI núm. 2 (Huella de carbono), PAI núm. 3 (Intensidad de GEI)

El gestor de inversiones evaluó los riesgos y las oportunidades específicos relacionados con el clima a los que se enfrentan las empresas individuales como parte de su proceso ascendente de selección de valores, que integraba estas consideraciones entre otras consideraciones medioambientales, sociales y de gobernanza. Cada subsector de infraestructuras se evaluó con arreglo a una ponderación de factores pertinentes para sus operaciones comerciales. La gestión de las emisiones de GEI por parte de las empresas, incluidos los planes de reducción creíbles, también se tuvo en cuenta como parte de este proceso.

PAI núm. 5 (Porcentaje de producción de energía no renovable)

El gestor de inversiones evalúa la combinación de generación de energía como parte de su evaluación de investigación ascendente, en particular en lo que se refiere al cambio climático y los objetivos de cero emisiones netas.

PAI núm. 10 (Incumplimiento de las Directrices del PMNU/OCDE)

Consulte «¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos?».

PIA n.º 14 (Exposición a armas controvertidas)

El Fondo no invierte, ni invirtió, en empresas que generaban ingresos a partir de: a) armas prohibidas según i) la Convención sobre la prohibición del empleo, almacenamiento, producción y transferencia de minas antipersonal y sobre su destrucción, y ii) la Convención sobre la prohibición de las municiones en racimo, y b) armas clasificadas como armas B o C de conformidad con la Convención sobre armas biológicas de las Naciones Unidas y la Convención sobre armas químicas de las Naciones Unidas, respectivamente.

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Emisiones de GEI: Emisiones totales en USD	Toneladas de CO2eq	157 591,00	96,86%
Huella de carbono en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares invertidos	444,57	96,86%
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	1 803,46	96,86%
Exposición a empresas del sector de los combustibles fósiles.	Porcentaje invertido del Fondo	54,13%	95,18%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	96,86%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	95,18%



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
EDP - Energias de Portugal, S.A.	Servicios públicos	4,76%	Portugal
NATIONAL GRID PLC	Servicios públicos	4,54%	Reino Unido
THE SOUTHERN COMPANY	Servicios públicos	4,03%	Estados Unidos
ENTERGY CORPORATION	Servicios públicos	3,91%	Estados Unidos
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INCORPORATED	Servicios públicos	3,51%	Estados Unidos
AMERICAN TOWER CORPORATION	Sector inmobiliario	3,47%	Estados Unidos
SNAM S.P.A.	Servicios públicos	3,45%	Italia
OGE ENERGY CORP.	Servicios públicos	3,40%	Estados Unidos
West Japan Railway Company	Sector industrial	3,40%	Japón
ENEL - SPA	Servicios públicos	3,24%	Italia
CROWN CASTLE INC.	Sector inmobiliario	3,18%	Estados Unidos
NEXTERA ENERGY, INC.	Servicios públicos	3,08%	Estados Unidos
UNION PACIFIC CORPORATION	Sector industrial	3,00%	Estados Unidos
PEMBINA PIPELINE CORPORATION	Energía	2,85%	Canadá
EDISON INTERNATIONAL	Servicios públicos	2,61%	Estados Unidos

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

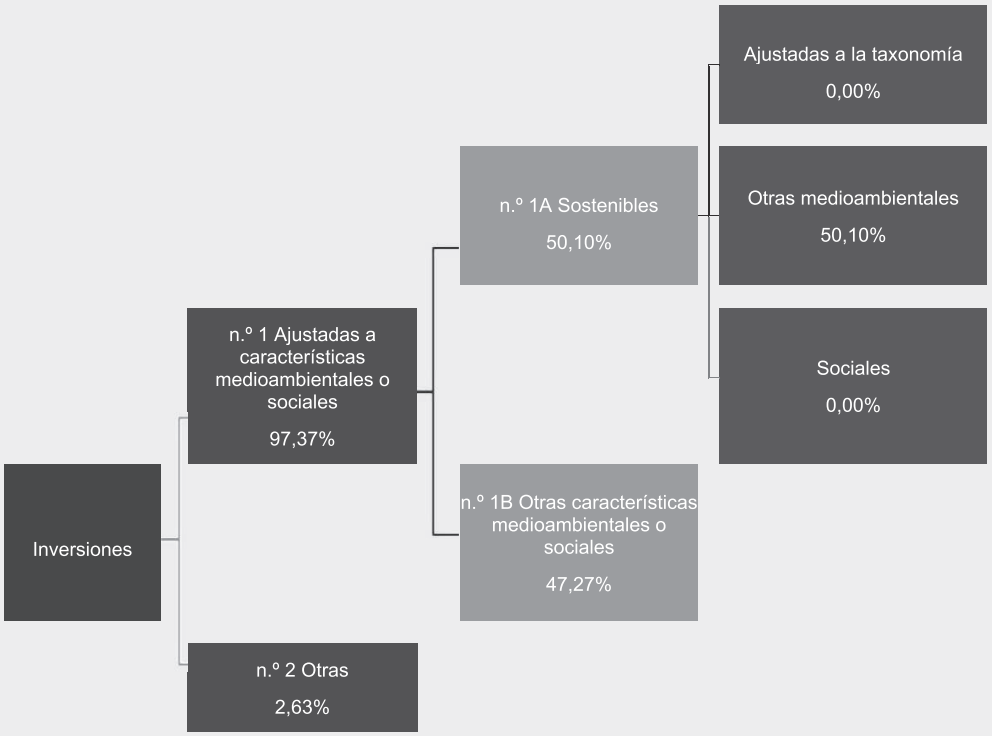
La proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 50,1 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 97,37 % de la cartera del Fondo se ajusta a las características ambientales o sociales promovidas por este. La parte restante (2,63 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos.

Del segmento de la cartera del Fondo que se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo destinó el 50,1 % de su cartera a inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo ni los derivados, fueron:

Sector principal	% de activos
Servicios públicos	66,41%
Sector industrial	15,74%
Energía	8,06%
Sector inmobiliario	6,64%

Principales subsectores	% de activos
Servicios públicos eléctricos	37,60%
Servicios de gas	10,36%
Servicios públicos múltiples	10,04%
Petróleo, gas y combustibles de consumo	8,06%
Infraestructura del transporte	6,75%
Fondos de inversión inmobiliaria especializados	6,64%
Transporte por tierra	6,40%
Servicios de suministro de agua	4,67%
Productores de energía y electricidad renovable independientes	3,73%
Construcción e ingeniería	2,59%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental ajustado a la taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

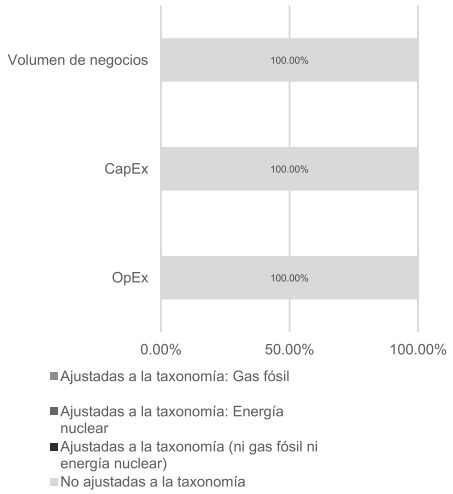
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

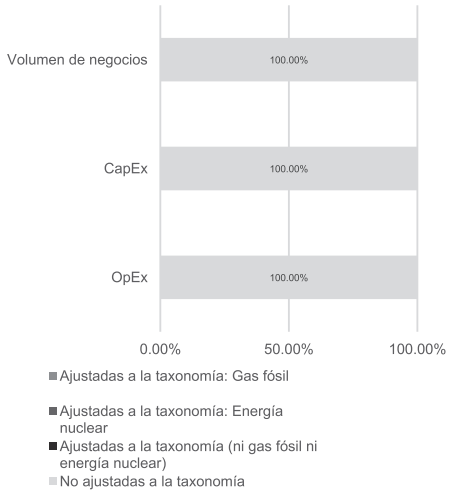
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transició facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica.

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

Como resultado de la estrategia de inversión, el Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la Taxonomía de la UE. Por lo tanto, a finales de febrero de 2023, el 50,1 % de la cartera del Fondo estaba formada por inversiones con un objetivo ambiental no ajustado a la Taxonomía de la UE.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

La proporción de inversiones socialmente sostenibles fue del 0,0 %.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

La proporción de inversiones en «N.º 2 Otros» era del 2,63 % e incluía el efectivo mantenido en depósito y los instrumentos derivados utilizados para la cobertura, así como los derivados para los que no había salvaguardias ambientales o sociales mínimas.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

1. El gestor de inversiones aplicó constantemente el proceso de ESG que se integraba y tenía en cuenta en todos los elementos clave del proceso de inversión.

Esto incluyó:

- Pantallas negativas en la construcción del universo de inversión para respetar los límites de extracción y producción de combustibles fósiles, tabaco, armas y fallos del PMNU
- Aplicación del proceso de tres pilares para la integración de ASG:
  - Ajustes de flujo de efectivo pronosticados basados en factores de ESG.
  - Ajuste del retorno requerido basado en el riesgo de ASG, según lo evaluado por las puntuaciones exclusivas de los gerentes (consulte a continuación)
  - Compromiso, incluido el control de controversias.
- Otros análisis y procesos ESG, como revisiones de sostenibilidad de las puntuaciones ESG de la empresa, análisis de combinación energética y planes de descarbonización, consideración de las PIA, etc.

Algunas de las acciones anteriores se describen detalladamente en los resultados a continuación.

2. El gestor de inversiones utilizó su sistema de calificación patentado y la investigación fundamental para evaluar cómo una empresa gestiona los riesgos y las oportunidades ESG. El sistema de calificación constaba de cuatro niveles de calificación: AAA, AA, A y B, que se asignan a las empresas en función de su estrategia de sostenibilidad y rendimiento en las cuestiones ESG clave. Se han calificado todas las empresas del Fondo. La distribución de la calificación del fondo a 29 de febrero de 2024 es:

- AAA: 19 %
- AA: 71 %
- A: 6 %
- B: 0 %

3. El gestor de inversiones se comprometía constantemente con las empresas de la cartera. El compromiso ESG del gestor de inversiones solía tener dos objetivos que se solapaban:

- Análisis: Comprender mejor las cuestiones ESG que podían influir en la tesis de inversión.
- Incidencia: Alentar cambios específicos en la empresa que podrían influir positivamente el mundo real.

Los compromisos del Fondo con respecto al período de referencia fueron los siguientes:

- medioambientales, 33 %
- sociales, 25 %
- De gobernanza: 42 %

4. El resultado fue que el Fondo respetaba los elementos vinculantes de su estrategia de inversión.

5. El Fondo mantuvo una calificación ESG de la cartera superior a la de su universo de inversión.

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica.

FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
254900JA2MNQ8SPZ8938

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 46,80% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☒ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

Durante el período objeto del informe, el Fondo promovió una serie de características ambientales y sociales que el gestor de inversiones considera pertinentes para la empresa en concreto y para el sector en el que la empresa opera. Estas características incluían, entre otras:

medioambientales,

- Mitigación del cambio climático
- Adaptación al cambio climático
- Agua
- Biodiversidad

sociales,

- Salud y seguridad
- Diversidad de género
- Inclusión financiera
- Seguridad alimentaria
- Agua limpia

Además, el Fondo ha mantenido su compromiso mínimo de «inversión sostenible» del 10 %.

No se ha designado ningún punto de referencia para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Los indicadores de sostenibilidad utilizados para medir la consecución de cada una de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo fueron:

- el 46,8 % del Fondo mantenido en inversiones sostenibles, tal y como se define en la metodología de inversiones sostenibles propia del gestor de inversiones, que incluye el ajuste de productos o servicios a los Objetivos de Desarrollo Sostenible («ODS») de las Naciones Unidas y la consideración de «no causar un perjuicio significativo»;
- los indicadores específicos de principales incidencias adversas (PAI), en concreto PAI n.º 1 (Emisiones de GEI), PAI n.º 2 (Huella de carbono), PAI n.º 3 (Intensidad de GEI), PAI n.º 4 (Incumplimiento del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Directrices de la OCDE), PAI n.º 7 (actividades que afectan negativamente a zonas

sensibles a la biodiversidad), PAI n.º 10 (Incumplimientos del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Directrices de la OCDE), PAI n.º 13 (Diversidad de género en el Consejo de Administración) y PAI n.º 14 (Exposición a armas controvertidas). Consulte los valores divulgados en la sección «¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?»;

- Exposición de la cartera a empresas que han establecido objetivos basados en la ciencia para la reducción de las emisiones de GEI; 54,2 %
- Metodologías propias para evaluar el progreso de las reuniones de colaboración en materia ESG del gestor de inversiones. ClearBridge celebró compromisos de ESG periódicos con las empresas de su cartera. Los puntos de vista del equipo de inversión sobre el progreso debatido en estas reuniones se reflejaron en las calificaciones de ESG patentadas, las decisiones de voto por poder y las decisiones de inversión.

¿...y en comparación con períodos anteriores?

No se aplica.

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

Las inversiones sostenibles realizadas por el Fondo fueron en valores de renta variable emitidos por empresas que contribuyeron a al menos uno de los siguientes:

- A través de sus productos y servicios, a uno o varios de los factores ambientales o sociales de los ODS y a sus metas e indicadores subyacentes determinados mediante la evaluación de la contribución del gestor de inversiones; 30,2 % de la cartera.
- Objetivos de reducción de emisiones e intensidad de GEI en las actividades económicas de una empresa determinada a través de un objetivo de descarbonización verificado por terceros y alineado con el Acuerdo de París o es un proveedor de soluciones climáticas. Supervisamos el progreso de los emisores con respecto a los objetivos a través de nuestro proceso de compromiso; 40,5 % de la cartera.

Además de contribuir a uno de los objetivos ambientales o sociales indicados anteriormente, las empresas fueron evaluadas mediante el examen de la buena gobernanza propio del gestor de inversiones y superaron los criterios de «no causar un perjuicio significativo», tal y como se detalla a continuación.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

El gestor de inversiones utilizó una combinación de calificaciones de controversia sobre riesgos graves de terceros, una selección basada en normas mundiales de terceros, incluido el cumplimiento del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU), la consideración de la PIA* y otros factores ambientales, sociales y de gobernanza importantes, que estaban integrados en la investigación fundamental del gestor de inversiones y en el proceso de calificación ESG propio, que incluía una evaluación de gobernanza, para revisar si las inversiones causan un perjuicio significativo a cualquier objetivo de inversión sostenible.

Además, el gestor de inversiones utilizó el proceso de compromiso para identificar los mejores valores.

*Los PAI que se tomaron en consideración dependían de la evaluación de materialidad ASG por subsector propia del gestor de inversiones que se aplicaba durante su proceso de calificación ASG o de la disponibilidad de datos.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Todas las PIA que eran importantes para la empresa calificada se tuvieron en cuenta como parte de la calificación ESG del gestor de inversiones que se aplicó en el proceso de selección de valores.

La forma en que se consideraron y se tuvieron en cuenta las PIA se detalla a continuación.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

El gestor de inversiones apoya los principios del PMNU. Así, el Fondo no invirtió en empresas que infringiesen alguno de los diez principios de cada una de las cuatro áreas (derechos humanos, trabajo, medioambiente y lucha contra la corrupción) del PMNU.

El gestor de inversiones utilizó un proveedor de datos externo para supervisar el cumplimiento de los principios del PMNU. Si existían discrepancias o desacuerdos entre la investigación del gestor de inversiones y la evaluación del proveedor sobre una controversia específica, el gestor de inversiones, junto con el equipo de cumplimiento y los miembros del equipo de ESG, trataron la cuestión con la empresa. Si el gestor de inversiones llegaba a la conclusión de que la empresa había tomado las medidas necesarias para abordar la controversia o había subsanado de manera eficaz el problema debía proporcionar una explicación detallada de por qué se podía seguir invirtiendo en la empresa.

Para garantizar que las inversiones sostenibles se ajustaban a las directrices de la OCDE, el gestor de inversiones recurrió a un proveedor externo para supervisar el cumplimiento y las posibles infracciones.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.



¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Todas las PIA que eran importantes para la empresa calificada se tuvieron en cuenta como parte de la calificación ASG del Gestor de Inversiones que se aplicó en el proceso de selección de valores, concretamente:

PAI núm. 1 (Emisiones de GEI), PAI núm. 2 (Huella de carbono), PAI núm. 3 (Intensidad de GEI)

El gestor de inversiones evaluó los riesgos específicos relacionados con el clima y las oportunidades de las empresas como parte del proceso de selección de existencias, que integró tanto estas como otras consideraciones medioambientales, sociales y de gobernanza.

Aunque el gestor de inversiones evaluó cada sector en función de una serie de criterios específicos que eran pertinentes para sus operaciones comerciales, la evaluación solía incluir una cuidadosa consideración de factores relacionados con el clima como: el entorno normativo/político, la ubicación geográfica de los activos y las operaciones, la capacidad de trasladar los costes a los clientes, las alternativas y los avances tecnológicos, los cambios en las preferencias de los clientes, los precios de las materias primas, los gastos de capital futuros y los planes de I+D, la estrategia comercial a largo plazo, la calidad general del equipo de gestión, entre otros factores.

El gestor de inversiones utilizó la herramientas Carbon Portfolio Analytics de MSCI para evaluar la exposición a empresas con reservas de combustibles fósiles. El gestor de inversiones llevó a cabo un análisis de la intensidad del carbono en las inversiones de la empresa en su conjunto para comprender la intensidad del carbono de los activos totales de la empresa en relación con los mercados de valores mundiales. También puede llevar a cabo un análisis de la intensidad del carbono en el contexto de la cartera.

PAI núm. 10 (Incumplimiento de las Directrices del PMNU/OCDE)

Consulte «¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos?».

PAI núm. 13 (Diversidad de género en el consejo de administración)

El gestor de inversiones utiliza datos de terceros para el seguimiento de la diversidad de género en los consejos de administración. Además, tiene una disposición en su política de voto por delegación para votar en contra de los miembros y el presidente del comité de nombramientos si la empresa no cuenta con al menos una mujer en el consejo. El gestor de inversiones también tuvo en cuenta la diversidad, la igualdad y la inclusión como un componente de su análisis y calificación ESG, así como un tema de toda la empresa para el compromiso de la empresa.

PIA n.º 14 (Exposición a armas controvertidas)

El Fondo no invirtió en empresas que generen parte de su volumen de negocio a través de la producción o distribución de armas controvertidas (es decir, minas antipersona, armamento nuclear, armamento biológico y químico y armas de racimo).

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Emisiones de GEI: Alcance 3 USD	Toneladas de CO2eq	5 447,99	91,65%
Huella de carbono en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares invertidos	1 167,84	91,65%
Intensidad de GEI en USD	Toneladas de CO2eq/millón de dólares de ingresos	1 276,97	91,65%
Intensidad de consumo de energía: Agua USD	GWh por millón de dólares de ventas	2,90	76,77%
Violaciones de los principios del Pacto Mundial de la ONU y las Directrices de la OCDE	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	91,65%
Diversidad de género en los consejos de administración	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	37,73%	91,65%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	91,65%

¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
Hitachi, Ltd.	Sector industrial	4,98%	Japón
TotalEnergies SE	Energía	4,55%	Francia
COMPASS GROUP PLC	Consumo discrecional	4,17%	Reino Unido
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria, S.A.	Sector financiero	3,90%	España
META PLATFORMS, INC.	Servicios de comunicación	3,66%	Estados Unidos
WELLS FARGO & COMPANY	Sector financiero	3,60%	Estados Unidos
FISERV, INC.	Sector financiero	3,53%	Estados Unidos
VERTIV HOLDINGS CO	Sector industrial	3,38%	Estados Unidos
ORACLE CORPORATION	Tecnología de la información	3,37%	Estados Unidos
ASTRAZENECA PLC	Sector sanitario	3,31%	Reino Unido
UNILEVER PLC	Bienes básicos de consumo	3,25%	Reino Unido
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP, INC.	Sector financiero	3,20%	Estados Unidos
JOHNSON & JOHNSON	Sector sanitario	3,16%	Estados Unidos
Siemens Aktiengesellschaft	Sector industrial	2,93%	Alemania
BNP PARIBAS SA	Sector financiero	2,87%	Francia

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

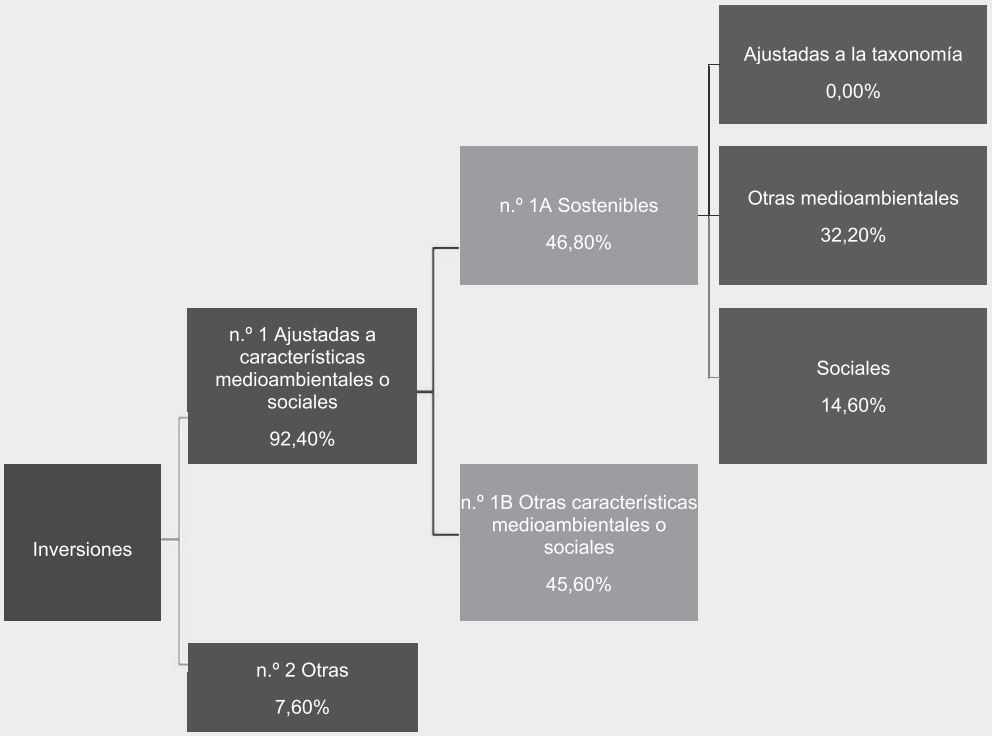
La proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 46,8 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 92,4 % de la cartera del Fondo se ajusta a las características ambientales o sociales promovidas por este. La parte restante (7,6 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos.

Del segmento de la cartera del Fondo que se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo destinó el 46,8 % de su cartera a inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Sector principal	% de activos
Sector financiero	22,84%
Sector industrial	21,03%
Sector sanitario	11,54%
Servicios públicos	8,29%
Energía	7,38%
Bienes básicos de consumo	5,66%
Consumo discrecional	4,17%
Materiales	3,69%
Servicios de comunicación	3,66%
Tecnología de la información	3,37%

Principales subsectores	% de activos
Bancos	12,26%
Equipos eléctricos	9,38%
Conglomerados industriales	7,91%
Petróleo, gas y combustibles de consumo	7,38%
Industria farmacéutica	6,47%
Productos de cuidado personal	5,66%
Seguros	5,15%
Hoteles, restaurantes y actividades de ocio	4,17%
Medios de comunicación y servicios interactivos	3,66%
Servicios financieros	3,53%
Software	3,37%
Productores de energía y electricidad renovable independientes	3,23%
Transporte por tierra	2,71%
Metales y minería	2,37%
Proveedores y servicios sanitarios	2,33%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental ajustado a la taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

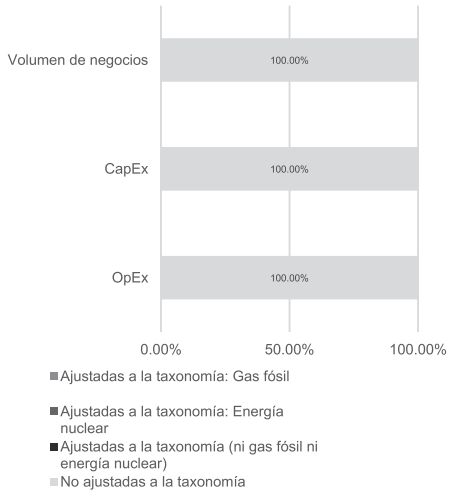
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

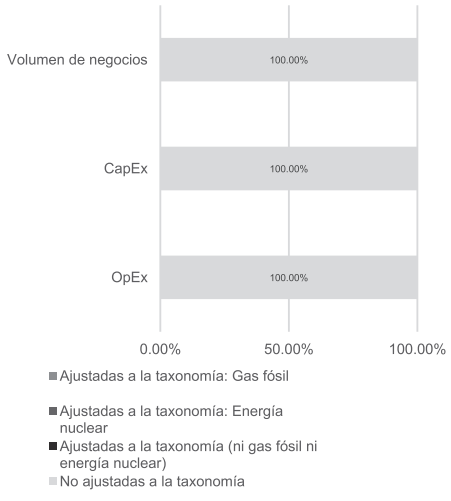
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transición facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica.

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

Como resultado de la estrategia de inversión, el Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la Taxonomía de la UE. Por lo tanto, a finales de febrero de 2024, el 32,2 % de la cartera del Fondo estaba formada por inversiones con un objetivo ambiental no ajustado a la Taxonomía de la UE.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

La proporción de inversiones socialmente sostenibles fue del 14,6 %.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

La proporción de inversiones en «N.º 2 Otros» era del 7,6 % e incluía el efectivo mantenido en depósito y los instrumentos derivados utilizados para la cobertura, así como los derivados para los que no había salvaguardias ambientales o sociales mínimas.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

1. El Fondo no invirtió en los umbrales de ingresos establecidos, tal y como se describe en el prospecto, para las siguientes industrias:

- Armas convencionales y controvertidas
- Tabaco
- Juegos de azar
- Entretenimiento para adultos

2. El gestor de inversiones utilizó su sistema de calificación patentado y la investigación fundamental para evaluar cómo una empresa gestiona los riesgos y las oportunidades de ESG, incluida la buena gobernanza. El sistema de calificación constaba de cuatro niveles de calificación: AAA, AA, A y B, que se asignaban a las empresas en función de su estrategia de sostenibilidad y rendimiento en las cuestiones ESG clave. Se calificaron todas las empresas del Fondo. La distribución de la calificación del Fondo a 29 de febrero de 2024 era:

AAA: 16 %

AA: 45 %

A: 31 %

B: 0 %

3. El Gestor de Inversiones colaboró constantemente con las empresas de su cartera. El compromiso ESG en ClearBridge solía tener dos objetivos que se solapaban:

- Análisis: Comprender mejor las cuestiones ESG que podían influir en la tesis de inversión.
- Incidencia: Alentar cambios específicos en la empresa que podrían influir positivamente el mundo real.

4. El Fondo no invirtió en empresas que infringían uno o varios de los diez principios de las cuatro áreas cubiertas por el PMNU (derechos humanos, trabajo, medioambiente y lucha contra la corrupción).

5. Los activos de los fondos son objeto de seguimiento y control para detectar el deterioro o la mejora de los factores ambientales y sociales.

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica.

FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
5493007B7CQP4E08O434

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 83,84% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☒ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

Para cumplir con las características ambientales o sociales promovidas por el producto financiero, el Fondo incluyó inversiones en empresas:

- Que están reduciendo y gestionando sus emisiones de carbono.
- Con una exposición limitada o nula a la industria de los combustibles fósiles.
- Con un enfoque en el uso eficiente de la energía y del agua.
- Que están limitando la contaminación y gestionando el riesgo para la biodiversidad.
- Con un buen historial en materia de derechos humanos y asuntos relacionados con los empleados.
- Con ninguna exposición a armas controvertidas.

No todas las participaciones en el Fondo promovieron todas las características. Estos factores se consideraron como parte del análisis de cada empresa y se incorporaron al análisis de inversión.

No se han utilizado instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Al final del período de referencia, el 84 % del Fondo se mantenía en inversiones sostenibles, tal y como se define en el marco propio del gestor de inversiones, basado en los Objetivos de Desarrollo Sostenible de las Naciones Unidas (ODS).

Se tuvieron en cuenta y se midieron los 14 indicadores obligatorios de las PIA y dos indicadores adicionales. Consulte los valores divulgados en la sección «¿Cómo tuvo en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?».

Al final del período, aproximadamente el 60 % del valor liquidativo (NAV) de la cartera se invirtió en empresas que habían aprobado objetivos en el marco de la Iniciativa de objetivos basados en la ciencia, con un 22 % adicional invertido en empresas comprometidas con el establecimiento de objetivos durante los próximos dos años.

Durante el período, el equipo de gestión del Fondo realizó siete compromisos sobre temas ambientales, sociales y de gobernanza (ESG) con el objetivo de influir en el comportamiento. Abarcaron temas como la composición de la junta y la

remuneración de los consejeros. Al final del año, los compromisos se encontraban en las etapas de finalización que se muestran a continuación.

Además, el gestor de inversiones empleó parámetros de datos externos (p. ej., MSCI), entre los que se incluye la huella de carbono, la puntuación ESG y su investigación interna (en particular, el análisis de los costes del carbono y los factores de riesgo de esclavitud moderna) como insumos para fundamentar su análisis y sus calificaciones internas de riesgo de gobernanza y sostenibilidad, que se utilizaron como base para la selección de valores, las exclusiones y el proceso de colaboración.

De acuerdo con nuestra Política de ampliación y compromiso climático, hemos clasificado las empresas en nuestra clasificación interna con respecto al cumplimiento de las emisiones netas de valor cero. Esto aumentará y aportará más información a los clientes, además de a los activos comprometidos que tienen objetivos específicos basados en la adopción de objetivos basados en la ciencia. Para este Fondo, la distribución de la cartera entre esas categorías es la siguiente:

KPI de sostenibilidad Nombre	Valor
Interacciones: 1. Contacto con la empresa para comentar los problemas	0,00%
Interacciones: 2. La empresa acepta la interacción	14,00%
Interacciones: 3. Se debaten los problemas pertinentes	71,00%
Interacciones: 4. La empresa elabora un plan para abordar los problemas	14,00%
Interacciones: 5. La empresa soluciona el problema	0,00%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: conseguir unas emisiones netas de valor cero	0,00%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ajustado al objetivo de emisiones netas de valor cero	0,00%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ajustándose al objetivo de emisiones netas de valor cero	59,70%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: compromiso adquirido	22,10%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: primeras acciones en relación con el cambio climático	9,60%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ninguna medida adoptada	8,60%

¿...y en comparación con períodos anteriores?

En comparación con el ejercicio anterior, no hemos observado ningún cambio en la proporción de valor liquidativo del Fondo invertido en empresas con un objetivo basado en la ciencia, que era del 60 % a finales del ejercicio anterior, y hemos observado un aumento en la proporción de empresas que se han comprometido a establecer objetivos basados en la ciencia del 7 % al 22 %.

Hemos observado un aumento en los compromisos sobre temas ambientales, sociales y de gobernanza (ESG) con el objetivo de influir en el comportamiento en comparación con el trimestre anterior, de 5 a 7. Al final del año, los compromisos se encontraban en las etapas de finalización que se muestran a continuación.

	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
KPI de sostenibilidad Nombre	Valor	Valor
Interacciones: 1. Contacto con la empresa para comentar los problemas	0,00%	40,00%
Interacciones: 2. La empresa acepta la interacción	14,00%	0,00%
Interacciones: 3. Se debaten los problemas pertinentes	71,00%	0,00%
Interacciones: 4. La empresa elabora un plan para abordar los problemas	14,00%	40,00%
Interacciones: 5. La empresa soluciona el problema	0,00%	20,00%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: conseguir unas emisiones netas de valor cero	0,00%	N/A
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ajustado al objetivo de emisiones netas de valor cero	0,00%	N/A
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ajustándose al objetivo de emisiones netas de valor cero	59,70%	N/A
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: compromiso adquirido	22,10%	N/A
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: primeras acciones en relación con el cambio climático	9,60%	N/A

	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
KPI de sostenibilidad Nombre	**Valor**	**Valor**
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ninguna medida adoptada	8,60%	N/A

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	**Unidad de medida**	**Valor**	**Cobertura**	**Valor**	**Cobertura**
Emisiones de GEI: Emisiones totales EUR	Toneladas de CO2eq	8 886,22	99,38%	8 716,25	99,49%
Huella de carbono EUR	Toneladas de CO2eq/millón de euros invertidos	65,92	99,38%	67,27	99,49%
Intensidad de GEI EUR	Toneladas de CO2eq/millón de euros de beneficios	358,02	99,38%	431,12	99,49%
Exposición frente a empresas activas en el sector de los combustibles fósiles	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	99,38%	0,00%	99,49%
Porcentaje de consumo y producción de energías no renovables.	Porcentaje invertido del Fondo	57,73%	83,94%	65,03%	85,02%
Intensidad de consumo de energía: Agricultura EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	92,25%	0,00	93,86%
Intensidad de consumo de energía: Minería EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	92,25%	0,00	93,86%
Intensidad de consumo de energía: Fabricación EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,31	92,25%	0,34	93,86%
Intensidad de consumo de energía: Electricidad EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	92,25%	0,00	93,86%
Intensidad de consumo de energía: Agua EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	92,25%	0,00	93,86%
Intensidad de consumo de energía: Construcción EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	92,25%	0,00	93,86%
Intensidad de consumo de energía: Comercio y vehículos EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,02	92,25%	0,02	93,86%

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	**Unidad de medida**	**Valor**	**Cobertura**	**Valor**	**Cobertura**
Intensidad de consumo de energía: Transporte y logística EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	92,25%	0,00	93,86%
Intensidad de consumo de energía: Sector inmobiliario EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	92,25%	0,00	93,86%
Actividades que afectan negativamente a zonas sensibles en cuanto a la biodiversidad	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	99,38%	0,00%	99,49%
Emisiones al agua EUR	Toneladas métricas EUR	0,00	0,00%	1,01	10,62%
Residuos peligrosos EUR	Toneladas métricas EUR	0,05	43,01%	0,06	36,29%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	99,38%	0,00%	99,49%
Ausencia de procesos y mecanismos de cumplimiento para realizar un seguimiento del cumplimiento de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	43,22%	99,38%	52,33%	99,12%
Diferencias salariales entre hombres y mujeres sin ajustar	Porcentaje invertido del Fondo	12,16%	37,97%	11,75%	20,44%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	35,84%	99,38%	32,86%	99,49%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	99,38%	0,00%	99,49%

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

Las inversiones sostenibles del Fondo comprendían valores de renta variable emitidos por empresas que contribuyeron, a través de sus productos o servicios, a los objetivos ambientales o sociales de un subconjunto relevante de metas subyacentes a los 17 ODS.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

Además de identificar posibles inversiones sostenibles mediante la asignación de empresas a un subconjunto específico de metas de los ODS, como se ha detallado anteriormente, las posibles empresas participadas estaban sujetas a la evaluación del principio DNSH que se llevaba a cabo de dos maneras:

1. Una evaluación del cumplimiento de las normas globales, basada en los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU), y las controversias relacionadas con los demás aspectos ambientales de los indicadores de las PIA.

2. Una evaluación del principio de DNSH en relación con los factores relacionados con el cambio climático destacados por los indicadores de las PIA, incluidas áreas como la exposición del negocio a la extracción de combustibles fósiles, así como una huella de carbono elevada y no gestionada en una industria de alta emisión.

Al evaluar el principio de DNSH relacionados con el cambio climático, el gestor de inversiones también tuvo en cuenta la naturaleza de las operaciones de una empresa, así como la existencia de controversias o señales de los indicadores de las PIA. Para cada agrupación de indicadores de las PIA, el gestor de inversiones evaluó la importancia de cada indicador de las PIA y la existencia de un posible daño significativo. Esta evaluación se llevó a cabo mediante un análisis propio.Los resultados de la evaluación del principio de DNSH pueden haber influido en las calificaciones de riesgo de gobernanza y sostenibilidad asignadas por el gestor de inversiones, aunque la evaluación del DNSH está diseñada para funcionar como un proceso paralelo a las calificaciones de riesgo con el fin de cumplir el compromiso de realizar «inversiones sostenibles» en el marco del SFDR.El resultado clave de la evaluación del DNSH es determinar si existía alguna evidencia de daño significativo que excluyese una inversión de ser considerada una inversión sostenible.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

El gestor de inversiones tuvo en cuenta los 14 indicadores obligatorios de las PIA y dos indicadores adicionales en su gestión del Fondo. Los dos indicadores adicionales eran:

- medioambientales, esto es, inversiones en empresas sin iniciativas de reducción de emisiones de carbono;
- sociales, esto es, la falta de una política de derechos humanos.

El análisis de las empresas por parte del gestor de inversiones tuvo en cuenta estos factores y si identificaban posibles impactos adversos importantes, se pondría en contacto con las empresas. De acuerdo con los requisitos específicos del SFDR, el gestor de inversiones también informó sobre los indicadores de las PIA utilizando datos de la empresa o sustitutos cuando estos no estaban disponibles.

Para obtener más información sobre cómo el análisis de las empresas llevado a cabo por el gestor de inversiones tuvo en cuenta estos factores, consulte el apartado «¿Cómo tuvo en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?».

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

Todas las posibles inversiones sostenibles identificadas estaban sujetas a un análisis ESG más amplio del gestor de inversiones, que examinó la gestión, la cultura y el riesgo social y ambiental. Este análisis se enmarcaba en las líneas directrices de la OCDE para empresas multinacionales y el gestor de inversiones tenía un enfoque adicional específico sobre el riesgo de explotación social enmarcado en los Principios Rectores de la ONU sobre Empresas y Derechos Humanos.

El PMNU (sobre el que el Fondo tiene criterios vinculantes) establece 10 principios que fijan las responsabilidades mínimas en los ámbitos de los derechos humanos, el trabajo, el medioambiente y la lucha contra la corrupción, según se desprende de los convenios establecidos.

Existe un importante solapamiento entre los principios del PMNU y las Directrices de la OCDE que se recogen de forma exhaustiva en la evaluación de los PMNU del gestor de inversiones. Otros instrumentos multilaterales citados en las directrices también son componentes de las directrices de la OCDE, a saber, los Principios Fundamentales de la OIT (Organización Internacional del Trabajo) y la Declaración Universal de los Derechos Humanos. Estos cubren de forma efectiva las posibles controversias relacionadas con los pilares clave de la OCDE: derechos humanos, trabajo, medioambiente, lucha contra la corrupción y protección del consumidor.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.

¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Los factores de sostenibilidad pueden tener un impacto en las empresas en las que invierte el Fondo, y el gestor de inversiones también reconoce que las propias empresas pueden tener un impacto adverso en, por ejemplo, el medioambiente, sus empleados o las comunidades en las que operan. Estos impactos adversos incluyen, sin limitación, la generación de emisiones de gases de efecto invernadero (GEI) y otras formas de contaminación o posibles incumplimientos del PMNU. El análisis de las empresas por parte del gestor de inversiones tuvo en cuenta estos factores y, cuando identifica posibles impactos adversos importantes, interactuó y se comprometió con las empresas, tal y como se establecía con más detalle en la Política de gestión y compromiso del gestor de inversiones. De acuerdo con los requisitos específicos del SFDR, el gestor de inversiones también informó sobre los indicadores del PAI utilizando datos de la empresa o sustitutos cuando estos no estaban disponibles.

El análisis de las PIA se incorporó a la diligencia debida del gestor de inversiones sobre cada empresa. La evaluación de las 14 PIA obligatorias y las dos PIA adicionales se agrupan en seis áreas clave para evaluar la importancia. No todas las PIA eran importantes para todas las empresas. El gestor de inversiones evaluó si alguna de las seis áreas era importante para la empresa en la que se invertía y, de ser así, incorporaba estas áreas en sus calificaciones de riesgo, en su tesis de inversión y, si era pertinente, en la actividad de compromiso planificada.

Las seis agrupaciones clave de los PAI son las siguientes:

- Emisiones y gestión del carbono (PAI núm. 1 [Emisiones de GEI], PAI núm. 2 [Huella de carbono] y PAI núm. 3 [Intensidad de GEI de las empresas participadas], así como el PAI opcional sobre empresas sin iniciativas de reducción de emisiones de carbono).
- Exposición a empresas del sector de los combustibles fósiles (PAI núm. 4 (Exposición a empresas del sector de los combustibles fósiles)).
- Eficiencia energética e hídrica (PAI n.° 5 [Porcentaje de consumo y producción de energía no renovable] y n.° 6 [Intensidad del consumo de energía por sector de alto impacto climático]).
- Contaminación y biodiversidad (PAI núm. 7 [Actividades que afectan negativamente a las áreas sensibles a la biodiversidad], PAI núm. 8 [Emisiones al agua] y PAI núm. 9 [Relación de residuos peligrosos]).
- Derechos humanos y Asuntos de los empleados (PAI núm. 10-13 [Incumplimientos de las Directrices del PMNU y la OCDE; Falta de procesos y mecanismos de cumplimiento para supervisar el cumplimiento de las Directrices del PMNU y la OCDE; Brecha salarial no ajustada; y Diversidad en el Consejo de Administración], así como un PAI adicional centrado en las empresas que carecen de una política de derechos humanos).
- Exposición a armas controvertidas (PAI núm. 14 (Exposición a armas controvertidas]).

En algunos casos, como la PIA n.º 10 (Incumplimientos del PMNU y de las Directrices de la OCDE), el Fondo tiene criterios vinculantes y no invertirá en empresas calificadas como «fallidas» según el PMNU. De acuerdo con la Política de armas controvertidas del gestor de inversiones, el Fondo no mantendrá empresas con exposición a armas controvertidas.

La información sobre las PIA en los factores de sostenibilidad se puede encontrar en la Política de inversión del responsable.

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Emisiones de GEI: Emisiones totales EUR	Toneladas de CO2eq	8 886,22	99,38%
Huella de carbono EUR	Toneladas de CO2eq/millón de euros invertidos	65,92	99,38%
Intensidad de GEI EUR	Toneladas de CO2eq/millón de euros de beneficios	358,02	99,38%
Exposición frente a empresas activas en el sector de los combustibles fósiles	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	99,38%
Porcentaje de consumo y producción de energías no renovables.	Porcentaje invertido del Fondo	57,73%	83,94%
Intensidad de consumo de energía: Agricultura EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	92,25%
Intensidad de consumo de energía: Minería EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	92,25%
Intensidad de consumo de energía: Fabricación EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,31	92,25%
Intensidad de consumo de energía: Electricidad EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	92,25%
Intensidad de consumo de energía: Agua EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	92,25%
Intensidad de consumo de energía: Construcción EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	92,25%
Intensidad de consumo de energía: Comercio y vehículos EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,02	92,25%
Intensidad de consumo de energía: Transporte y logística EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	92,25%
Intensidad de consumo de energía: Sector inmobiliario EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	92,25%
Actividades que afectan negativamente a zonas sensibles en cuanto a la biodiversidad	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	99,38%
Emisiones al agua EUR	Toneladas métricas EUR	0,00	0,00%

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Residuos peligrosos EUR	Toneladas métricas EUR	0,05	43,01%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	99,38%
Ausencia de procesos y mecanismos de cumplimiento para realizar un seguimiento del cumplimiento de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	43,22%	99,38%
Diferencias salariales entre hombres y mujeres sin ajustar	Porcentaje invertido del Fondo	12,16%	37,97%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	35,84%	99,38%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	99,38%



¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
NVIDIA CORPORATION	Tecnología de la información	9,10%	Estados Unidos
ASML Holding N.V.	Tecnología de la información	5,83%	Países Bajos
MICROSOFT CORPORATION	Tecnología de la información	5,79%	Estados Unidos
LINDE PUBLIC LIMITED COMPANY	Materiales	4,90%	Reino Unido
Ferrari N.V.	Consumo discrecional	4,53%	Italia
MONCLER S.P.A.	Consumo discrecional	4,14%	Italia
L'OREAL SA	Bienes básicos de consumo	4,05%	Francia
Atlas Copco Aktiebolag	Sector industrial	3,99%	Suecia
MASTERCARD INCORPORATED.	Sector financiero	3,74%	Estados Unidos
KINGSPAN GROUP PUBLIC LIMITED COMPANY	Sector industrial	3,72%	Irlanda
COLOPLAST A/S	Sector sanitario	3,05%	Dinamarca
CSL LIMITED	Sector sanitario	2,98%	Australia
Adyen N.V.	Sector financiero	2,93%	Países Bajos
RESMED INC.	Sector sanitario	2,80%	Estados Unidos
ZOETIS INC.	Sector sanitario	2,70%	Estados Unidos

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

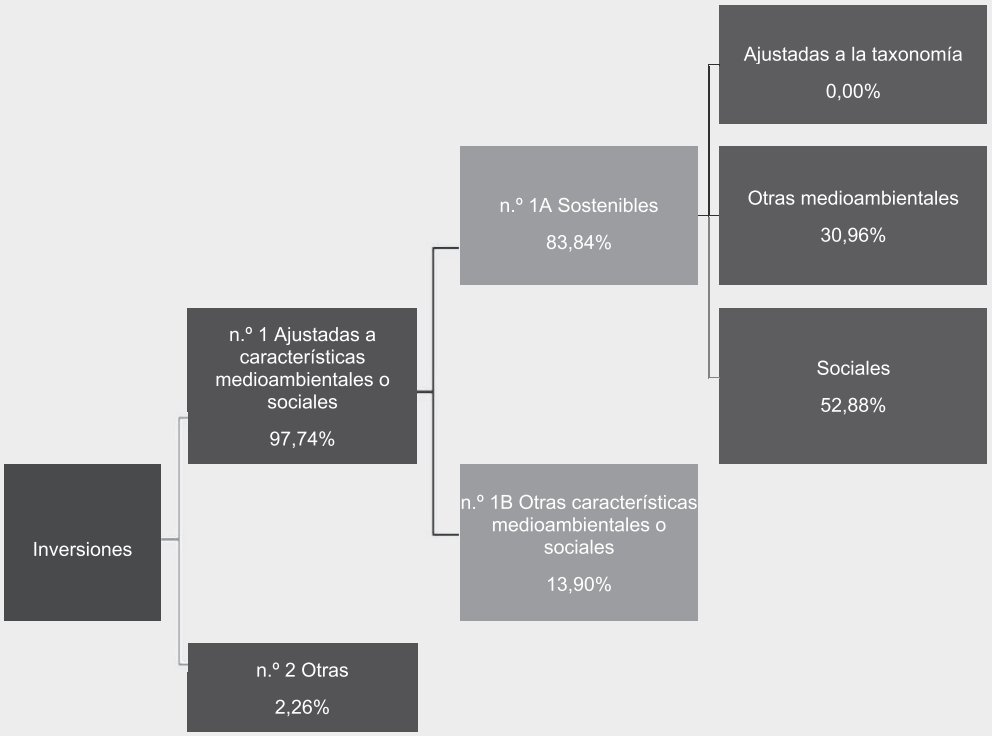
La proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 83,84 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 97,74 % de la cartera del Fondo se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas por este. La parte restante (2,26 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos.

Del segmento de la cartera del Fondo que se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo destinó el 83,84 % de su cartera a inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Sector principal	% de activos
Tecnología de la información	30,77%
Sector sanitario	22,55%
Consumo discrecional	12,93%
Sector industrial	10,18%
Bienes básicos de consumo	8,48%
Sector financiero	7,29%
Materiales	7,20%

Principales subsectores	% de activos
Semiconductores y equipos semiconductores	14,93%
Software	13,39%
Textiles, ropa y artículos de lujo	8,40%
Equipos y suministros sanitarios	7,98%
Productos químicos	7,20%
Servicios financieros	6,67%
Herramientas y servicios de las ciencias biológicas	6,58%
Productos para la construcción	6,18%
Productos de cuidado personal	5,62%
Automóviles	4,53%
Maquinaria	3,99%
Biotecnología	2,98%
Industria farmacéutica	2,70%
Equipos, instrumentos y componentes electrónicos	2,45%
Bebidas	2,36%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental ajustado a la taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

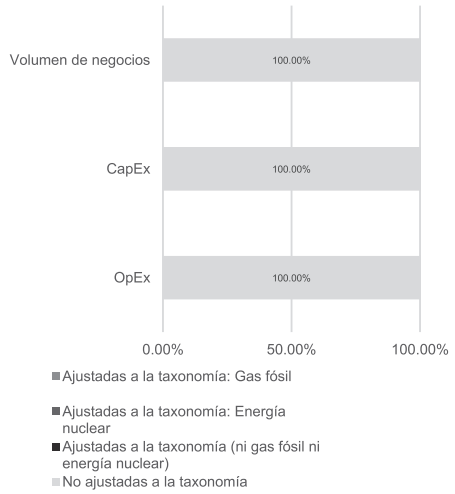
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

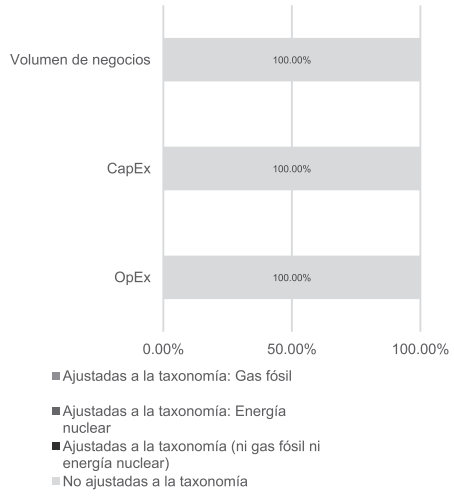
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transición facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica.

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

Como resultado de la estrategia de inversión, el Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la Taxonomía de la UE. Por lo tanto, a finales de febrero de 2023, el 30,96 % de la cartera del Fondo estaba formada por inversiones con un objetivo ambiental no ajustado a la Taxonomía de la UE.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

La proporción de inversiones socialmente sostenibles fue del 52,88 %.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

La proporción de inversiones en «N.º 2 Otros» era del 2,26 % e incluía el efectivo para el que no había salvaguardias ambientales o sociales mínimas.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

- Compromiso con empresas de la cartera en las iniciativas para reducir las emisiones de gases de efecto invernadero.
- Se adhirió a las exclusiones establecidas en el prospecto con respecto a las calificaciones de riesgo de sostenibilidad y gobernanza patentadas, violaciones del Pacto Mundial de las Naciones Unidas, armas controvertidas y todas las actividades comerciales a las que se aplican exclusiones.
- Se consideraron las 14 PIA obligatorias y dos PIA adicionales como parte del análisis de inversión que incluye indicadores sobre eficiencia energética y del agua, contaminación y riesgo de biodiversidad.
- No se incluyeron en el Fondo las empresas que tengan una calificación de riesgo de sostenibilidad o gobernanza igual o superior a 4, en una escala de calificación del 1 (riesgo bajo) al 5 (riesgo alto).

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica.

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
549300REHT50ARB1IW32

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 74,90% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☒ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

Para cumplir con las características ambientales o sociales promovidas por el producto financiero, el Fondo incluyó inversiones en empresas:

- Que están reduciendo y gestionando sus emisiones de carbono.
- Con una exposición limitada o nula a la industria de los combustibles fósiles.
- Con un enfoque en el uso eficiente de la energía y del agua.
- Que están limitando la contaminación y gestionando el riesgo para la biodiversidad.
- Con un buen historial en materia de derechos humanos y asuntos relacionados con los empleados.
- Con ninguna exposición a armas controvertidas.

No todas las participaciones en el Fondo promovieron todas las características. Estos factores se consideraron como parte del análisis de cada empresa y se incorporaron al análisis de inversión.

No se han utilizado instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Al final del período de referencia, el 81 % del Fondo se mantenía en inversiones sostenibles, tal y como se define en el marco propio del gestor de inversiones, basado en los Objetivos de Desarrollo Sostenible de las Naciones Unidas (ODS).

Se tuvieron en cuenta y se midieron los 14 indicadores obligatorios de las PIA y dos indicadores adicionales. Consulte los valores divulgados en la sección «¿Cómo tuvo en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?».

Al final del período, el 16 % del valor liquidativo (NAV) de la cartera se invirtió en empresas que habían aprobado objetivos en el marco de la Iniciativa de objetivos basados en la ciencia, con un 11 % adicional invertido en empresas comprometidas con el establecimiento de objetivos durante los próximos dos años.

Durante el período, el equipo de gestión del Fondo realizó 4 compromisos sobre temas ambientales, sociales y de gobernanza (ESG) con el objetivo de influir en el comportamiento. Abarcaron temas como la remuneración y los incentivos de la dirección,

así como las vías de transición hacia unas emisiones bajas de carbono. Al final del año, los compromisos se encontraban en las etapas de finalización que se muestran a continuación.

Además, el gestor de inversiones empleó parámetros de datos externos (p. ej., MSCI), entre los que se incluye la huella de carbono, la puntuación ESG y su investigación interna (en particular, el análisis de los costes del carbono y los factores de riesgo de esclavitud moderna) como insumos para fundamentar su análisis y sus calificaciones internas de riesgo de gobernanza y sostenibilidad, que se utilizaron como base para la selección de valores, las exclusiones y el proceso de colaboración.

De acuerdo con nuestra Política de ampliación y compromiso climático, hemos clasificado las empresas en nuestra clasificación interna con respecto al cumplimiento de las emisiones netas de valor cero. Esto aumentará y aportará más información a los clientes, además de a los activos comprometidos que tienen objetivos específicos basados en la adopción de objetivos basados en la ciencia. Para este Fondo, la distribución de la cartera entre esas categorías es la siguiente:

KPI de sostenibilidad Nombre	Valor
Interacciones: 1. Contacto con la empresa para comentar los problemas	75,00%
Interacciones: 2. La empresa acepta la interacción	0,00%
Interacciones: 3. Se debaten los problemas pertinentes	25,00%
Interacciones: 4. La empresa elabora un plan para abordar los problemas	0,00%
Interacciones: 5. La empresa soluciona el problema	0,00%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: conseguir unas emisiones netas de valor cero	0,00%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ajustado al objetivo de emisiones netas de valor cero	0,00%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ajustándose al objetivo de emisiones netas de valor cero	20,80%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: compromiso adquirido	11,40%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: primeras acciones en relación con el cambio climático	9,90%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ninguna medida adoptada	57,90%

¿...y en comparación con períodos anteriores?

En comparación con el ejercicio anterior, hemos observado un aumento en la proporción de valor liquidativo del Fondo invertido en empresas con un objetivo basado en la ciencia del 12 % al 16 % a finales del ejercicio anterior, y una disminución en la proporción de empresas que se han comprometido a establecer objetivos basados en la ciencia del 16 % al 11 %. Esto se debe en parte a que las empresas que se comprometieron anteriormente a establecer objetivos dieron el paso final y formalizaron estos compromisos.

Con respecto a los compromisos, hemos observado una disminución en el número de compromisos sobre temas ESG con el objetivo de influir en el comportamiento, de 8 a 4. Al final del año, los compromisos se encontraban en las etapas de finalización que se muestran a continuación.

	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
KPI de sostenibilidad Nombre	Valor	Valor
Interacciones: 1. Contacto con la empresa para comentar los problemas	75,00%	N/A
Interacciones: 2. La empresa acepta la interacción	0,00%	N/A
Interacciones: 3. Se debaten los problemas pertinentes	25,00%	N/A
Interacciones: 4. La empresa elabora un plan para abordar los problemas	0,00%	N/A
Interacciones: 5. La empresa soluciona el problema	0,00%	N/A
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: conseguir unas emisiones netas de valor cero	0,00%	N/A
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ajustado al objetivo de emisiones netas de valor cero	0,00%	N/A
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ajustándose al objetivo de emisiones netas de valor cero	20,80%	N/A
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: compromiso adquirido	11,40%	N/A

	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
KPI de sostenibilidad Nombre	**Valor**	**Valor**
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: primeras acciones en relación con el cambio climático	9,90%	N/A
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ninguna medida adoptada	57,90%	N/A

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	**Unidad de medida**	**Valor**	**Cobertura**	**Valor**	**Cobertura**
Emisiones de GEI: Emisiones totales EUR	Toneladas de CO2eq	14 029,70	96,38%	19 032,27	88,06%
Huella de carbono EUR	Toneladas de CO2eq/millón de euros invertidos	666,45	96,38%	854,37	88,06%
Intensidad de GEI EUR	Toneladas de CO2eq/millón de euros de beneficios	1 103,09	94,62%	1 411,15	88,06%
Exposición frente a empresas activas en el sector de los combustibles fósiles	Porcentaje invertido del Fondo	16,05%	92,50%	15,95%	88,06%
Proporción de producción y consumo de energía no renovable.	Porcentaje invertido del Fondo	79,49%	64,73%	81,00%	80,36%
Intensidad de consumo de energía: Agricultura EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	80,07%	0,00	86,78%
Intensidad de consumo de energía: Minería EUR	GWh por millón EUR de ventas	3,64	80,07%	0,01	86,78%
Intensidad de consumo de energía: Fabricación EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	80,07%	0,00	86,78%
Intensidad de consumo de energía: Electricidad EUR	GWh por millón EUR de ventas	13,25	80,07%	8,92	86,78%
Intensidad de consumo de energía: Agua EUR	GWh por millón EUR de ventas	4,27	80,07%	4,70	86,78%
Intensidad de consumo de energía: Construcción EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,10	80,07%	0,05	86,78%
Intensidad de consumo de	GWh por millón EUR de ventas	0,00	80,07%	0,00	86,78%

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura	Valor	Cobertura
energía: Comercio y vehículos EUR					
Intensidad de consumo de energía: Transporte y logística EUR	GWh por millón EUR de ventas	1,49	80,07%	1,06	86,78%
Intensidad de consumo de energía: Sector inmobiliario EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,36	80,07%	0,24	86,78%
Actividades que afectan negativamente a zonas sensibles en cuanto a la biodiversidad	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	92,50%	0,00%	88,06%
Emisiones al agua EUR	Toneladas métricas EUR	0,02	1,33%	0,00	0,00%
Residuos peligrosos EUR	Toneladas métricas EUR	0,19	37,88%	0,34	28,29%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	96,38%	0,00%	95,90%
Ausencia de procesos y mecanismos de cumplimiento para realizar un seguimiento del cumplimiento de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	65,18%	92,50%	56,51%	84,70%
Brecha salarial entre hombres y mujeres, sin ajustar	Porcentaje invertido del Fondo	9,84%	2,80%	17,86%	2,48%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	28,83%	92,50%	28,83%	88,06%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	92,50%	0,00%	88,06%

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

Las inversiones sostenibles del Fondo comprendían valores de renta variable emitidos por empresas que contribuyeron, a través de sus productos o servicios, a los objetivos ambientales o sociales de un subconjunto relevante de metas subyacentes a los 17 ODS.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

Además de identificar posibles inversiones sostenibles mediante la asignación de empresas a un subconjunto específico de metas de los ODS, como se ha detallado anteriormente, las posibles empresas participadas estaban sujetas a la evaluación del principio DNSH que se llevaba a cabo de dos maneras:

1. Una evaluación del cumplimiento de las normas globales, basada en los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU), y las controversias relacionadas con los demás aspectos ambientales de los indicadores de las PIA.

2. Una evaluación del principio de DNSH en relación con los factores relacionados con el cambio climático destacados por los indicadores de las PIA, incluidas áreas como la exposición del negocio a la extracción de combustibles fósiles, así como una huella de carbono elevada y no gestionada en una industria de alta emisión.

Al evaluar el principio de DNSH relacionados con el cambio climático, el gestor de inversiones también tuvo en cuenta la naturaleza de las operaciones de una empresa, así como la existencia de controversias o señales de los indicadores de las PIA. Para cada agrupación de indicadores de las PIA, el gestor de inversiones evaluó la importancia de cada indicador de las PIA y la existencia de un posible daño significativo. Esta evaluación se llevó a cabo mediante un análisis propio.Los resultados de la evaluación del principio de DNSH pueden haber influido en las calificaciones de riesgo de gobernanza y sostenibilidad asignadas por el gestor de inversiones, aunque la evaluación del DNSH está diseñada para funcionar como un proceso paralelo a las calificaciones de riesgo con el fin de cumplir el compromiso de realizar «inversiones sostenibles» en el marco del SFDR.El resultado clave de la evaluación del DNSH es determinar si existía alguna evidencia de daño significativo que excluyese una inversión de ser considerada una inversión sostenible.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

El gestor de inversiones tuvo en cuenta los 14 indicadores obligatorios de las PIA y dos indicadores adicionales en su gestión del Fondo. Los dos indicadores adicionales eran:

- medioambientales, esto es, inversiones en empresas sin iniciativas de reducción de emisiones de carbono;
- sociales, esto es, la falta de una política de derechos humanos.

El análisis de las empresas por parte del gestor de inversiones tuvo en cuenta estos factores y si identificaban posibles impactos adversos importantes, se pondría en contacto con las empresas. De acuerdo con los requisitos específicos del SFDR, el gestor de inversiones también informó sobre los indicadores de las PIA utilizando datos de la empresa o sustitutos cuando estos no estaban disponibles.

Para obtener más información sobre cómo el análisis de las empresas llevado a cabo por el gestor de inversiones tuvo en cuenta estos factores, consulte el apartado «¿Cómo tuvo en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?».

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

Todas las posibles inversiones sostenibles identificadas estaban sujetas a un análisis ESG más amplio del gestor de inversiones, que examinó la gestión, la cultura y el riesgo social y ambiental. Este análisis se enmarcaba en las líneas directrices de la OCDE para empresas multinacionales y el gestor de inversiones tenía un enfoque adicional específico sobre el riesgo de explotación social enmarcado en los Principios Rectores de la ONU sobre Empresas y Derechos Humanos.

El PMNU (sobre el que el Fondo tiene criterios vinculantes) establece 10 principios que fijan las responsabilidades mínimas en los ámbitos de los derechos humanos, el trabajo, el medioambiente y la lucha contra la corrupción, según se desprende de los convenios establecidos.

Existe un importante solapamiento entre los principios del PMNU y las Directrices de la OCDE que se recogen de forma exhaustiva en la evaluación de los PMNU del gestor de inversiones. Otros instrumentos multilaterales citados en las directrices también son componentes de las directrices de la OCDE, a saber, los Principios Fundamentales de la OIT (Organización Internacional del Trabajo) y la Declaración Universal de los Derechos Humanos. Estos cubren de forma efectiva las posibles controversias relacionadas con los pilares clave de la OCDE: derechos humanos, trabajo, medioambiente, lucha contra la corrupción y protección del consumidor.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.



¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Los factores de sostenibilidad pueden tener un impacto en las empresas en las que invierte el Fondo, y el gestor de inversiones también reconoce que las propias empresas pueden tener un impacto adverso en, por ejemplo, el medioambiente, sus empleados o las comunidades en las que operan. Estos impactos adversos incluyen, sin limitación, la generación de emisiones de gases de efecto invernadero (GEI) y otras formas de contaminación o posibles incumplimientos del PMNU. El análisis de las empresas por parte del gestor de inversiones tuvo en cuenta estos factores y, cuando identifica posibles impactos adversos importantes, interactuó y se comprometió con las empresas, tal y como se establecía con más detalle en la Política de gestión y compromiso del gestor de inversiones. De acuerdo con los requisitos específicos del SFDR, el gestor de inversiones también informó sobre los indicadores del PAI utilizando datos de la empresa o sustitutos cuando estos no estaban disponibles.

El análisis de las PIA se incorporó a la diligencia debida del gestor de inversiones sobre cada empresa. La evaluación de las 14 PIA obligatorias y las dos PIA adicionales se agrupan en seis áreas clave para evaluar la importancia. No todas las PIA eran importantes para todas las empresas. El gestor de inversiones evaluó si alguna de las seis áreas era importante para la empresa en la que se invertía y, de ser así, incorporaba estas áreas en sus calificaciones de riesgo, en su tesis de inversión y, si era pertinente, en la actividad de compromiso planificada.

Las seis agrupaciones clave de los PAI son las siguientes:

- Emisiones y gestión del carbono (PAI núm. 1 [Emisiones de GEI], PAI núm. 2 [Huella de carbono] y PAI núm. 3 [Intensidad de GEI de las empresas participadas], así como el PAI opcional sobre empresas sin iniciativas de reducción de emisiones de carbono).
- Exposición a empresas del sector de los combustibles fósiles (PAI núm. 4 (Exposición a empresas del sector de los combustibles fósiles)).
- Eficiencia energética e hídrica (PAI n.° 5 [Porcentaje de consumo y producción de energía no renovable] y n.° 6 [Intensidad del consumo de energía por sector de alto impacto climático]).
- Contaminación y biodiversidad (PAI núm. 7 [Actividades que afectan negativamente a las áreas sensibles a la biodiversidad], PAI núm. 8 [Emisiones al agua] y PAI núm. 9 [Relación de residuos peligrosos]).
- Derechos humanos y Asuntos de los empleados (PAI núm. 10-13 [Incumplimientos de las Directrices del PMNU y la OCDE; Falta de procesos y mecanismos de cumplimiento para supervisar el cumplimiento de las Directrices del PMNU y la OCDE; Brecha salarial no ajustada; y Diversidad en el Consejo de Administración], así como un PAI adicional centrado en las empresas que carecen de una política de derechos humanos).
- Exposición a armas controvertidas (PAI núm. 14 (Exposición a armas controvertidas]).

En algunos casos, como la PIA n.º 10 (Incumplimientos del PMNU y de las Directrices de la OCDE), el Fondo tiene criterios vinculantes y no invertirá en empresas calificadas como «fallidas» según el PMNU. De acuerdo con la Política de armas controvertidas del gestor de inversiones, el Fondo no mantendrá empresas con exposición a armas controvertidas.

La información sobre las PIA en los factores de sostenibilidad se puede encontrar en la Política de inversión del responsable.

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Emisiones de GEI: Emisiones totales EUR	Toneladas de CO2eq	14 029,70	96,38%
Huella de carbono EUR	Toneladas de CO2eq/millón de euros invertidos	666,45	96,38%
Intensidad de GEI EUR	Toneladas de CO2eq/millón de euros de beneficios	1 103,09	94,62%
Exposición frente a empresas activas en el sector de los combustibles fósiles	Porcentaje invertido del Fondo	16,05%	92,50%
Proporción de producción y consumo de energía no renovable.	Porcentaje invertido del Fondo	79,49%	64,73%
Intensidad de consumo de energía: Agricultura EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	80,07%
Intensidad de consumo de energía: Minería EUR	GWh por millón EUR de ventas	3,64	80,07%
Intensidad de consumo de energía: Fabricación EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	80,07%
Intensidad de consumo de energía: Electricidad EUR	GWh por millón EUR de ventas	13,25	80,07%
Intensidad de consumo de energía: Agua EUR	GWh por millón EUR de ventas	4,27	80,07%
Intensidad de consumo de energía: Construcción EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,10	80,07%

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Intensidad de consumo de energía: Comercio y vehículos EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	80,07%
Intensidad de consumo de energía: Transporte y logística EUR	GWh por millón EUR de ventas	1,49	80,07%
Intensidad de consumo de energía: Sector inmobiliario EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,36	80,07%
Actividades que afectan negativamente a zonas sensibles en cuanto a la biodiversidad	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	92,50%
Emisiones al agua EUR	Toneladas métricas EUR	0,02	1,33%
Residuos peligrosos EUR	Toneladas métricas EUR	0,19	37,88%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	96,38%
Ausencia de procesos y mecanismos de cumplimiento para realizar un seguimiento del cumplimiento de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	65,18%	92,50%
Brecha salarial entre hombres y mujeres, sin ajustar	Porcentaje invertido del Fondo	9,84%	2,80%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	28,83%	92,50%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	92,50%

¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
AURIZON HOLDINGS LIMITED	Sector industrial	6,53%	Australia
Link Real Estate Investment Trust	Sector inmobiliario	5,89%	Hong Kong
SCENTRE GROUP	Sector inmobiliario	5,49%	Australia
Embassy Office Parks REIT	Sector inmobiliario	5,29%	India
GUANGDONG INVESTMENT LIMITED	Servicios públicos	5,07%	Hong Kong
CHORUS LIMITED	Servicios de comunicación	4,38%	Nueva Zelanda
POWER GRID CORPORATION OF INDIA LIMITED	Servicios públicos	4,34%	India
CHARTER HALL RETAIL REIT	Sector inmobiliario	4,11%	Australia
CLP HOLDINGS LIMITED	Servicios públicos	3,69%	Hong Kong
Fortune Real Estate Investment Trust	Sector inmobiliario	3,28%	Hong Kong
Vicinity Centres	Sector inmobiliario	3,17%	Australia
AGL ENERGY LIMITED	Servicios públicos	3,17%	Australia
SCB X PUBLIC COMPANY LIMITED	Sector financiero	2,93%	Tailandia
CapitaLand India Trust	Sector inmobiliario	2,80%	Singapur
Yuexiu Transport infrastructure Limited	Sector industrial	2,78%	Hong Kong

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

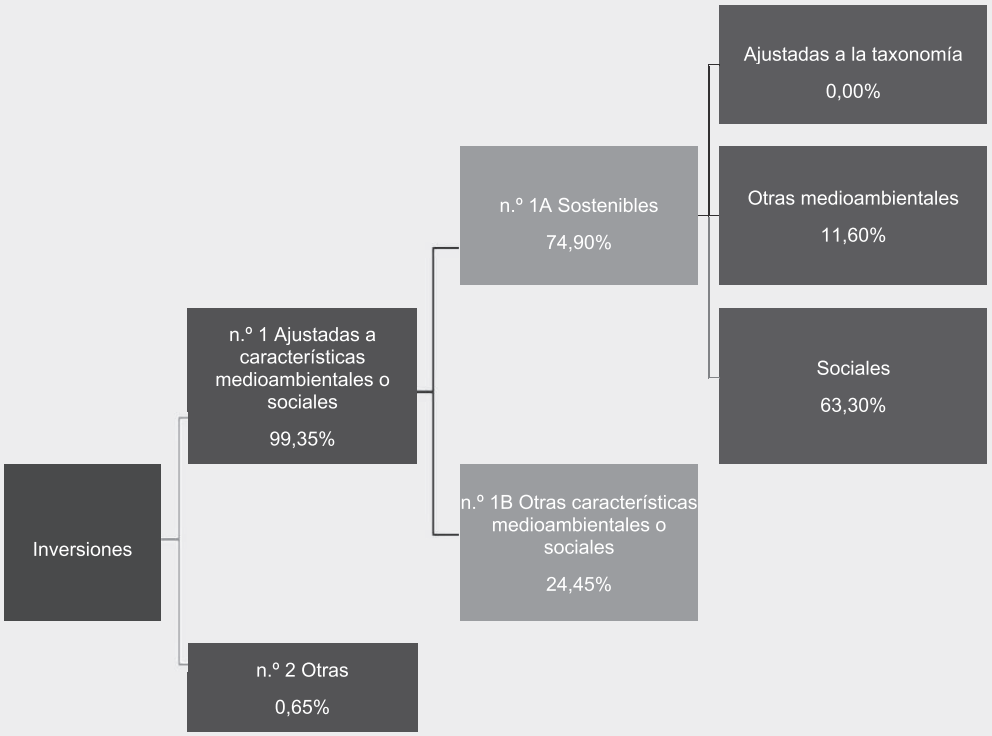
La proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 74,90 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 99,35 % de la cartera del Fondo se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas por este. La parte restante (0,65 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos.

Del segmento de la cartera del Fondo que se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo destinó el 74,90 % de su cartera a inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Sector principal	% de activos
Sector inmobiliario	45,17%
Servicios públicos	24,07%
Sector industrial	15,86%
Servicios de comunicación	9,88%
Sector financiero	2,93%

Principales subsectores	% de activos
REIT comerciales	27,77%
Servicios públicos eléctricos	11,77%
Servicios de telecomunicaciones diversificados	9,88%
Infraestructura del transporte	9,33%
Transporte por tierra	6,53%
Fondos de inversión inmobiliaria diversificados	5,39%
REIT de oficinas	5,29%
Servicios de suministro de agua	5,07%
Gestión y desarrollo del mercado inmobiliario	4,30%
Servicios públicos múltiples	3,17%
Servicios de gas	3,02%
Servicios financieros	2,93%
REIT industriales	2,42%
Productores de energía y electricidad renovable independientes	1,04%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental ajustado a la taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

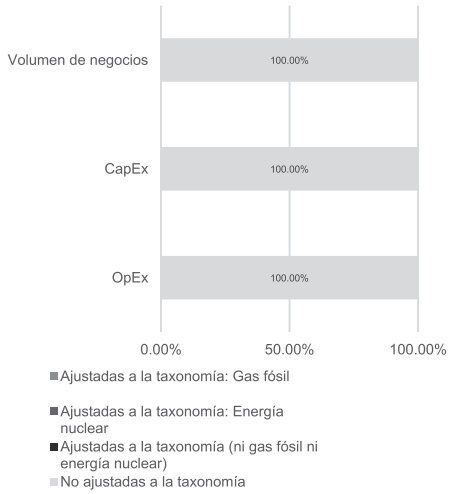
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

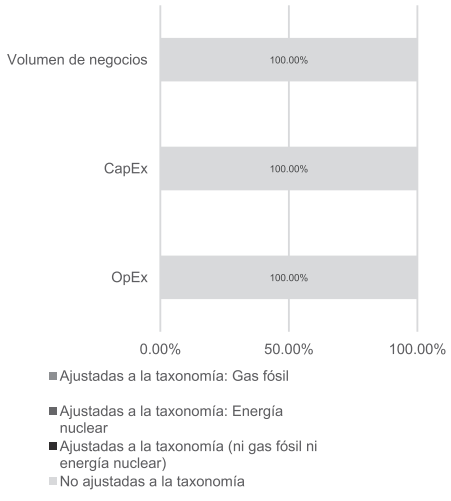
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transició facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica.

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

Como resultado de la estrategia de inversión, el Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la Taxonomía de la UE. Por lo tanto, a finales de febrero de 2023, el 11,60 % de la cartera del Fondo estaba formada por inversiones con un objetivo ambiental no ajustado a la Taxonomía de la UE.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

La proporción de inversiones socialmente sostenibles fue del 63,30 %.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

La proporción de inversiones en «N.º 2 Otros» era del 0,65 % e incluía el efectivo para el que no había salvaguardias ambientales o sociales mínimas.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

- Hablamos con las empresas de la cartera sobre la estructura actual de la remuneración variable que podría dar lugar a resultados deficientes para los accionistas, y sobre nuestras preferencias al respecto. Los gestores de carteras también hablaron sobre la adopción de vías de transición hacia unas emisiones de carbono más claras y sobre otra información ESG en algunas empresas de la cartera.
- Se adhirió a las exclusiones establecidas en el prospecto con respecto a las calificaciones de riesgo de sostenibilidad patentadas, violaciones del Pacto Mundial de las Naciones Unidas, armas controvertidas y otras actividades comerciales excluidas.
- Se consideraron las 14 PIA obligatorias y dos PIA adicionales como parte del análisis de inversión que incluye indicadores sobre eficiencia energética y del agua, contaminación y riesgo de biodiversidad.
- No se incluyeron en el Fondo las empresas que tengan una calificación de riesgo de sostenibilidad de 5 en una escala de calificación del 1 (riesgo bajo) al 5 (riesgo alto).
- El Fondo mantuvo una calificación ESG de la cartera superior a la del universo de inversión del Fondo, que son valores de renta variable situados en países de mercados desarrollados o emergentes en los que el país estaba representado en el MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index.

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica.

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
549300Y8TPNIB3NAMF62

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 72,55% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☒ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

Para cumplir con las características ambientales o sociales promovidas por el producto financiero, el Fondo incluyó inversiones en empresas:

- Que están reduciendo y gestionando sus emisiones de carbono.
- Con una exposición limitada o nula a la industria de los combustibles fósiles.
- Con un enfoque en el uso eficiente de la energía y del agua.
- Que están limitando la contaminación y gestionando el riesgo para la biodiversidad.
- Con un buen historial en materia de derechos humanos y asuntos relacionados con los empleados.
- Con ninguna exposición a armas controvertidas.

No todas las participaciones en el Fondo promovieron todas las características. Estos factores se consideraron como parte del análisis de cada empresa y se incorporaron al análisis de inversión.

No se han utilizado instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Al final del período de referencia, el 72 % del Fondo se mantenía en inversiones sostenibles, tal y como se define en el marco propio del gestor de inversiones, basado en los Objetivos de Desarrollo Sostenible de las Naciones Unidas (ODS).

Se tuvieron en cuenta y se midieron los 14 indicadores obligatorios de las PIA y dos indicadores adicionales. Consulte los valores divulgados en la sección «¿Cómo tuvo en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?».

Al final del período, aproximadamente el 17 % del valor liquidativo (NAV) de la cartera se invirtió en empresas que habían aprobado objetivos en el marco de la Iniciativa de objetivos basados en la ciencia, con un 11 % adicional invertido en empresas comprometidas con el establecimiento de objetivos durante los próximos dos años.

Durante el período, el equipo de gestión del Fondo realizó 90 compromisos sobre temas ambientales, sociales y de gobernanza (ESG) con el objetivo de influir en el comportamiento. Abarcaron temas que incluyen la composición de la junta,

los planes de transición de carbono cero neto de las empresas y la cultura en el lugar de trabajo. Al final del año, los compromisos se encontraban en las etapas de finalización que se muestran a continuación.

Además, el gestor de inversiones empleó parámetros de datos externos (p. ej., MSCI), entre los que se incluye la huella de carbono, la puntuación ESG y su investigación interna (en particular, el análisis de los costes del carbono y los factores de riesgo de esclavitud moderna) como insumos para fundamentar su análisis y sus calificaciones internas de riesgo de gobernanza y sostenibilidad, que se utilizaron como base para la selección de valores, las exclusiones y el proceso de colaboración.

De acuerdo con nuestra Política de ampliación y compromiso climático, hemos clasificado las empresas en nuestra clasificación interna con respecto al cumplimiento de las emisiones netas de valor cero. Esto aumentará y aportará más información a los clientes, además de a los activos comprometidos que tienen objetivos específicos basados en la adopción de objetivos basados en la ciencia. Para este Fondo, la distribución de la cartera entre esas categorías es la siguiente:

KPI de sostenibilidad Nombre	Valor
Interacciones: 1. Contacto con la empresa para comentar los problemas	23,00%
Interacciones: 2. La empresa acepta la interacción	11,00%
Interacciones: 3. Se debaten los problemas pertinentes	53,00%
Interacciones: 4. La empresa elabora un plan para abordar los problemas	9,00%
Interacciones: 5. La empresa soluciona el problema	4,00%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: conseguir unas emisiones netas de valor cero	0,00%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ajustado al objetivo de emisiones netas de valor cero	0,00%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ajustándose al objetivo de emisiones netas de valor cero	17,40%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: compromiso adquirido	11,00%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: primeras acciones en relación con el cambio climático	14,30%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ninguna medida adoptada	57,30%

¿...y en comparación con períodos anteriores?

En comparación con el ejercicio anterior, hemos observado un aumento en la proporción de valor liquidativo del Fondo invertido en empresas con un objetivo basado en la ciencia del 4 % al 1 % a 3 de enero de 2023, y una disminución en la proporción de empresas que se han comprometido a establecer objetivos basados en la ciencia del 20 % al 11 %. Esto se debe principalmente a que las empresas que se comprometieron anteriormente a establecer objetivos dieron el paso final y formalizaron estos compromisos.

En cuanto a los compromisos, hemos observado un aumento de los compromisos en fase inicial y media y una disminución de los compromisos en fase avanzada, ya que seguimos trabajando con las empresas de la cartera en asuntos importantes, algunos de los cuales han llegado a su fin. Consulte el informe anual anterior para ver los valores específicos.

	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
KPI de sostenibilidad Nombre	Valor	Valor
Interacciones: 1. Contacto con la empresa para comentar los problemas	23,00%	4,00%
Interacciones: 2. La empresa acepta la interacción	11,00%	12,00%
Interacciones: 3. Se debaten los problemas pertinentes	53,00%	58,00%
Interacciones: 4. La empresa elabora un plan para abordar los problemas	9,00%	19,00%
Interacciones: 5. La empresa soluciona el problema	4,00%	8,00%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: conseguir unas emisiones netas de valor cero	0,00%	N/A
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ajustado al objetivo de emisiones netas de valor cero	0,00%	N/A
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ajustándose al objetivo de emisiones netas de valor cero	17,40%	N/A
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: compromiso adquirido	11,00%	N/A

	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
KPI de sostenibilidad Nombre	**Valor**	**Valor**
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: primeras acciones en relación con el cambio climático	14,30%	N/A
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ninguna medida adoptada	57,30%	N/A

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	**Unidad de medida**	**Valor**	**Cobertura**	**Valor**	**Cobertura**
Emisiones de GEI: Emisiones totales EUR	Toneladas de CO2eq	11 584,50	97,41%	11 085,00	96,39%
Huella de carbono EUR	Toneladas de CO2eq/millón de euros invertidos	362,44	97,41%	329,97	96,39%
Intensidad de GEI EUR	Toneladas de CO2eq/millón de euros de beneficios	912,40	97,32%	1 004,71	96,39%
Exposición frente a empresas activas en el sector de los combustibles fósiles	Porcentaje invertido del Fondo	6,87%	97,20%	7,95%	96,39%
Proporción de producción y consumo de energía no renovable.	Porcentaje invertido del Fondo	86,53%	75,94%	86,15%	81,90%
Intensidad de consumo de energía: Agricultura EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	81,19%	0,00	87,61%
Intensidad de consumo de energía: Minería EUR	GWh por millón EUR de ventas	1,43	81,19%	1,47	87,61%
Intensidad de consumo de energía: Fabricación EUR	GWh por millón EUR de ventas	1,42	81,19%	3,01	87,61%
Intensidad de consumo de energía: Electricidad EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,52	81,19%	0,00	87,61%
Intensidad de consumo de energía: Agua EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	81,19%	0,00	87,61%
Intensidad de consumo de energía: Construcción EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	81,19%	0,00	87,61%
Intensidad de consumo de	GWh por millón EUR de ventas	0,21	81,19%	0,22	87,61%

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura	Valor	Cobertura
energía: Comercio y vehículos EUR					
Intensidad de consumo de energía: Transporte y logística EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,07	81,19%	0,07	87,61%
Intensidad de consumo de energía: Sector inmobiliario EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	81,19%	0,00	87,61%
Actividades que afectan negativamente a zonas sensibles en cuanto a la biodiversidad	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	97,20%	0,00%	96,39%
Emisiones al agua EUR	Toneladas métricas EUR	0,00	3,34%	0,02	14,67%
Residuos peligrosos EUR	Toneladas métricas EUR	1,07	47,28%	0,45	50,50%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	97,38%	0,00%	96,68%
Ausencia de procesos y mecanismos de cumplimiento para realizar un seguimiento del cumplimiento de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	66,13%	97,20%	74,61%	95,98%
Brecha salarial entre hombres y mujeres, sin ajustar	Porcentaje invertido del Fondo	24,15%	8,73%	25,65%	9,73%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	19,98%	97,12%	18,30%	96,39%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	97,20%	0,00%	96,39%

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

Las inversiones sostenibles del Fondo comprendían valores de renta variable emitidos por empresas que contribuyeron, a través de sus productos o servicios, a los objetivos ambientales o sociales de un subconjunto relevante de metas subyacentes a los 17 ODS.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

Además de identificar posibles inversiones sostenibles mediante la asignación de empresas a un subconjunto específico de metas de los ODS, como se ha detallado anteriormente, las posibles empresas participadas estaban sujetas a la evaluación del principio DNSH que se llevaba a cabo de dos maneras:

1. Una evaluación del cumplimiento de las normas globales, basada en los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU), y las controversias relacionadas con los demás aspectos ambientales de los indicadores de las PIA.

2. Una evaluación del principio de DNSH en relación con los factores relacionados con el cambio climático destacados por los indicadores de las PIA, incluidas áreas como la exposición del negocio a la extracción de combustibles fósiles, así como una huella de carbono elevada y no gestionada en una industria de alta emisión.

Al evaluar el principio de DNSH relacionados con el cambio climático, el gestor de inversiones también tuvo en cuenta la naturaleza de las operaciones de una empresa, así como la existencia de controversias o señales de los indicadores de las PIA. Para cada agrupación de indicadores de las PIA, el gestor de inversiones evaluó la importancia de cada indicador de las PIA y la existencia de un posible daño significativo. Esta evaluación se llevó a cabo mediante un análisis propio.Los resultados de la evaluación del principio de DNSH pueden haber influido en las calificaciones de riesgo de gobernanza y sostenibilidad asignadas por el gestor de inversiones, aunque la evaluación del DNSH está diseñada para funcionar como un proceso paralelo a las calificaciones de riesgo con el fin de cumplir el compromiso de realizar «inversiones sostenibles» en el marco del SFDR.El resultado clave de la evaluación del DNSH es determinar si existía alguna evidencia de daño significativo que excluyese una inversión de ser considerada una inversión sostenible.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

El gestor de inversiones tuvo en cuenta los 14 indicadores obligatorios de las PIA y dos indicadores adicionales en su gestión del Fondo. Los dos indicadores adicionales eran:

- medioambientales, esto es, inversiones en empresas sin iniciativas de reducción de emisiones de carbono;
- sociales, esto es, la falta de una política de derechos humanos.

El análisis de las empresas por parte del gestor de inversiones tuvo en cuenta estos factores y si identificaban posibles impactos adversos importantes, se pondría en contacto con las empresas. De acuerdo con los requisitos específicos del SFDR, el gestor de inversiones también informó sobre los indicadores de las PIA utilizando datos de la empresa o sustitutos cuando estos no estaban disponibles.

Para obtener más información sobre cómo el análisis de las empresas llevado a cabo por el gestor de inversiones tuvo en cuenta estos factores, consulte el apartado «¿Cómo tuvo en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?».

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

Todas las posibles inversiones sostenibles identificadas estaban sujetas a un análisis ESG más amplio del gestor de inversiones, que examinó la gestión, la cultura y el riesgo social y ambiental. Este análisis se enmarcaba en las líneas directrices de la OCDE para empresas multinacionales y el gestor de inversiones tenía un enfoque adicional específico sobre el riesgo de explotación social enmarcado en los Principios Rectores de la ONU sobre Empresas y Derechos Humanos.

El PMNU (sobre el que el Fondo tiene criterios vinculantes) establece 10 principios que fijan las responsabilidades mínimas en los ámbitos de los derechos humanos, el trabajo, el medioambiente y la lucha contra la corrupción, según se desprende de los convenios establecidos.

Existe un importante solapamiento entre los principios del PMNU y las Directrices de la OCDE que se recogen de forma exhaustiva en la evaluación de los PMNU del gestor de inversiones. Otros instrumentos multilaterales citados en las directrices también son componentes de las directrices de la OCDE, a saber, los Principios Fundamentales de la OIT (Organización Internacional del Trabajo) y la Declaración Universal de los Derechos Humanos. Estos cubren de forma efectiva las posibles controversias relacionadas con los pilares clave de la OCDE: derechos humanos, trabajo, medioambiente, lucha contra la corrupción y protección del consumidor.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.



¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Los factores de sostenibilidad pueden tener un impacto en las empresas en las que invierte el Fondo, y el gestor de inversiones también reconoce que las propias empresas pueden tener un impacto adverso en, por ejemplo, el medioambiente, sus empleados o las comunidades en las que operan. Estos impactos adversos incluyen, sin limitación, la generación de emisiones de gases de efecto invernadero (GEI) y otras formas de contaminación o posibles incumplimientos del PMNU. El análisis de las empresas por parte del gestor de inversiones tuvo en cuenta estos factores y, cuando identifica posibles impactos adversos importantes, interactuó y se comprometió con las empresas, tal y como se establecía con más detalle en la Política de gestión y compromiso del gestor de inversiones. De acuerdo con los requisitos específicos del SFDR, el gestor de inversiones también informó sobre los indicadores del PAI utilizando datos de la empresa o sustitutos cuando estos no estaban disponibles.

El análisis de las PIA se incorporó a la diligencia debida del gestor de inversiones sobre cada empresa. La evaluación de las 14 PIA obligatorias y las dos PIA adicionales se agrupan en seis áreas clave para evaluar la importancia. No todas las PIA eran importantes para todas las empresas. El gestor de inversiones evaluó si alguna de las seis áreas era importante para la empresa en la que se invertía y, de ser así, incorporaba estas áreas en sus calificaciones de riesgo, en su tesis de inversión y, si era pertinente, en la actividad de compromiso planificada.

Las seis agrupaciones clave de los PAI son las siguientes:

- Emisiones y gestión del carbono (PAI núm. 1 [Emisiones de GEI], PAI núm. 2 [Huella de carbono] y PAI núm. 3 [Intensidad de GEI de las empresas participadas], así como el PAI opcional sobre empresas sin iniciativas de reducción de emisiones de carbono).
- Exposición a empresas del sector de los combustibles fósiles (PAI núm. 4 (Exposición a empresas del sector de los combustibles fósiles)).
- Eficiencia energética e hídrica (PAI n.° 5 [Porcentaje de consumo y producción de energía no renovable] y n.° 6 [Intensidad del consumo de energía por sector de alto impacto climático]).
- Contaminación y biodiversidad (PAI núm. 7 [Actividades que afectan negativamente a las áreas sensibles a la biodiversidad], PAI núm. 8 [Emisiones al agua] y PAI núm. 9 [Relación de residuos peligrosos]).
- Derechos humanos y Asuntos de los empleados (PAI núm. 10-13 [Incumplimientos de las Directrices del PMNU y la OCDE; Falta de procesos y mecanismos de cumplimiento para supervisar el cumplimiento de las Directrices del PMNU y la OCDE; Brecha salarial no ajustada; y Diversidad en el Consejo de Administración], así como un PAI adicional centrado en las empresas que carecen de una política de derechos humanos).
- Exposición a armas controvertidas (PAI núm. 14 (Exposición a armas controvertidas]).

En algunos casos, como la PIA n.º 10 (Incumplimientos del PMNU y de las Directrices de la OCDE), el Fondo tiene criterios vinculantes y no invertirá en empresas calificadas como «fallidas» según el PMNU. De acuerdo con la Política de armas controvertidas del gestor de inversiones, el Fondo no mantendrá empresas con exposición a armas controvertidas.

La información sobre las PIA en los factores de sostenibilidad se puede encontrar en la Política de inversión del responsable.

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Emisiones de GEI: Emisiones totales EUR	Toneladas de CO2eq	11 584,50	97,41%
Huella de carbono EUR	Toneladas de CO2eq/millón de euros invertidos	362,44	97,41%
Intensidad de GEI EUR	Toneladas de CO2eq/millón de euros de beneficios	912,40	97,32%
Exposición frente a empresas activas en el sector de los combustibles fósiles	Porcentaje invertido del Fondo	6,87%	97,20%
Proporción de producción y consumo de energía no renovable.	Porcentaje invertido del Fondo	86,53%	75,94%
Intensidad de consumo de energía: Agricultura EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	81,19%
Intensidad de consumo de energía: Minería EUR	GWh por millón EUR de ventas	1,43	81,19%
Intensidad de consumo de energía: Fabricación EUR	GWh por millón EUR de ventas	1,42	81,19%
Intensidad de consumo de energía: Electricidad EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,52	81,19%
Intensidad de consumo de energía: Agua EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	81,19%
Intensidad de consumo de energía: Construcción EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	81,19%

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Intensidad de consumo de energía: Comercio y vehículos EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,21	81,19%
Intensidad de consumo de energía: Transporte y logística EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,07	81,19%
Intensidad de consumo de energía: Sector inmobiliario EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	81,19%
Actividades que afectan negativamente a zonas sensibles en cuanto a la biodiversidad	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	97,20%
Emisiones al agua EUR	Toneladas métricas EUR	0,00	3,34%
Residuos peligrosos EUR	Toneladas métricas EUR	1,07	47,28%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	97,38%
Ausencia de procesos y mecanismos de cumplimiento para realizar un seguimiento del cumplimiento de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	66,13%	97,20%
Brecha salarial entre hombres y mujeres, sin ajustar	Porcentaje invertido del Fondo	24,15%	8,73%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	19,98%	97,12%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	97,20%

¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	Tecnología de la información	9,71%	Taiwán
Samsung Electronics Co., Ltd.	Tecnología de la información	8,73%	Corea del Sur
Tencent Holdings Limited	Servicios de comunicación	5,95%	China
SK hynix Inc.	Tecnología de la información	3,79%	Corea del Sur
HDFC BANK LIMITED	Sector financiero	3,50%	India
ICICI BANK LIMITED	Sector financiero	3,33%	India
ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	Consumo discrecional	3,25%	China
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	Energía	2,95%	India
TITAN COMPANY LIMITED	Consumo discrecional	2,83%	India
PT Bank Rakyat Indonesia (Persero) Tbk	Sector financiero	2,39%	Indonesia
AIA Group Limited	Sector financiero	2,30%	Hong Kong
ANTOFAGASTA PLC	Materiales	2,10%	Reino Unido
Grupo Financiero Banorte, S.A.B. de C.V.	Sector financiero	2,05%	México
WEG S.A.	Sector industrial	2,02%	Brasil
Al Rajhi Banking & Investment Corporation SJSC	Sector financiero	1,89%	Arabia Saudí

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

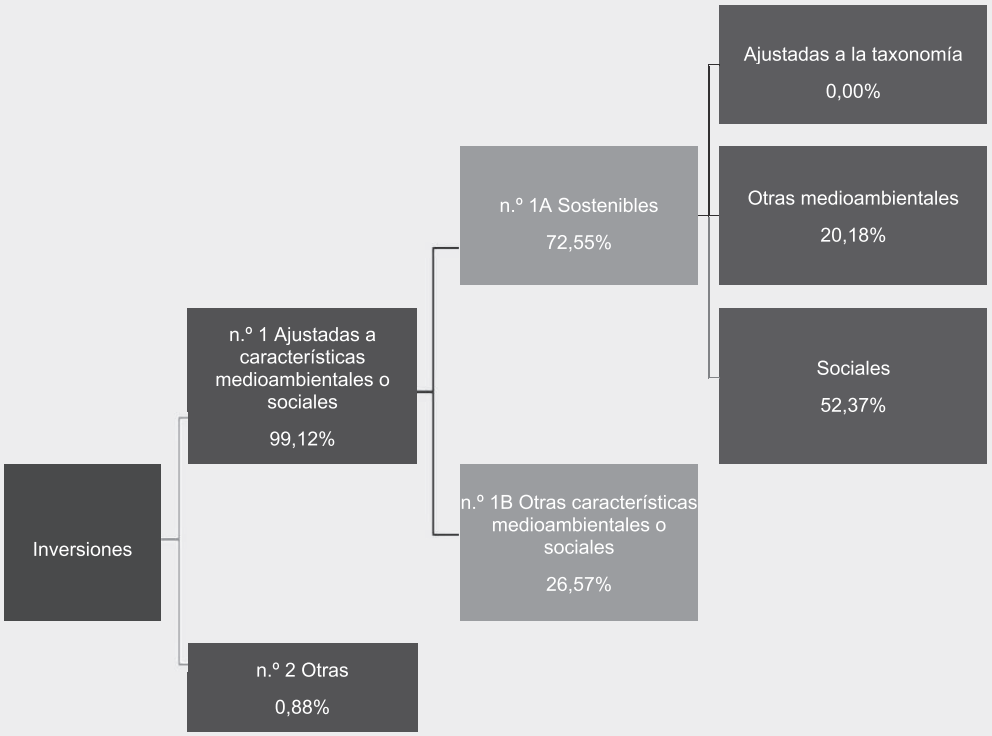
La proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 72,55 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 99,12 % de la cartera del Fondo se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas por este. La parte restante (0,88 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos.

Del segmento de la cartera del Fondo que se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo destinó el 72,55 % de su cartera a inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Sector principal	% de activos
Tecnología de la información	30,21%
Sector financiero	25,49%
Consumo discrecional	11,82%
Servicios de comunicación	8,11%
Materiales	7,18%
Sector industrial	5,09%
Energía	4,75%
Sector sanitario	3,37%
Bienes básicos de consumo	2,61%
Servicios públicos	0,41%

Principales subsectores	% de activos
Bancos	19,76%
Semiconductores y equipos semiconductores	15,71%
Hardware, almacenamiento y periféricos de tecnología	8,73%
Medios de comunicación y servicios interactivos	6,83%
Petróleo, gas y combustibles de consumo	4,75%
Venta al por menor	4,63%
Seguros	4,15%
Equipos eléctricos	3,81%
Productos químicos	3,77%
Servicios informáticos	3,07%
Textiles, ropa y artículos de lujo	2,83%
Equipos, instrumentos y componentes electrónicos	2,70%
Comercio minorista y distribución de bienes básicos de consumo	2,13%
Metales y minería	2,10%
Hoteles, restaurantes y actividades de ocio	1,75%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental ajustado a la taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

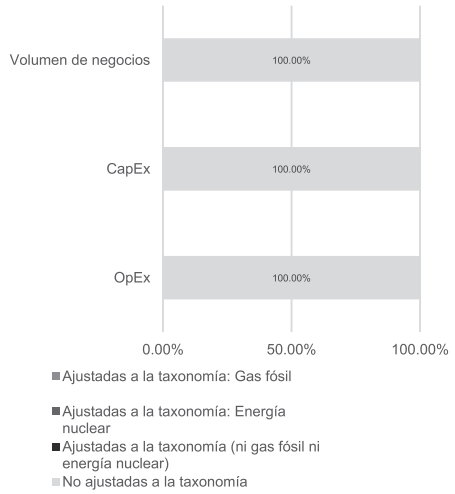
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

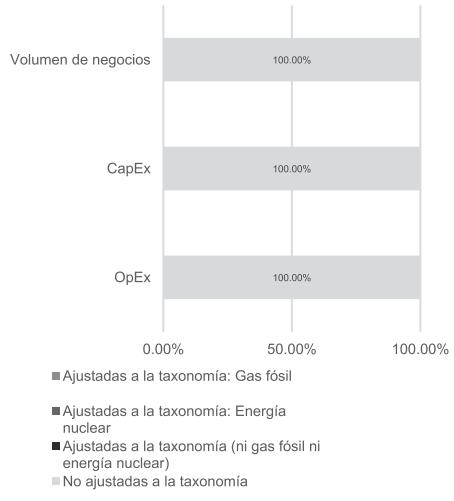
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transición facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica.

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

Como resultado de la estrategia de inversión, el Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la Taxonomía de la UE. Por lo tanto, a finales de febrero de 2023, el 20,18 % de la cartera del Fondo estaba formada por inversiones con un objetivo ambiental no ajustado a la Taxonomía de la UE.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

La proporción de inversiones socialmente sostenibles fue del 52,37 %.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

La proporción de inversiones en «N.º 2 Otros» era del 0,88 % e incluía el efectivo para el que no había salvaguardias ambientales o sociales mínimas.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

- Compromiso con empresas de cartera en el establecimiento o implementación de objetivos de reducción de emisiones de gases de efecto invernadero.
- Se adhirió a las exclusiones establecidas en el prospecto con respecto a las calificaciones de riesgo de sostenibilidad y gobernanza patentadas, tabaco, violaciones del Pacto Mundial de las Naciones Unidas, armas controvertidas y carbón.
- Se consideraron las 14 PIA obligatorias y dos PIA adicionales como parte del análisis de inversión que incluye indicadores sobre eficiencia energética y del agua, contaminación y riesgo de biodiversidad.
- No se incluyeron en el Fondo las empresas que tengan una calificación de riesgo de sostenibilidad o gobernanza igual o superior a 4, en una escala de calificación del 1 (riesgo bajo) al 5 (riesgo alto).

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica.

FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
5493001JP7YZEMZJTE31

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 75,27% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☒ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

Para cumplir con las características ambientales o sociales promovidas por el producto financiero, el Fondo incluyó inversiones en empresas:

- Que están reduciendo y gestionando sus emisiones de carbono.
- Con una exposición limitada o nula a la industria de los combustibles fósiles.
- Con un enfoque en el uso eficiente de la energía y del agua.
- Que están limitando la contaminación y gestionando el riesgo para la biodiversidad.
- Con un buen historial en materia de derechos humanos y asuntos relacionados con los empleados.
- Con ninguna exposición a armas controvertidas.

No todas las participaciones en el Fondo promovieron todas las características. Estos factores se consideraron como parte del análisis de cada empresa y se incorporaron al análisis de inversión.

No se han utilizado instrumentos derivados para lograr las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Al final del período de referencia, el 77 % del Fondo se mantenía en inversiones sostenibles, tal y como se define en el marco propio del gestor de inversiones, basado en los Objetivos de Desarrollo Sostenible de las Naciones Unidas (ODS).

Se tuvieron en cuenta y se midieron los 14 indicadores obligatorios de las PIA y dos indicadores adicionales. Consulte los valores divulgados en la sección «¿Cómo tuvo en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?».

Al final del período, aproximadamente el 62 % del valor liquidativo (NAV) de la cartera se invirtió en empresas que habían aprobado objetivos en el marco de la Iniciativa de objetivos basados en la ciencia, con un 19 % adicional invertido en empresas comprometidas con el establecimiento de objetivos durante los próximos dos años.

Durante el período, el equipo de gestión del Fondo realizó 4 compromisos sobre temas ambientales, sociales y de gobernanza (ESG) con el objetivo de influir en el comportamiento. Abarcaron temas como la composición del consejo de administración

y los riesgos del cambio climático. Al final del año, los compromisos se encontraban en las etapas de finalización que se muestran a continuación.

Se firmaron un total de 22 compromisos durante el ejercicio.

Además, el gestor de inversiones empleó parámetros de datos externos (p. ej., MSCI), entre los que se incluye la huella de carbono, la puntuación ESG y su investigación interna (en particular, el análisis de los costes del carbono y los factores de riesgo de esclavitud moderna) como insumos para fundamentar su análisis y sus calificaciones internas de riesgo de gobernanza y sostenibilidad, que se utilizaron como base para la selección de valores, las exclusiones y el proceso de colaboración.

De acuerdo con nuestra Política de ampliación y compromiso climático, hemos clasificado las empresas en nuestra clasificación interna con respecto al cumplimiento de las emisiones netas de valor cero. Esto aumentará y aportará más información a los clientes, además de a los activos comprometidos que tienen objetivos específicos basados en la adopción de objetivos basados en la ciencia. Para este Fondo, la distribución de la cartera entre esas categorías es la siguiente:

KPI de sostenibilidad Nombre	Valor
Interacciones: 1. Contacto con la empresa para comentar los problemas	0,00%
Interacciones: 2. La empresa acepta la interacción	0,00%
Interacciones: 3. Se debaten los problemas pertinentes	100,00%
Interacciones: 4. La empresa elabora un plan para abordar los problemas	0,00%
Interacciones: 5. La empresa soluciona el problema	0,00%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: conseguir unas emisiones netas de valor cero	0,00%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ajustado al objetivo de emisiones netas de valor cero	0,00%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ajustándose al objetivo de emisiones netas de valor cero	62,30%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: compromiso adquirido	19,60%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: primeras acciones en relación con el cambio climático	8,30%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ninguna medida adoptada	9,80%

¿...y en comparación con períodos anteriores?

En comparación con el ejercicio anterior, hemos observado una pequeña disminución en la proporción de valor liquidativo del Fondo invertido en empresas con un objetivo basado en la ciencia del 64 % al 62 % a finales del ejercicio anterior, y un aumento en la proporción de empresas que se han comprometido a establecer objetivos basados en la ciencia del 9 % al 19 %. Esto se debe a los cambios en las posiciones de la cartera y al compromiso de las empresas con el establecimiento de objetivos basados en la ciencia.

Hemos observado más compromisos sobre temas ambientales, sociales y de gobernanza (ESG) con el objetivo de influir en el comportamiento en comparación con el trimestre anterior, de 0 a 4. Hemos observado una disminución de los compromisos totales de 26 a 22.

	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
KPI de sostenibilidad Nombre	Valor	Valor
Interacciones: 1. Contacto con la empresa para comentar los problemas	0,00%	N/A
Interacciones: 2. La empresa acepta la interacción	0,00%	N/A
Interacciones: 3. Se debaten los problemas pertinentes	100,00%	N/A
Interacciones: 4. La empresa elabora un plan para abordar los problemas	0,00%	N/A
Interacciones: 5. La empresa soluciona el problema	0,00%	N/A
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: conseguir unas emisiones netas de valor cero	0,00%	N/A
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ajustado al objetivo de emisiones netas de valor cero	0,00%	N/A
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ajustándose al objetivo de emisiones netas de valor cero	62,30%	N/A
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: compromiso adquirido	19,60%	N/A

	Sustainability KPI historical comparison	
	2024	2023
KPI de sostenibilidad Nombre	**Valor**	**Valor**
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: primeras acciones en relación con el cambio climático	8,30%	N/A
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ninguna medida adoptada	9,80%	N/A

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	**Unidad de medida**	**Valor**	**Cobertura**	**Valor**	**Cobertura**
Emisiones de GEI: Emisiones totales EUR	Toneladas de CO2eq	14 201,20	99,16%	12 594,31	96,22%
Huella de carbono EUR	Toneladas de CO2eq/millón de euros invertidos	76,46	99,16%	71,95	96,22%
Intensidad de GEI EUR	Toneladas de CO2eq/millón de euros de beneficios	386,71	98,50%	416,67	96,22%
Exposición frente a empresas activas en el sector de los combustibles fósiles	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	97,88%	0,00%	96,22%
Intensidad de consumo de energía: Agricultura EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	87,07%	0,00	93,16%
Intensidad de consumo de energía: Minería EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	87,07%	0,00	93,16%
Intensidad de consumo de energía: Fabricación EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,32	87,07%	0,31	93,16%
Intensidad de consumo de energía: Electricidad EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	87,07%	0,00	93,16%
Intensidad de consumo de energía: Agua EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	87,07%	0,00	93,16%
Intensidad de consumo de energía: Construcción EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	87,07%	0,00	93,16%
Intensidad de consumo de energía: Comercio y vehículos EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,02	87,07%	0,02	93,16%
Intensidad de consumo de energía:	GWh por millón EUR de ventas	0,00	87,07%	0,00	93,16%

		Comparación histórica de PIA			
		2024		2023	
Indicadores de las principales incidencias adversas	**Unidad de medida**	**Valor**	**Cobertura**	**Valor**	**Cobertura**
Transporte y logística EUR					
Intensidad de consumo de energía: Sector inmobiliario EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	87,07%	0,00	93,16%
Actividades que afectan negativamente a zonas sensibles en cuanto a la biodiversidad	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	97,88%	0,00%	96,22%
Emisiones al agua EUR	Toneladas métricas EUR	0,00	0,00%	0,01	5,04%
Residuos peligrosos EUR	Toneladas métricas EUR	0,05	45,55%	0,09	47,76%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	99,16%	0,00%	98,99%
Ausencia de procesos y mecanismos de cumplimiento para realizar un seguimiento del cumplimiento de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	39,84%	97,88%	50,36%	95,15%
Brecha salarial entre hombres y mujeres, sin ajustar	Porcentaje invertido del Fondo	19,20%	28,93%	19,03%	11,63%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	38,14%	97,88%	35,94%	96,22%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	97,88%	0,00%	96,22%

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

Las inversiones sostenibles del Fondo comprendían valores de renta variable emitidos por empresas que contribuyeron, a través de sus productos o servicios, a los objetivos ambientales o sociales de un subconjunto relevante de metas subyacentes a los 17 ODS.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

Además de identificar posibles inversiones sostenibles mediante la asignación de empresas a un subconjunto específico de metas de los ODS, como se ha detallado anteriormente, las posibles empresas participadas estaban sujetas a la evaluación del principio DNSH que se llevaba a cabo de dos maneras:

1. Una evaluación del cumplimiento de las normas globales, basada en los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU), y las controversias relacionadas con los demás aspectos ambientales de los indicadores de las PIA.

2. Una evaluación del principio de DNSH en relación con los factores relacionados con el cambio climático destacados por los indicadores de las PIA, incluidas áreas como la exposición del negocio a la extracción de combustibles fósiles, así como una huella de carbono elevada y no gestionada en una industria de alta emisión.

Al evaluar el principio de DNSH relacionados con el cambio climático, el gestor de inversiones también tuvo en cuenta la naturaleza de las operaciones de una empresa, así como la existencia de controversias o señales de los indicadores de las PIA. Para cada agrupación de indicadores de las PIA, el gestor de inversiones evaluó la importancia de cada indicador de las PIA y la existencia de un posible daño significativo. Esta evaluación se llevó a cabo mediante un análisis propio.Los resultados de la evaluación del principio de DNSH pueden haber influido en las calificaciones de riesgo de gobernanza y sostenibilidad asignadas por el gestor de inversiones, aunque la evaluación del DNSH está diseñada para funcionar como un proceso paralelo a las calificaciones de riesgo con el fin de cumplir el compromiso de realizar «inversiones sostenibles» en el marco del SFDR.El resultado clave de la evaluación del DNSH es determinar si existía alguna evidencia de daño significativo que excluyese una inversión de ser considerada una inversión sostenible.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

El gestor de inversiones tuvo en cuenta los 14 indicadores obligatorios de las PIA y dos indicadores adicionales en su gestión del Fondo. Los dos indicadores adicionales eran:

- medioambientales, esto es, inversiones en empresas sin iniciativas de reducción de emisiones de carbono;
- sociales, esto es, la falta de una política de derechos humanos.

El análisis de las empresas por parte del gestor de inversiones tuvo en cuenta estos factores y si identificaban posibles impactos adversos importantes, se pondría en contacto con las empresas. De acuerdo con los requisitos específicos del SFDR, el gestor de inversiones también informó sobre los indicadores de las PIA utilizando datos de la empresa o sustitutos cuando estos no estaban disponibles.

Para obtener más información sobre cómo el análisis de las empresas llevado a cabo por el gestor de inversiones tuvo en cuenta estos factores, consulte el apartado «¿Cómo tuvo en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?».

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

Todas las posibles inversiones sostenibles identificadas estaban sujetas a un análisis ESG más amplio del gestor de inversiones, que examinó la gestión, la cultura y el riesgo social y ambiental. Este análisis se enmarcaba en las líneas directrices de la OCDE para empresas multinacionales y el gestor de inversiones tenía un enfoque adicional específico sobre el riesgo de explotación social enmarcado en los Principios Rectores de la ONU sobre Empresas y Derechos Humanos.

El PMNU (sobre el que el Fondo tiene criterios vinculantes) establece 10 principios que fijan las responsabilidades mínimas en los ámbitos de los derechos humanos, el trabajo, el medioambiente y la lucha contra la corrupción, según se desprende de los convenios establecidos.

Existe un importante solapamiento entre los principios del PMNU y las Directrices de la OCDE que se recogen de forma exhaustiva en la evaluación de los PMNU del gestor de inversiones. Otros instrumentos multilaterales citados en las directrices también son componentes de las directrices de la OCDE, a saber, los Principios Fundamentales de la OIT (Organización Internacional del Trabajo) y la Declaración Universal de los Derechos Humanos. Estos cubren de forma efectiva las posibles controversias relacionadas con los pilares clave de la OCDE: derechos humanos, trabajo, medioambiente, lucha contra la corrupción y protección del consumidor.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.

¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Los factores de sostenibilidad pueden tener un impacto en las empresas en las que invierte el Fondo, y el gestor de inversiones también reconoce que las propias empresas pueden tener un impacto adverso en, por ejemplo, el medioambiente, sus empleados o las comunidades en las que operan. Estos impactos adversos incluyen, sin limitación, la generación de emisiones de gases de efecto

invernadero (GEI) y otras formas de contaminación o posibles incumplimientos del PMNU. El análisis de las empresas por parte del gestor de inversiones tuvo en cuenta estos factores y, cuando identifica posibles impactos adversos importantes, interactuó y se comprometió con las empresas, tal y como se establecía con más detalle en la Política de gestión y compromiso del gestor de inversiones. De acuerdo con los requisitos específicos del SFDR, el gestor de inversiones también informó sobre los indicadores del PAI utilizando datos de la empresa o sustitutos cuando estos no estaban disponibles.

El análisis de las PIA se incorporó a la diligencia debida del gestor de inversiones sobre cada empresa. La evaluación de las 14 PIA obligatorias y las dos PIA adicionales se agrupan en seis áreas clave para evaluar la importancia. No todas las PIA eran importantes para todas las empresas. El gestor de inversiones evaluó si alguna de las seis áreas era importante para la empresa en la que se invertía y, de ser así, incorporaba estas áreas en sus calificaciones de riesgo, en su tesis de inversión y, si era pertinente, en la actividad de compromiso planificada.

Las seis agrupaciones clave de los PAI son las siguientes:

- Emisiones y gestión del carbono (PAI núm. 1 [Emisiones de GEI], PAI núm. 2 [Huella de carbono] y PAI núm. 3 [Intensidad de GEI de las empresas participadas], así como el PAI opcional sobre empresas sin iniciativas de reducción de emisiones de carbono).
- Exposición a empresas del sector de los combustibles fósiles (PAI núm. 4 (Exposición a empresas del sector de los combustibles fósiles)).
- Eficiencia energética e hídrica (PAI n.° 5 [Porcentaje de consumo y producción de energía no renovable] y n.° 6 [Intensidad del consumo de energía por sector de alto impacto climático]).
- Contaminación y biodiversidad (PAI núm. 7 [Actividades que afectan negativamente a las áreas sensibles a la biodiversidad], PAI núm. 8 [Emisiones al agua] y PAI núm. 9 [Relación de residuos peligrosos]).
- Derechos humanos y Asuntos de los empleados (PAI núm. 10-13 [Incumplimientos de las Directrices del PMNU y la OCDE; Falta de procesos y mecanismos de cumplimiento para supervisar el cumplimiento de las Directrices del PMNU y la OCDE; Brecha salarial no ajustada; y Diversidad en el Consejo de Administración], así como un PAI adicional centrado en las empresas que carecen de una política de derechos humanos).
- Exposición a armas controvertidas (PAI núm. 14 (Exposición a armas controvertidas]).

En algunos casos, como la PIA n.º 10 (Incumplimientos del PMNU y de las Directrices de la OCDE), el Fondo tiene criterios vinculantes y no invertirá en empresas calificadas como «fallidas» según el PMNU. De acuerdo con la Política de armas controvertidas del gestor de inversiones, el Fondo no mantendrá empresas con exposición a armas controvertidas.

La información sobre las PIA en los factores de sostenibilidad se puede encontrar en la Política de inversión del responsable.

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Emisiones de GEI: Emisiones totales EUR	Toneladas de CO2eq	14 201,20	99,16%
Huella de carbono EUR	Toneladas de CO2eq/millón de euros invertidos	76,46	99,16%
Intensidad de GEI EUR	Toneladas de CO2eq/millón de euros de beneficios	386,71	98,50%
Exposición frente a empresas activas en el sector de los combustibles fósiles	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	97,88%
Intensidad de consumo de energía: Agricultura EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	87,07%
Intensidad de consumo de energía: Minería EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	87,07%
Intensidad de consumo de energía: Fabricación EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,32	87,07%
Intensidad de consumo de energía: Electricidad EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	87,07%
Intensidad de consumo de energía: Agua EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	87,07%
Intensidad de consumo de energía: Construcción EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	87,07%
Intensidad de consumo de energía: Comercio y vehículos EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,02	87,07%
Intensidad de consumo de energía: Transporte y logística EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	87,07%
Intensidad de consumo de energía: Sector inmobiliario EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	87,07%
Actividades que afectan negativamente a zonas sensibles en cuanto a la biodiversidad	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	97,88%
Emisiones al agua EUR	Toneladas métricas EUR	0,00	0,00%
Residuos peligrosos EUR	Toneladas métricas EUR	0,05	45,55%

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	99,16%
Ausencia de procesos y mecanismos de cumplimiento para realizar un seguimiento del cumplimiento de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	39,84%	97,88%
Brecha salarial entre hombres y mujeres, sin ajustar	Porcentaje invertido del Fondo	19,20%	28,93%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	38,14%	97,88%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	97,88%

¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
Ferrari N.V.	Consumo discrecional	9,77%	Italia
ASML Holding N.V.	Tecnología de la información	9,59%	Países Bajos
MONCLER S.P.A.	Consumo discrecional	6,71%	Italia
L'OREAL SA	Bienes básicos de consumo	5,37%	Francia
LINDE PUBLIC LIMITED COMPANY	Materiales	5,28%	Reino Unido
Atlas Copco Aktiebolag	Sector industrial	4,85%	Suecia
KINGSPAN GROUP PUBLIC LIMITED COMPANY	Sector industrial	4,63%	Irlanda
ASSA ABLOY AB	Sector industrial	4,51%	Suecia
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC.	Sector sanitario	4,49%	Estados Unidos
DASSAULT SYSTEMES SE	Tecnología de la información	4,34%	Francia
SARTORIUS STEDIM BIOTECH S.A.	Sector sanitario	4,28%	Francia
NEMETSCHEK SE	Tecnología de la información	4,23%	Alemania
Partners Group Holding AG	Sector financiero	4,01%	Suiza
Hexagon Aktiebolag	Tecnología de la información	3,93%	Suecia
COLOPLAST A/S	Sector sanitario	3,80%	Dinamarca

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

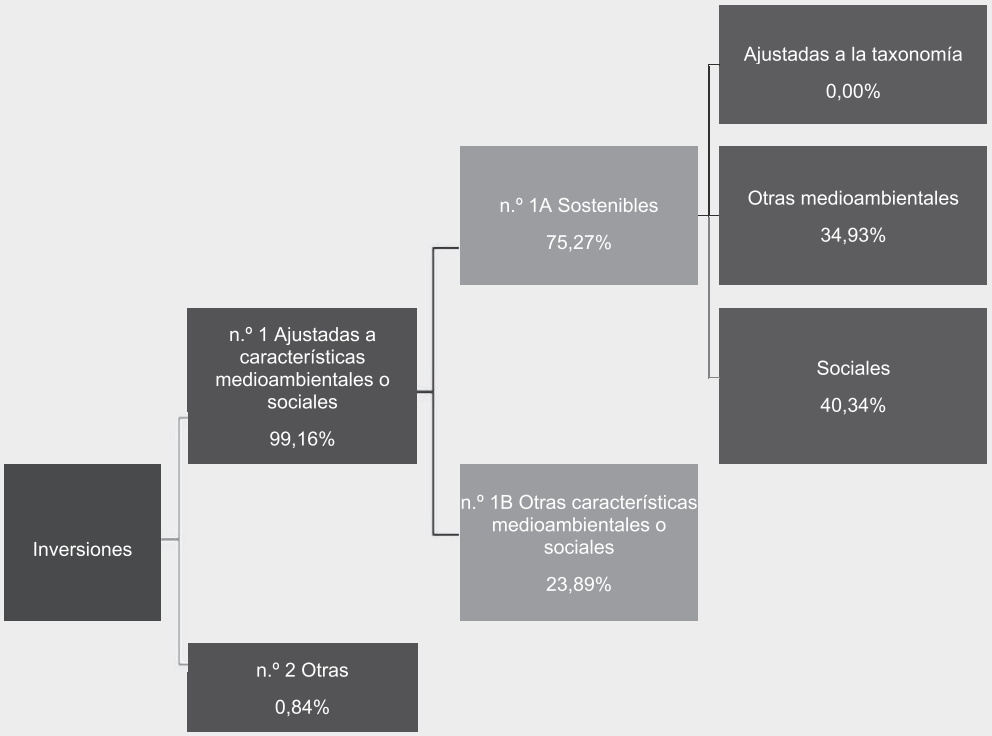
La proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 75,27 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 99,16 % de la cartera del Fondo se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas por este. La parte restante (0,84 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos.

Del segmento de la cartera del Fondo que se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo destinó el 75,27 % de su cartera a inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Sector principal	% de activos
Tecnología de la información	26,89%
Consumo discrecional	19,99%
Sector sanitario	14,55%
Sector industrial	13,88%
Bienes básicos de consumo	8,66%
Materiales	8,20%
Sector financiero	6,97%

Principales subsectores	% de activos
Semiconductores y equipos semiconductores	14,49%
Herramientas y servicios de las ciencias biológicas	10,78%
Textiles, ropa y artículos de lujo	10,30%
Automóviles	9,69%
Productos para la construcción	9,07%
Software	8,50%
Productos químicos	8,20%
Productos de cuidado personal	5,33%
Maquinaria	4,81%
Mercados de capitales	3,97%
Equipos, instrumentos y componentes electrónicos	3,90%
Equipos y suministros sanitarios	3,77%
Servicios financieros	3,00%
Bebidas	2,66%
Productos alimenticios	0,68%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental ajustado a la taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

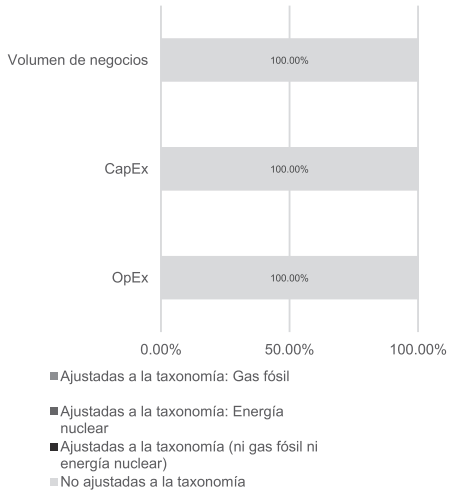
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

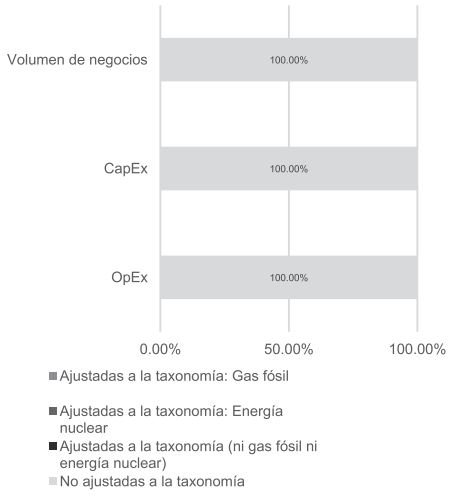
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transició facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica.

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

Como resultado de la estrategia de inversión, el Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la Taxonomía de la UE. Por lo tanto, a finales de febrero de 2023, el 34,93 % de la cartera del Fondo estaba formada por inversiones con un objetivo ambiental no ajustado a la Taxonomía de la UE.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

La proporción de inversiones socialmente sostenibles fue del 40,34 %.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

La proporción de inversiones en «N.º 2 Otros» era del 0,84 % e incluía el efectivo para el que no había salvaguardias ambientales o sociales mínimas.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

- Compromiso con empresas de cartera en el establecimiento o implementación de objetivos de reducción de emisiones de gases de efecto invernadero.
- Se adhirió a las exclusiones establecidas en el prospecto con respecto a las calificaciones de riesgo de sostenibilidad y gobernanza patentadas, violaciones del Pacto Mundial de las Naciones Unidas, armas controvertidas y todas las actividades comerciales a las que se aplican exclusiones.
- Se consideraron las 14 PIA obligatorias y dos PIA adicionales como parte del análisis de inversión que incluye indicadores sobre eficiencia energética y del agua, contaminación y riesgo de biodiversidad.
- No se incluyeron en el Fondo las empresas que tengan una calificación de riesgo de sostenibilidad o gobernanza igual o superior a 4, en una escala de calificación del 1 (riesgo bajo) al 5 (riesgo alto).
- El Fondo mantuvo una calificación ESG de la cartera superior a la del universo de inversión del Fondo, que son valores de renta variable situados en países de mercados desarrollados o emergentes en los que el país estaba representado en el MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index.

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica.

FTGF Martin Currie Improving Society Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
254900MZ0K8Z3QFWHN23

FRANKLIN TEMPLETON

Objetivo de inversión sostenible

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☒ SÍ	☐ NO
☒ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 14,80%	☐ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 0,00% de inversión sostenible
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☒ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☐ con un objetivo social
☒ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 82,10%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué medida se cumplió el objetivo de inversión sostenible de este producto financiero?

Para cumplir con el objetivo de inversión sostenible del Fondo, las empresas en las que se invierte ofrecieron productos o servicios que i) contribuyen a la igualdad de oportunidades sociales; ii) contribuyen a mejorar el bienestar, la inclusión o iii) apoyan una transición justa hacia una economía sostenible.

No se han utilizado instrumentos derivados para lograr el objetivo ambiental o social del Fondo.

A 29 de febrero de 2024, el 98,2 % de los activos gestionados del Fondo se invirtió en empresas que contribuían a la consecución del objetivo de inversión sostenible, y el 1,8 % restante se mantuvo en efectivo.

No se ha designado ningún índice de referencia para el logro del objetivo de inversión sostenible del Fondo.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan los objetivos sostenibles de este producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Los indicadores de sostenibilidad utilizados para medir el logro del objetivo de inversión sostenible del Fondo son los siguientes:

- Proporción del Fondo representada por las inversiones sostenibles con un objetivo social: Durante el ejercicio, la proporción del Fondo destinada a inversiones sostenibles con un objetivo social fue mayor del 70 %.
- Proporción del Fondo representada por las inversiones ambientalmente sostenibles que promueven el objetivo social del Fondo: Durante el ejercicio, la proporción del Fondo no destinada a inversiones sostenibles con un objetivo social o en efectivo, se destinó a inversiones sostenibles con un objetivo ambiental que promovía el objetivo social del Fondo.
- La proporción del Fondo que cumple los indicadores clave de rendimiento (KPI) de impacto específicos que se fijan para cada empresa, que los supera o va la zaga de ellos. Al final del ejercicio, el estado de los KPI de la cartera se distribuía de la siguiente manera:
- Proporción del Fondo con un proceso de compromiso estructurado:

- centrado en los aspectos en los que el gestor de inversiones se compromete en relación con KPI específicos de la empresa; y
- centrado en la mejora del comportamiento relativo a la sostenibilidad.

Durante el ejercicio, el 100 % del Fondo se comprometió con al menos uno de los dos ámbitos anteriores.

De acuerdo con nuestra Política de ampliación y compromiso climático, hemos clasificado las empresas en nuestra clasificación interna con respecto al cumplimiento de las emisiones netas de valor cero. Esto aumentará y aportará más información a los clientes, además de a los activos comprometidos que tienen objetivos específicos basados en la adopción de objetivos basados en la ciencia. Para este Fondo, la distribución de la cartera entre esas categorías es la siguiente:

KPI de sostenibilidad Nombre	Valor
KPI de impacto: se alcanzan	70,45%
KPI de impacto: se superan	17,05%
KPI de impacto: a la zaga	12,50%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: conseguir unas emisiones netas de valor cero	0,00%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ajustado al objetivo de emisiones netas de valor cero	0,00%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ajustándose al objetivo de emisiones netas de valor cero	32,90%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: compromiso adquirido	24,90%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: primeras acciones en relación con el cambio climático	5,20%
Cumplimiento de las emisiones netas de valor cero de MC: ninguna medida adoptada	35,20%

¿...y en comparación con períodos anteriores?

No se aplica.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

Además de identificar posibles inversiones sostenibles mediante la asignación de empresas a un subconjunto específico de metas de los ODS, como se ha detallado anteriormente, las posibles empresas participadas estaban sujetas a la evaluación del principio DNSH que se llevaba a cabo de dos maneras:

1. Una evaluación del cumplimiento de las normas globales, basada en los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas (PMNU), y las controversias relacionadas con los demás aspectos ambientales de los indicadores de las PIA.

2. Una evaluación del principio de DNSH en relación con los factores relacionados con el cambio climático destacados por los indicadores de las PIA, incluidas áreas como la exposición del negocio a la extracción de combustibles fósiles, así como una huella de carbono elevada y no gestionada en una industria de alta emisión.

Al evaluar el principio de DNSH relacionados con el cambio climático, el gestor de inversiones también tuvo en cuenta la naturaleza de las operaciones de una empresa, así como la existencia de controversias o señales de los indicadores de las PIA. Para cada agrupación de indicadores de las PIA, el gestor de inversiones evaluó la importancia de cada indicador de las PIA y la existencia de un posible daño significativo. Esta evaluación se llevó a cabo mediante un análisis propio.Los resultados de la evaluación del principio de DNSH pueden haber influido en las calificaciones de riesgo de gobernanza y sostenibilidad asignadas por el gestor de inversiones, aunque la evaluación del DNSH está diseñada para funcionar como un proceso paralelo a las calificaciones de riesgo con el fin de cumplir el compromiso de realizar «inversiones sostenibles» en el marco del SFDR.El resultado clave de la evaluación del DNSH es determinar si existía alguna evidencia de daño significativo que excluyese una inversión de ser considerada una inversión sostenible.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

El gestor de inversiones tuvo en cuenta los 14 indicadores obligatorios de las PIA y dos indicadores adicionales en su gestión del Fondo. Los dos indicadores adicionales eran:

- medioambientales, esto es, inversiones en empresas sin iniciativas de reducción de emisiones de carbono;
- sociales, esto es, la falta de una política de derechos humanos.

El análisis de las empresas por parte del gestor de inversiones tuvo en cuenta estos factores y si identificaban posibles impactos adversos importantes, se pondría en contacto con las empresas. De acuerdo con los requisitos específicos del SFDR, el gestor de inversiones también informó sobre los indicadores de las PIA utilizando datos de la empresa o sustitutos cuando estos no estaban disponibles.

Para obtener más información sobre cómo el análisis de las empresas llevado a cabo por el gestor de inversiones tuvo en cuenta estos factores, consulte el apartado «¿Cómo tuvo en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?».

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

Todas las posibles inversiones sostenibles identificadas estaban sujetas a un análisis ESG más amplio del gestor de inversiones, que examinó la gestión, la cultura y el riesgo social y ambiental. Este análisis se enmarcaba en las líneas directrices de la OCDE para empresas multinacionales y el gestor de inversiones tenía un enfoque adicional específico sobre el riesgo de explotación social enmarcado en los Principios Rectores de la ONU sobre Empresas y Derechos Humanos.

El PMNU (sobre el que el Fondo tiene criterios vinculantes) establece 10 principios que fijan las responsabilidades mínimas en los ámbitos de los derechos humanos, el trabajo, el medioambiente y la lucha contra la corrupción, según se desprende de los convenios establecidos.

Existe un importante solapamiento entre los principios del PMNU y las Directrices de la OCDE que se recogen de forma exhaustiva en la evaluación de los PMNU del gestor de inversiones. Otros instrumentos multilaterales citados en las directrices también son componentes de las directrices de la OCDE, a saber, los Principios Fundamentales de la OIT (Organización Internacional del Trabajo) y la Declaración Universal de los Derechos Humanos. Estos cubren de forma efectiva las posibles controversias relacionadas con los pilares clave de la OCDE: derechos humanos, trabajo, medioambiente, lucha contra la corrupción y protección del consumidor.

¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Los factores de sostenibilidad pueden tener un impacto en las empresas en las que invierte el Fondo, y el gestor de inversiones también reconoce que las propias empresas pueden tener un impacto adverso en, por ejemplo, el medioambiente, sus empleados o las comunidades en las que operan. Estos impactos adversos incluyen, sin limitación, la generación de emisiones de gases de efecto invernadero (GEI) y otras formas de contaminación o posibles incumplimientos del PMNU. El análisis de las empresas por parte del gestor de inversiones tuvo en cuenta estos factores y, cuando identifica posibles impactos adversos importantes, interactuó y se comprometió con las empresas, tal y como se establecía con más detalle en la Política de gestión y compromiso del gestor de inversiones. De acuerdo con los requisitos específicos del SFDR, el gestor de inversiones también informó sobre los indicadores del PAI utilizando datos de la empresa o sustitutos cuando estos no estaban disponibles.

El análisis de las PIA se incorporó a la diligencia debida del gestor de inversiones sobre cada empresa. La evaluación de las 14 PIA obligatorias y las dos PIA adicionales se agrupan en seis áreas clave para evaluar la importancia. No todas las PIA eran importantes para todas las empresas. El gestor de inversiones evaluó si alguna de las seis áreas era importante para la empresa en la que se invertía y, de ser así, incorporaba estas áreas en sus calificaciones de riesgo, en su tesis de inversión y, si era pertinente, en la actividad de compromiso planificada.

Las seis agrupaciones clave de los PAI son las siguientes:

- Emisiones y gestión del carbono (PAI núm. 1 [Emisiones de GEI], PAI núm. 2 [Huella de carbono] y PAI núm. 3 [Intensidad de GEI de las empresas participadas], así como el PAI opcional sobre empresas sin iniciativas de reducción de emisiones de carbono).
- Exposición a empresas del sector de los combustibles fósiles (PAI núm. 4 (Exposición a empresas del sector de los combustibles fósiles)).
- Eficiencia energética e hídrica (PAI n.° 5 [Porcentaje de consumo y producción de energía no renovable] y n.° 6 [Intensidad del consumo de energía por sector de alto impacto climático]).
- Contaminación y biodiversidad (PAI núm. 7 [Actividades que afectan negativamente a las áreas sensibles a la biodiversidad], PAI núm. 8 [Emisiones al agua] y PAI núm. 9 [Relación de residuos peligrosos]).
- Derechos humanos y Asuntos de los empleados (PAI núm. 10-13 [Incumplimientos de las Directrices del PMNU y la OCDE; Falta de procesos y mecanismos de cumplimiento para supervisar el cumplimiento de las Directrices del PMNU y la OCDE; Brecha salarial no ajustada; y Diversidad en el Consejo de Administración], así como un PAI adicional centrado en las empresas que carecen de una política de derechos humanos).
- Exposición a armas controvertidas (PAI núm. 14 (Exposición a armas controvertidas]).

En algunos casos, como la PIA n.º 10 (Incumplimientos del PMNU y de las Directrices de la OCDE), el Fondo tiene criterios vinculantes y no invertirá en empresas calificadas como «fallidas» según el PMNU. De acuerdo con la Política de armas controvertidas del gestor de inversiones, el Fondo no mantendrá empresas con exposición a armas controvertidas.

La información sobre las PIA en los factores de sostenibilidad se puede encontrar en la Política de inversión del responsable.

¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
INTUITIVE SURGICAL, INC.	Sector sanitario	6,78%	Estados Unidos
XYLEM INC.	Sector industrial	6,34%	Estados Unidos
HDFC BANK LIMITED	Sector financiero	5,49%	India
NOVOZYMES A/S	Materiales	5,42%	Dinamarca
MERCADOLIBRE, INC.	Consumo discrecional	5,37%	Uruguay
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA	Servicios públicos	4,97%	Francia
ECOLAB INC.	Materiales	4,94%	Estados Unidos
REVVITY, INC.	Sector sanitario	4,94%	Estados Unidos
CRODA INTERNATIONAL PUBLIC LIMITED COMPANY	Materiales	4,68%	Reino Unido
VALMONT INDUSTRIES, INC.	Sector industrial	4,51%	Estados Unidos
AMPLIFON S.P.A.	Sector sanitario	4,29%	Italia
VEEVA SYSTEMS INC.	Sector sanitario	4,26%	Estados Unidos
DEERE & COMPANY	Sector industrial	4,18%	Estados Unidos
AIRTEL AFRICA PLC	Servicios de comunicación	4,04%	Reino Unido
ILLUMINA, INC.	Sector sanitario	3,63%	Estados Unidos

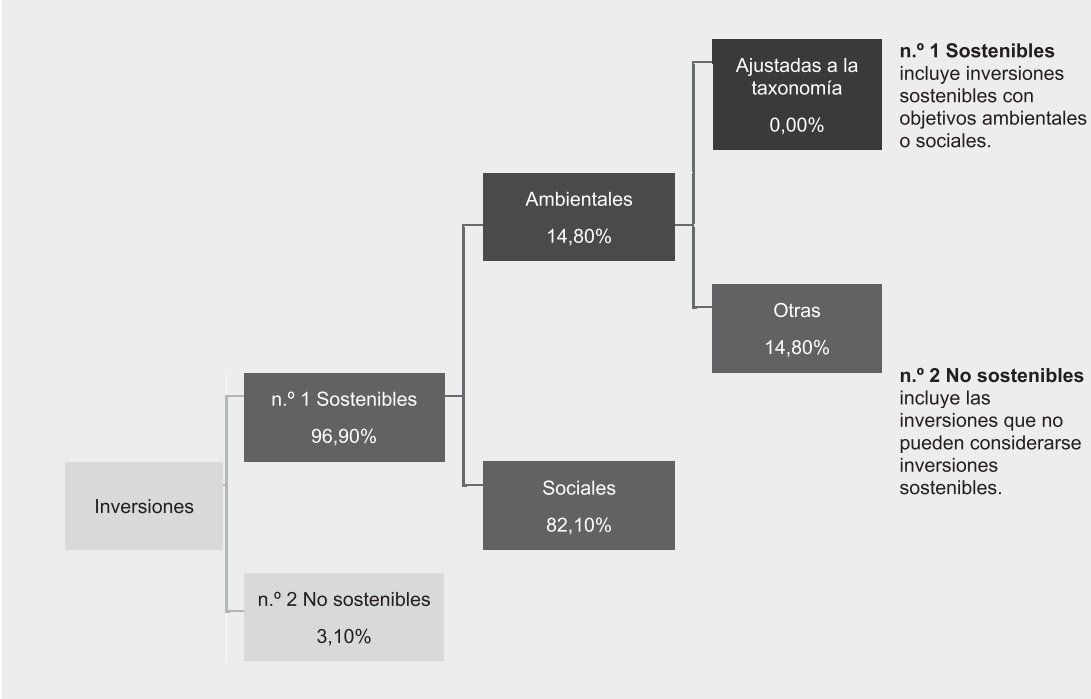
¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

La proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad fue del 96,90 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

El 96,90 % del valor liquidativo del Fondo se destinó a inversiones sostenibles. La parte restante (3,10 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos.



¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Sector principal	% de activos
Sector sanitario	27,04%
Sector industrial	19,17%
Materiales	15,04%
Consumo discrecional	14,81%
Sector financiero	8,57%
Servicios públicos	6,15%
Servicios de comunicación	4,04%
Tecnología de la información	2,05%

Principales subsectores	% de activos
Productos químicos	15,04%
Maquinaria	12,09%
Equipos y suministros sanitarios	9,92%
Herramientas y servicios de las ciencias biológicas	8,57%
Bancos	8,57%
Venta al por menor	5,37%
Servicios públicos múltiples	4,97%
Construcción e ingeniería	4,51%
Proveedores y servicios sanitarios	4,29%
Tecnología sanitaria	4,26%
Servicios inalámbricos de telecomunicaciones	4,04%
Servicios de consumo diversificados	3,69%
Bienes de consumo doméstico duraderos	2,79%
Hoteles, restaurantes y actividades de ocio	1,63%
Servicios profesionales	1,51%

¿En qué medida se ajustaron las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos.

Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental.

Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental ajustado a la taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE? [1]

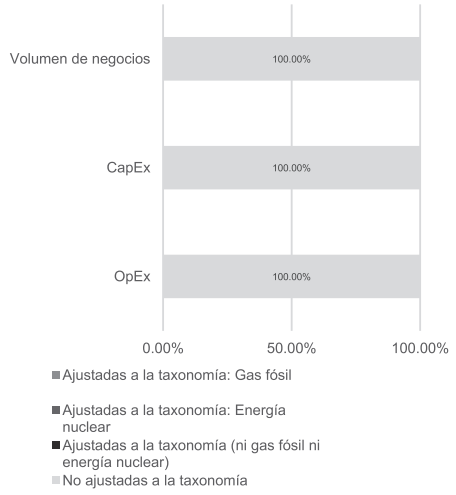
☐ Sí

☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

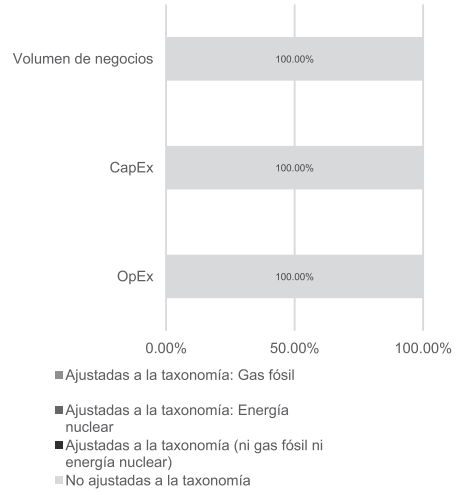
☒ No

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:

- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transición y facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica.

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

Como resultado de la estrategia de inversión, el Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la Taxonomía de la UE. Por lo tanto, durante el período de referencia, el 14,80 % de la cartera del Fondo estaba formada por inversiones con un objetivo ambiental no ajustado a la Taxonomía de la UE.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

Durante el período de referencia, la proporción de inversiones socialmente sostenibles fue del 82,10 %.

¿Qué inversiones se han incluido en «no sostenibles» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías ambientales o sociales mínimas?

La proporción de inversiones en «N.º 2 Otros» era del 3,10 % e incluía el efectivo para el que no había salvaguardias ambientales o sociales mínimas.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir el objetivo de inversión sostenible durante el período de referencia?

Los gestores de carteras se comprometieron con las empresas de la cartera sobre el impacto que cada empresa está teniendo a través de sus productos y servicios, o sobre la mejora de los comportamientos relacionados con la sostenibilidad.

Se respetaron todas las exclusiones establecidas en el folleto. Consulte el anexo del Fondo para ver información completa sobre estas.

Se consideraron las 14 PAI obligatorias y dos PAI adicionales como parte del análisis de inversión.

El Fondo mantuvo una calificación ESG MSCI de la cartera superior a la de su universo de inversión (MSCI ACWI IMI).

¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

No se aplica.

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra el objetivo sostenible.

Franklin Responsible Income 2028 Fund (el «Fondo»)

Identificador de entidad jurídica:
254900FTK4TK4QA6CU84

FRANKLIN TEMPLETON

Características medioambientales o sociales

Inversión sostenible significa una inversión en una actividad económica que contribuye a un objetivo ambiental o social, siempre que la inversión no cause un perjuicio significativo a ningún objetivo medioambiental o social y que las empresas en las que se invierte sigan prácticas de buena gobernanza.

La **taxonomía de la UE** es un sistema de clasificación previsto en el Reglamento (UE) 2020/852 por el que se establece una lista de **actividades económicas medioambientalmente sostenibles**. Dicho Reglamento no incluye una lista de actividades económicas socialmente sostenibles. Las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental pueden ajustarse, o no, a la taxonomía.

¿Este producto financiero tenía un objetivo de inversión sostenible?

☐ SÍ	☒ NO
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental:** 0,00%	☒ **Promovió características medioambientales o sociales** y, aunque no tenía como objetivo una inversión sostenible, tuvo un porcentaje del 15,72% de inversiones sostenibles
☐ en actividades económicas que se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☐ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que pueden considerarse medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
☐ en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE	☒ con un objetivo medioambiental en actividades económicas que no se consideran medioambientalmente sostenibles con arreglo a la taxonomía de la UE
	☒ con un objetivo social
☐ Realizó **inversiones sostenibles con un objetivo social:** 0,00%	☐ Promovió características medioambientales o sociales, pero **no realizó ninguna inversión sostenible**

¿En qué grado se cumplieron las características medioambientales o sociales que promueve este producto financiero?

Para promover la transición hacia una economía con bajas emisiones de carbono, el equipo de gestión de carteras evitó exponerse a lo que denominan rezagados climáticos. A los emisores soberanos que estaban entre el 20 % de los peor calificados de su grupo de homólogos, en función de factores ambientales que incluían, entre otros, las emisiones de GEI, la intensidad energética, la protección de la biodiversidad, la contaminación del aire y la combinación de energías renovables, se les denominó «rezagados ambientales». En el caso de los emisores corporativos, fueron empresas que estaban entre el 20 % de las mejor calificadas de su grupo de homólogos, con base en la intensidad de sus emisiones de gases de efecto invernadero. Al final del período objeto del informe, la asignación del Subfondo a los rezagados ambientales se mantuvo en un 0 % de su valor liquidativo.

Además, el Subfondo también se abstuvo de invertir en emisores con comportamientos comerciales controvertidos o actividades económicas adversas (tal y como se describe más adelante en el acuerdo precontractual), en particular, cuya exposición a la extracción de combustibles fósiles o a la producción de energía a partir de combustibles fósiles superase el límite aceptado por el equipo de inversión (p. ej.: se considera que no se puede invertir en empresas que obtengan más del 5 % de sus ingresos de la extracción de carbón térmico), un emisor estuvo implicado en la producción e armas de destrucción masiva o una empresa incumplió de manera grave y repetida el Pacto Mundial de las Naciones Unidas. Además de las exclusiones enumeradas, el Subfondo también se abstuvo de invertir en emisores soberanos que tengan una calificación «No libre» según el Freedom House Index.

El Subfondo se comprometió a destinar una asignación mínima del 11 % de su valor liquidativo a inversiones sostenibles en actividades económicas que contribuyan a objetivos ambientales y una asignación mínima del 1 % a inversiones sostenibles en actividades económicas que contribuyan a objetivos sociales. Durante el período objeto del informe, el 15,72 % del valor liquidativo del Subfondo se destinó a inversiones sostenibles (véase un desglose detallado en la siguiente sección: «¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?»; si no se indica lo contrario, todos los valores mostrados se basan en la media ponderada a lo largo de cuatro trimestres durante el período de referencia objeto del informe). Esto se consiguió principalmente a través de inversiones en bonos verdes, sociales y de uso sostenible de los ingresos que se emitieron explícitamente para financiar un conjunto específico de proyectos medioambientales o sociales subvencionables. Un ejemplo de esto incluye la inversión del Subfondo en un bono de uso de los ingresos emitido por ABN AMRO Bank N.V para apoyar su objetivo de aumentar sustancialmente su cuota de energía renovable en el conjunto de fuentes de energía a nivel mundial para 2030 y de mejorar la resiliencia al cambio climático y los desastres naturales. La mayor parte de los ingresos procedentes de la venta de bonos se destinaron a fomentar la eficiencia energética. La eficiencia energética se refiere, por ejemplo, a los préstamos para instalar paneles solares en las viviendas actuales, los bienes inmobiliarios comerciales sostenibles y la energía eólica. Entre los proyectos más destacados figura el aumento de la financiación de inmuebles con etiqueta energética A o superior. Además, ABN AMRO Bank aumentó su inversión en proyectos de energía renovable, como, por ejemplo, la financiación de un buque cisterna MR de metanol de nueva construcción.

A este respecto, la media ponderada a lo largo de cuatro trimestres durante el período de referencia objeto del informe, que va del 1 de marzo de 2023 al 29 de febrero de 2024, representó el 98,56 % de los activos que se ajustaban las características ambientales

o sociales, mientras que el 1,44 % restante de los activos del Subfondo que no se ajustaban a estas características fueron efectivo y derivados.

Los **indicadores de sostenibilidad** miden cómo se alcanzan las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?

Los indicadores de sostenibilidad siguientes se utilizaron para medir la consecución de las características ambientales o sociales promovidas por el Fondo:

Exposición a bonos verdes, sociales y sostenibles (GSS), así como a los emitidos por los campeones ambientales.

- 11,24 % de las inversiones en bonos verdes;

- 4,48 % de las inversiones en bonos sociales;

- 0,00 % de inversiones en bonos sostenibles;

- 41,10 % de las inversiones en bonos emitidos por los mejores emisores de su clase («campeones ambientales»);

Porcentaje de inversiones en emisores con exposición o vinculación a sectores excluidos y las exclusiones adicionales descritas en la sección de Estrategia de Inversión de este anexo - 0,00 %

Lista de emisores con los que se compromete el gestor de inversiones entre el 1 de marzo de 2023 y el 29 de febrero de 2024:

1. ABANCA Corporacion Bancaria 2. Abertis 3. ABN AMRO Bank 4. Adevinta 5. AIB Group 6. Altice France 7. Apple 8. Arena Luxembourg Finance 9. Atlantia 10. Autostrade per l'Italia 11. Avantor 12. Azelis 13. Banco Sabadell 14. Bank of Ireland 15. Barclays 16. Berry Global 17. Blackstone Property Partners Europe Holdings 18. BNP Paribas 19. Caixa Geral de Depositos 20. CaixaBank 21. CEZ Group 22. Commerzbank AG 23. Credit Agricole Assurances24. Credit Suisse 25. Crown European Holdings 26. Danske Bank 27. DXC Technology 28. EasyJet 29. Eaton Vance 30. ENGIE 31. Goldman Sachs 32. Holding d'Infrastructures 33. HSBC 34. Ibercaja Banco 35. IBM 36. iliad Group 37. IMA Group 38. ING Groep NV 39. Intesa Sanpaolo 40. IQVIA 41. Italmatch Chemicals 42. JPMorgan Chase 43. LKQ Corp 44. Logicor 45. Lufthansa Group 46. Matterhorn Telecom 47. National Grid 48. Nationwide Building Society 49. NatWest 50. Orano 51. Paprec 52. Prosus 53. PVH Corp. 54. Rabobank 55. Renault Group 56. Rumanía 57. Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 58. SANEF 59. Grupo Santander 60. Santander UK 61. Schneider Electric 62. Societe Generale 63. Swedbank 64. TenneT 65. Thames Water 66. UBS Group AG 67. Unicaja Banco 68. Verisure 69. Verizon 70. Victoria PLC 71. Volvo Cars 72. Vonovia SE

KPI de sostenibilidad Nombre	Valor
Exposición a bonos verdes	11,24%
Exposición a bonos sociales	4,48%
Exposición a bonos sostenibles	0,00%
Exposición a campeones ambientales	41,10%
Exposición a sectores excluidos	0,00%
Exposición a los indicadores de principales incidencias adversas (PIA)	1,00
Lista de emisores con los que se relaciona el gestor de inversiones	1,00

¿...y en comparación con períodos anteriores?

No es posible realizar una comparación directa, puesto que el fondo se constituyó el 23 de enero de 2023, con lo que el primer período de presentación de informes abarcó poco más de un mes, entre el 23 de enero de 2023 y el 28 de febrero de 2023, mientras que el período de presentación para este informe es un ejercicio completo, del 1 de marzo de 2023 al 29 de febrero de 2024.

¿Cuáles han sido los objetivos de las inversiones sostenibles que ha realizado en parte el producto financiero y de qué forma ha contribuido la inversión sostenible a dichos objetivos?

El objetivo de las inversiones sostenibles era, entre otros, financiar y promover:

a) El uso eficiente de la energía, las materias primas, el agua y la tierra.

b) La producción de energías renovables.

c) La reducción de los residuos y de las emisiones de gases de efecto invernadero (GEI), y del impacto de las actividades económicas en la biodiversidad.

d) El desarrollo de una economía circular.

e) La lucha contra las desigualdades y el fomento de la cohesión social.

f) La integración social.

g) Las buenas relaciones laborales.

h) Las inversiones en capital humano, incluidas las comunidades desfavorecidas.

Las inversiones sostenibles del Fondo incluían una asignación mínima del 10 % de su cartera a inversiones sostenibles en actividades económicas que contribuían a objetivos ambientales.

Esto se consiguió mediante la inversión en bonos etiquetados como «verdes», o en cualquier otro valor cuyo(s):

A) procedimientos se utilicen en proyectos ambientales elegibles;

B) marco se adhiere a las normas internacionales (incluidos, entre otros, los Principios de los Bonos Verdes de la Asociación Internacional de Mercados de Capitales (ICMA), y el futuro Estándar de Bonos Verdes de la Unión Europea (el GBS de la UE)); y

C) Emisores no perjudiquen de forma significativa otros objetivos medioambientales y sociales, a la vez que demuestran prácticas de buen gobierno.

El uso de los ingresos de estos bonos estaba claramente definido y se ajustaba a los objetivos anteriores.

Además, el Fondo se comprometió a incluir una asignación mínima del 1 % de su cartera a actividades sociales sostenibles. Esto se consiguió mediante la ivnersión en bonos etiquetados como «sociales», o en cualquier otro valor cuyo(s):

A) procedimientos se utilicen en proyectos sociales elegibles;

B) Marco se adhiera a las normas internacionales (incluidos, entre otros, los Principios de Bonos Sociales de la ICMA).

C) Emisores no perjudiquen de forma significativa otros objetivos medioambientales y sociales, a la vez que demuestran prácticas de buen gobierno.

Las **principales incidencias adversas** son las incidencias negativas más importantes de las decisiones de inversión sobre los factores de sostenibilidad relativos a asuntos medioambientales, sociales y laborales, al respeto de los derechos humanos y a cuestiones de lucha contra la corrupción y el soborno.

¿De qué manera las inversiones sostenibles que el producto financiero ha realizado en parte no causan un perjuicio significativo a ningún objetivo de inversión sostenible medioambiental o social?

El gestor de inversiones utilizó herramientas de datos propias e investigación cualitativa para garantizar la alineación con el principio de No Hacer Daño Significativo (DNSH) en toda la cartera.

El seguimiento de los emisores corporativos se realizó a través de la aplicación de riesgos de incidencia adversa (PAI Risk App). La aplicación PAI Risk App utilizó datos de MSCI para identificar a los emisores implicados en actividades económicas perjudiciales o controversias. Los emisores que se considera que incumplieron las PIA n.º 7 (Actividades que afectan negativamente a zonas sensibles a la biodiversidad), n.º 10 (Incumplimiento de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de los principios de las Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales) y n.º 14 (Exposición a armas controvertidas) estaban excluidos del universo de inversión del Fondo.

El gestor de inversiones también utilizó el Índice de Transición Energética y Medioambiental (EETI, por sus siglas en inglés), que clasifica el resto de emisores del universo de inversión del Fondo en función de sus emisiones e intensidad de GEI. Los emisores que se encontraban entre el 20 % inferior de sus grupos de pares con respecto a las PIA n.º 1 (Emisiones de GEI) y n.º 3 (Huella de carbono) (para las empresas) y la PIA n.º 15 (Intensidad de GEI) (para las soberanías) quedaron excluidos del universo de inversión.

Además, los emisores soberanos se sometieron a pruebas basadas en sus libertades políticas (PIA n.º 16) o en la corrupción.

Cuando se destinan fondos a inversiones sostenibles, especialmente en lo que respecta al compromiso de invertir el 11 % del valor liquidativo (VL) en consonancia con los objetivos ambientales y sociales, el gestor de inversiones aplicaba una evaluación cualitativa adicional (basada en una investigación interna o en la opinión de una segunda parte externa) de la elegibilidad del emisor y de los proyectos para la DNSH.

¿Cómo se han tenido en cuenta los indicadores de incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Los indicadores de impacto adverso, incluidos los PAI y otros puntos de datos considerados por el gestor de inversiones como sustitutos del impacto adverso, se utilizaron para:

a) eliminar de la cartera a los emisores que se consideraron causantes de un daño significativo, y

b) informar al gestor de inversiones sobre el riesgo asociado al impacto adverso, y para tomar las medidas oportunas, lo que incluye la debida diligencia, el examen cualitativo o el compromiso (para los detalles de un compromiso, consulte las secciones «Principales indicencias adversas» y «Estrategia de inversión» del Fondo de este anexo).

Al evaluar los bonos verdes y sociales elegibles, el gestor de inversiones revisó y documentó la prioridad de las PIA relevantes para el proyecto, así como el modo en que la ejecución del proyecto afecta a las perspectivas generales de las PIA del emisor.

Por ejemplo, al invertir en un bono verde cuyos ingresos se destinan al desarrollo de fuentes de energía renovable (como paneles solares/fotovoltaicos), el gestor de inversiones se aseguró de que los proyectos financiados obtuviesen una buena calificación en las PIA vinculadas a las emisiones de GEI.

¿Se han ajustado las inversiones sostenibles a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos? Detalles:

En el caso de los bonos emitidos por países soberanos, las Líneas Directrices de la Organización para la Cooperación y el Desarrollo Económico (OCDE) para Empresas Multinacionales y los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos no eran aplicables a dichas inversiones. En el caso de los bonos emitidos por emisores corporativos, las inversiones sostenibles se ajustaban a las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y a los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos.

La alineación se controló con datos del MSCI. Las infracciones identificadas por estos proveedores de servicios se marcaron en el sistema de cumplimiento de las inversiones para su posterior investigación por parte del gestor de inversiones.

Si la diligencia debida demostraba que el emisor no se ajustaba a las Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales y a los Principios Rectores de las Naciones Unidas sobre las Empresas y los Derechos Humanos, se consideraría que no se podía invertir en él.

La taxonomía de la Unión Europea establece el principio de «no causar un perjuicio significativo» según el cual las inversiones que se ajusten a la taxonomía no deben perjudicar significativamente los objetivos de la taxonomía de la UE, e incluye criterios específicos de la UE.

El principio de «no causar un perjuicio significativo» se aplica únicamente a las inversiones subyacentes al producto financiero que tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles. Las inversiones subyacentes al resto del producto financiero no tienen en cuenta los criterios de la UE para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles.

Cualquier otra inversión sostenible tampoco debe perjudicar significativamente a ningún objetivo medioambiental o social.



¿Cómo tiene en cuenta este producto financiero las principales incidencias adversas sobre los factores de sostenibilidad?

Los indicadores de las PIA se consideraron con el propósito de:

(i) Identificar a los emisores considerados «los mejores de su categoría».

(ii) Restringir el universo de inversión del Fondo.

(iii) Orientar el compromiso temático

Identificación de los mejores inversores de su categoría

El Fondo invirtió en bonos emitidos por empresas y países considerados por el gestor de inversiones como «campeones ambientales». Los «campeones ambientales» se identificaron con dos calificaciones ESG propias:

- El EETI clasifica a los emisores soberanos en cuanto a eficiencia energética, conservación del capital natural y rendimiento de las energías renovables, utilizando varios puntos de datos, incluida la intensidad de los GEI (emisiones normalizadas por el producto interior bruto, CO2e/PIB).
- La ESG Credit App clasifica a los emisores corporativos por sus emisiones de GEI y su intensidad de GEI utilizando varios puntos de datos, como las emisiones de GEI de alcance 1 y 2, y las trayectorias históricas de los emisores.

Restricción del universo de inversión del Fondo

También se excluyeron de la cartera los emisores soberanos que se situaban entre el 20 % inferior del universo de inversión según el EETI y los emisores corporativos que se situaban entre el 20 % inferior (es decir, que se están quedando atrás en términos climáticos) según la ESG Credit App.

Orientación del compromiso temático

El gestor de inversiones se comprometió a participar con el 5 % de las participaciones activas que se consideraban de bajo rendimiento en términos de su exposición agregada a las métricas obligatorias aplicables de las PIA.

Para obtener más información sobre cómo el Fondo ha considerado sus PIA, consulte el informe periódico del Fondo.

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Emisiones de GEI: Ámbito 1 EUR	Toneladas de CO2eq	3 138,53	71,04%
Emisiones de GEI: Ámbito 2 EUR	Toneladas de CO2eq	310,51	71,04%
Emisiones de GEI: Ámbito 3 EUR	Toneladas de CO2eq	14 877,17	71,04%
Emisiones de GEI: Ámbitos 1 y 2 EUR	Toneladas de CO2eq	3 449,04	71,04%
Emisiones de GEI: Emisiones totales est. EUR	Toneladas de CO2eq	18 392,30	71,04%
Huella de carbono de los ámbitos 1 y 2 EUR	Toneladas de CO2eq/millón de euros invertidos	57,62	71,04%
Huella de carbono est. EUR	Toneladas de CO2eq/millón de euros invertidos	310,66	71,04%
Intensidad de GEI de los ámbitos 1 y 2 EUR	Toneladas de CO2eq/millón de euros de beneficios	74,78	88,21%
Intensidad de GEI est. EUR	Toneladas de CO2eq/millón de euros de beneficios	749,46	88,37%
Exposición frente a empresas activas en el sector de los combustibles fósiles	Porcentaje invertido del Fondo	4,32%	84,69%
Proporción de producción y consumo de energía no renovable.	Porcentaje invertido del Fondo	64,38%	67,18%

Indicadores de las principales incidencias adversas	Unidad de medida	Valor	Cobertura
Intensidad de consumo de energía: Agricultura EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	65,27%
Intensidad de consumo de energía: Minería EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	65,27%
Intensidad de consumo de energía: Fabricación EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,18	65,27%
Intensidad de consumo de energía: Electricidad EUR	GWh por millón EUR de ventas	8,66	65,27%
Intensidad de consumo de energía: Agua EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	65,27%
Intensidad de consumo de energía: Construcción EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,09	65,27%
Intensidad de consumo de energía: Comercio y vehículos EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,03	65,27%
Intensidad de consumo de energía: Transporte y logística EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,47	65,27%
Intensidad de consumo de energía: Sector inmobiliario EUR	GWh por millón EUR de ventas	0,00	65,27%
Actividades que afectan negativamente a zonas sensibles en cuanto a la biodiversidad	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	84,69%
Emisiones al agua EUR	Toneladas métricas EUR	0,00	0,00%
Residuos peligrosos EUR	Toneladas métricas EUR	0,45	14,85%
Infracciones de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	86,53%
Ausencia de procesos y mecanismos de cumplimiento para realizar un seguimiento del cumplimiento de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y de las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales	Porcentaje invertido del Fondo	26,14%	84,69%
Brecha salarial entre hombres y mujeres, sin ajustar	Porcentaje invertido del Fondo	23,02%	29,76%
Diversidad de género de la junta directiva	Porcentaje medio de mujeres en la junta directiva	37,87%	84,69%
Exposición a armas controvertidas	Porcentaje invertido del Fondo	0,00%	84,69%
Intensidad de GEI de los países receptores de la inversión EUR	Toneladas de CO2eq/millón de euros de beneficios	481,28	2,02%
Países receptores de inversiones sujetos a violaciones sociales	Recuento de países en el Fondo	0,00	2,02%

¿Cuáles han sido las inversiones principales de este producto financiero?

La lista incluye las inversiones que constituyen **la mayor parte de las inversiones** del producto financiero durante el período de referencia, que es: 01/03/2023 - 29/02/2024.

Durante el período de referencia, las inversiones más importantes de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Mayores inversiones	Sector	% de activos	País
Romanian Government International Bond 2.125% 03/07/2028 REG S	Bonos del Estado	2,02%	Rumanía
Intesa Sanpaolo Spa 1.75% 03/20/2028 REG S	Sector financiero	1,58%	Italia
Bank Of Ireland Group PLC 4.875% 07/16/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Sector financiero	1,54%	Irlanda
UBS Group AG 4.625% 03/17/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Sector financiero	1,53%	Suiza
BNP Paribas SA .5% 02/19/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Sector financiero	1,53%	Francia
National Grid PLC .163% 01/20/2028 REG S	Servicios públicos	1,51%	Reino Unido
ABN AMRO Bank NV 4% 01/16/2028 REG S	Sector financiero	1,51%	Países Bajos
AIB Group PLC 2.25% 04/04/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Sector financiero	1,51%	Irlanda
ING Groep NV 4.875% 11/14/2027 *FIXED TO FLOAT* REG S	Sector financiero	1,51%	Países Bajos
Skandinaviska Enskilda Banken AB .375% 06/21/2028 REG S	Sector financiero	1,50%	Suecia
Thermo Fisher Scientific Inc .5% 03/01/2028	Sector sanitario	1,49%	Estados Unidos
Crelan SA 5.75% 01/26/2028 REG S	Sector financiero	1,49%	Bélgica
Barclays PLC .877% 01/28/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Sector financiero	1,49%	Reino Unido
Sage Group PLC/The 3.82% 02/15/2028 REG S	Tecnología de la información	1,48%	Reino Unido
Natwest Markets PLC 4.25% 01/13/2028 REG S	Sector financiero	1,48%	Reino Unido

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad?

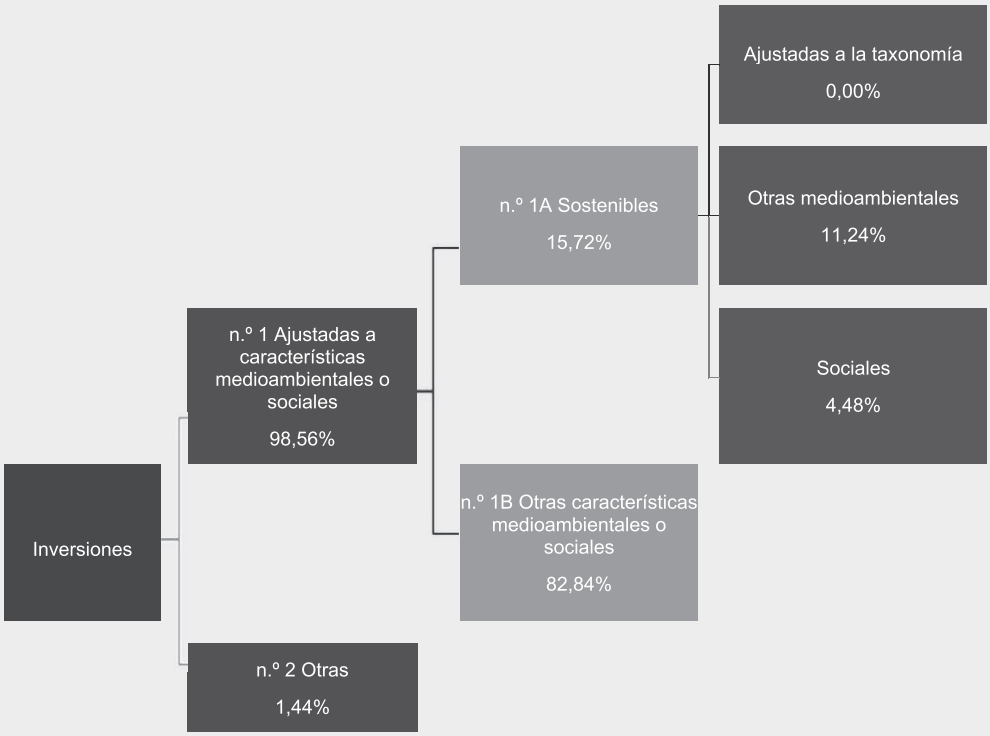
La proporción de inversiones relacionadas con la sostenibilidad es del 15,72 %.

La **asignación de activos** describe el porcentaje de inversiones en activos específicos.

¿Cuál ha sido la asignación de activos?

Al menos el 98,56 % de la cartera del Fondo se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas por este (si no se indica lo contrario, todos los valores mostrados se basan en la media ponderada a lo largo de cuatro trimestres durante el período de referencia objeto del informe). La parte restante (1,44 %) no se ajustaba a las características promovidas y consistía mayormente en activos líquidos.

Del segmento de la cartera del Fondo que se ajustaba a las características ambientales o sociales promovidas, el Fondo destinó el 15,72 % de su cartera a inversiones sostenibles.



La categoría n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales incluye las inversiones del producto financiero utilizadas para lograr las características medioambientales o sociales que promueve el producto financiero.

La categoría n.º 2 Otras incluye el resto de inversiones del producto financiero que ni se ajustan a las características medioambientales o sociales ni pueden considerarse como inversiones sostenibles.

La categoría **n.º 1 Ajustadas a características medioambientales o sociales** abarca:

- La subcategoría **n.º 1A Sostenibles** abarca las inversiones medioambiental y socialmente sostenibles.
- La subcategoría **n.º 1B Otras características medioambientales o sociales**, que abarca inversiones ajustadas a las características medioambientales o sociales que no se consideran inversiones sostenibles.

¿En qué sectores económicos se han realizado las inversiones?

Durante el período de referencia, los sectores y subsectores principales de este Fondo, sin incluir el efectivo, fueron:

Sector principal	% de activos
Sector financiero	49,73%
Sector industrial	14,83%
Consumo discrecional	6,58%
Servicios de comunicación	6,13%
Sector sanitario	5,85%
Servicios públicos	5,58%
Tecnología de la información	4,45%
Materiales	2,77%
Bonos del Estado	2,02%
Sector inmobiliario	0,52%
Bienes básicos de consumo	0,12%

Principales subsectores	% de activos
Bancos	34,44%
Servicios financieros	7,06%
Mercados de capitales	6,92%
Servicios de telecomunicaciones diversificados	3,27%
Servicios públicos múltiples	2,95%
Equipos eléctricos	2,52%
Servicios profesionales	2,43%
Aerolíneas de pasajeros	2,41%
Envases y envoltorios	2,28%
Servicios públicos eléctricos	2,27%
Infraestructura del transporte	2,18%
Software	2,07%
Bonos del Estado	2,02%
Transporte por tierra	1,62%
Herramientas y servicios de las ciencias biológicas	1,51%

Para cumplir con la taxonomía de la UE, los criterios para el **gas fósil** incluyen limitaciones de las emisiones y el paso a energías totalmente renovables o combustibles hipocarbónicos para finales de 2035. En el caso de la **energía nuclear**, los criterios incluyen normas exhaustivas de seguridad y gestión de residuos. Las **actividades facilitadoras** permiten de forma directa que otras actividades contribuyan significativamente a un objetivo medioambiental. Las **actividades de transición** son actividades para las que todavía no se dispone de alternativas con bajas emisiones de carbono y que, entre otras cosas, tienen niveles de emisión de gases de efecto invernadero que se corresponden con los mejores resultados.

¿En qué medida se ajustaban las inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental a la taxonomía de la UE?

El Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental ajustado a la taxonomía de la UE.

¿Invirtió el producto financiero en actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear que cumplían la taxonomía de la UE?[1]

☐ Sí

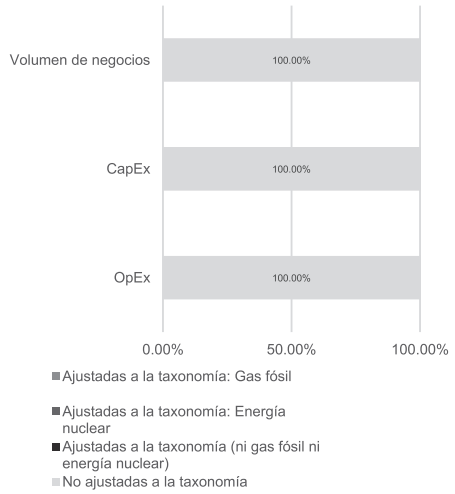
☐ En el gas fósil ☐ En la energía nuclear

☒ No

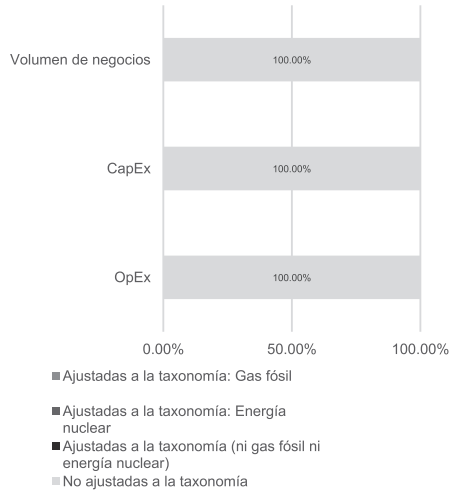
Las actividades que se ajustan a la taxonomía se expresan como un porcentaje de:
- El **volumen de negocios**, que refleja la proporción de ingresos procedentes de actividades ecológicas de las empresas en las que se invierte.
- La **inversión en activo fijo** (CapEx), que muestra las inversiones ecológicas realizadas por las empresas en las que se invierte, por ejemplo, para la transición a una economía verde.
- Los **gastos de explotación** (OpEx), que reflejan las actividades operativas ecológicas de las empresas en las que se invierte.

Los gráficos que figuran a continuación muestran en verde el porcentaje de inversiones que se ajustaban a la taxonomía de la UE. Dado que no existe una metodología adecuada para determinar la adaptación a la taxonomía de los bonos soberanos, el primer gráfico muestra la adaptación a la taxonomía correspondiente a todas las inversiones del producto financiero, incluidos los bonos soberanos, mientras que el segundo gráfico muestra la adaptación a la taxonomía solo en relación con las inversiones del producto financiero distintas de los bonos soberanos.*

1. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **incluidos los bonos soberanos***



2. Ajuste a la taxonomía de las inversiones, **excluidos los bonos soberanos***



Este gráfico representa 100,00% de las inversiones totales.

** A efectos de estos gráficos, los «bonos soberanos» incluyen todas las exposiciones soberanas*

¿Cuál ha sido la proporción de las inversiones realizadas en actividades de transición facilitadoras?

El Fondo no invirtió en actividades de transición ni facilitadoras.

[1] Las actividades relacionadas con el gas fósil o la energía nuclear solo cumplirán la taxonomía de la UE cuando contribuyan a limitar el cambio climático («mitigación del cambio climático») y no perjudiquen significativamente ningún objetivo de la taxonomía de la UE (véase la nota explicativa en el margen izquierdo). Los criterios completos aplicables a las actividades económicas relacionadas con el gas fósil y la energía nuclear que cumplen la taxonomía de la UE se establecen en el Reglamento Delegado (UE) 2022/1214 de la Comisión.

¿Qué porcentaje de inversiones se han ajustado a la taxonomía de la UE en comparación con los períodos de referencia anteriores?

No se aplica.

son inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental que **no tienen en cuenta los criterios** para las actividades económicas medioambientalmente sostenibles con arreglo al Reglamento (UE) 2020/852.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones sostenibles con un objetivo medioambiental no ajustadas a la taxonomía de la UE?

El 11,24 % de la cartera del Fondo estaba formada por inversiones con un objetivo ambiental no ajustado a la Taxonomía de la UE.

Como resultado de la estrategia de inversión, el Fondo no realizó inversiones sostenibles con un objetivo ambiental ajustado a la taxonomía de la UE.

¿Cuál ha sido la proporción de inversiones socialmente sostenibles?

La proporción de inversiones socialmente sostenibles fue del 4,48 %.

¿Qué inversiones se han incluido en «otras» y cuál ha sido su propósito? ¿Ha habido garantías medioambientales o sociales mínimas?

La proporción de las inversiones en el epígrafe «N.º 2 Otros» era del 1,44 % e incluía activos líquidos (activos líquidos auxiliares, depósitos bancarios, instrumentos del mercado monetario y fondos del mercado monetario) mantenidos para atender las necesidades cotidianas del Fondo.

No se establecieron salvaguardias mínimas ambientales o sociales.

¿Qué medidas se han adoptado para cumplir las características medioambientales o sociales durante el período de referencia?

1. Los gestores de inversiones han utilizado numerosas herramientas informáticas para determinar la composición de la cartera de manera que se ajustase a las características ambientales y sociales promovidas. Estas características fueron: promover la transición a una economía con bajas emisiones de carbono, evitando las inversiones en emisores que se están quedando atrás en la transición e implementar exámenes negativos como parte del proceso de inversión. Mediante el uso de datos internos y externos (p. ej., los datos de MSCI), los gestores de inversiones evaluaron qué emisores se podían (o no) mantener en la cartera.

Por ejemplo, el Fondo empleó una metodología de calificación ESG propia con el objetivo de evitar invertir en emisores que se están quedando atrás en la transición para respaldar una economía con bajas emisiones de carbono. El Fondo utilizó un enfoque selectivo para excluir de su cartera a los emisores (empresas y soberanías) que se situaban entre el 20 % inferior de su universo de inversión basándose en una serie de características. En el caso de las empresas, los gestores de inversiones analizar su intensidad y sus emisiones de GEI, mientras que en el caso de los países, disponen de una lista de 16 métricas ambientales, como la eficiencia energética, la protección de la biodiversidad y la gestión responsable de residuos. Una compleja herramienta informática (el Índice de Transición Energética y Medioambiental [EETI] en el caso de los países y ESG Credit App en el caso de las empresas) asigna una clasificación en función de estas características y reduce el universo de inversión en el anteriormente mencionado 20 %.

El Fondo cuenta con una lista propia de exclusión y, en este sentido, los gestores de inversiones no invirtieron en emisores que:

- infringieran de manera reiterada y grave los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas, los Principios rectores de las Naciones Unidas sobre las empresas y los derechos humanos y las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales;

- tuviesen una calificación de «No libre» según el Freedom House Index para los emisores soberanos;

- fabricasen armas controvertidas, como aquellas que se consideran indiscriminadas o componentes para su uso en esa clase de armas;

- obtuviesen más del 5 % de sus ingresos de la producción de armas convencionales;

- produjesen tabaco o productos del tabaco o poseyesen unos ingresos derivados de este tipo de productos que superasen el umbral del 5 % de los Gestores de Inversiones.

- obtuviesen más del 5 % de sus ingresos de los juegos de azar o del entretenimiento para adultos;

- obtuviesen más del 5 % de sus ingresos de la extracción de carbón térmico y su venta a terceros;

- obtuviesen más del 5 % de sus ingresos de los combustibles fósiles más contaminantes;

- superasen el nivel de tolerancia de los Gestores de Inversiones del 30 % para los combustibles fósiles o del 5 % para el carbón térmico utilizados para generar electricidad o careciesen de objetivos de descarbonización ambiciosos para la generación de electricidad;

- afectasen negativamente a zonas sensibles en cuanto a la biodiversidad;

- Tuviesen una calificación ESG de CCC, según MSCI.

Además, el seguimiento de los emisores se realizó a través de la aplicación de riesgos de incidencia adversa (PAI Risk App). La aplicación analiza el rendimiento de los emisores corporativos y soberanos en función de las 14 métricas obligatorias de los 14 indicadores de los principales impactos adversos (PAI). La aplicación de los PAI identificó previamente y excluyó del universo de inversión a los emisores que:

- violen de manera reiterada y grave los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y las Líneas Directrices de la OCDE para Empresas Multinacionales (PAI 10)

- tenga una exposición a armas controvertidas (PAI 14)

- tengan operaciones ubicadas en zonas sensibles en cuanto a la biodiversidad y estén implicadas en controversias con un grave impacto en el medio ambiente (PAI 7)

- sean países sujetos a infracciones sociales, según se indica en los convenios y tratados internacionales (PAI 16)

2. Cuando se destinan fondos a inversiones sostenibles, especialmente en lo que respecta al compromiso de invertir el 11 % del valor liquidativo (VL) en consonancia con los objetivos ambientales y sociales, el gestor de inversiones aplicaba una evaluación cualitativa adicional (es decir, el formulario de evaluación de inversión sostenible, que se basa en una investigación interna o en la opinión de una segunda parte externa) de la elegibilidad del emisor y de los proyectos de DNSH.

De acuerdo con la ambición de los gestores de inversiones de conseguir un impacto positivo en los aspectos ambientales y sociales, así como de satisfacer los requisitos normativos, los gestores de inversiones comprueban en primer lugar que todos los gastos admisibles de un bono que se esté considerando adquirir sea realmente sostenible y contribuya de manera favorable a la consecución de los objetivos ambientales y sociales. A continuación, los gestores se aseguran de que ni el emisor ni el proyecto que se financia a través de la emisión de bonos causa perjuicio significativo a otros objetivos ambientales o sociales. Al mismo tiempo, los gestores de inversiones comprueban el impacto general de un emisor sobre el medio ambiente, ya que no invertirían en una empresa de servicios públicos que, a pesar de las inversiones en energía verde, aumenta su capacidad de producción de electricidad alimentada por combustibles fósiles. Los aspectos sociales son igualmente importantes, y los gestores de inversiones se abstienen de invertir en proyectos verdes o sociales si existen pruebas de graves controversias relacionadas con los empleados o la comunidad local. Al evaluar esos parámetros, los gestores de inversiones analizan un conjunto de 16 indicadores obligatorios de incidencia adversa (PAI).

3. La implicación fue una parte fundamental del enfoque de sostenibilidad y de la gestión ESG del Fondo. Durante el período de referencia, los gestores de inversiones interactuaron con numerosos emisores. Los gestores de inversiones lo han hecho por correo electrónico, videollamadas directas, presentaciones itinerantes y reuniones en persona y a través de la interacción transversal mediante el envío de encuestas sobre un tema específico. La interacción consistió tanto en la interacción voluntaria para promover las características ambientales y sociales del fondo y obtener datos para tomar las decisiones de inversión mejor fundamentadas, como en una interacción obligatoria con el 5 % de los emisores que obtienen peores resultados que sus homólogos en lo que respecta a la exposición a los PAI.

Aunque todas las implicaciones se enumeraron anteriormente, en la sección «¿Cómo se han comportado los indicadores de sostenibilidad?», el siguiente ejemplo ayuda a explicar el enfoque de los gestores de carteras. Durante el período objeto de análisis, los gestores de inversiones estuvieron en contacto voluntariamente con la empresa de telecomunicaciones Verizon, principalmente para tratar el tema de las emisiones energéticas y la exclusión digital. Los representantes de Verizon nos informaron de que trabajan en la optimización de la red mediante el establecimiento de objetivos de emisiones de valor cero validados por SBTi para las operaciones, teniendo en cuenta las emisiones de la cadena de valor. Las emisiones de alcance 2 se reducen mediante centrales eléctricas virtuales de energía verde, que se subcontratan mediante un contrato de compra de electricidad (PPA) con un productor independiente de energía verde. La empresa ha sustituido el cobre por fibra óptica, que es más eficiente y ofrece el mismo ancho de banda. Además, la empresa emplea la IA y el aprendizaje automático para optimizar más la red. Con respecto a la integración digital, la empresa manifestó que el 4G es el núcleo que cubrirá a todos los estadounidenses y que se asegurará de que tanto las comunidades urbanas como rurales no queden excluidas. Las exclusiones digitales se basan en tres temas: el acceso, la adaptación y la asequibilidad. En primer lugar, permitir el acceso a zonas desatendidas. Adaptación: permitir que aquellos que no tienen competencias digitales puedan conectarse. Finalmente, la asequibilidad mediante la eliminación de las barreras económicas.

Los gestores de inversiones siguen comprometidos con los emisores que se mantienen en la cuenta. Además, los gestores de inversiones colaboraron con el 5 % de las participaciones consideradas de bajo rendimiento en términos de su exposición agregada a los parámetros obligatorios aplicables de las PIA durante el período de referencia. Un ejemplo ilustrativo de esta colaboración obligatoria es la comunicación de los gestores de inversiones con la empresa química Italmatch Chemicals, que se basan en un tema de la iniciativa de los Objetivos basados en la ciencia.



¿Cómo se ha comportado este producto financiero en comparación con el índice de referencia designado?

Los **índices de referencia** son índices para medir si el producto financiero logra las características medioambientales o sociales que promueve.

No se aplica.

[Esta página se ha dejado intencionadamente en blanco]

[Esta página se ha dejado intencionadamente en blanco]

[Esta página se ha dejado intencionadamente en blanco]



FRANKLIN
TEMPLETON